

【表紙】

【提出書類】	有価証券報告書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2025年5月15日提出
【計算期間】	第6期(自 2024年2月20日至 2025年2月18日)
【ファンド名】	三井住友ＤＳ・年金バランス３０（債券重点型） 三井住友ＤＳ・年金バランス５０（標準型） 三井住友ＤＳ・年金バランス７０（株式重点型）
【発行者名】	三井住友ＤＳアセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 荻原 亘
【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】	小林 雅子
【連絡場所】	東京都港区虎ノ門一丁目１７番１号
【電話番号】	03-6205-0911
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【ファンド情報】

第１【ファンドの状況】

１【ファンドの性格】

（１）【ファンドの目的及び基本的性格】

- イ 当ファンドは、「国内株式インデックス・マザーファンド（Ｂ号）」、「国内債券パッシブ・マザーファンド」、「外国株式インデックス・マザーファンド」、「外国債券パッシブ・マザーファンド」（以下「マザーファンド」といいます。）受益証券への投資を通じて、日本を含む世界各国の株式、公社債に分散投資します。
- ロ 各ファンドの運用にあたっては、株式、債券、短期金融資産を各ファンド毎の基本資産配分の比率により独自に作成した合成指数をベンチマークとして、当該指数の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。
- ベンチマークの詳細については、後述の「２ 投資方針」をご参照ください。
- ハ 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。
- ニ 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)	補足分類
単位型	国内	株式	インデックス型
		債券	
	海外	不動産投信	
追加型	内外	その他資産 () 資産複合	
			特殊型

（注）当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

属性区分表

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

(投資信託証券(資産複合(株式・債券)資産配分固定型)) 資産複合 () 資産配分固定型 資産配分変更型		中近東(中東) エマージング			その他 (合成指数)
---	--	-----------------------	--	--	---------------

(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】

2019年6月28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。

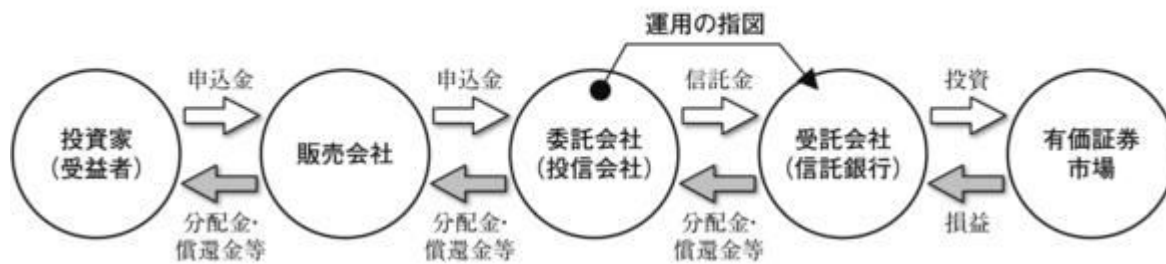
（ロ）受託会社 「三井住友信託銀行株式会社」

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。

運営の仕組み



□ 委託会社の概況

（イ）資本金の額

20億円（2025年2月28日現在）

（ロ）会社の沿革

- 1985年 7 月15日 三生投資顧問株式会社設立
- 1987年 2 月20日 証券投資顧問業の登録
- 1987年 6 月10日 投資一任契約にかかる業務の認可
- 1999年 1 月 1 日 三井生命保険相互会社の特別勘定運用部門と統合
- 1999年 2 月 5 日 三生投資顧問株式会社から三井生命グローバルアセットマネジメント株式会社へ商号変更
- 2000年 1 月27日 証券投資信託委託業の認可取得
- 2002年12月 1 日 住友ライフ・インベストメント株式会社、スミセイ グローバル投信株式会社、三井住友海上アセットマネジメント株式会社およびさくら投信投資顧問株式会社と合併し、三井住友アセットマネジメント株式会社に商号変更
- 2013年 4 月 1 日 トヨタアセットマネジメント株式会社と合併
- 2019年 4 月 1 日 大和住銀投信投資顧問株式会社と合併し、三井住友ＤＳアセットマネジメント株式会社に商号変更

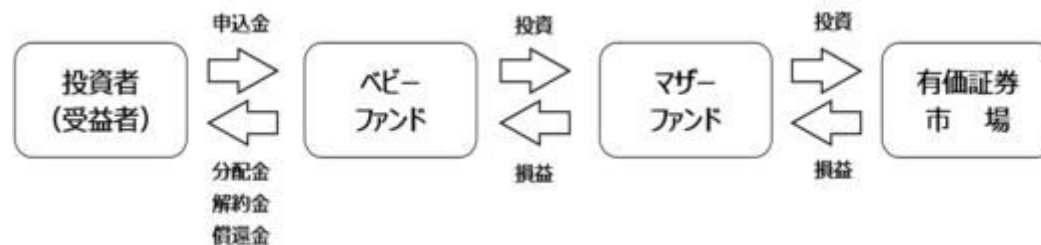
（ハ）大株主の状況

（2025年2月28日現在）

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

ハ ファンドの運用形態（ファミリーファンド方式による運用）

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



2【投資方針】

（１）【投資方針】

イ 基本方針

内外の株式・公社債に投資する４つのマザーファンドの組入れを通じて、日本を含む世界各国の株式、公社債に分散投資することにより、信託財産の着実な成長を目指した運用を行います。

国内株式	国内株式インデックス・マザーファンド（Ｂ号）
国内債券	国内債券パッシブ・マザーファンド
外国株式	外国株式インデックス・マザーファンド
外国債券	外国債券パッシブ・マザーファンド

ロ 投資態度

（イ）各ファンドにつき、マザーファンド受益証券への投資を通じて行う各資産への実質的な基本資産配分は下記の通りとします。

ただし、それぞれの資産の時価変動等に伴う各資産比率の変化については、一定の範囲（±３％）を設けて調整を行います。

	マイパッケージ N E X T 30	マイパッケージ N E X T 50	マイパッケージ N E X T 70
株 式	30%	50%	70%
国内株式	20%	35%	50%
外国株式	10%	15%	20%
債 券	65%	45%	25%
国内債券	55%	35%	15%
外国債券	10%	10%	10%
短期金融資産	5 %	5 %	5 %

（ロ）各ファンドの運用は、以下の比率により委託会社が独自に作成した合成指数をベンチマークとし、ベンチマークの動きに連動する投資成果を目指します。

	マイパッケージ N E X T 30	マイパッケージ N E X T 50	マイパッケージ N E X T 70
ＴＯＰＩＸ（東証株価指数、配当込み）	20%	35%	50%
NOMURA - B P I（総合）	55%	35%	15%
M S C Iコクサイ・インデックス（配当込み、円換算ベース）	10%	15%	20%
F T S E世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）	10%	10%	10%
有担保コール翌日物	5 %	5 %	5 %

（ハ）実質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わないことを基本とします。

（二）非株式割合に関する制限

a．マイパッケージN E X T 30

制限はありません。

b．マイパッケージN E X T 50

株式以外の資産（他の投資信託受益証券を通じて投資する場合は、当該他の投資信託の信

託財産に属する株式以外の資産のうち、この投資信託の信託財産に属するとみなした部分を含みます。）への投資割合は、原則として信託財産総額の75%以下とします。

c. マイパッケージNEXT70

株式以外の資産（他の投資信託受益証券を通じて投資する場合は、当該他の投資信託の信託財産に属する株式以外の資産のうち、この投資信託の信託財産に属するとみなした部分を含みます。）への投資割合は、原則として信託財産総額の50%以下とします。

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

ファンドの特色

1 内外の株式、公社債に投資する4つのマザーファンドへの投資を通じて、日本を含む世界各国の株式、公社債に分散投資します。

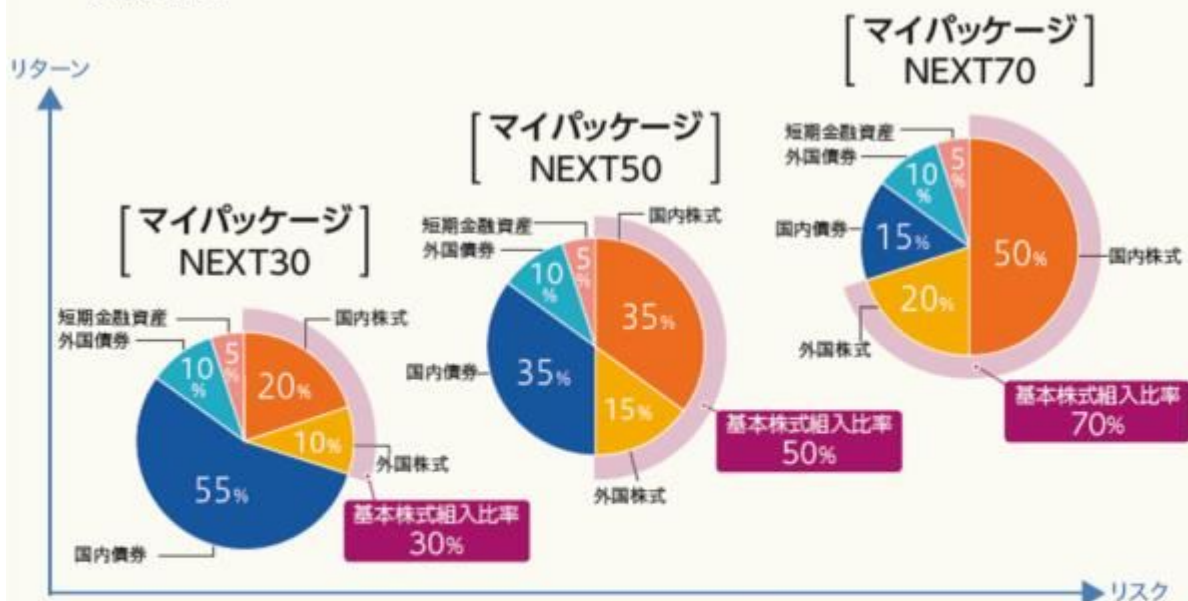
2 国内株式、外国株式、国内債券および外国債券への投資割合が異なる3つのファンドからお選びいただけます。

■ 各ファンドの基本資産配分は、下記の通りとします。

■ 時価変動等に伴う各資産への投資比率の変化については、一定の範囲（±3%）を超えた場合、調整します。

〔基本資産配分とリスク・リターンのイメージ〕

■ ファンドの運用（各マザーファンドへの資産配分および調整）は、運用部 マルチアセットグループが行います。



※ 上記は、各ファンドの基本資産配分を示したものであり、実際の配分比率を示すものではありません。
また、各ファンドのリスク・リターンの関係はイメージであり、実際とは異なる場合があります。

※ 運用担当部署の概要については、委託会社のホームページをご覧ください。

<運用担当者に係る事項>https://www.smd-am.co.jp/corporate/investment/pdf/org_structure01.pdf

3

委託会社が独自に作成した合成指数の動きに連動する投資成果を目指します。

〔各ファンドのベンチマークの資産別合成比率〕

	投資対象資産	マイパッケージ NEXT30	マイパッケージ NEXT50	マイパッケージ NEXT70
TOPIX (東証株価指数、配当込み)	国内株式	20%	35%	50%
NOMURA-BPI(総合)	国内債券	55%	35%	15%
MSCIコクサイ・インデックス (配当込み、円換算ベース)	外国株式	10%	15%	20%
FTSE世界国債インデックス (除く日本、円換算ベース)	外国債券	10%	10%	10%
有担保コール翌日物	短期金融資産	5%	5%	5%

4

実質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は行いません。

■ 基準価額は為替変動の影響を受けます。

※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。

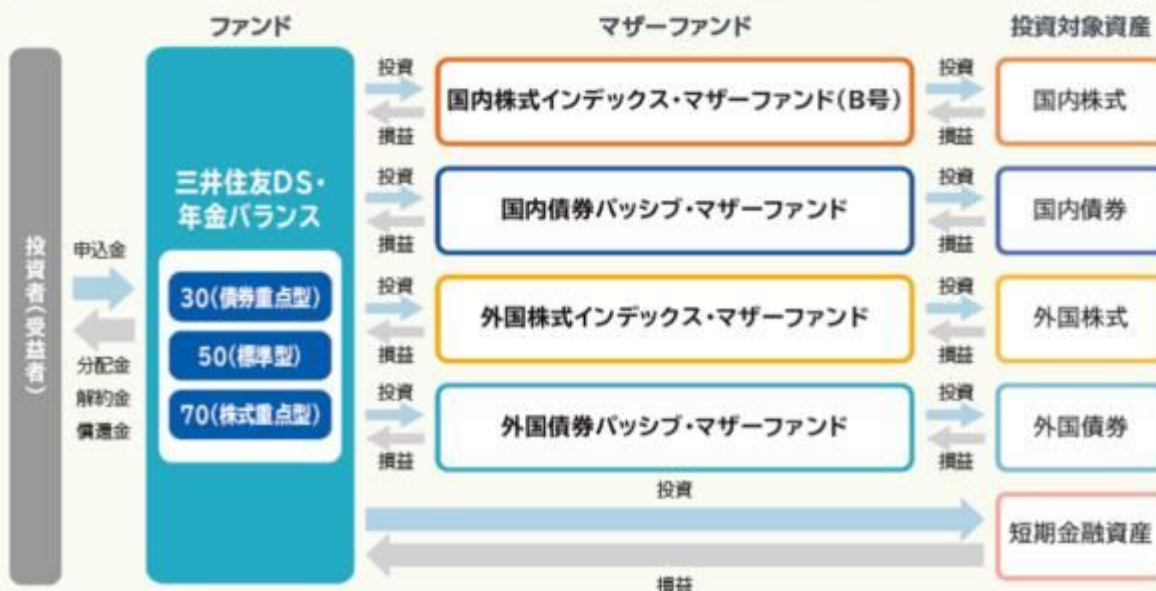


指数の著作権など

- TOPIX(東証株価指数)は株式会社JPX総研、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、MSCIコクサイ・インデックスはMSCI Inc.、FTSE世界国債インデックスはFTSE Fixed Income LLCが、それぞれ公表している指数です。
- 各インデックスに関する著作権、知的所有権、その他一切の権利は、指数を公表および許諾する各社に帰属します。また、当該各社は当ファンドの取引および運用成果等に関して一切責任を負いません。

ファンドのしくみ

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



各マザーファンドの投資方針等

▶ 国内株式インデックス・マザーファンド(B号)

- 主として日本の株式に投資し、TOPIX（東証株価指数、配当込み）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。
- TOPIX（東証株価指数）採用銘柄の中から、原則として投資不適格銘柄および低流動性銘柄を除外した上で、最適化法によりポートフォリオを構築します。

▶ 国内債券パッシブ・マザーファンド

- 日本の公社債および短期金融資産を主要投資対象とし、NOMURA-BPI（総合）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。
- 層化抽出法により、デュレーション、満期構成、債券種別配分、事業債の格付け構成および業種を可能な限りNOMURA-BPI（総合）に近づけたポートフォリオを構築します。

▶ 外国株式インデックス・マザーファンド

- 主として日本を除く世界各国の株式に投資し、MSCIコクサイ・インデックス（配当込み、円換算ベース）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。
- MSCIコクサイ・インデックス構成銘柄の中から、原則として投資不適格銘柄および低流動性銘柄を除外した上で、最適化法によりポートフォリオを構築します。

▶ 外国債券パッシブ・マザーファンド

- 主として日本を除く世界各国の債券に投資し、FTSE世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。
- 層化抽出法により、通貨配分、国別配分、デュレーション、満期構成等を可能な限りFTSE世界国債インデックス（除く日本）に近づけたポートフォリオを構築します。



最適化法とは

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

層化抽出法とは

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

デュレーションとは

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

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

（２）【投資対象】

イ 投資対象とする資産の種類

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

- １．有価証券
- ２．デリバティブ取引にかかる権利
- ３．約束手形

４．金銭債権

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

- １．株券または新株引受権証券
- ２．国債証券
- ３．地方債証券
- ４．特別の法律により法人の発行する債券
- ５．社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
- ６．資産の流動化に関する法律に規定する特定社債券（金融商品取引法第２条第１項第４号で定めるものをいいます。）
- ７．特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第２条第１項第６号で定めるものをいいます。）
- ８．協同組織金融機関にかかる優先出資証券（金融商品取引法第２条第１項第７号で定めるものをいいます。）
- ９．資産の流動化に関する法律に規定する優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券（金融商品取引法第２条第１項第８号で定めるものをいいます。）
- １０．資産の流動化に関する法律に規定する特定目的信託の受益証券
- １１．コマーシャル・ペーパー
- １２．新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）および新株予約権証券
- １３．外国または外国の者の発行する証券または証書で、前各号の証券または証書の性質を有するもの
- １４．投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第２条第１項第１０号で定めるものをいいます。）
- １５．投資証券もしくは新投資口予約権証券または外国投資証券（金融商品取引法第２条第１項第１１号で定めるものをいいます。次号において同じ。）で次号に定めるもの以外のもの
- １６．投資法人債券（金融商品取引法第２条第１項第１１号で定めるものをいいます。以下本号において同じ。）または外国投資証券で投資法人債券に類する証券
- １７．外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第２条第１項第１８号で定めるものをいいます。）
- １８．オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第２条第１項第１９号で定めるものをいい、有価証券にかかるものに限ります。）
- １９．預託証書（金融商品取引法第２条第１項第２０号で定めるものをいいます。）
- ２０．外国法人が発行する譲渡性預金証書
- ２１．受益証券発行信託の受益証券（金融商品取引法第２条第１項第１４号で定めるものをいいます。）
- ２２．外国の者に対する権利で、貸付債権信託受益権であって前号の有価証券に表示されるべき権利の性質を有するもの
- ２３．抵当証券（金融商品取引法第２条第１項第１６号で定めるものをいいます。）

なお、第１号の証券または証書、ならびに第１３号、第１９号および第２１号の証券または証書のうち第１号の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、第２号から第６号までの証券および第１６号の証券ならびに第１３号、第１９号および第２１号の証券または証書のうち第２号から第６号までの証券の性質を有するものならびに第１９号および第２１号の証券または証書のうち第１６号の証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、第１４号および第１５号の証券な

らびに第19号および第21号の証券または証書のうち第14号および第15号の証券の性質を有するものを以下「投資信託証券」といいます。

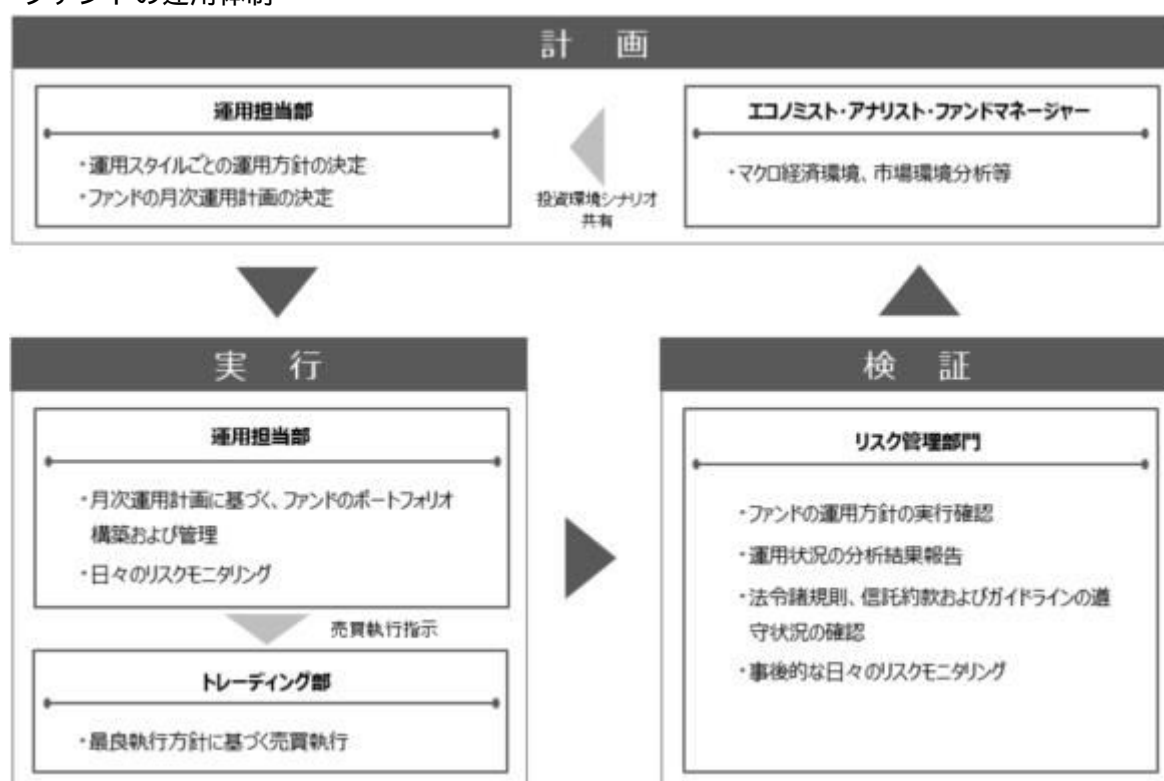
ハ 投資対象とする金融商品

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

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

（３）【運用体制】

イ ファンドの運用体制



リスク管理部門の人員数は、約40名です。

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

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2月18日。ただし、休業日の場合は翌営業日となります。）決算を行い、原則として以下の方針に基づき分配金額を決定します。

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

します。

- 収益分配金額は、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、委託会社の判断により分配を行わない場合もあるため、将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。
- ハ 留保益の運用については特に制限を定めず、委託会社の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。

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

（基準価額水準、市況動向等によっては変更する場合があります。）

（５）【投資制限】

ファンドの信託約款に基づく主要な投資制限

- イ 株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への実質投資割合は、信託財産の純資産総額に対して、以下の通りとします。

マイパッケージNEXT30	50%未満
マイパッケージNEXT50	25%以上
マイパッケージNEXT70	50%以上

実質投資割合とは、当ファンドが保有するある種類の資産の評価額が当ファンドの純資産総額に占める比率（「組入比率」といいます。）と、当該同一種類の資産のマザーファンドにおける組入比率に当該マザーファンド受益証券の当ファンドにおける組入比率を乗じて得た率を合計したものをいいます（以下同じ。）。
 - 外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の50%以下とします。
 - ハ 投資信託証券（マザーファンド受益証券および上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。
 - ニ 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

ファンドの信託約款に基づくその他の投資制限

- イ デリバティブ取引等にかかる投資制限
委託会社は、デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。
- 投資する株式等の範囲
 - （イ）委託会社が投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、取引所に上場されている株式の発行会社の発行するもの、取引所に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。
 - （ロ）上記（イ）にかかわらず、上場予定または登録予定の株式、新株引受権証券および新株予約権証券で目論見書等において上場または登録されることが確認できるものについては委託会社が投資することを指図することができるものとします。
- ハ 信用取引の指図
 - （イ）委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売り付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、株券の引渡しまたは買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。
 - （ロ）上記（イ）の信用取引の指図は、当該売付けにかかる建玉の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する当該売付けにかかる建玉の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。

- (ハ) 上記(ロ)において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める当該売付けにかかる建玉の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
- (二) 信託財産の一部解約等の事由により、上記(ロ)の売付けにかかる建玉の時価総額の合計額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する売付けの一部を決済するための指図をするものとします。

二 先物取引等の指図

- (イ) 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクを回避するため、日本の取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。）ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めて取り扱うものとします（以下同じ。）。
- (ロ) 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、日本の取引所における通貨にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。
- (ハ) 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクを回避するため、日本の取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。

ホ スワップ取引の指図

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

ヘ 金利先渡取引、為替先渡取引および直物為替先渡取引の指図

- (イ) 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、金利先渡取引、為替先渡取引および直物為替先渡取引を行うことの指図をすることができます。
- (ロ) 金利先渡取引、為替先渡取引および直物為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日

が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。

- (ハ) 金利先渡取引、為替先渡取引および直物為替先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかる金利先渡取引、為替先渡取引および直物為替先渡取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかる金利先渡取引、為替先渡取引および直物為替先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額（以下「金利先渡取引、為替先渡取引および直物為替先渡取引の想定元本の合計額」といいます。）が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記純資産総額が減少して、金利先渡取引、為替先渡取引および直物為替先渡取引の想定元本の合計額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は、速やかに、その超える額に相当する金利先渡取引、為替先渡取引および直物為替先渡取引の一部の解約を指図するものとします。
- (ニ) 上記（ハ）においてマザーファンドの信託財産にかかる金利先渡取引、為替先渡取引および直物為替先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかる金利先渡取引、為替先渡取引および直物為替先渡取引の想定元本の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
- (ホ) 金利先渡取引、為替先渡取引および直物為替先渡取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額により行うものとします。
- (ヘ) 委託会社は、金利先渡取引、為替先渡取引および直物為替先渡取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めたときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。
- (ト) 「金利先渡取引」とは、当事者間において、あらかじめ将来の特定の日（以下「決済日」といいます。）における決済日から一定の期間を経過した日（以下「満期日」といいます。）までの期間にかかる国内または海外において代表的利率として公表される預金契約または金銭の貸借契約に基づく債権の利率（以下「指標利率」といいます。）の数値を取り決め、その取決めにかかる数値と決済日における当該指標利率の現実の数値との差にあらかじめ元本として定めた金額および当事者間で約定した日数を基準とした数値を乗じた額を決済日における当該指標利率の現実の数値で決済日における現在価値に割り引いた額の金銭の授受を約する取引をいいます。
- (チ) 「為替先渡取引」とは、当事者間において、あらかじめ決済日から満期日までの期間にかかる為替スワップ取引（同一の相手方との間で直物外国為替取引および当該直物外国為替取引と反対売買の関係に立つ先物外国為替取引を同時に約定する取引をいいます。以下同じ。）のスワップ幅（当該直物外国為替取引にかかる外国為替相場と当該先物外国為替取引にかかる外国為替相場との差を示す数値をいいます。以下同じ。）を取り決め、その取決めにかかるスワップ幅から決済日における当該為替スワップ取引の現実のスワップ幅を差し引いた値にあらかじめ元本として定めた金額を乗じた額を決済日における指標利率の数値で決済日における現在価値に割り引いた額の金銭またはその取決めにかかるスワップ幅から決済日における当該為替スワップ取引の現実のスワップ幅を差し引いた値にあらかじめ元本として定めた金額を乗じた金額とあらかじめ元本として定めた金額について決済日を受渡日として行った先物外国為替取引を決済日における直物外国為替取引で反対売買したときの差金にかかる決済日から満期日までの利息とを合算した額を決済日における指標利率の数値で決済日における現在価値に割り引いた額の金銭の授受を約する取引をいいます。
- (リ) 「直物為替先渡取引」とは、当事者間において、あらかじめ元本として定めた金額について決済日を受渡日として行った先物外国為替取引を決済日における直物外国為替取引で反対売買したときの差金の授受を約する取引、その他これに類似する取引をいいます。

ト 有価証券の貸付けの指図

- (イ) 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式および公社債を次の各号の範囲内で貸し付けることの指図をすることができます。

１．株式の貸付けは、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式

の時価合計額を超えないものとします。

２．公社債の貸付けは、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額を超えないものとします。

（ロ）上記（イ）の各号に定める限度額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとします。

（ハ）委託会社は、有価証券の貸付けにあたって必要と認めたときは、担保の受入れの指図を行うものとします。

チ 有価証券の空売りの指図

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

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

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

リ 有価証券の借入れの指図

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

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

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

（二）借入れにかかる品借料は、信託財産中から支弁します。

ヌ 特別の場合の外貨建有価証券への投資制限

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

ル 外国為替予約取引の指図

（イ）委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、ならびに信託財産に属する資産の為替変動リスクを回避するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。

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

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

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

ヲ 資金の借入れ

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

該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。

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

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

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

（二）借入金の利息は、信託財産中から支弁します。

法令に基づく投資制限

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

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

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

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

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

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

（参考情報：マザーファンドの投資方針等）

（国内株式インデックス・マザーファンド（B号））

（1）投資方針等

イ 基本方針

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

ロ 投資態度

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

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

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

（２）投資対象

イ 投資対象とする資産の種類

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

ロ 投資対象とする有価証券

委託会社は、信託金を、主として次の有価証券（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、かつ本邦通貨表示のものに限ります。）に投資することを指図します。

- １．株券または新株引受権証書
- ２．国債証券
- ３．特別の法律により法人の発行する債券
- ４．コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等
- ５．投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第２条第１項第10号で定めるものをいいます。）
- ６．外国法人が発行する譲渡性預金証書
- ７．指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第２条第１項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）

ハ 投資対象とする金融商品

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

（３）投資制限

イ ファンドの信託約款に基づく主要な投資制限

（イ）外貨建資産への投資は行いません。

（ロ）株式への投資割合には制限を設けません。

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

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

（国内債券パッシブ・マザーファンド）

（１）投資方針等

イ 基本方針

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

ロ 投資態度

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

（ロ）公社債の組入比率は原則として高位を保ちます。

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

（２）投資対象

イ 投資対象とする資産の種類

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

ロ 投資対象とする有価証券

委託会社は、信託金を、主として次の有価証券（金融商品取引法第２条第２項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図します。

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

ハ 投資対象とする金融商品

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

（３）投資制限

イ ファンドの信託約款に基づく主要な投資制限

（イ）株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への投資割合は、信託財産の純資

産総額の10%以内とします。

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

（外国株式インデックス・マザーファンド）

（１）投資方針等

イ 基本方針

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

ロ 投資態度

- （イ）主として世界各国の株式に投資し、MSCIコクサイ・インデックス（配当込み、円換算ベース）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。
- （ロ）外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行わないものとします。
- （ハ）株価指数先物取引等を含む株式の実質組入比率は、原則として高位を保ちます。ただし、資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

（２）投資対象

イ 投資対象とする資産の種類

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

ロ 投資対象とする有価証券

委託会社は、信託金を、主として次の有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図します。

- １．株券または新株引受権証券
- ２．国債証券
- ３．特別の法律により法人の発行する債券
- ４．社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
- ５．コマーシャル・ペーパー
- ６．新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）および新株予約権証券
- ７．外国または外国の者の発行する証券または証書で、前各号の証券または証書の性質を有するもの
- ８．投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）
- ９．投資証券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）
- 10．外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）

す。）

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

ハ 投資対象とする金融商品

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

（３）投資制限

イ ファンドの信託約款に基づく主要な投資制限

（イ）株式への投資割合には制限を設けません。

（ロ）外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

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

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

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

（外国債券パッシブ・マザーファンド）

（１）投資方針等

イ 基本方針

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

ロ 投資態度

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

（ロ）ポートフォリオ構築にあたっては、取引コストを極力抑えながら、推定トラッキングエラーを最小化します。

（ハ）ベンチマークの月次の変化状況とポートフォリオのリスク量の状況を勘案しながらリバランスを行います。

（ニ）保有する外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行いません。

（ホ）公社債の組入比率は原則として高位を保ちます。

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

（２）投資対象

イ 投資対象とする資産の種類

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

ロ 投資対象とする有価証券

委託会社は、信託金を、主として次の有価証券（金融商品取引法第２条第２項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図します。

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

ハ 投資対象とする金融商品

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

（３）投資制限

イ ファンドの信託約款に基づく主要な投資制限

- （イ）株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への投資割合は、信託財産の純資産総額の１０％以内とします。
- （ロ）投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の５％以内とします。
- （ハ）外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

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

３【投資リスク】

イ ファンドのもつリスクの特性

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

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

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

当ファンドの主要なリスクは以下の通りです。

（イ）株式市場リスク

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

（ロ）債券市場リスク

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

（ハ）信用リスク

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

（ニ）為替変動リスク

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

（ホ）カントリーリスク

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

（ヘ）流動性リスク

有価証券等を大量に売買しなければならない場合、あるいは市場を取り巻く外部環境に急激な

変化があり、市場規模の縮小や市場の混乱が生じた場合等に、十分な数量の売買ができなかったり、通常よりも不利な価格での取引を余儀なくされることがあります。これらはファンドの基準価額が下落する要因となります。

ロ その他の留意点

（イ）ファンド固有の留意点

合成指数の動きと連動しない要因

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

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

（ロ）投資信託に関する留意点

- ・ 当ファンドは「ファミリーファンド方式」により運用するため、当ファンドと同じマザーファンドを投資対象とする他のベビーファンドに追加設定・一部解約により資金の流出入が生じた場合、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ある場合や主たる取引市場において市場環境が急変した場合等に、一時的に組入資産の流動性が低下し、市場実勢から期待できる価格で取引できないリスク、取引量が限られてしまうリスクがあります。

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

（ハ）分配金に関する留意事項

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



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

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

ハ 投資リスクの管理体制

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

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

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

さらに、流動性リスク管理について規程を定め、ファンドの組入資産の流動性リスクのモニタリングやストレステストを実施するとともに、緊急時対応策等の策定や有効性の検証等を行います。なお、当該流動性リスクの適切な管理の実施等について、定期的にリスク管理会議へ報告します。コンプライアンス担当部は、法令・諸規則等の遵守状況の確認等を行い、結果をコンプライアンス会議に報告します。

（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。

■マイパッケージNEXT30



「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。



■マイパッケージNEXT50



※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。
※ファンドのベンチマークは合成指数です。

※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。

■マイパッケージNEXT70



※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。

※ファンドのベンチマークは合成指数です。

「ファンドと他の代表的な 資産クラスとの騰落率の比較」

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



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

※すべての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。

各資産クラスの指数

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

※海外の指数は、為替ヘッジなしによる投資を想定して、円ベースとしています。

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

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

ありません。

(2)【換金(解約)手数料】

解約手数料はありません。

（３）【信託報酬等】

純資産総額に年0.154％（税抜き0.14％）の率を乗じて得た金額が、毎日信託財産の費用として計上され、ファンドの基準価額に反映されます。また、信託報酬は、毎計算期間の最初の６ヵ月終了日と各計算期末または信託終了のときに、信託財産中から支弁するものとします。

信託報酬の配分は以下の通りです。

< 信託報酬の配分（税抜き）>

支払先	料率	役務の内容
委託会社	年0.06％	ファンドの運用およびそれに伴う調査、受託会社への指図、基準価額の算出、法定書面等の作成等の対価
販売会社	年0.06％	交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
受託会社	年0.02％	ファンドの財産の保管および管理、委託会社からの指図の実行等の対価

上記の配分には別途消費税等相当額がかかります。

（４）【その他の手数料等】

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

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

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

（５）【課税上の取扱い】

- イ 個別元本について
 - （イ）追加型株式投資信託について、受益者毎の信託時の受益権の価額等（申込手数料および当該申込手数料にかかる消費税等相当額は含まれません。）が当該受益者の元本（個別元本）にあたります。
 - （ロ）受益者が同一ファンドの受益権を複数回取得した場合、個別元本は、当該受益者が追加信託を行うつど当該受益者の受益権口数で加重平均することにより算出されます。ただし、同一ファンドを複数の販売会社で取得する場合については、各販売会社毎に個別元本の算出が行われます。また、同一販売会社であっても同一受益者の顧客口座が複数存在する場合や、「分配金受取りコース」と「分配金自動再投資コース」を併用するファンドの場合には、別々に個別元本

の算出が行われることがあります。

- （ハ）受益者が元本払戻金（特別分配金）を受け取った場合、収益分配金発生時にその個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の当該受益者の個別元本となります。（「元本払戻金（特別分配金）」については、下記の（収益分配金の課税について）を参照。）

ロ 一部解約時および償還時の課税について

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

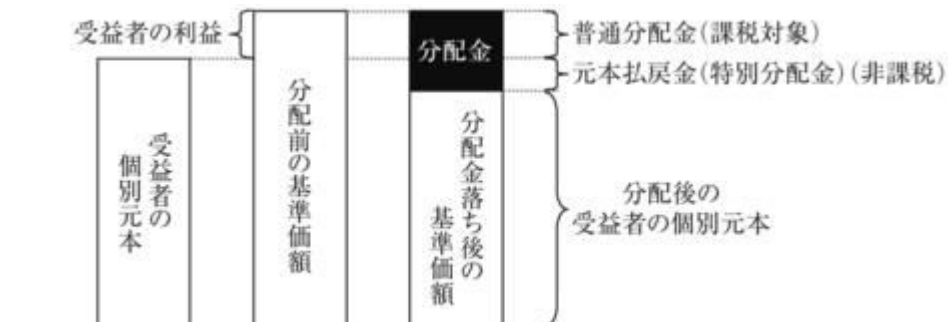
ハ 収益分配金の課税について

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

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



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



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

二 個人、法人別の課税の取扱いについて

（イ）個人の受益者に対する課税

・収益分配時

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

・一部解約時および償還時

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

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

（ロ）法人の受益者に対する課税

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

当ファンドは、課税上は株式投資信託として取り扱われます。

＜配当控除および益金不算入制度の適用の可否＞

a．マイパッケージNEXT30

配当控除および益金不算入制度の適用はありません。

b．マイパッケージNEXT50

配当控除の適用が可能です。益金不算入制度の適用はありません。

c．マイパッケージNEXT70

配当控除の適用が可能です。益金不算入制度の適用はありません。

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

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

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

上記「（５）課税上の取扱い」ほか税制に関する本書の記載は、2025年2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（2024年2月20日～2025年2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。

	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
マイパッケージNEXT30	0.17%	0.15%	0.01%
マイパッケージNEXT50	0.17%	0.15%	0.01%
マイパッケージNEXT70	0.17%	0.15%	0.02%

※上記は、対象期間の運用報告書に記載されている総経費率（原則として、購入時手数料、売買委託手数料および有価証券取引税は含まれていません。）です。

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

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

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

5【運用状況】

（１）【投資状況】

三井住友ＤＳ・年金バランス３０（債券重点型）

2025年2月28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	1,005,070,327	95.02
現金・預金・その他の資産（負債控除後）	-	52,676,943	4.98
合計（純資産総額）		1,057,747,270	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。

三井住友ＤＳ・年金バランス５０（標準型）

2025年2月28日現在

資産の種類	国／地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
親投資信託受益証券	日本	3,564,722,652	94.91
現金・預金・その他の資産（負債控除後）	-	191,129,914	5.09
合計（純資産総額）		3,755,852,566	100.00

三井住友ＤＳ・年金バランス７０（株式重点型）

2025年2月28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	2,841,817,544	94.97
現金・預金・その他の資産（負債控除後）	-	150,518,654	5.03
合計（純資産総額）		2,992,336,198	100.00

（２）【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

三井住友ＤＳ・年金バランス３０（債券重点型）

イ 主要投資銘柄

2025年2月28日現在

国／地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	投資 比率 (%)
日本	親投資 信託受 益証券	国内債券パッシ ブ・マザーファ ンド	502,761,587	1.1638	585,113,937	1.1678	587,124,981	55.51
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)	43,152,752	5.0097	216,182,343	4.8422	208,954,255	19.75
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	46,860,923	2.3044	107,986,311	2.2809	106,885,079	10.10
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	10,457,610	10.2647	107,344,230	9.7638	102,106,012	9.65

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

2025年2月28日現在

種類	投資比率（％）
親投資信託受益証券	95.02
合 計	95.02

三井住友ＤＳ・年金バランス５０（標準型）

イ 主要投資銘柄

2025年2月28日現在

国／地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価 （円）	帳簿価額 （円）	評価額 単価 （円）	評価額 （円）	投資 比率 （％）
日本	親投資 信託受 益証券	国内債券パッシ ブ・マザーファ ンド	1,143,115,051	1.1638	1,330,357,296	1.1678	1,334,929,756	35.54
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）	269,685,207	5.0097	1,351,041,982	4.8422	1,305,869,709	34.77
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	56,105,094	10.2636	575,842,322	9.7638	547,798,916	14.59
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	164,901,693	2.3044	379,998,516	2.2809	376,124,271	10.01

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

2025年2月28日現在

種類	投資比率（％）
親投資信託受益証券	94.91
合 計	94.91

三井住友ＤＳ・年金バランス７０（株式重点型）

イ 主要投資銘柄

2025年2月28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）	308,363,575	5.0097	1,544,809,002	4.8422	1,493,158,102	49.90
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	59,920,196	10.2647	615,062,835	9.7638	585,048,809	19.55

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	396,507,993	1.1638	461,456,002	1.1678	463,042,034	15.47
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	131,776,316	2.3044	303,665,342	2.2809	300,568,599	10.04

以上が、当ファンドが保有する有価証券のすべてです。

□ 種類別投資比率

2025年2月28日現在

種類	投資比率（％）
親投資信託受益証券	94.97
合 計	94.97

【投資不動産物件】

三井住友ＤＳ・年金バランス３０（債券重点型）

該当事項はありません。

三井住友ＤＳ・年金バランス５０（標準型）

該当事項はありません。

三井住友ＤＳ・年金バランス７０（株式重点型）

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ＤＳ・年金バランス３０（債券重点型）

該当事項はありません。

三井住友ＤＳ・年金バランス５０（標準型）

該当事項はありません。

三井住友ＤＳ・年金バランス７０（株式重点型）

該当事項はありません。

（３）【運用実績】

【純資産の推移】

三井住友ＤＳ・年金バランス３０（債券重点型）

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 (2020年 2月18日)	1,036,533	1,036,533	10,365	10,365
第2期 (2021年 2月18日)	129,349,680	129,349,680	10,869	10,869
第3期 (2022年 2月18日)	244,216,550	244,216,550	11,031	11,031
第4期 (2023年 2月20日)	695,911,173	695,911,173	11,084	11,084
第5期 (2024年 2月19日)	906,190,138	906,190,138	12,305	12,305
第6期 (2025年 2月18日)	1,083,797,292	1,083,797,292	12,512	12,512
2024年 2月末日	914,546,635	-	12,379	-
3月末日	950,063,502	-	12,547	-
4月末日	948,234,310	-	12,484	-
5月末日	967,143,745	-	12,438	-
6月末日	986,192,717	-	12,610	-
7月末日	987,943,629	-	12,473	-
8月末日	996,568,004	-	12,429	-
9月末日	1,007,124,807	-	12,426	-
10月末日	1,037,557,537	-	12,584	-
11月末日	1,050,775,776	-	12,504	-
12月末日	1,090,930,364	-	12,684	-
2025年 1月末日	1,102,540,200	-	12,612	-
2月末日	1,057,747,270	-	12,376	-

(注) 各月末日の数字は最終営業日のものです。

三井住友ＤＳ・年金バランス５０（標準型）

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 (2020年 2月18日)	2,279,719	2,279,719	10,571	10,571
第2期 (2021年 2月18日)	335,342,429	335,342,429	11,511	11,511
第3期 (2022年 2月18日)	718,044,759	718,044,759	11,845	11,845
第4期 (2023年 2月20日)	2,144,057,572	2,144,057,572	12,173	12,173
第5期 (2024年 2月19日)	3,169,238,539	3,169,238,539	14,346	14,346
第6期 (2025年 2月18日)	3,825,702,412	3,825,702,412	15,026	15,026
2024年 2月末日	3,222,938,576	-	14,467	-
3月末日	3,318,283,258	-	14,793	-
4月末日	3,314,801,660	-	14,743	-
5月末日	3,415,149,813	-	14,779	-
6月末日	3,495,558,137	-	15,053	-
7月末日	3,482,323,116	-	14,837	-
8月末日	3,500,579,385	-	14,672	-
9月末日	3,484,394,509	-	14,635	-
10月末日	3,612,664,150	-	14,929	-
11月末日	3,645,845,695	-	14,850	-

12月末日	3,784,924,528	-	15,187	-
2025年 1月末日	3,868,103,146	-	15,129	-
2月末日	3,755,852,566	-	14,741	-

（注）各月末日の数字は最終営業日のものです。

三井住友ＤＳ・年金バランス７０（株式重点型）

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（2020年 2月18日）	1,078,471	1,078,471	10,785	10,785
第2期（2021年 2月18日）	212,907,677	212,907,677	12,154	12,154
第3期（2022年 2月18日）	476,770,596	476,770,596	12,669	12,669
第4期（2023年 2月20日）	1,467,519,245	1,467,519,245	13,306	13,306
第5期（2024年 2月19日）	2,416,266,025	2,416,266,025	16,651	16,651
第6期（2025年 2月18日）	3,078,399,151	3,078,399,151	17,969	17,969
2024年 2月末日	2,461,978,737	-	16,833	-
3月末日	2,590,887,098	-	17,363	-
4月末日	2,604,769,115	-	17,333	-
5月末日	2,733,456,103	-	17,480	-
6月末日	2,808,535,108	-	17,885	-
7月末日	2,796,254,698	-	17,568	-
8月末日	2,780,442,432	-	17,248	-
9月末日	2,769,678,314	-	17,167	-
10月末日	2,886,795,973	-	17,645	-
11月末日	2,907,230,973	-	17,567	-
12月末日	3,011,680,495	-	18,111	-
2025年 1月末日	3,120,896,531	-	18,072	-
2月末日	2,992,336,198	-	17,483	-

（注）各月末日の数字は最終営業日のものです。

【分配の推移】

三井住友ＤＳ・年金バランス３０（債券重点型）

	計算期間	１万口当たり分配金（円）
第1期	2019年 6月28日～2020年 2月18日	0
第2期	2020年 2月19日～2021年 2月18日	0
第3期	2021年 2月19日～2022年 2月18日	0
第4期	2022年 2月19日～2023年 2月20日	0
第5期	2023年 2月21日～2024年 2月19日	0
第6期	2024年 2月20日～2025年 2月18日	0

三井住友ＤＳ・年金バランス５０（標準型）

	計算期間	１万口当たり分配金（円）
--	------	--------------

第1期	2019年 6月28日～2020年 2月18日	0
第2期	2020年 2月19日～2021年 2月18日	0
第3期	2021年 2月19日～2022年 2月18日	0
第4期	2022年 2月19日～2023年 2月20日	0
第5期	2023年 2月21日～2024年 2月19日	0
第6期	2024年 2月20日～2025年 2月18日	0

三井住友ＤＳ・年金バランス７０（株式重点型）

	計算期間	1万口当たり分配金（円）
第1期	2019年 6月28日～2020年 2月18日	0
第2期	2020年 2月19日～2021年 2月18日	0
第3期	2021年 2月19日～2022年 2月18日	0
第4期	2022年 2月19日～2023年 2月20日	0
第5期	2023年 2月21日～2024年 2月19日	0
第6期	2024年 2月20日～2025年 2月18日	0

【収益率の推移】

三井住友ＤＳ・年金バランス３０（債券重点型）

	収益率（％）
第1期	3.7
第2期	4.9
第3期	1.5
第4期	0.5
第5期	11.0
第6期	1.7

（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・年金バランス５０（標準型）

	収益率（％）
第1期	5.7
第2期	8.9
第3期	2.9
第4期	2.8
第5期	17.9
第6期	4.7

（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・年金バランス７０（株式重点型）

	収益率（％）
--	--------

第1期	7.9
第2期	12.7
第3期	4.2
第4期	5.0
第5期	25.1
第6期	7.9

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

（４）【設定及び解約の実績】

三井住友ＤＳ・年金バランス３０（債券重点型）

	設定口数（口）	解約口数（口）
第1期	1,000,000	0
第2期	129,718,508	11,715,048
第3期	128,773,003	26,390,611
第4期	462,903,268	56,454,623
第5期	192,456,553	83,880,109
第6期	271,899,979	142,118,190

（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・年金バランス５０（標準型）

	設定口数（口）	解約口数（口）
第1期	2,156,528	0
第2期	322,790,706	33,614,202
第3期	361,775,633	46,907,692
第4期	1,237,975,860	82,847,945
第5期	638,086,243	190,312,815
第6期	607,649,533	270,703,628

（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・年金バランス７０（株式重点型）

	設定口数（口）	解約口数（口）
第1期	1,000,000	0
第2期	190,606,278	16,430,623
第3期	241,009,796	39,861,352
第4期	790,507,406	63,891,265
第5期	517,739,312	169,580,161
第6期	460,451,390	198,425,091

（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）

2025年2月28日現在

資産の種類	国／地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
株式	日本	351,285,329,030	99.04
現金・預金・その他の資産（負債控除後）	-	3,414,791,572	0.96
合計（純資産総額）		354,700,120,602	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	3,371,760,000	0.95
合計	買建	-	3,371,760,000	0.95

国内債券パッシブ・マザーファンド

2025年2月28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	99,864,476,200	77.15
地方債証券	日本	10,765,711,400	8.32
特殊債券	日本	10,113,592,890	7.81
社債券	日本	7,798,672,000	6.02
現金・預金・その他の資産（負債控除後）	-	901,113,105	0.70
合計（純資産総額）		129,443,565,595	100.00

外国株式インデックス・マザーファンド

2025年2月28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	667,155,244,952	71.02
	イギリス	34,176,959,516	3.64
	カナダ	29,746,792,447	3.17
	スイス	26,089,801,713	2.78
	フランス	24,519,844,132	2.61
	ドイツ	23,039,043,023	2.45
	アイルランド	17,197,512,788	1.83
	オランダ	15,094,175,620	1.61
	オーストラリア	14,682,510,067	1.56
	スウェーデン	7,852,901,742	0.84
	スペイン	6,868,737,438	0.73
	デンマーク	6,615,736,919	0.70
	イタリア	5,718,270,695	0.61
	香港	3,529,753,861	0.38
	シンガポール	2,957,251,213	0.31
	フィンランド	2,404,106,323	0.26

	イスラエル	2,178,056,583	0.23
	ジャージー	1,784,605,530	0.19
	ベルギー	1,779,971,596	0.19
	ルクセンブルグ	1,732,905,113	0.18
	ケイマン諸島	1,472,032,111	0.16
	ノルウェー	1,381,983,827	0.15
	バミューダ	974,245,813	0.10
	オランダ領キュ ラソー	808,315,559	0.09
	リベリア	772,400,328	0.08
	ニュージーラン ド	659,291,924	0.07
	オーストリア	492,448,554	0.05
	パナマ	354,256,916	0.04
	ポルトガル	325,072,654	0.03
	マン島	59,556,019	0.01
	小計	902,423,784,976	96.07
新株予約権証券	カナダ	-	0.00
投資証券	アメリカ	15,186,443,864	1.62
	オーストラリア	1,367,638,064	0.15
	フランス	350,515,604	0.04
	シンガポール	220,239,014	0.02
	イギリス	218,164,695	0.02
	香港	164,362,275	0.02
	ケイマン諸島	83,786,010	0.01
	ベルギー	64,220,719	0.01
	カナダ	33,230,135	0.00
	小計	17,688,600,380	1.88
現金・預金・その他の資産（負債控除後）	-	19,256,236,114	2.05
合計（純資産総額）		939,368,621,470	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	791,375,875	0.08
株価指数先物取引	買建	ドイツ	2,792,223,328	0.30
株価指数先物取引	買建	アメリカ	16,666,493,495	1.77
株価指数先物取引	買建	オーストラリア	518,922,841	0.06
合計	買建	-	20,769,015,539	2.21

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	-	3,762,329,207	0.40

外国債券パッシブ・マザーファンド

2025年2月28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	93,878,186,941	46.89
	中国	22,142,736,635	11.06
	フランス	14,174,539,545	7.08
	イタリア	13,127,298,438	6.56
	ドイツ	11,193,193,721	5.59
	イギリス	10,153,536,950	5.07
	スペイン	8,584,816,539	4.29
	カナダ	3,926,308,769	1.96
	ベルギー	3,040,901,925	1.52
	オランダ	2,435,632,800	1.22
	オーストラリア	2,370,816,012	1.18
	オーストリア	2,121,347,828	1.06
	メキシコ	1,562,333,916	0.78
	ポルトガル	1,139,655,649	0.57
	ポーランド	1,112,310,686	0.56
	フィンランド	967,177,873	0.48
	マレーシア	966,025,448	0.48
	アイルランド	922,483,873	0.46
	シンガポール	753,908,967	0.38
	イスラエル	664,512,386	0.33
	ニュージーランド	524,695,054	0.26
	デンマーク	431,473,329	0.22
	スウェーデン	331,357,708	0.17
	ノルウェー	296,012,859	0.15
	小計	196,821,263,851	98.31
現金・預金・その他の資産（負債控除後）	-	3,378,654,419	1.69
合計（純資産総額）		200,199,918,270	100.00

（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）

2025年2月28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	4,881,500	2,624.17	12,809,902,744	2,689.00	13,126,353,500	3.70
日本	株式	ソニーグループ	電気機 器	3,168,800	3,024.20	9,583,074,996	3,739.00	11,848,143,200	3.34
日本	株式	三菱ＵＦＪ フィナンシャル・グループ	銀行業	5,802,300	1,829.07	10,612,841,068	1,903.00	11,041,776,900	3.11
日本	株式	日立製作所	電気機 器	2,360,200	3,944.31	9,309,350,884	3,750.00	8,850,750,000	2.50

日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	1,886,800	3,823.37	7,213,930,018	3,792.00	7,154,745,600	2.02
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	736,600	10,626.36	7,827,377,413	8,800.00	6,482,080,000	1.83
日本	株式	任天堂	その他製品	579,900	8,898.50	5,160,241,009	11,160.00	6,471,684,000	1.82
日本	株式	キーエンス	電気機器	91,900	65,248.63	5,996,348,841	59,410.00	5,459,779,000	1.54
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	1,220,900	3,886.48	4,744,998,098	4,177.00	5,099,699,300	1.44
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	882,900	5,698.51	5,031,217,736	5,297.00	4,676,721,300	1.32
日本	株式	三菱商事	卸売業	1,794,800	2,564.22	4,602,255,539	2,496.50	4,480,718,200	1.26
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	652,900	7,498.59	4,895,831,469	6,669.00	4,354,190,100	1.23
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	194,600	23,664.98	4,605,204,322	22,125.00	4,305,525,000	1.21
日本	株式	三井物産	卸売業	1,426,800	3,194.31	4,557,645,648	2,795.00	3,987,906,000	1.12
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	27,409,100	155.15	4,252,596,591	145.40	3,985,283,140	1.12
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	454,500	8,914.24	4,051,521,420	8,273.00	3,760,078,500	1.06
日本	株式	信越化学工業	化学	817,600	5,534.17	4,524,739,961	4,492.00	3,672,659,200	1.04
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	820,700	4,121.98	3,382,907,413	4,334.00	3,556,913,800	1.00
日本	株式	KDDI	情報・通信業	677,800	4,960.24	3,362,053,372	4,894.00	3,317,153,200	0.94
日本	株式	三菱重工業	機械	1,622,900	2,244.91	3,643,256,410	1,987.00	3,224,702,300	0.91
日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	14,749,400	195.19	2,879,008,094	213.70	3,151,946,780	0.89
日本	株式	HOYA	精密機器	179,800	19,540.65	3,513,409,585	17,495.00	3,145,601,000	0.89
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	2,176,200	1,307.18	2,844,686,467	1,393.00	3,031,446,600	0.85
日本	株式	第一三共	医薬品	852,500	4,858.12	4,141,549,429	3,447.00	2,938,567,500	0.83
日本	株式	ファーストリテイリング	小売業	54,600	50,457.93	2,755,003,034	45,470.00	2,482,662,000	0.70
日本	株式	富士通	電気機器	854,500	2,863.55	2,446,902,780	2,879.00	2,460,105,500	0.69
日本	株式	アドバンテスト	電気機器	290,100	8,441.15	2,448,776,453	8,116.00	2,354,451,600	0.66
日本	株式	キヤノン	電気機器	458,200	4,911.18	2,250,301,762	5,063.00	2,319,866,600	0.65
日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	1,074,400	2,598.39	2,791,704,890	2,144.00	2,303,513,600	0.65
日本	株式	三菱電機	電気機器	944,000	2,568.94	2,425,082,127	2,307.00	2,177,808,000	0.61

□ 種類別・業種別投資比率

2025年2月28日現在

種類	業種	投資比率（％）
株式（国内）	水産・農林業	0.08
	鉱業	0.25
	建設業	2.16
	食料品	2.97
	繊維製品	0.41
	パルプ・紙	0.14
	化学	4.91
	医薬品	4.14
	石油・石炭製品	0.54
	ゴム製品	0.62
	ガラス・土石製品	0.63
	鉄鋼	0.89
	非鉄金属	0.80
	金属製品	0.50
	機械	5.33
	電気機器	17.72
	輸送用機器	7.25
	精密機器	2.19
	その他製品	3.13
	電気・ガス業	1.26
	陸運業	2.38
	海運業	0.70
	空運業	0.35
	倉庫・運輸関連業	0.14
	情報・通信業	7.66
	卸売業	6.44
	小売業	4.39
	銀行業	9.09
	証券、商品先物取引業	0.94
	保険業	3.29
	その他金融業	1.12
	不動産業	1.84
	サービス業	4.77
合 計		99.04

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）

2025年2月28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	1 5 0 5 年国債	2,390,000,000	99.03	2,366,817,000	98.66	2,357,950,100	0.005	2026/12/20	1.82
日本	国債 証券	3 7 7 1 0 年国 債	1,360,000,000	98.97	1,345,984,800	98.53	1,340,021,600	1.200	2034/12/20	1.04

日本	国債 証券	1 5 6 5 年国債	1,290,000,000	98.99	1,276,990,800	98.24	1,267,231,500	0.200	2027/12/20	0.98
日本	国債 証券	3 7 5 1 0 年国 債	1,250,000,000	102.07	1,275,929,200	98.18	1,227,212,500	1.100	2034/06/20	0.95
日本	国債 証券	1 5 4 5 年国債	1,220,000,000	98.91	1,206,641,000	98.19	1,197,893,600	0.100	2027/09/20	0.93
日本	国債 証券	3 6 8 1 0 年国 債	1,270,000,000	95.18	1,208,803,000	93.21	1,183,703,500	0.200	2032/09/20	0.91
日本	国債 証券	3 6 6 1 0 年国 債	1,170,000,000	95.48	1,117,159,600	93.99	1,099,694,700	0.200	2032/03/20	0.85
日本	国債 証券	1 4 9 5 年国債	1,090,000,000	99.16	1,080,844,000	98.87	1,077,715,700	0.005	2026/09/20	0.83
日本	国債 証券	3 6 7 1 0 年国 債	1,120,000,000	95.26	1,066,945,800	93.60	1,048,353,600	0.200	2032/06/20	0.81
日本	国債 証券	3 7 6 1 0 年国 債	1,090,000,000	98.74	1,076,240,700	96.11	1,047,609,900	0.900	2034/09/20	0.81
日本	国債 証券	4 6 8 2 年国債	1,040,000,000	99.95	1,039,486,000	99.67	1,036,609,600	0.600	2027/01/01	0.80
日本	国債 証券	3 7 3 1 0 年国 債	1,090,000,000	96.44	1,051,169,600	94.51	1,030,148,100	0.600	2033/12/20	0.80
日本	国債 証券	3 6 1 1 0 年国 債	1,070,000,000	96.34	1,030,838,000	94.78	1,014,146,000	0.100	2030/12/20	0.78
日本	国債 証券	3 7 2 1 0 年国 債	1,050,000,000	98.61	1,035,413,600	96.45	1,012,714,500	0.800	2033/09/20	0.78
日本	国債 証券	3 7 1 1 0 年国 債	1,080,000,000	95.52	1,031,616,000	93.61	1,010,977,200	0.400	2033/06/20	0.78
日本	国債 証券	3 7 0 1 0 年国 債	1,050,000,000	96.62	1,014,510,000	94.76	994,969,500	0.500	2033/03/20	0.77
日本	国債 証券	3 7 4 1 0 年国 債	1,000,000,000	97.71	977,141,600	95.88	958,750,000	0.800	2034/03/20	0.74
日本	国債 証券	3 6 5 1 0 年国 債	1,020,000,000	95.02	969,204,000	93.64	955,158,600	0.100	2031/12/20	0.74
日本	国債 証券	3 6 4 1 0 年国 債	1,010,000,000	95.47	964,247,000	93.95	948,864,700	0.100	2031/09/20	0.73
日本	国債 証券	3 6 3 1 0 年国 債	980,000,000	95.73	938,161,300	94.25	923,630,400	0.100	2031/06/20	0.71
日本	国債 証券	1 7 6 5 年国債	910,000,000	100.02	910,200,200	100.00	910,000,000	1.000	2029/12/20	0.70

日本	国債証券	3 6 9 1 0 年国債	940,000,000	96.97	911,537,400	95.08	893,705,000	0.500	2032/12/20	0.69
日本	国債証券	3 5 7 1 0 年国債	910,000,000	97.31	885,521,000	95.81	871,889,200	0.100	2029/12/20	0.67
日本	国債証券	3 6 0 1 0 年国債	910,000,000	96.51	878,239,200	95.04	864,882,200	0.100	2030/09/20	0.67
日本	国債証券	1 4 7 2 0 年国債	840,000,000	105.61	887,090,400	102.82	863,646,000	1.600	2033/12/20	0.67
日本	国債証券	1 5 8 5 年国債	880,000,000	98.59	867,595,000	97.73	860,015,200	0.100	2028/03/20	0.66
日本	国債証券	1 7 4 5 年国債	870,000,000	99.85	868,733,700	98.74	859,011,900	0.700	2029/09/20	0.66
日本	国債証券	3 5 9 1 0 年国債	900,000,000	96.58	869,216,800	95.30	857,727,000	0.100	2030/06/20	0.66
日本	国債証券	3 6 2 1 0 年国債	890,000,000	95.97	854,156,000	94.52	841,210,200	0.100	2031/03/20	0.65
日本	国債証券	3 5 8 1 0 年国債	870,000,000	97.00	843,941,600	95.56	831,380,700	0.100	2030/03/20	0.64

□ 種類別投資比率

2025年2月28日現在

種類	投資比率（％）
国債証券	77.15
地方債証券	8.32
特殊債券	7.81
社債券	6.02
合 計	99.30

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）

2025年2月28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	1,393,801	35,485.85	49,460,216,570	35,516.69	49,503,199,432	5.27
アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導体・半導体製造装置	2,248,704	20,715.01	46,581,927,562	17,982.85	40,438,107,850	4.30

アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	647,383	63,438.98	41,069,319,174	58,749.97	38,033,728,656	4.05
アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	一般消費財・サービス流通・小売り	866,234	31,185.61	27,014,038,610	31,242.12	27,062,982,937	2.88
アメリカ	株式	META PLATFORMS INC-CLASS A	メディア・娯楽	200,531	86,086.75	17,263,062,021	98,518.78	19,756,069,632	2.10
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	537,733	25,362.62	13,638,316,141	25,219.40	13,561,300,931	1.44
アメリカ	株式	BROADCOM INC	半導体・半導体製造装置	407,291	24,455.04	9,960,316,472	29,604.73	12,057,738,457	1.28
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	461,454	25,593.23	11,810,096,840	25,475.33	11,755,693,252	1.25
アメリカ	株式	TESLA INC	自動車・自動車部品	263,858	51,839.17	13,678,178,545	42,199.46	11,134,664,193	1.19
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	261,379	37,409.81	9,778,138,788	38,772.01	10,134,190,116	1.08
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	74,266	118,930.70	8,832,507,181	135,475.30	10,061,208,421	1.07
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	金融サービス	121,713	72,237.20	8,792,206,099	75,195.70	9,152,294,806	0.97
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	金融サービス	153,622	47,180.21	7,247,918,063	53,243.61	8,179,389,210	0.87
アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORP	エネルギー	408,498	17,633.41	7,203,212,018	16,486.15	6,734,559,506	0.72
アメリカ	株式	MASTERCARD INC - A	金融サービス	75,943	79,746.35	6,056,177,359	84,536.61	6,419,963,727	0.68
アメリカ	株式	COSTCO WHOLESALE CORP	生活必需品流通・小売り	40,656	145,403.05	5,911,506,391	152,919.34	6,217,088,512	0.66

アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	84,958	91,084.17	7,738,328,809	70,129.38	5,958,051,458	0.63
アメリカ	株式	WALMART INC	生活必需品流通・小売り	407,059	13,846.42	5,636,308,526	14,486.56	5,896,884,342	0.63
アメリカ	株式	NETFLIX INC	メディア・娯楽	39,492	132,948.53	5,250,403,499	144,142.69	5,692,482,991	0.61
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO/THE	家庭用品・パーソナル用品	216,434	26,790.69	5,798,416,393	25,738.75	5,570,740,595	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	221,811	23,174.51	5,140,361,274	24,505.47	5,435,582,606	0.58
アメリカ	株式	HOME DEPOT INC	一般消費財・サービス流通・小売り	91,151	64,186.96	5,850,705,673	58,411.71	5,324,285,860	0.57
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	162,914	27,342.51	4,454,477,234	30,685.34	4,999,072,034	0.53
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	643,841	7,106.29	4,575,320,158	6,603.44	4,251,565,670	0.45
アメリカ	株式	COCA-COLA CO/THE	食品・飲料・タバコ	378,121	9,582.18	3,623,223,068	10,607.11	4,010,772,136	0.43
オランダ	株式	ASML HOLDING NV	半導体・半導体製造装置	36,764	102,665.50	3,774,394,591	108,779.96	3,999,186,449	0.43
ドイツ	株式	SAP SE	ソフトウェア・サービス	95,669	35,096.31	3,357,629,245	41,623.00	3,982,030,787	0.42

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	296,713	15,723.72	4,665,431,911	13,387.95	3,972,378,214	0.42
アメリ カ	株式	SALESFORCE INC	ソフト ウェア・ サービ ス	88,160	49,396.76	4,354,818,356	44,137.68	3,891,178,133	0.41
アメリ カ	株式	ORACLE CORP	ソフト ウェア・ サービ ス	153,413	27,663.39	4,243,923,625	24,659.63	3,783,107,694	0.40

ロ 種類別・業種別投資比率

2025年2月28日現在

種類	業種	投資比率（％）
株式（外国）	エネルギー	3.90
	素材	3.25
	資本財	6.94
	商業・専門サービス	1.57
	運輸	1.41
	自動車・自動車部品	1.71
	耐久消費財・アパレル	1.22
	消費者サービス	2.00
	一般消費財・サービス流通・小売り	4.97
	生活必需品流通・小売り	1.89
	食品・飲料・タバコ	2.89
	家庭用品・パーソナル用品	1.39
	ヘルスケア機器・サービス	3.85
	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	7.04
	銀行	6.04
	金融サービス	7.43
	保険	3.13
	ソフトウェア・サービス	9.60
	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	6.78
	半導体・半導体製造装置	8.24
	電気通信サービス	1.23
	公益事業	2.53
	メディア・娯楽	6.76
	不動産管理・開発	0.28
新株予約権証券	-	0.00

投資証券	-	1.88
合 計		97.95

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）

2025年2月28日現在

国／ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
アメ リカ	国債 証券	US TREASURY N/B	11,450,000	14,430.73	1,652,318,858	14,527.87	1,663,440,911	1.625	2026/05/15	0.83
中国	国債 証券	CHINA GOVERNMENT BOND	72,000,000	2,094.67	1,508,163,144	2,079.77	1,497,435,346	2.390	2026/11/15	0.75
中国	国債 証券	CHINA GOVERNMENT BOND	68,600,000	2,085.78	1,430,842,535	2,070.71	1,420,508,852	2.040	2027/02/25	0.71
中国	国債 証券	CHINA GOVERNMENT BOND	44,700,000	2,757.47	1,232,590,371	2,741.00	1,225,224,785	3.720	2051/04/12	0.61
アメ リカ	国債 証券	US TREASURY N/B	8,000,000	15,077.61	1,206,208,490	15,088.53	1,207,082,563	4.875	2026/04/30	0.60
アメ リカ	国債 証券	US TREASURY N/B	8,200,000	14,590.43	1,196,415,282	14,666.76	1,202,674,482	2.250	2026/03/31	0.60
中国	国債 証券	CHINA GOVERNMENT BOND	50,000,000	2,098.65	1,049,323,512	2,085.10	1,042,549,981	2.690	2026/08/12	0.52
アメ リカ	国債 証券	US TREASURY N/B	6,870,000	14,361.29	986,620,314	14,512.00	996,974,619	3.875	2034/08/15	0.50
アメ リカ	国債 証券	US TREASURY N/B	6,350,000	14,672.23	931,686,844	14,937.66	948,541,707	4.250	2034/11/15	0.47
中国	国債 証券	CHINA GOVERNMENT BOND	43,500,000	2,119.20	921,853,439	2,110.19	917,930,734	2.110	2034/08/25	0.46
アメ リカ	国債 証券	US TREASURY N/B	6,250,000	13,336.64	833,540,293	13,497.39	843,586,891	1.625	2029/08/15	0.42
アメ リカ	国債 証券	US TREASURY N/B	5,600,000	14,766.14	826,904,000	14,890.37	833,860,661	4.125	2032/11/15	0.42
アメ リカ	国債 証券	US TREASURY N/B	5,500,000	14,948.29	822,156,018	15,091.53	830,033,899	4.375	2034/05/15	0.41
アメ リカ	国債 証券	US TREASURY N/B	5,500,000	14,931.83	821,250,515	14,983.91	824,115,199	4.125	2027/02/15	0.41
中国	国債 証券	CHINA GOVERNMENT BOND	38,000,000	2,122.93	806,714,678	2,103.61	799,370,571	2.400	2028/07/15	0.40
アメ リカ	国債 証券	US TREASURY N/B	5,700,000	13,587.79	774,504,084	13,746.44	783,547,145	2.875	2032/05/15	0.39
アメ リカ	国債 証券	US TREASURY N/B	5,500,000	13,930.68	766,187,670	14,085.89	774,724,099	3.375	2033/05/15	0.39
アメ リカ	国債 証券	US TREASURY N/B	5,300,000	14,311.89	758,530,403	14,429.09	764,741,559	2.750	2028/02/15	0.38

アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,100,000	14,530.26	741,043,409	14,679.03	748,630,780	4.000	2034/02/15	0.37
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,000,000	14,859.69	742,984,330	14,946.50	747,324,760	4.000	2028/02/29	0.37
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,900,000	14,895.01	729,855,427	14,946.79	732,392,932	4.000	2027/01/15	0.37
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,800,000	15,100.21	724,809,902	15,238.80	731,462,434	4.500	2033/11/15	0.37
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,000,000	14,431.93	721,596,487	14,583.10	729,154,822	3.875	2033/08/15	0.36
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,800,000	15,068.03	723,265,308	15,097.66	724,687,771	4.625	2026/11/15	0.36
中国	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	35,000,000	2,069.71	724,397,928	2,060.32	721,112,612	1.990	2026/03/15	0.36
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,700,000	12,452.39	709,786,476	12,618.38	719,247,566	1.125	2031/02/15	0.36
中国	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	32,400,000	2,228.54	722,047,953	2,213.85	717,286,847	3.020	2031/05/27	0.36
中国	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	34,600,000	2,080.78	719,949,901	2,060.59	712,963,510	1.740	2029/10/15	0.36
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,500,000	12,734.37	700,390,493	12,908.14	709,947,671	1.625	2031/05/15	0.35
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,000,000	13,865.43	693,271,440	14,012.55	700,627,720	2.375	2029/03/31	0.35

口 種類別投資比率

2025年2月28日現在

種類	投資比率（％）
国債証券	98.31
合 計	98.31

投資不動産物件

国内株式インデックス・マザーファンド（Ｂ号）

該当事項はありません。

国内債券パッシブ・マザーファンド

該当事項はありません。

外国株式インデックス・マザーファンド

該当事項はありません。

外国債券パッシブ・マザーファンド

該当事項はありません。

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）

2025年2月28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 ０７０３ 月 ２０２５年 ３月	買建	126	日本・円	3,451,676,700	3,371,760,000	0.95

（注）主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。

国内債券パッシブ・マザーファンド

該当事項はありません。

外国株式インデックス・マザーファンド

2025年2月28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	ＩＣ Ｅ－ ＥＵ	ＦＴＳ Ｅ １０ ０ ＩＤ Ｘ ＦＵ Ｔ ＭＡ Ｒ ２５ 2025年3 月	買建	48	イギリス・ポ ンド	4,073,241.00	768,457,647	4,194,720.00	791,375,875	0.08
	ドイツ	ＥＵ ＲＥ Ｘ	ＥＵＲ Ｏ ＳＴ Ｏ Ｘ Ｘ ５０ Ｍ ＡＲ ２５ 2025年3 月	買建	328	ユーロ	17,087,056.00	2,658,745,913	17,944,880.00	2,792,223,328	0.30
	アメリカ	シカ ゴ商 品取 引所	Ｓ＆Ｐ ５００ ＥＭＩＮ Ｉ ＦＵ Ｔ ＭＡ Ｒ ２５ 2025年3 月	買建	379	アメリカ・ド ル	113,741,024.50	17,023,619,136	111,354,937.50	16,666,493,495	1.77
	オーストラリア	シド ニー 先物 取引 所	ＳＰＩ ２００ ＦＵＴＵ ＲＥＳ ＭＡＲ ２ ５ 2025 年3月	買建	27	オーストラ リア・ドル	5,608,921.50	522,919,751	5,566,050.00	518,922,841	0.06

（注）主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。

2025年2月28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	18,906,000.00	2,823,681,100	2,828,213,622	0.30
	ユーロ	買建	2,308,000.00	360,067,964	359,023,190	0.04
	カナダ・ドル	買建	1,667,000.00	172,974,330	172,659,859	0.02
	イギリス・ポンド	買建	817,000.00	154,214,188	154,053,185	0.02
	スイス・フラン	買建	887,000.00	147,761,236	147,605,670	0.02
	スウェーデン・クローナ	買建	3,800,000.00	52,920,700	52,920,320	0.01
	香港・ドル	買建	2,487,000.00	47,726,524	47,853,361	0.01

（注）日本における対顧客先物相場の仲値で評価しております。

外国債券パッシブ・マザーファンド

該当事項はありません。

参考情報

基準日: 2025年2月28日

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

基準価額・純資産の推移

分配の推移

■マイパッケージNEXT30



決算期	分配金
2025年2月	0円
2024年2月	0円
2023年2月	0円
2022年2月	0円
2021年2月	0円
設定来累計	0円

※分配金は1万口当たり、税引前です。
 ※直近5計算期間を記載しています。

■マイパッケージNEXT50



決算期	分配金
2025年2月	0円
2024年2月	0円
2023年2月	0円
2022年2月	0円
2021年2月	0円
設定来累計	0円

※分配金は1万口当たり、税引前です。
 ※直近5計算期間を記載しています。

■マイパッケージNEXT70



決算期	分配金
2025年2月	0円
2024年2月	0円
2023年2月	0円
2022年2月	0円
2021年2月	0円
設定来累計	0円

※分配金は1万口当たり、税引前です。
 ※直近5計算期間を記載しています。

※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

■マイパッケージNEXT30

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	95.02
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		4.98
合計(純資産総額)		100.00

主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	比率(%)
日本	親投資信託受益証券	国内債券パッシブ・マザーファンド	55.51
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)	19.75
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	10.10
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	9.65

■マイパッケージNEXT50

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	94.91
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		5.09
合計(純資産総額)		100.00

主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	比率(%)
日本	親投資信託受益証券	国内債券パッシブ・マザーファンド	35.54
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)	34.77
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	14.59
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	10.01

■マイパッケージNEXT70

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	94.97
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		5.03
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)	49.90
日本	親投資信託受益証券	外国株式インデックス・マザーファンド	19.55
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	15.47
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	10.04

※比率は、ファンドのそれぞれの純資産総額に対する時価の比率です。

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

■国内株式インデックス・マザーファンド（Ｂ号）

資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
株式	日本	99.04
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		0.96
合計(純資産総額)		100.00

※株価指数先物取引の買建て 0.95%

主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	業種	比率(%)
日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	3.70
日本	株式	ソニーグループ	電気機器	3.34
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	3.11
日本	株式	日立製作所	電気機器	2.50
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	2.02
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	1.83
日本	株式	任天堂	その他製品	1.82
日本	株式	キーエンス	電気機器	1.54
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	1.44
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	1.32

■国内債券パッシブ・マザーファンド

資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
国債証券	日本	77.15
地方債証券	日本	8.32
特殊債券	日本	7.81
社債券	日本	6.02
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		0.70
合計(純資産総額)		100.00

主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	利率(%)	償還期限	比率(%)
日本	国債証券	150 5年国債	0.005	2026/12/20	1.82
日本	国債証券	377 10年国債	1.200	2034/12/20	1.04
日本	国債証券	156 5年国債	0.200	2027/12/20	0.98
日本	国債証券	375 10年国債	1.100	2034/06/20	0.95
日本	国債証券	154 5年国債	0.100	2027/09/20	0.93
日本	国債証券	368 10年国債	0.200	2032/09/20	0.91
日本	国債証券	366 10年国債	0.200	2032/03/20	0.85
日本	国債証券	149 5年国債	0.005	2026/09/20	0.83
日本	国債証券	367 10年国債	0.200	2032/06/20	0.81
日本	国債証券	376 10年国債	0.900	2034/09/20	0.81

■外国株式インデックス・マザーファンド

資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
株式	アメリカ	71.02
	イギリス	3.64
	カナダ	3.17
	スイス	2.78
	フランス	2.61
	ドイツ	2.45
	その他	10.40
投資証券	アメリカ・その他	1.88
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		2.05
合計(純資産総額)		100.00

※株価指数先物取引の買建て 2.21%

主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	業種	比率(%)
アメリカ	株式	APPLE INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	5.27
アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導体・半導体製造装置	4.30
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	4.05
アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	一般消費財・サービス流通・小売り	2.88
アメリカ	株式	META PLATFORMS INC-CLASS A	メディア・娯楽	2.10
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	1.44
アメリカ	株式	BROADCOM INC	半導体・半導体製造装置	1.28
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	1.25
アメリカ	株式	TESLA INC	自動車・自動車部品	1.19
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	1.08

※比率は、マザーファンドのそれぞれの純資産総額に対する時価の比率です。

■外国債券パッシブ・マザーファンド

資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
国債証券	アメリカ	46.89
	中国	11.06
	フランス	7.08
	イタリア	6.56
	ドイツ	5.59
	イギリス	5.07
	スペイン	4.29
	その他	11.77
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1.69
合計(純資産総額)		100.00

主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	利率(%)	償還期限	比率(%)
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1.625	2026/05/15	0.83
中国	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	2.390	2026/11/15	0.75
中国	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	2.040	2027/02/25	0.71
中国	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	3.720	2051/04/12	0.61
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4.875	2026/04/30	0.60
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.250	2026/03/31	0.60
中国	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	2.690	2026/08/12	0.52
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3.875	2034/08/15	0.50
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4.250	2034/11/15	0.47
中国	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	2.110	2034/08/25	0.46

※比率は、マザーファンドの純資産総額に対する時価の比率です。

年間収益率の推移(暦年ベース)

■マイパッケージNEXT30



■マイパッケージNEXT50



■マイパッケージNEXT70



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

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

※2025年の収益率は、年初から基準日までの騰落率です。

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

第2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

イ 申込方法

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

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

- （ロ）原則として午後３時30分までに、取得申込みが行われ販売会社所定の事務手続きが完了したものを当日の申込受付分とします。なお、販売会社によっては対応が異なる場合がありますので、お申込みの販売会社にご確認ください。

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

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

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

ファンドのお買付けに関しましては、クーリング・オフ制度の適用はありません。

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

□ 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。

二 申込単位

お申込単位の詳細は、取扱いの販売会社にお問い合わせください。

ホ 照会先

手続き等のご不明な点についての委託会社に対する照会は下記においてできます。

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

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

ヘ 申込取扱場所・払込取扱場所

販売会社において申込み・払込みを取り扱います。

ト 払込期日

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

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

２【換金（解約）手続等】

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

お買付けの販売会社にお申し出ください。

解約請求のお申込みに関しては、原則として午後３時30分までに、解約請求のお申込みが行われ販売会社所定の事務手続きが完了したものを当日の解約請求受付分とします。なお、販売会社によっ

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となります。

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

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

３【資産管理等の概要】

（１）【資産の評価】

イ 基準価額の算出方法

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

<主要投資対象の評価方法>

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

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

ロ 基準価額の算出頻度・照会方法

基準価額は、委託会社の営業日において日々算出されます。

基準価額は、販売会社または委託会社にお問い合わせいただけるほか、原則として翌日付の日本経済新聞朝刊紙面に、「マイパッケージNEXT30」は「マイN30」、「マイパッケージNEXT50」は「マイN50」、「マイパッケージNEXT70」は「マイN70」として掲載されます。

委託会社に対する照会は下記においてできます。

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

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

（２）【保管】

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

（３）【信託期間】

2019年6月28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2月19日から翌年2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、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発します。
- c. 書面決議において、受益者（委託会社等を除きます。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行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。

（二）受託会社の辞任および解任に伴う取扱い

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

ロ 収益分配金、償還金の支払い

（イ）収益分配金

- a．分配金額は、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。
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、）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、）に支払われます。

ハ 信託約款の変更等

- （イ）委託会社は、当ファンドの信託約款を変更することが受益者の利益のため必要と認めるとき、監督官庁より変更の命令を受けたとき、その他やむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意の上、当ファンドの信託約款を変更すること、または当ファンドと他のファンドとの併合（投資信託及び投資法人に関する法律第16条第２号に規定する「委託者指図型投資信託の併合」をいいます。）を行うことができるものとし、あらかじめ、変更または併合しようとする旨および内容を監督官庁に届け出ます。
- （ロ）委託会社は、上記（イ）の事項（変更についてはその内容が重大なものに該当する場合に限り、併合にあっては、その併合が受益者の利益に及ぼす影響が軽微なものに該当する場合を除きます。以下、合わせて「重大な信託約款の変更等」といいます。）について、書面決議を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに重大な信託約款の変更等の内容およびその理由などの事項を定め、当該決議の日の２週間前までに、当ファンドの知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発します。
- （ハ）上記（ロ）の書面決議において、受益者（委託会社等を除きます。）は受益権の口数に応じ

て、議決権を有し、これを行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。

- (二) 書面決議は議決権を行行使することができる受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います（書面決議は、当ファンドのすべての受益者に対してその効力を生じます。）。
- (ホ) 上記（ロ）から（二）までの取扱いは、委託会社が重大な信託約款の変更等について提案をした場合において、当該提案につき、当ファンドのすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。
- (ヘ) 上記にかかわらず、当ファンドと他のファンドとの併合の場合は、当ファンドにおいて併合の書面決議が可決された場合にあっては、相手方となる他のファンドにおいて当該併合の書面決議が否決された場合は、併合を行うことはできません。

二 反対受益者の受益権買取請求の不適用

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

ホ 販売会社との契約の更改等

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

委託会社は毎決算時および償還時に、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、受益者に対し、原則として販売会社を通じて、書面交付または電磁的方法のいずれかの方法で提供されます。

運用報告書（全体版）は、委託会社のホームページ（<https://www.smd-am.co.jp>）に掲載されますが、受益者から請求があった場合には書面交付されます。

4【受益者の権利等】

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

受益者の有する主な権利は次の通りです。

イ 分配金請求権

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

収益分配金は、原則として、税金を差し引いた後、毎計算期間終了日後1ヵ月以内の委託会社の指定する日（原則として決算日から起算して5営業日目まで）から、販売会社において、決算日

の振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（当該収益分配金にかかる決算日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該収益分配金にかかる決算日以前に設定された受益権で取得申込代金支払い前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者とし、）に支払われます。

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

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

ロ 償還金請求権

受益者は、持分に応じて償還金を請求する権利を有します。

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

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

ハ 一部解約実行請求権

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

ニ 書面決議における議決権

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

ホ 帳簿閲覧・謄写請求権

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

第３【ファンドの経理状況】

- １．当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）ならびに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づいて作成しております。
なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
- ２．当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第6期（2024年2月20日から2025年2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ＤＳ・年金バランス３０（債券重点型）】

（１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第5期 （2024年 2月19日現在）	第6期 （2025年 2月18日現在）
資産の部		
流動資産		
金銭信託	994,567	438,470
コール・ローン	40,239,550	53,062,177
親投資信託受益証券	865,181,757	1,031,128,712
未収入金	1,160,000	46,000
流動資産合計	907,575,874	1,084,675,359
資産合計	907,575,874	1,084,675,359
負債の部		
流動負債		
未払解約金	716,175	47,087
未払受託者報酬	91,699	115,009
未払委託者報酬	550,358	690,179
その他未払費用	27,504	25,792
流動負債合計	1,385,736	878,067
負債合計	1,385,736	878,067
純資産の部		
元本等		
元本	736,410,941	866,192,730
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	169,779,197	217,604,562
（分配準備積立金）	83,789,407	82,667,871
元本等合計	906,190,138	1,083,797,292
純資産合計	906,190,138	1,083,797,292
負債純資産合計	907,575,874	1,084,675,359

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第5期 自 2023年 2月21日 至 2024年 2月19日	第6期 自 2024年 2月20日 至 2025年 2月18日
営業収益		
受取利息	522	80,638
有価証券売買等損益	84,278,984	15,861,955
営業収益合計	84,279,506	15,942,593
営業費用		
支払利息	16,766	387
受託者報酬	174,389	219,986
委託者報酬	1,046,634	1,320,212
その他費用	53,420	49,400
営業費用合計	1,291,209	1,589,985
営業利益又は営業損失（ ）	82,988,297	14,352,608
経常利益又は経常損失（ ）	82,988,297	14,352,608
当期純利益又は当期純損失（ ）	82,988,297	14,352,608
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（ ）	4,594,085	2,032,677
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	68,076,676	169,779,197
剰余金増加額又は欠損金減少額	32,901,701	68,724,812
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	32,901,701	68,724,812
剰余金減少額又は欠損金増加額	9,593,392	33,219,378
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	9,593,392	33,219,378
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（ ）	169,779,197	217,604,562

（３）【注記表】

（重要な会計方針の注記）

項 目	第6期 自 2024年2月20日 至 2025年2月18日	
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。 (1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。 (2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。 (3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。	
2. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	計算期間の取扱い 当計算期間は前期末が休日のため、2024年2月20日から2025年2月18日までとなっております。	

（重要な会計上の見積りに関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

項 目	第5期 (2024年2月19日現在)	第6期 (2025年2月18日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	736,410,941口	866,192,730口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.2305円 (1万口当たりの純資産額12,305円)	1口当たり純資産額 1.2512円 (1万口当たりの純資産額12,512円)

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

項 目	第5期 自 2023年2月21日 至 2024年2月19日	第6期 自 2024年2月20日 至 2025年2月18日

分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益（10,844,329円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（61,150,838円）、収益調整金（85,989,790円）、および分配準備積立金（11,794,240円）より、分配対象収益は169,779,197円（1万口当たり2,305.50円）であります、分配を行っておりません。	計算期間末における費用控除後の配当等収益（12,384,550円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（0円）、収益調整金（134,936,691円）、および分配準備積立金（70,283,321円）より、分配対象収益は217,604,562円（1万口当たり2,512.20円）であります、分配を行っておりません。
----------	--	--

（金融商品に関する注記）

．金融商品の状況に関する事項

項 目	第6期 自 2024年2月20日 至 2025年2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。 3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 (2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。

3. 金融商品に係るリスク管理体制	リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する会議をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。 また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、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。 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。
-------------------	--

・金融商品の時価等に関する事項

項 目	第6期 (2025年2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（親投資信託受益証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

第5期（自 2023年2月21日 至 2024年2月19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	75,495,820円
合計	75,495,820円

第6期（自 2024年2月20日 至 2025年2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	12,256,975円
合計	12,256,975円

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

第6期 自 2024年2月20日 至 2025年2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5期 （2024年2月19日現在）	第6期 （2025年2月18日現在）
期首元本額	627,834,497円	736,410,941円
期中追加設定元本額	192,456,553円	271,899,979円
期中一部解約元本額	83,880,109円	142,118,190円

（４）【附属明細表】

有価証券明細表

(a) 株式

該当事項はありません。

(b) 株式以外の有価証券

（単位：円）

種 類	銘 柄	券面総額	評価額	備考
親投資信託受益証券	国内株式インデックス・マザーファンド（Ｂ号）	43,940,393	220,128,186	
	外国株式インデックス・マザーファンド	10,722,773	110,066,048	
	外国債券パッシブ・マザーファンド	47,324,115	109,053,690	
	国内債券パッシブ・マザーファンド	508,576,034	591,880,788	
	親投資信託受益証券 小計		1,031,128,712	
合 計			1,031,128,712	

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。

【三井住友ＤＳ・年金バランス５０（標準型）】

（１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第5期 （2024年 2月19日現在）	第6期 （2025年 2月18日現在）
資産の部		
流動資産		
金銭信託	3,792,178	1,551,401
コール・ローン	153,429,144	187,745,471
親投資信託受益証券	3,015,135,173	3,640,313,963
流動資産合計	3,172,356,495	3,829,610,835
資産合計	3,172,356,495	3,829,610,835
負債の部		
流動負債		
未払解約金	849,352	1,016,931
未払受託者報酬	310,719	400,185
未払委託者報酬	1,864,524	2,401,345
その他未払費用	93,361	89,962
流動負債合計	3,117,956	3,908,423
負債合計	3,117,956	3,908,423
純資産の部		
元本等		
元本	2,209,102,316	2,546,048,221
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	960,136,223	1,279,654,191
（分配準備積立金）	484,184,153	575,751,000
元本等合計	3,169,238,539	3,825,702,412
純資産合計	3,169,238,539	3,825,702,412
負債純資産合計	3,172,356,495	3,829,610,835

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第5期 自 2023年 2月21日 至 2024年 2月19日	第6期 自 2024年 2月20日 至 2025年 2月18日
営業収益		
受取利息	1,755	297,445
有価証券売買等損益	439,900,433	160,672,790
営業収益合計	439,902,188	160,970,235
営業費用		
支払利息	55,926	1,469
受託者報酬	572,723	767,877
委託者報酬	3,436,738	4,607,667
その他費用	176,087	172,900
営業費用合計	4,241,474	5,549,913
営業利益又は営業損失（ ）	435,660,714	155,420,322
経常利益又は経常損失（ ）	435,660,714	155,420,322
当期純利益又は当期純損失（ ）	435,660,714	155,420,322
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（ ）	19,530,381	11,120,379
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	382,728,684	960,136,223
剰余金増加額又は欠損金減少額	204,872,465	294,100,067
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	204,872,465	294,100,067
剰余金減少額又は欠損金増加額	43,595,259	118,882,042
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	43,595,259	118,882,042
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（ ）	960,136,223	1,279,654,191

（３）【注記表】

（重要な会計方針の注記）

項 目	第6期
	自 2024年2月20日 至 2025年2月18日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。 (1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。 (2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。 (3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。
2. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	計算期間の取扱い 当計算期間は前期末が休日のため、2024年2月20日から2025年2月18日までとなっております。

（重要な会計上の見積りに関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

項 目	第5期	第6期
	（2024年2月19日現在）	（2025年2月18日現在）
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	2,209,102,316口	2,546,048,221口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.4346円 （1万口当たりの純資産額14,346円）	1口当たり純資産額 1.5026円 （1万口当たりの純資産額15,026円）

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

項 目	第5期	第6期
	自 2023年2月21日 至 2024年2月19日	自 2024年2月20日 至 2025年2月18日

分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益（42,588,360円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（373,541,973円）、収益調整金（475,952,070円）、および分配準備積立金（68,053,820円）より、分配対象収益は960,136,223円（1万口当たり4,346.27円）であります、分配を行っておりません。	計算期間末における費用控除後の配当等収益（54,794,342円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（89,505,601円）、収益調整金（703,903,191円）、および分配準備積立金（431,451,057円）より、分配対象収益は1,279,654,191円（1万口当たり5,026.04円）であります、分配を行っておりません。
----------	--	--

（金融商品に関する注記）

・金融商品の状況に関する事項

項 目	第6期 自 2024年2月20日 至 2025年2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。 3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 (2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。

3. 金融商品に係るリスク管理体制	リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する会議をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。 また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、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。 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。
-------------------	--

・金融商品の時価等に関する事項

項 目	第6期 (2025年2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（親投資信託受益証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

第5期（自 2023年2月21日 至 2024年2月19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	410,423,006円
合計	410,423,006円

第6期（自 2024年2月20日 至 2025年2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	151,249,980円
合計	151,249,980円

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

第6期 自 2024年2月20日 至 2025年2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5期 (2024年2月19日現在)	第6期 (2025年2月18日現在)
期首元本額	1,761,328,888円	2,209,102,316円
期中追加設定元本額	638,086,243円	607,649,533円
期中一部解約元本額	190,312,815円	270,703,628円

（４）【附属明細表】

有価証券明細表

(a) 株式

該当事項はありません。

(b) 株式以外の有価証券

（単位：円）

種 類	銘 柄	券面総額	評価額	備考
親投資信託受益証券	国内株式インデックス・マザーファンド（Ｂ号）	270,646,312	1,355,856,829	
	外国株式インデックス・マザーファンド	55,942,436	574,232,322	
	外国債券パッシブ・マザーファンド	164,844,435	379,867,516	
	国内債券パッシブ・マザーファンド	1,143,115,051	1,330,357,296	
	親投資信託受益証券 小計		3,640,313,963	
合 計			3,640,313,963	

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。

【三井住友ＤＳ・年金バランス７０（株式重点型）】

（１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第5期 （2024年 2月19日現在）	第6期 （2025年 2月18日現在）
資産の部		
流動資産		
金銭信託	2,853,170	1,270,064
コール・ローン	115,437,467	153,699,001
親投資信託受益証券	2,300,404,277	2,925,807,517
流動資産合計	2,418,694,914	3,080,776,582
資産合計	2,418,694,914	3,080,776,582
負債の部		
流動負債		
未払解約金	790,015	68,415
未払受託者報酬	224,457	319,571
未払委託者報酬	1,346,987	1,917,621
その他未払費用	67,430	71,824
流動負債合計	2,428,889	2,377,431
負債合計	2,428,889	2,377,431
純資産の部		
元本等		
元本	1,451,099,391	1,713,125,690
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	965,166,634	1,365,273,461
（分配準備積立金）	474,659,154	608,314,987
元本等合計	2,416,266,025	3,078,399,151
純資産合計	2,416,266,025	3,078,399,151
負債純資産合計	2,418,694,914	3,080,776,582

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第5期 自 2023年 2月21日 至 2024年 2月19日	第6期 自 2024年 2月20日 至 2025年 2月18日
営業収益		
受取利息	1,245	237,594
有価証券売買等損益	426,723,754	206,771,240
営業収益合計	426,724,999	207,008,834
営業費用		
支払利息	39,670	1,134
受託者報酬	405,001	610,023
委託者報酬	2,430,506	3,660,486
その他費用	124,464	137,309
営業費用合計	2,999,641	4,408,952
営業利益又は営業損失（ ）	423,725,358	202,599,882
経常利益又は経常損失（ ）	423,725,358	202,599,882
当期純利益又は当期純損失（ ）	423,725,358	202,599,882
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（ ）	19,936,237	13,483,307
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	364,579,005	965,166,634
剰余金増加額又は欠損金減少額	255,535,126	344,983,379
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	255,535,126	344,983,379
剰余金減少額又は欠損金増加額	58,736,618	133,993,127
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	58,736,618	133,993,127
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
分配金	-	-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	965,166,634	1,365,273,461

（３）【注記表】

（重要な会計方針の注記）

項 目	第6期	
	自 2024年2月20日 至 2025年2月18日	
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。 (1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。 (2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。 (3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。	
2. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	計算期間の取扱い 当計算期間は前期末が休日のため、2024年2月20日から2025年2月18日までとなっております。	

（重要な会計上の見積りに関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

項 目	第5期	第6期
	（2024年2月19日現在）	（2025年2月18日現在）
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	1,451,099,391口	1,713,125,690口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.6651円 （1万口当たりの純資産額16,651円）	1口当たり純資産額 1.7969円 （1万口当たりの純資産額17,969円）

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

項 目	第5期	第6期
	自 2023年2月21日 至 2024年2月19日	自 2024年2月20日 至 2025年2月18日

分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益（34,895,682円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（368,893,439円）、収益調整金（490,507,480円）、および分配準備積立金（70,870,033円）より、分配対象収益は965,166,634円（1万口当たり6,651.28円）であります。分配を行っておりません。	計算期間末における費用控除後の配当等収益（50,403,818円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（138,712,757円）、収益調整金（756,958,474円）、および分配準備積立金（419,198,412円）より、分配対象収益は1,365,273,461円（1万口当たり7,969.49円）であります。分配を行っておりません。
----------	--	---

（金融商品に関する注記）

．金融商品の状況に関する事項

項 目	第6期 自 2024年2月20日 至 2025年2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。 3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 (2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。

3. 金融商品に係るリスク管理体制	リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する会議をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。 また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、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。 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。
-------------------	--

・金融商品の時価等に関する事項

項 目	第6期 (2025年2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（親投資信託受益証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

第5期（自 2023年2月21日 至 2024年2月19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	410,265,625円
合計	410,265,625円

第6期（自 2024年2月20日 至 2025年2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	198,018,584円
合計	198,018,584円

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

第6期 自 2024年2月20日 至 2025年2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5期 (2024年2月19日現在)	第6期 (2025年2月18日現在)
期首元本額	1,102,940,240円	1,451,099,391円
期中追加設定元本額	517,739,312円	460,451,390円
期中一部解約元本額	169,580,161円	198,425,091円

（４）【附属明細表】

有価証券明細表

(a) 株式

該当事項はありません。

(b) 株式以外の有価証券

（単位：円）

種 類	銘 柄	券面総額	評価額	備考
親投資信託受益証券	国内株式インデックス・マザーファンド（Ｂ号）	308,526,127	1,545,623,338	
	外国株式インデックス・マザーファンド	59,920,196	615,062,835	
	外国債券パッシブ・マザーファンド	131,776,316	303,665,342	
	国内債券パッシブ・マザーファンド	396,507,993	461,456,002	
	親投資信託受益証券 小計		2,925,807,517	
合 計			2,925,807,517	

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

（参考）

「三井住友ＤＳ・年金バランス３０（債券重点型）」、「三井住友ＤＳ・年金バランス５０（標準型）」および「三井住友ＤＳ・年金バランス７０（株式重点型）」は、「国内株式インデックス・マザーファンド（Ｂ号）」、「国内債券パッシブ・マザーファンド」、「外国株式インデックス・マザーファンド」および「外国債券パッシブ・マザーファンド」受益証券を投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同マザーファンドの受益証券です。

なお、以下に記載した状況は、監査の対象外です。

国内株式インデックス・マザーファンド（Ｂ号）

（１）貸借対照表

（単位：円）

（2025年2月18日現在）

資産の部

流動資産

金銭信託	34,473,156
コール・ローン	4,171,827,318
株式	361,477,157,590
派生商品評価勘定	50,059,900
未収入金	101,268,400
未収配当金	510,413,815
差入委託証拠金	242,354,761

流動資産合計	366,587,554,940
--------	-----------------

資産合計

366,587,554,940

負債の部

流動負債

派生商品評価勘定	259,400
前受金	39,920,000
未払解約金	199,840,464

流動負債合計	240,019,864
--------	-------------

負債合計

240,019,864

純資産の部

元本等

元本	73,128,223,766
----	----------------

剰余金

剰余金又は欠損金（ ）	293,219,311,310
-------------	-----------------

元本等合計	366,347,535,076
-------	-----------------

純資産合計

366,347,535,076

負債純資産合計

366,587,554,940

（２）注記表

（重要な会計方針の注記）

項 目	自 2024年2月20日 至 2025年2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。

（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	（2025年2月18日現在）
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	73,128,223,766口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 5.0097円 （1万口当たりの純資産額50,097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 2024年2月20日 至 2025年2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。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する会議をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。 また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限値、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用部署に是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用部署は、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。なお、投資信託協会の流動性リスク管理規制に抵触する場合には、流動性リスクを管理する会議で審議の上、流動性リスクの管理責任者が対処方針を決定します。その後、決定した対処方針やその実施等について、リスク管理会議に報告を行う体制となっております。 なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する会議にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。

・金融商品の時価等に関する事項

項 目	(2025年2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） 「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）

（2025年2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 0703月	4,670,249,500	-	4,720,050,000	49,800,500
	小計	4,670,249,500	-	4,720,050,000	49,800,500
合 計		4,670,249,500	-	4,720,050,000	49,800,500

（注）１．時価の算定方法

株価指数先物取引の時価の算定方法については以下のように評価しております。

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

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

- 2)株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

２．ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

自 2024年2月20日 至 2025年2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）

（2025年2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	68,652,536,502円
同期中における追加設定元本額	11,500,504,192円
同期中における一部解約元本額	7,024,816,928円
2025年2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	9,663,827,363円
三井住友・ＤＣ年金バランス３０（債券重点型）	951,034,801円
三井住友・ＤＣ年金バランス５０（標準型）	4,271,250,477円
三井住友・ＤＣ年金バランス７０（株式重点型）	3,757,122,108円
ＳＭＡＭ・グローバルバランスファンド（機動的資産配分型）	146,746,146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）	2,997,128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）	11,408,167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）	34,814,572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）	116,324,942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）	118,940,309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）	242,389,345円

国内株式指数ファンド（ＴＯＰＩＸ）	1,545,347,521円
三井住友・ＤＣつみたてＮＩＳＡ・日本株インデックスファンド	30,673,033,245円
アセットアロケーション・ファンド（安定型）	171,377,146円
アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）	261,786,922円
アセットアロケーション・ファンド（成長型）	159,836,001円
イオン・バランス戦略ファンド	38,376,546円
三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０５０	98,500,924円
三井住友・資産最適化ファンド（１安定重視型）	219,832,297円
三井住友・資産最適化ファンド（２やや安定型）	229,198,931円
三井住友・資産最適化ファンド（３バランス型）	956,592,224円
三井住友・資産最適化ファンド（４やや成長型）	586,689,985円
三井住友・資産最適化ファンド（５成長重視型）	752,275,741円
三井住友・ＤＣつみたてＮＩＳＡ・世界分散ファンド	77,159,962円
三井住友ＤＳ・国内株式インデックス年金ファンド	1,691,355,349円
三井住友ＤＳ・年金バランス３０（債券重点型）	43,940,393円
三井住友ＤＳ・年金バランス５０（標準型）	270,646,312円
三井住友ＤＳ・年金バランス７０（株式重点型）	308,526,127円
三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０６０	23,522,733円
日興ＦＷＳ・日本株インデックス	3,279,860,601円
三井住友ＤＳ・ＴＯＰＩＸインデックス・ファンド	334,982,755円
三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０３５	57,687,833円
三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０４０	36,995,556円
三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０４５	35,218,243円
三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０５５	24,187,708円
三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０６５	19,535,723円
三井住友ＤＳ・ＦＷ専用ポートフォリオ・レベル１（保守型）	1,316,534円
三井住友ＤＳ・ＦＷ専用ポートフォリオ・レベル２（安定型）	27,846,373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）	157,420,054円
三井住友ＤＳ・ＦＷ専用ポートフォリオ・レベル４（成長型）	151,931,897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）	58,204,049円
三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０７０	268,411円
ＳＭＡＭ・国内株式パッシブ・ファンド（適格機関投資家専用）	2,063,960,733円
バランスファンドＶＡ（安定運用型）＜適格機関投資家限定＞	6,508,544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＞	30,933,278円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ２５＜適格機関投資家専用＞	553,559,816円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ３７．５＜適格機関投資家専用＞	923,021,734円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ５０＜適格機関投資家専用＞	3,717,469,583円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＬ３０＜適格機関投資家限定＞	22,448,074円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＬ５０＜適格機関投資家限定＞	87,655,219円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ７５＜適格機関投資家専用＞	543,539,109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＞	152,899,860円
ＳＭＡＭ・インデックス・バランスＶＡ５０＜適格機関投資家専用＞	536,155,884円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ４０＜適格機関投資家専用＞	326,172,239円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ３５＜適格機関投資家専用＞	954,698,017円
ＳＭＡＭ・グローバルバランス４０ＶＡ＜適格機関投資家限定＞	21,353,661円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２０Ａ＜適格機関投資家専用＞	20,796,106円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ３５Ａ＜適格機関投資家専用＞	16,012,834円

ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ５０Ａ＜適格機関投資家専用＞	13,108,576円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２０Ｌ＜適格機関投資家専用＞	48,401,349円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２５Ｌ＜適格機関投資家専用＞	135,002,727円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２０Ａ２＜適格機関投資家専用＞	26,646,973円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ３５Ａ２＜適格機関投資家専用＞	25,149,276円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ５０Ａ２＜適格機関投資家専用＞	5,893,479円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ３０Ｌ２＜適格機関投資家専用＞	23,113,329円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２５Ｌ２＜適格機関投資家専用＞	306,667,110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）	146,957,825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＞	119,934,421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＞	49,757,360円
ＳＭＡＭ・世界バランスファンドＶＡ＜適格機関投資家限定＞	36,779,648円
ＳＭＡＭ・世界バランスファンドＶＡ２＜適格機関投資家限定＞	21,527,650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＞	37,552,315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＞	20,662,261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＞	31,949,305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＞	400,839,051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＞	61,751,030円
合 計	73,128,223,766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	4,800	4,210.000	20,208,000	
ニッスイ	127,800	854.800	109,243,440	
マルハニチロ	18,400	3,098.000	57,003,200	
雪国まいたけ	14,400	1,235.000	17,784,000	
カネコ種苗	4,800	1,406.000	6,748,800	
サカタのタネ	15,800	3,465.000	54,747,000	
ホクト	10,200	1,930.000	19,686,000	
住石ホールディングス	16,600	816.000	13,545,600	
日鉄鉱業	5,200	5,900.000	30,680,000	
ＩＮＰＥＸ	386,200	1,876.000	724,511,200	
石油資源開発	70,400	1,129.000	79,481,600	
Ｋ＆Ｏエナジーグループ	6,200	3,370.000	20,894,000	
ショーボンドホールディングス	16,300	4,845.000	78,973,500	
ミライト・ワン	40,800	2,344.000	95,635,200	
タマホーム	8,200	3,385.000	27,757,000	
第一カッター興業	700	1,443.000	1,010,100	
安藤・間	73,700	1,339.000	98,684,300	
東急建設	41,000	792.000	32,472,000	

コムシスホールディングス	44,400	3,298.000	146,431,200		
ビーアールホールディングス	18,500	346.000	6,401,000		
高松コンストラクショングループ	9,000	2,815.000	25,335,000		
東建コーポレーション	2,900	12,470.000	36,163,000		
ヤマウラ	6,300	1,305.000	8,221,500		
オリエンタル白石	44,000	388.000	17,072,000		
大成建設	81,800	6,789.000	555,340,200		
大林組	296,000	2,046.000	605,616,000		
清水建設	246,900	1,474.000	363,930,600		
長谷工コーポレーション	81,200	2,044.000	165,972,800		
松井建設	9,700	929.000	9,011,300		
鹿島建設	198,300	3,065.000	607,789,500		
不動テトラ	5,900	2,182.000	12,873,800		
鉄建建設	6,600	2,607.000	17,206,200		
西松建設	14,100	4,957.000	69,893,700		
三井住友建設	79,500	426.000	33,867,000		
大豊建設	2,900	3,670.000	10,643,000		
奥村組	16,100	4,405.000	70,920,500		
東鉄工業	10,900	3,135.000	34,171,500		
浅沼組	35,100	682.000	23,938,200		
戸田建設	113,000	948.100	107,135,300		
熊谷組	15,200	3,965.000	60,268,000		
矢作建設工業	11,500	1,321.000	15,191,500		
ピーエス・コンストラクション	6,300	1,572.000	9,903,600		
日本ハウスホールディングス	19,900	325.000	6,467,500		
新日本建設	11,500	1,471.000	16,916,500		
東亜道路工業	17,000	1,507.000	25,619,000		
日本道路	8,800	1,931.000	16,992,800		
東亜建設工業	27,300	1,392.000	38,001,600		
日本国土開発	32,100	490.000	15,729,000		
若築建設	2,500	3,580.000	8,950,000		
東洋建設	25,200	1,345.000	33,894,000		
五洋建設	120,900	694.000	83,904,600		
世紀東急工業	11,600	1,554.000	18,026,400		
福田組	3,200	5,350.000	17,120,000		
住友林業	77,500	4,719.000	365,722,500		
大和ハウス工業	269,600	5,008.000	1,350,156,800		
ライト工業	16,300	2,615.000	42,624,500		
積水ハウス	270,800	3,456.000	935,884,800		
日特建設	6,800	1,047.000	7,119,600		
北陸電気工事	6,100	1,215.000	7,411,500		
ユアテック	18,100	1,691.000	30,607,100		
日本リーテック	7,700	1,505.000	11,588,500		
四電工	10,600	1,389.000	14,723,400		
中電工	13,000	3,315.000	43,095,000		
関電工	49,100	2,666.000	130,900,600		
きんでん	62,300	3,235.000	201,540,500		
東京エネシス	9,400	1,116.000	10,490,400		

トーエネック	16,200	1,035.000	16,767,000
住友電設	8,000	4,890.000	39,120,000
日本電設工業	15,600	2,184.000	34,070,400
エクシオグループ	92,700	1,768.000	163,893,600
新日本空調	11,400	1,677.000	19,117,800
九電工	19,400	4,703.000	91,238,200
三機工業	18,700	3,510.000	65,637,000
日揮ホールディングス	88,600	1,164.500	103,174,700
中外炉工業	3,000	3,420.000	10,260,000
太平電業	5,600	4,980.000	27,888,000
高砂熱学工業	21,600	5,511.000	119,037,600
朝日工業社	8,400	2,050.000	17,220,000
明星工業	16,400	1,304.000	21,385,600
大気社	11,200	4,820.000	53,984,000
ダイダン	11,800	3,925.000	46,315,000
日比谷総合設備	7,200	3,370.000	24,264,000
飛島ホールディングス	9,600	1,722.000	16,531,200
フィル・カンパニー	2,200	850.000	1,870,000
テスホールディングス	24,700	280.000	6,916,000
インフロニア・ホールディングス	94,600	1,149.500	108,742,700
東洋エンジニアリング	13,200	744.000	9,820,800
レイズネクスト	12,800	1,587.000	20,313,600
ニッポン	28,100	2,126.000	59,740,600
日清製粉グループ本社	93,200	1,702.500	158,673,000
日東富士製粉	1,700	6,540.000	11,118,000
昭和産業	7,200	2,824.000	20,332,800
中部飼料	12,400	1,273.000	15,785,200
フィード・ワン	13,100	774.000	10,139,400
日本甜菜製糖	5,200	2,380.000	12,376,000
ＤＭ三井製糖ホールディングス	8,400	3,465.000	29,106,000
ウェルネオシュガー	4,700	2,297.000	10,795,900
森永製菓	36,800	2,528.000	93,030,400
中村屋	3,100	3,175.000	9,842,500
江崎グリコ	25,500	4,537.000	115,693,500
名糖産業	1,100	2,006.000	2,206,600
井村屋グループ	4,900	2,462.000	12,063,800
不二家	5,800	2,286.000	13,258,800
山崎製パン	60,700	2,548.500	154,693,950
モロゾフ	8,100	1,673.000	13,551,300
亀田製菓	5,600	3,945.000	22,092,000
寿スピリッツ	53,100	2,466.000	130,944,600
カルビー	40,800	2,851.000	116,320,800
森永乳業	33,700	3,112.000	104,874,400
六甲バター	6,500	1,185.000	7,702,500
ヤクルト本社	129,400	2,848.500	368,595,900
明治ホールディングス	117,000	2,912.000	340,704,000
雪印メグミルク	24,600	2,544.000	62,582,400
プリマハム	11,500	2,155.000	24,782,500

日本ハム	38,800	4,428.000	171,806,400
丸大食品	8,800	1,671.000	14,704,800
S F o o d s	9,900	2,339.000	23,156,100
柿安本店	3,200	2,860.000	9,152,000
伊藤ハム米久ホールディングス	13,600	3,750.000	51,000,000
サッポロホールディングス	29,900	7,404.000	221,379,600
アサヒグループホールディングス	675,800	1,799.500	1,216,102,100
キリンホールディングス	376,000	1,968.000	739,968,000
シマダヤ	4,500	1,530.000	6,885,000
宝ホールディングス	59,200	1,236.500	73,200,800
オエノンホールディングス	29,200	424.000	12,380,800
養命酒製造	3,000	2,596.000	7,788,000
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	56,900	2,328.500	132,491,650
ライフドリンク カンパニー	19,900	1,730.000	34,427,000
サントリー食品インターナショナル	63,400	4,587.000	290,815,800
ダイドーグループホールディングス	10,400	2,966.000	30,846,400
伊藤園	30,300	3,302.000	100,050,600
キーコーヒー	9,800	2,064.000	20,227,200
日清オイリオグループ	12,800	4,835.000	61,888,000
不二製油グループ本社	18,800	2,697.000	50,703,600
J - オイルミルズ	9,100	1,997.000	18,172,700
キッコーマン	296,200	1,469.500	435,265,900
味の素	207,200	6,260.000	1,297,072,000
ブルドックソース	4,700	1,726.000	8,112,200
キュービー	48,300	2,819.000	136,157,700
ハウス食品グループ本社	29,600	2,774.000	82,110,400
カゴメ	37,900	2,876.000	109,000,400
アリアケジャパン	8,900	6,120.000	54,468,000
エバラ食品工業	2,800	2,841.000	7,954,800
ニチレイ	35,900	3,378.000	121,270,200
東洋水産	41,600	8,695.000	361,712,000
イトアンドホールディングス	4,500	2,108.000	9,486,000
ヨシムラ・フード・ホールディングス	5,700	1,023.000	5,831,100
日清食品ホールディングス	114,000	2,990.000	340,860,000
フジッコ	7,700	1,636.000	12,597,200
ロック・フィールド	9,600	1,595.000	15,312,000
日本たばこ産業	545,600	3,761.000	2,052,001,600
ケンコーマヨネーズ	6,300	1,930.000	12,159,000
わらべや日洋ホールディングス	6,600	2,134.000	14,084,400
なとり	4,900	2,191.000	10,735,900
ファーマフーズ	12,500	953.000	11,912,500
ユーグレナ	58,300	502.000	29,266,600
紀文食品	7,600	1,049.000	7,972,400
ピックルスホールディングス	5,200	1,012.000	5,262,400
理研ビタミン	7,500	2,354.000	17,655,000
片倉工業	9,000	2,000.000	18,000,000
ゲンゼ	6,700	5,160.000	34,572,000

東洋紡	42,000	972.000	40,824,000
富士紡ホールディングス	4,000	4,845.000	19,380,000
倉敷紡績	6,400	5,840.000	37,376,000
シキボウ	5,700	1,013.000	5,774,100
日本毛織	25,100	1,345.000	33,759,500
帝国繊維	11,500	2,416.000	27,784,000
帝人	85,100	1,311.000	111,566,100
東レ	667,200	1,000.000	667,200,000
セーレン	17,300	2,708.000	46,848,400
小松マテーレ	13,900	810.000	11,259,000
ワコールホールディングス	17,900	5,163.000	92,417,700
ホギメディカル	13,300	4,855.000	64,571,500
ＴＳＩホールディングス	28,800	1,265.000	36,432,000
ワールド	15,100	2,400.000	36,240,000
三陽商会	4,700	2,850.000	13,395,000
オンワードホールディングス	56,900	571.000	32,489,900
ルックホールディングス	3,700	2,276.000	8,421,200
ゴールドウイン	15,900	7,436.000	118,232,400
特種東海製紙	5,800	3,715.000	21,547,000
王子ホールディングス	355,900	609.800	217,027,820
北越コーポレーション	55,100	1,485.000	81,823,500
大王製紙	53,900	835.000	45,006,500
レンゴー	88,600	815.400	72,244,440
トーモク	7,600	2,434.000	18,498,400
ザ・バック	8,400	3,360.000	28,224,000
北の達人コーポレーション	41,500	173.000	7,179,500
クラレ	121,900	1,909.000	232,707,100
旭化成	618,400	1,023.000	632,623,200
レゾナック・ホールディングス	82,300	3,704.000	304,839,200
住友化学	741,700	344.800	255,738,160
住友精化	5,200	5,040.000	26,208,000
日産化学	46,800	4,461.000	208,774,800
ラサ工業	3,400	2,707.000	9,203,800
クレハ	19,600	2,841.000	55,683,600
多木化学	3,500	3,525.000	12,337,500
テイカ	7,600	1,562.000	11,871,200
石原産業	14,800	1,720.000	25,456,000
日本曹達	20,200	2,999.000	60,579,800
東ソー	121,100	2,064.500	250,010,950
トクヤマ	29,000	2,673.500	77,531,500
セントラル硝子	11,200	3,255.000	36,456,000
東亜合成	39,800	1,426.000	56,754,800
大阪ソーダ	32,100	1,456.000	46,737,600
関東電化工業	19,500	896.000	17,472,000
デンカ	34,800	2,108.000	73,358,400
信越化学工業	811,800	4,614.000	3,745,645,200
日本カーバイド工業	4,100	1,908.000	7,822,800
堺化学工業	6,600	2,735.000	18,051,000

第一稀元素化学工業	8,300	703.000	5,834,900
エア・ウォーター	84,900	1,927.000	163,602,300
日本酸素ホールディングス	88,200	4,410.000	388,962,000
日本化学工業	3,000	2,435.000	7,305,000
日本パーカライジング	39,500	1,288.000	50,876,000
高压ガス工業	12,600	848.000	10,684,800
四国化成ホールディングス	11,000	1,991.000	21,901,000
ステラ ケミファ	4,800	4,320.000	20,736,000
保土谷化学工業	2,800	3,235.000	9,058,000
日本触媒	57,100	1,870.000	106,777,000
大日精化工業	5,800	3,105.000	18,009,000
カネカ	22,200	3,771.000	83,716,200
三菱瓦斯化学	73,200	2,420.000	177,144,000
三井化学	82,300	3,303.000	271,836,900
東京応化工業	43,200	3,713.000	160,401,600
大阪有機化学工業	7,700	2,648.000	20,389,600
三菱ケミカルグループ	669,000	768.800	514,327,200
K Hネオケム	15,400	2,458.000	37,853,200
ダイセル	102,000	1,323.500	134,997,000
住友ベークライト	28,100	3,609.000	101,412,900
積水化学工業	182,000	2,513.500	457,457,000
日本ゼオン	70,200	1,520.000	106,704,000
アイカ工業	22,500	3,367.000	75,757,500
U B E	48,900	2,234.000	109,242,600
積水樹脂	13,300	1,904.000	25,323,200
旭有機材	5,900	4,045.000	23,865,500
ニチバン	5,500	2,052.000	11,286,000
リケンテクノス	18,200	1,016.000	18,491,200
大倉工業	4,000	3,640.000	14,560,000
積水化成成品工業	9,700	356.000	3,453,200
群栄化学工業	2,100	2,711.000	5,693,100
ダイキョーニシカワ	18,600	618.000	11,494,800
森六ホールディングス	4,600	2,030.000	9,338,000
恵和	6,300	1,209.000	7,616,700
日本化薬	61,900	1,374.000	85,050,600
カーリット	8,900	1,144.000	10,181,600
日本精化	6,100	2,265.000	13,816,500
扶桑化学工業	9,400	3,500.000	32,900,000
トリケミカル研究所	10,300	3,750.000	38,625,000
A D E K A	30,600	2,794.000	85,496,400
日油	106,500	2,090.000	222,585,000
ハリマ化成グループ	5,800	867.000	5,028,600
花王	222,900	6,456.000	1,439,042,400
第一工業製薬	3,700	2,788.000	10,315,600
石原ケミカル	4,200	2,184.000	9,172,800
三洋化成工業	5,800	4,015.000	23,287,000
大日本塗料	9,700	1,260.000	12,222,000
日本ペイントホールディングス	405,500	1,030.500	417,867,750

関西ペイント	76,400	2,171.500	165,902,600
中国塗料	20,700	2,219.000	45,933,300
藤倉化成	13,700	500.000	6,850,000
太陽ホールディングス	15,800	3,830.000	60,514,000
ＤＩＣ	33,000	3,230.000	106,590,000
サカティンクス	21,500	1,825.000	39,237,500
a r t i e n c e	18,300	3,120.000	57,096,000
富士フイルムホールディングス	550,800	3,255.000	1,792,854,000
資生堂	192,400	2,361.000	454,256,400
ライオン	116,500	1,860.500	216,748,250
高砂香料工業	6,800	6,650.000	45,220,000
マンダム	21,300	1,293.000	27,540,900
ミルボン	14,700	2,941.000	43,232,700
コーセー	18,800	6,000.000	112,800,000
コタ	8,600	1,561.000	13,424,600
ポーラ・オルビスホールディングス	47,200	1,191.500	56,238,800
ノエビアホールディングス	8,300	4,205.000	34,901,500
新日本製薬	5,000	2,178.000	10,890,000
I - n e	3,400	1,721.000	5,851,400
アクシージア	7,100	435.000	3,088,500
エステー	7,000	1,492.000	10,444,000
コニシ	28,200	1,217.000	34,319,400
長谷川香料	18,400	2,781.000	51,170,400
小林製薬	24,000	5,740.000	137,760,000
荒川化学工業	8,500	1,175.000	9,987,500
メック	7,600	2,692.000	20,459,200
日本高純度化学	2,300	3,150.000	7,245,000
タカラバイオ	28,600	905.000	25,883,000
ＪＣＵ	9,800	3,870.000	37,926,000
ＯＡＴアグリオ	3,500	1,906.000	6,671,000
デクセリアルズ	78,600	2,267.500	178,225,500
アース製薬	8,500	5,080.000	43,180,000
北興化学工業	9,600	1,334.000	12,806,400
大成ラミック	3,500	2,547.000	8,914,500
クミアイ化学工業	36,700	763.000	28,002,100
日本農薬	16,900	767.000	12,962,300
アキレス	5,700	1,505.000	8,578,500
有沢製作所	15,900	1,440.000	22,896,000
日東電工	288,100	2,891.000	832,897,100
レック	12,800	1,279.000	16,371,200
三光合成	11,700	678.000	7,932,600
Z A C R O S	7,000	4,195.000	29,365,000
前澤化成工業	6,000	1,789.000	10,734,000
未来工業	3,400	3,500.000	11,900,000
ＪＳＰ	6,800	2,069.000	14,069,200
エフピコ	20,400	2,958.000	60,343,200
天馬	6,900	2,648.000	18,271,200
信越ポリマー	19,300	1,585.000	30,590,500

ニフコ	33,500	3,654.000	122,409,000
バルカー	7,500	3,285.000	24,637,500
ユニ・チャーム	572,400	1,127.500	645,381,000
協和キリン	108,300	2,057.500	222,827,250
武田薬品工業	815,700	4,224.000	3,445,516,800
アステラス製薬	806,400	1,476.000	1,190,246,400
塩野義製薬	303,600	2,204.000	669,134,400
日本新薬	24,100	3,931.000	94,737,100
中外製薬	286,500	7,404.000	2,121,246,000
科研製薬	15,400	4,459.000	68,668,600
エーザイ	120,100	4,372.000	525,077,200
ロート製薬	97,400	2,299.000	223,922,600
小野薬品工業	187,500	1,516.000	284,250,000
久光製薬	20,500	4,333.000	88,826,500
持田製薬	11,500	3,235.000	37,202,500
参天製薬	167,100	1,356.500	226,671,150
扶桑薬品工業	4,500	2,457.000	11,056,500
ツムラ	31,600	4,400.000	139,040,000
キッセイ薬品工業	15,500	3,655.000	56,652,500
生化学工業	19,000	781.000	14,839,000
栄研化学	17,300	2,243.000	38,803,900
鳥居薬品	5,300	4,330.000	22,949,000
ＪＣＲファーマ	32,600	578.000	18,842,800
東和薬品	14,300	2,994.000	42,814,200
富士製薬工業	7,900	1,380.000	10,902,000
ゼリア新薬工業	14,500	2,030.000	29,435,000
ネクセラファーマ	44,600	887.000	39,560,200
第一三共	864,000	3,621.000	3,128,544,000
杏林製薬	21,900	1,371.000	30,024,900
大幸薬品	24,400	292.000	7,124,800
ダイト	8,000	2,061.000	16,488,000
大塚ホールディングス	226,000	7,483.000	1,691,158,000
ペプチドリーム	44,700	2,207.000	98,652,900
セルソース	8,600	825.000	7,095,000
あすか製薬ホールディングス	9,900	1,950.000	19,305,000
サワイグループホールディングス	54,400	2,065.500	112,363,200
日本コークス工業	100,300	95.000	9,528,500
ニチレキグループ	11,400	2,302.000	26,242,800
ユシロ化学工業	4,600	2,107.000	9,692,200
出光興産	429,100	1,020.500	437,896,550
ＥＮＥＯＳホールディングス	1,555,400	838.800	1,304,669,520
コスモエネルギーホールディングス	30,400	6,633.000	201,643,200
横浜ゴム	46,000	3,624.000	166,704,000
ＴＯＹＯ　ＴＩＲＥ	52,100	2,601.500	135,538,150
ブリヂストン	267,200	5,874.000	1,569,532,800
住友ゴム工業	90,400	1,758.500	158,968,400
藤倉コンポジット	9,500	1,503.000	14,278,500
オカモト	5,100	5,170.000	26,367,000

フコク	6,800	1,629.000	11,077,200		
ニッタ	9,100	3,680.000	33,488,000		
住友理工	18,200	1,755.000	31,941,000		
三ツ星ベルト	12,100	3,865.000	46,766,500		
バンドー化学	12,700	1,771.000	22,491,700		
日東紡績	10,800	5,260.000	56,808,000		
A G C	89,600	4,356.000	390,297,600		
日本電気硝子	35,000	3,500.000	122,500,000		
オハラ	5,300	1,078.000	5,713,400		
住友大阪セメント	16,000	3,501.000	56,016,000		
太平洋セメント	56,400	4,097.000	231,070,800		
日本ヒューム	8,400	1,755.000	14,742,000		
日本コンクリート工業	19,100	365.000	6,971,500		
三谷セキサン	3,900	5,860.000	22,854,000		
アジアパイルホールディングス	13,500	891.000	12,028,500		
東海カーボン	89,900	905.300	81,386,470		
日本カーボン	4,700	4,070.000	19,129,000		
東洋炭素	6,200	4,065.000	25,203,000		
ノリタケ	9,600	3,575.000	34,320,000		
T O T O	66,600	3,772.000	251,215,200		
日本碍子	102,800	1,902.000	195,525,600		
日本特殊陶業	74,700	4,515.000	337,270,500		
M A R U W A	3,800	38,630.000	146,794,000		
品川リフラクトリーズ	10,700	1,754.000	18,767,800		
黒崎播磨	7,200	2,577.000	18,554,400		
ヨータイ	5,000	1,715.000	8,575,000		
フジインコーポレーテッド	24,100	2,070.000	49,887,000		
ニチアス	22,600	4,595.000	103,847,000		
ニチハ	11,100	3,045.000	33,799,500		
日本製鉄	479,600	3,386.000	1,623,925,600		
神戸製鋼所	188,900	1,737.500	328,213,750		
中山製鋼所	19,400	767.000	14,879,800		
合同製鐵	5,200	3,965.000	20,618,000		
J F E ホールディングス	284,000	1,774.500	503,958,000		
東京製鐵	26,600	1,558.000	41,442,800		
共英製鋼	10,000	1,984.000	19,840,000		
大和工業	17,300	8,241.000	142,569,300		
東京鐵鋼	4,100	5,970.000	24,477,000		
大阪製鐵	5,300	2,656.000	14,076,800		
淀川製鋼所	9,800	5,980.000	58,604,000		
中部鋼鈑	6,500	2,257.000	14,670,500		
丸一鋼管	28,600	3,504.000	100,214,400		
モリ工業	2,300	4,800.000	11,040,000		
大同特殊鋼	58,400	1,192.000	69,612,800		
日本冶金工業	6,400	4,225.000	27,040,000		
愛知製鋼	5,600	7,340.000	41,104,000		
大平洋金属	9,100	1,549.000	14,095,900		
新日本電工	54,600	283.000	15,451,800		

栗本鐵工所	4,500	4,770.000	21,465,000
三菱製鋼	6,800	1,677.000	11,403,600
日本精線	7,700	1,355.000	10,433,500
エンビプロ・ホールディングス	9,500	389.000	3,695,500
大紀アルミニウム工業所	13,700	1,006.000	13,782,200
日本軽金属ホールディングス	26,900	1,584.000	42,609,600
三井金属鉱業	23,300	4,468.000	104,104,400
三菱マテリアル	67,000	2,385.000	159,795,000
住友金属鉱山	119,500	3,453.000	412,633,500
ＤＯＷＡホールディングス	25,000	4,590.000	114,750,000
古河機械金属	12,900	2,334.000	30,108,600
大阪チタニウムテクノロジーズ	17,000	2,018.000	34,306,000
東邦チタニウム	20,000	1,013.000	20,260,000
ＵＡＣＪ	13,400	4,890.000	65,526,000
ＣＫサンエツ	2,300	3,960.000	9,108,000
古河電気工業	31,500	7,294.000	229,761,000
住友電気工業	324,900	2,876.500	934,574,850
フジクラ	101,100	6,890.000	696,579,000
ＳＷＣＣ	12,700	6,860.000	87,122,000
平河ヒューテック	6,300	1,505.000	9,481,500
リョービ	10,300	2,248.000	23,154,400
ＡＲＥホールディングス	38,600	1,871.000	72,220,600
稲葉製作所	6,200	1,693.000	10,496,600
宮地エンジニアリンググループ	11,400	1,849.000	21,078,600
トーカロ	26,900	1,802.000	48,473,800
ＳＵＭＣＯ	179,400	1,118.000	200,569,200
川田テクノロジーズ	6,900	3,115.000	21,493,500
ＲＳ　ＴＥＣＨＮＯＬＯＧＩＥＳ	7,100	3,630.000	25,773,000
東洋製罐グループホールディングス	59,800	2,297.500	137,390,500
ホッカンホールディングス	5,100	1,677.000	8,552,700
横河ブリッジホールディングス	15,700	2,617.000	41,086,900
三和ホールディングス	92,600	4,854.000	449,480,400
文化シャッター	25,300	1,865.000	47,184,500
三協立山	13,900	603.000	8,381,700
アルインコ	7,700	1,046.000	8,054,200
ＬＩＸＩＬ	138,100	1,738.000	240,017,800
ノーリツ	15,200	1,689.000	25,672,800
長府製作所	10,600	1,902.000	20,161,200
リンナイ	49,700	3,289.000	163,463,300
日東精工	13,700	585.000	8,014,500
岡部	16,300	829.000	13,512,700
ジーテクト	10,800	1,652.000	17,841,600
東ブレ	17,100	1,900.000	32,490,000
高周波熱錬	14,700	1,007.000	14,802,900
東京製綱	5,800	1,305.000	7,569,000
パイオラックス	12,500	2,370.000	29,625,000
エイチワン	9,900	1,165.000	11,533,500
日本発条	82,900	1,791.000	148,473,900

中央発條	6,100	1,608.000	9,808,800		
立川ブラインド工業	4,400	1,432.000	6,300,800		
日本製鋼所	28,100	5,592.000	157,135,200		
三浦工業	42,700	3,141.000	134,120,700		
タクマ	31,100	1,845.000	57,379,500		
ツガミ	19,700	1,636.000	32,229,200		
オークマ	15,900	3,290.000	52,311,000		
芝浦機械	11,800	3,635.000	42,893,000		
アマダ	125,300	1,468.500	184,003,050		
アイダエンジニアリング	19,900	822.000	16,357,800		
F U J I	38,000	2,242.000	85,196,000		
牧野フライス製作所	10,300	11,880.000	122,364,000		
オーエスジー	39,800	1,666.500	66,326,700		
旭ダイヤモンド工業	21,200	855.000	18,126,000		
D M G 森精機	58,300	2,427.500	141,523,250		
ソディック	24,200	889.000	21,513,800		
ディスコ	44,400	47,010.000	2,087,244,000		
日東工器	4,300	2,169.000	9,326,700		
日進工具	7,100	762.000	5,410,200		
富士ダイス	6,700	805.000	5,393,500		
リケンN P R	13,000	2,628.000	34,164,000		
島精機製作所	15,200	946.000	14,379,200		
オプトラン	14,800	1,793.000	26,536,400		
イワキ	6,200	2,372.000	14,706,400		
フリュー	9,200	1,048.000	9,641,600		
ヤマシンフィルタ	22,400	632.000	14,156,800		
日阪製作所	10,200	1,064.000	10,852,800		
やまびこ	14,800	2,520.000	37,296,000		
野村マイクロ・サイエンス	15,300	2,775.000	42,457,500		
平田機工	4,400	4,830.000	21,252,000		
P E G A S U S	11,000	512.000	5,632,000		
マルマエ	4,300	1,485.000	6,385,500		
タツモ	6,600	2,306.000	15,219,600		
ナブテスコ	57,900	2,449.000	141,797,100		
三井海洋開発	11,900	4,300.000	51,170,000		
レオン自動機	10,300	1,361.000	14,018,300		
S M C	27,500	54,460.000	1,497,650,000		
ホソカワミクロン	6,300	3,960.000	24,948,000		
ユニオンツール	4,000	4,765.000	19,060,000		
瑞光	7,300	1,309.000	9,555,700		
オイレス工業	12,100	2,336.000	28,265,600		
日精エー・エス・ビー機械	3,400	5,410.000	18,394,000		
サトーホールディングス	11,600	2,111.000	24,487,600		
技研製作所	8,700	1,446.000	12,580,200		
日本エアーテック	5,400	1,069.000	5,772,600		
日精樹脂工業	7,100	957.000	6,794,700		
ワイエイシイホールディングス	9,100	975.000	8,872,500		
小松製作所	453,600	4,763.000	2,160,496,800		

住友重機械工業	54,500	2,950.500	160,802,250
日立建機	36,400	3,875.000	141,050,000
日工	11,000	703.000	7,733,000
巴工業	3,700	3,675.000	13,597,500
井関農機	13,800	988.000	13,634,400
ＴＯＷＡ	29,000	1,714.000	49,706,000
北川鉄工所	1,900	1,227.000	2,331,300
ローツェ	48,000	1,668.500	80,088,000
クボタ	470,500	1,904.000	895,832,000
荏原実業	4,500	4,205.000	18,922,500
三菱化工機	3,000	3,800.000	11,400,000
月島ホールディングス	12,600	1,555.000	19,593,000
帝国電機製作所	6,000	2,963.000	17,778,000
新東工業	21,800	918.000	20,012,400
澁谷工業	8,500	3,390.000	28,815,000
アイチコーポレーション	14,900	1,502.000	22,379,800
小森コーポレーション	21,900	1,318.000	28,864,200
鶴見製作所	7,500	3,265.000	24,487,500
酒井重工業	3,500	2,337.000	8,179,500
荏原製作所	189,000	2,702.000	510,678,000
西島製作所	7,900	2,414.000	19,070,600
北越工業	9,300	2,096.000	19,492,800
ダイキン工業	120,000	16,130.000	1,935,600,000
オルガノ	14,200	6,900.000	97,980,000
トーヨーカネツ	3,100	3,860.000	11,966,000
栗田工業	51,400	5,104.000	262,345,600
椿本チエイン	44,500	1,847.000	82,191,500
木村化工機	8,700	838.000	7,290,600
アネスト岩田	15,200	1,295.000	19,684,000
ダイフク	154,900	3,803.000	589,084,700
サムコ	2,300	3,035.000	6,980,500
タダノ	51,900	1,129.500	58,621,050
フジテック	29,600	5,795.000	171,532,000
ＣＫＤ	25,200	2,337.000	58,892,400
平和	31,200	2,340.000	73,008,000
理想科学工業	14,800	1,466.000	21,696,800
ＳＡＮＫＹＯ	106,600	2,106.500	224,552,900
日本金銭機械	11,100	1,165.000	12,931,500
マースグループホールディングス	6,000	3,190.000	19,140,000
フクシマガリレイ	13,600	2,782.000	37,835,200
ダイコク電機	4,600	2,660.000	12,236,000
竹内製作所	16,600	5,520.000	91,632,000
アマノ	25,900	3,826.000	99,093,400
ジャノメ	9,400	1,013.000	9,522,200
マックス	11,800	4,155.000	49,029,000
グローリー	24,300	2,670.500	64,893,150
新晃工業	26,500	1,302.000	34,503,000
大和冷機工業	13,500	1,630.000	22,005,000

セガサミーホールディングス	82,700	3,047.000	251,986,900
ＴＰＲ	11,000	2,362.000	25,982,000
ツバキ・ナカシマ	25,800	461.000	11,893,800
ホシザキ	59,500	5,837.000	347,301,500
大豊工業	9,000	642.000	5,778,000
日本精工	169,900	635.400	107,954,460
ＮＴＮ	219,600	238.700	52,418,520
ジェイテクト	81,900	1,167.500	95,618,250
不二越	6,700	3,280.000	21,976,000
日本トムソン	25,800	481.000	12,409,800
ＴＨＫ	53,400	3,731.000	199,235,400
ユーシン精機	7,900	652.000	5,150,800
前澤給装工業	6,900	1,361.000	9,390,900
イーグル工業	9,800	2,028.000	19,874,400
ＰＩＬＬＡＲ	8,200	3,790.000	31,078,000
キッツ	29,500	1,159.000	34,190,500
マキタ	114,600	4,790.000	548,934,000
三井Ｅ＆Ｓ	49,900	1,808.000	90,219,200
カナデビア	77,500	976.000	75,640,000
三菱重工業	1,611,900	2,173.000	3,502,658,700
ＩＨＩ	74,100	9,780.000	724,698,000
スター精密	15,300	1,877.000	28,718,100
キオクシアホールディングス	41,500	2,359.000	97,898,500
日清紡ホールディングス	68,200	924.800	63,071,360
イビデン	53,000	3,644.000	193,132,000
コニカミノルタ	207,500	546.600	113,419,500
ブラザー工業	123,600	2,617.500	323,523,000
ミネベアミツミ	160,500	2,348.500	376,934,250
日立製作所	2,373,200	4,345.000	10,311,554,000
三菱電機	938,500	2,382.500	2,235,976,250
富士電機	56,100	6,779.000	380,301,900
安川電機	100,500	4,179.000	419,989,500
シンフォニアテクノロジー	9,600	6,870.000	65,952,000
明電舎	16,700	4,675.000	78,072,500
山洋電気	4,500	9,500.000	42,750,000
デンヨー	7,000	2,706.000	18,942,000
ＫＯＫＵＳＡＩ　ＥＬＥＣＴＲＩＣ	65,000	3,212.000	208,780,000
ソシオネクスト	92,200	2,020.000	186,244,000
東芝テック	13,900	3,050.000	42,395,000
芝浦メカトロニクス	6,700	9,310.000	62,377,000
マブチモーター	39,100	2,328.000	91,024,800
ニデック	407,600	2,650.500	1,080,343,800
トレックス・セミコンダクター	4,800	1,255.000	6,024,000
東光高岳	5,300	2,145.000	11,368,500
ダイヘン	9,300	7,340.000	68,262,000
ヤーマン	19,000	756.000	14,364,000
ＪＶＣケンウッド	73,300	1,450.500	106,321,650
ミマキエンジニアリング	9,000	1,570.000	14,130,000

大崎電気工業	21,000	785.000	16,485,000		
オムロン	85,200	4,508.000	384,081,600		
日東工業	15,000	3,040.000	45,600,000		
ＩＤＥＣ	16,700	2,538.000	42,384,600		
ジーエス・ユアサ　コーポレーション	42,400	2,445.000	103,668,000		
メルコホールディングス	1,500	2,435.000	3,652,500		
日本電気	130,200	15,600.000	2,031,120,000		
富士通	848,500	3,106.000	2,635,441,000		
沖電気工業	44,700	967.000	43,224,900		
電気興業	4,000	1,624.000	6,496,000		
サンケン電気	9,400	5,829.000	54,792,600		
アイホン	6,100	2,653.000	16,183,300		
ルネサスエレクトロニクス	702,300	2,512.000	1,764,177,600		
セイコーエプソン	118,600	2,416.000	286,537,600		
ワコム	64,900	650.000	42,185,000		
アルバック	20,300	5,695.000	115,608,500		
アクセル	4,400	1,220.000	5,368,000		
ＥＩＺＯ	12,600	2,142.000	26,989,200		
日本信号	23,200	903.000	20,949,600		
京三製作所	21,500	507.000	10,900,500		
能美防災	12,800	3,040.000	38,912,000		
ホーチキ	7,400	2,541.000	18,803,400		
エレコム	23,700	1,659.000	39,318,300		
パナソニック　ホールディングス	1,089,700	1,900.500	2,070,974,850		
シャープ	134,800	989.900	133,438,520		
アンリツ	64,000	1,469.500	94,048,000		
ソニーグループ	3,148,400	3,782.000	11,907,248,800		
ＴＤＫ	796,400	1,665.000	1,326,006,000		
帝国通信工業	4,100	2,457.000	10,073,700		
タムラ製作所	36,400	591.000	21,512,400		
アルプスアルパイン	76,600	1,555.500	119,151,300		
日本電波工業	10,800	925.000	9,990,000		
鈴木	5,300	1,760.000	9,328,000		
メイコー	9,100	8,450.000	76,895,000		
日本トリム	2,200	3,800.000	8,360,000		
フォスター電機	9,700	1,508.000	14,627,600		
ＳＭＫ	2,500	2,815.000	7,037,500		
ヨコオ	8,900	1,496.000	13,314,400		
ホシデン	24,600	2,132.000	52,447,200		
ヒロセ電機	13,400	18,280.000	244,952,000		
日本航空電子工業	24,900	2,747.000	68,400,300		
ＴＯＡ	10,100	972.000	9,817,200		
マクセル	21,100	1,925.000	40,617,500		
古野電気	11,800	2,365.000	27,907,000		
スミダコーポレーション	12,900	981.000	12,654,900		
アイコム	3,600	2,765.000	9,954,000		
リオン	3,800	2,569.000	9,762,200		
横河電機	100,900	2,842.500	286,808,250		

新電元工業	4,400	2,632.000	11,580,800		
アズビル	248,500	1,180.000	293,230,000		
日本光電工業	81,600	2,313.000	188,740,800		
チノー	3,700	2,196.000	8,125,200		
日本電子材料	6,500	2,230.000	14,495,000		
堀場製作所	17,300	9,721.000	168,173,300		
アドバンテスト	287,600	9,503.000	2,733,062,800		
エスベック	8,100	2,415.000	19,561,500		
キーエンス	91,300	65,000.000	5,934,500,000		
日置電機	4,800	7,010.000	33,648,000		
シスメックス	236,400	2,764.500	653,527,800		
日本マイクロニクス	15,500	4,895.000	75,872,500		
メガチップス	6,900	5,070.000	34,983,000		
ＯＢＡＲＡ　ＧＲＯＵＰ	5,900	3,505.000	20,679,500		
コーセル	11,400	1,027.000	11,707,800		
イリソ電子工業	9,800	2,679.000	26,254,200		
オブテックスグループ	19,900	1,665.000	33,133,500		
千代田インテグレ	3,800	3,185.000	12,103,000		
レーザーテック	35,400	15,015.000	531,531,000		
スタンレー電気	57,600	2,546.500	146,678,400		
ウシオ電機	40,300	2,086.000	84,065,800		
日本セラミック	10,000	2,691.000	26,910,000		
山一電機	7,700	2,159.000	16,624,300		
図研	8,800	4,835.000	42,548,000		
日本電子	21,100	5,330.000	112,463,000		
カシオ計算機	76,000	1,239.500	94,202,000		
ファナック	441,700	4,453.000	1,966,890,100		
日本シイエムケイ	31,000	507.000	15,717,000		
エンプラス	2,700	4,745.000	12,811,500		
大真空	13,300	614.000	8,166,200		
ローム	165,800	1,585.000	262,793,000		
浜松ホトニクス	146,900	1,734.500	254,798,050		
三井ハイテック	40,700	868.000	35,327,600		
新光電気工業	29,100	5,904.000	171,806,400		
京セラ	569,300	1,741.000	991,151,300		
太陽誘電	40,000	2,589.000	103,560,000		
村田製作所	803,500	2,735.500	2,197,974,250		
双葉電子工業	19,500	532.000	10,374,000		
ニチコン	23,600	1,230.000	29,028,000		
ＫＯＡ	16,000	965.000	15,440,000		
市光工業	18,900	416.000	7,862,400		
小糸製作所	95,700	1,960.000	187,572,000		
ミツバ	18,200	825.000	15,015,000		
ＳＣＲＥＥＮホールディングス	38,200	10,815.000	413,133,000		
キャノン電子	9,100	2,527.000	22,995,700		
キャノン	455,200	5,144.000	2,341,548,800		
リコー	241,700	1,564.500	378,139,650		
象印マホービン	30,000	1,592.000	47,760,000		

東京エレクトロン	193,100	25,130.000	4,852,603,000		
イノテック	6,500	1,388.000	9,022,000		
トヨタ紡織	38,100	2,018.500	76,904,850		
ユニプレス	17,700	1,067.000	18,885,900		
豊田自動織機	77,800	12,670.000	985,726,000		
モリタホールディングス	15,900	2,132.000	33,898,800		
三櫻工業	13,000	650.000	8,450,000		
デンソー	891,500	1,949.000	1,737,533,500		
東海理化電機製作所	26,700	2,246.000	59,968,200		
川崎重工業	69,000	7,905.000	545,445,000		
名村造船所	26,500	2,065.000	54,722,500		
日本車輛製造	4,500	2,138.000	9,621,000		
三菱ロジスネクスト	15,200	1,898.000	28,849,600		
日産自動車	1,146,700	439.500	503,974,650		
いすゞ自動車	281,800	2,011.000	566,699,800		
トヨタ自動車	4,850,000	2,804.000	13,599,400,000		
日野自動車	74,000	495.500	36,667,000		
三菱自動車工業	351,200	417.500	146,626,000		
武蔵精密工業	22,600	2,841.000	64,206,600		
日産車体	14,600	1,046.000	15,271,600		
新明和工業	26,500	1,395.000	36,967,500		
極東開発工業	14,900	2,542.000	37,875,800		
トピー工業	8,100	2,130.000	17,253,000		
ティラド	2,400	3,610.000	8,664,000		
曙ブレーキ工業	78,600	117.000	9,196,200		
タチエス	18,500	1,808.000	33,448,000		
N O K	35,600	2,369.500	84,354,200		
フタバ産業	27,600	788.000	21,748,800		
カヤバ	16,200	2,970.000	48,114,000		
大同メタル工業	19,500	512.000	9,984,000		
プレス工業	36,200	578.000	20,923,600		
太平洋工業	22,000	1,426.000	31,372,000		
アイシン	193,600	1,766.000	341,897,600		
マツダ	282,700	1,031.500	291,605,050		
本田技研工業	2,162,500	1,417.500	3,065,343,750		
スズキ	737,000	1,926.500	1,419,830,500		
S U B A R U	274,900	2,811.000	772,743,900		
ヤマハ発動機	384,900	1,208.000	464,959,200		
エクセディ	15,000	4,790.000	71,850,000		
豊田合成	25,500	2,729.500	69,602,250		
愛三工業	19,000	1,950.000	37,050,000		
ヨロズ	10,700	1,058.000	11,320,600		
エフ・シー・シー	17,600	3,260.000	57,376,000		
シマノ	39,600	20,500.000	811,800,000		
テイ・エス テック	36,700	1,742.500	63,949,750		
リガク・ホールディングス	48,300	1,121.000	54,144,300		
テルモ	609,400	2,802.000	1,707,538,800		
日機装	23,400	1,246.000	29,156,400		

日本エム・ディ・エム	6,700	613.000	4,107,100
島津製作所	130,700	3,955.000	516,918,500
J M S	4,000	476.000	1,904,000
長野計器	6,500	1,996.000	12,974,000
ブイ・テクノロジー	4,700	2,282.000	10,725,400
東京計器	6,900	3,475.000	23,977,500
愛知時計電機	4,100	1,802.000	7,388,200
インターアクション	5,700	1,146.000	6,532,200
東京精密	18,600	8,930.000	166,098,000
マニー	36,200	1,446.000	52,345,200
ニコン	144,600	1,532.000	221,527,200
トプコン	52,200	2,808.000	146,577,600
オリンパス	522,400	2,057.500	1,074,838,000
理研計器	12,800	2,945.000	37,696,000
タムロン	12,600	3,930.000	49,518,000
H O Y A	178,100	19,040.000	3,391,024,000
ノーリツ鋼機	8,700	4,795.000	41,716,500
A & Dホロンホールディングス	11,900	2,069.000	24,621,100
朝日インテック	111,200	2,737.500	304,410,000
シチズン時計	84,300	891.000	75,111,300
メニコン	34,500	1,359.000	46,885,500
松風	9,200	2,290.000	21,068,000
セイコーグループ	14,400	5,080.000	73,152,000
ニプロ	76,200	1,340.500	102,146,100
三井松島ホールディングス	6,800	4,560.000	31,008,000
パラマウントベッドホールディングス	20,200	2,691.000	54,358,200
トランザクション	6,200	2,073.000	12,852,600
ニホンフラッシュ	8,600	806.000	6,931,600
前田工繊	18,400	1,845.000	33,948,000
アートネイチャー	9,800	759.000	7,438,200
フルヤ金属	8,400	3,000.000	25,200,000
バンダイナムコホールディングス	246,800	4,950.000	1,221,660,000
S H O E I	25,600	1,940.000	49,664,000
フランスベッドホールディングス	11,900	1,295.000	15,410,500
パイロットコーポレーション	13,800	4,254.000	58,705,200
萩原工業	6,300	1,513.000	9,531,900
フジシールインターナショナル	20,600	2,805.000	57,783,000
タカラトミー	38,300	4,115.000	157,604,500
広済堂ホールディングス	36,400	506.000	18,418,400
プロネクサス	8,600	1,287.000	11,068,200
T O P P A Nホールディングス	119,600	4,842.000	579,103,200
大日本印刷	189,400	2,170.000	410,998,000
共同印刷	2,800	4,350.000	12,180,000
N I S S H A	15,700	1,426.000	22,388,200
T A K A R A & C O M P A N Y	5,300	3,095.000	16,403,500
アシックス	336,800	3,717.000	1,251,885,600
ツツミ	3,200	2,296.000	7,347,200
ローランド	6,700	3,930.000	26,331,000

小松ウオール工業	6,600	1,510.000	9,966,000		
ヤマハ	163,600	1,073.500	175,624,600		
河合楽器製作所	2,900	3,185.000	9,236,500		
クリナップ	9,800	655.000	6,419,000		
ビジョン	57,800	1,642.000	94,907,600		
キングジム	9,300	861.000	8,007,300		
リンテック	17,500	2,915.000	51,012,500		
イトーキ	18,200	1,751.000	31,868,200		
任天堂	575,600	11,450.000	6,590,620,000		
三菱鉛筆	12,400	2,611.000	32,376,400		
タカラスタンダード	20,600	1,796.000	36,997,600		
コクヨ	43,500	2,917.000	126,889,500		
ナカバヤシ	2,500	532.000	1,330,000		
グローブライド	8,800	1,926.000	16,948,800		
オカムラ	27,300	2,041.000	55,719,300		
美津濃	9,200	8,390.000	77,188,000		
グリムス	4,100	2,198.000	9,011,800		
東京電力ホールディングス	772,500	402.100	310,622,250		
中部電力	334,800	1,580.000	528,984,000		
関西電力	444,900	1,710.000	760,779,000		
中国電力	158,000	855.000	135,090,000		
北陸電力	92,300	793.000	73,193,900		
東北電力	239,900	1,088.000	261,011,200		
四国電力	83,200	1,146.500	95,388,800		
九州電力	210,300	1,302.500	273,915,750		
北海道電力	96,100	727.900	69,951,190		
沖縄電力	23,900	930.000	22,227,000		
電源開発	68,500	2,532.500	173,476,250		
エフオン	9,900	381.000	3,771,900		
イーレックス	22,500	773.000	17,392,500		
レノバ	26,000	729.000	18,954,000		
東京瓦斯	173,000	4,733.000	818,809,000		
大阪瓦斯	179,000	3,245.000	580,855,000		
東邦瓦斯	35,900	3,965.000	142,343,500		
北海道瓦斯	26,100	526.000	13,728,600		
広島ガス	21,300	352.000	7,497,600		
西部ガスホールディングス	9,600	1,653.000	15,868,800		
静岡ガス	20,000	1,033.000	20,660,000		
メタウォーター	12,300	1,945.000	23,923,500		
ＳＢＳホールディングス	9,000	2,710.000	24,390,000		
東武鉄道	95,600	2,638.000	252,192,800		
相鉄ホールディングス	29,200	2,454.500	71,671,400		
東急	256,000	1,721.500	440,704,000		
京浜急行電鉄	112,500	1,454.000	163,575,000		
小田急電鉄	150,900	1,509.000	227,708,100		
京王電鉄	48,400	3,970.000	192,148,000		
京成電鉄	159,800	1,538.000	245,772,400		
富士急行	12,100	2,400.000	29,040,000		

東日本旅客鉄道	502,300	2,819.000	1,415,983,700
西日本旅客鉄道	223,500	2,886.000	645,021,000
東海旅客鉄道	354,000	2,856.500	1,011,201,000
東京地下鉄	154,100	1,837.000	283,081,700
西武ホールディングス	99,500	3,252.000	323,574,000
鴻池運輸	16,800	2,994.000	50,299,200
西日本鉄道	25,900	2,193.500	56,811,650
ハマキョウレックス	29,900	1,255.000	37,524,500
サカイ引越センター	11,200	2,351.000	26,331,200
近鉄グループホールディングス	98,000	3,272.000	320,656,000
阪急阪神ホールディングス	120,500	3,680.000	443,440,000
南海電気鉄道	40,100	2,525.000	101,252,500
京阪ホールディングス	50,500	3,376.000	170,488,000
神戸電鉄	2,200	2,493.000	5,484,600
名古屋鉄道	99,700	1,770.000	176,469,000
山陽電気鉄道	6,500	2,044.000	13,286,000
ヤマトホールディングス	111,200	1,909.000	212,280,800
山九	21,700	5,819.000	126,272,300
丸全昭和運輸	5,900	5,830.000	34,397,000
センコーグループホールディングス	60,100	1,425.000	85,642,500
トナミホールディングス	2,100	6,230.000	13,083,000
ニッコンホールディングス	51,500	2,259.000	116,338,500
福山通運	10,000	3,615.000	36,150,000
セイノーホールディングス	44,500	2,235.500	99,479,750
神奈川中央交通	2,500	3,900.000	9,750,000
A Z - C O M丸和ホールディングス	28,900	1,226.000	35,431,400
九州旅客鉄道	70,000	3,648.000	255,360,000
S Gホールディングス	152,300	1,409.000	214,590,700
N I P P O N E X P R E S Sホールディングス	98,200	2,644.000	259,640,800
日本郵船	188,500	5,206.000	981,331,000
商船三井	172,700	5,513.000	952,095,100
川崎汽船	206,900	2,152.500	445,352,250
N Sユナイテッド海運	6,200	4,095.000	25,389,000
飯野海運	34,700	1,050.000	36,435,000
乾汽船	12,600	1,482.000	18,673,200
日本航空	209,500	2,594.500	543,547,750
A N Aホールディングス	247,600	2,892.000	716,059,200
日新	6,700	4,355.000	29,178,500
三菱倉庫	93,600	1,031.500	96,548,400
三井倉庫ホールディングス	9,800	7,610.000	74,578,000
住友倉庫	27,100	2,773.000	75,148,300
澁澤倉庫	3,600	3,165.000	11,394,000
日本トランスシティ	18,600	985.000	18,321,000
中央倉庫	2,000	1,444.000	2,888,000
安田倉庫	6,900	1,863.000	12,854,700
上組	41,400	3,305.000	136,827,000
キューソー流通システム	6,700	2,011.000	13,473,700

エーアイテイー	5,400	1,672.000	9,028,800
内外トランスライン	3,500	2,505.000	8,767,500
日本コンセプト	3,300	1,833.000	6,048,900
クロスキャット	7,100	1,072.000	7,611,200
システナ	134,900	351.000	47,349,900
デジタルアーツ	6,500	6,440.000	41,860,000
日鉄ソリューションズ	32,300	4,340.000	140,182,000
キューブシステム	4,500	1,020.000	4,590,000
コア	4,300	1,853.000	7,967,900
手間いらず	1,900	3,015.000	5,728,500
ラクーンホールディングス	8,100	886.000	7,176,600
ソリトンシステムズ	4,800	1,111.000	5,332,800
ソフトクリエイトホールディングス	7,100	2,061.000	14,633,100
T I S	98,000	3,764.000	368,872,000
グリーンホールディングス	31,100	561.000	17,447,100
GMOペパボ	600	1,464.000	878,400
コーエーテクモホールディングス	70,100	2,063.000	144,616,300
三菱総合研究所	4,900	4,975.000	24,377,500
ファインデックス	7,900	745.000	5,885,500
ブレインパッド	7,500	1,310.000	9,825,000
ポールトゥウィンホールディングス	15,000	452.000	6,780,000
ネクソン	202,200	2,047.500	414,004,500
アイスタイル	29,900	513.000	15,338,700
エムアップホールディングス	11,500	1,664.000	19,136,000
エイチーム	6,700	921.000	6,170,700
セルシス	14,800	1,294.000	19,151,200
エニグモ	12,700	337.000	4,279,900
コロブラ	32,000	507.000	16,224,000
ブロードリーフ	43,900	655.000	28,754,500
デジタルハーツホールディングス	6,200	1,109.000	6,875,800
メディアドゥ	4,400	1,709.000	7,519,600
じげん	25,500	446.000	11,373,000
フィックスターズ	9,800	1,963.000	19,237,400
C A R T A H O L D I N G S	5,100	1,496.000	7,629,600
オブティム	14,600	748.000	10,920,800
セレス	4,200	2,929.000	12,301,800
S H I F T	92,900	1,422.000	132,103,800
セック	1,400	5,320.000	7,448,000
テクマトリックス	22,200	2,285.000	50,727,000
プロシップ	3,900	1,554.000	6,060,600
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	22,800	3,096.000	70,588,800
GMOペイメントゲートウェイ	21,200	8,011.000	169,833,200
システムリサーチ	5,900	1,688.000	9,959,200
インターネットイニシアティブ	50,800	2,696.000	136,956,800
さくらインターネット	14,600	4,470.000	65,262,000
GMOグローバルサイン・ホールディングス	2,800	2,311.000	6,470,800
S R Aホールディングス	5,200	4,300.000	22,360,000
朝日ネット	8,600	672.000	5,779,200

e B A S E	12,200	590.000	7,198,000
アバントグループ	15,200	1,918.000	29,153,600
アドソル日進	3,500	2,060.000	7,210,000
フリービット	4,900	1,578.000	7,732,200
コムチュア	12,300	1,979.000	24,341,700
アイル	5,400	2,531.000	13,667,400
マークライنز	5,200	2,396.000	12,459,200
メディカル・データ・ビジョン	12,600	450.000	5,670,000
g u m i	18,400	558.000	10,267,200
テラスカイ	4,300	2,471.000	10,625,300
デジタル・インフォメーション・テクノロ ジー	5,700	2,369.000	13,503,300
ネオジャパン	3,200	1,731.000	5,539,200
P R T I M E S	2,200	2,351.000	5,172,200
ラクス	43,800	2,091.000	91,585,800
ダブルスタンダード	3,400	1,675.000	5,695,000
オープンドア	6,500	620.000	4,030,000
アカツキ	4,600	2,980.000	13,708,000
U B I C O Mホールディングス	3,100	1,454.000	4,507,400
カナミックネットワーク	12,200	473.000	5,770,600
チェンジホールディングス	24,600	1,371.000	33,726,600
オークネット	4,200	2,527.000	10,613,400
オロ	3,900	2,658.000	10,366,200
ユーザーローカル	3,800	1,859.000	7,064,200
P K S H A T E C H N O L O G Y	8,100	4,145.000	33,574,500
マネーフォワード	22,800	4,552.000	103,785,600
S U N A S T E R I S K	6,900	573.000	3,953,700
プラスアルファ・コンサルティング	11,600	1,568.000	18,188,800
電算システムホールディングス	4,200	2,426.000	10,189,200
A P P I E R G R O U P	29,700	1,683.000	49,985,100
ビジョナル	10,800	7,568.000	81,734,400
野村総合研究所	199,000	5,337.000	1,062,063,000
日本システム技術	8,400	1,981.000	16,640,400
インテージホールディングス	8,800	1,757.000	15,461,600
東邦システムサイエンス	3,800	1,225.000	4,655,000
シンプレクス・ホールディングス	17,900	2,915.000	52,178,500
ラクスル	24,400	1,252.000	30,548,800
メルカリ	50,900	2,292.000	116,662,800
I P S	2,900	2,566.000	7,441,400
システムサポートホールディングス	3,300	2,121.000	6,999,300
イーソル	7,500	649.000	4,867,500
ウイングアーク1 s t	9,500	3,580.000	34,010,000
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディン グス	2,900	940.000	2,726,000
サーバーワークス	2,100	2,454.000	5,153,400
S a n s a n	27,000	2,459.000	66,393,000
ギフトィ	8,300	1,393.000	11,561,900
メドレー	10,900	3,035.000	33,081,500

ベース	4,400	3,220.000	14,168,000
J M D C	11,800	3,285.000	38,763,000
フォーカスシステムズ	6,000	1,095.000	6,570,000
クレスコ	15,000	1,132.000	16,980,000
フジ・メディア・ホールディングス	89,700	2,850.000	255,645,000
オービック	170,500	4,508.000	768,614,000
ジャストシステム	14,900	3,420.000	50,958,000
T D C ソフト	16,800	1,370.000	23,016,000
L I N E ヤフー	1,473,600	489.600	721,474,560
トレンドマイクロ	48,300	11,680.000	564,144,000
I D ホールディングス	5,900	1,865.000	11,003,500
日本オラクル	17,700	14,420.000	255,234,000
アルファシステムズ	2,600	3,365.000	8,749,000
フューチャー	25,800	1,858.000	47,936,400
C A C H O L D I N G S	5,300	2,027.000	10,743,100
オービックビジネスコンサルタント	15,600	7,379.000	115,112,400
アイティフォー	10,900	1,309.000	14,268,100
東計電算	2,800	4,365.000	12,222,000
大塚商会	104,600	3,578.000	374,258,800
サイボウズ	12,800	3,145.000	40,256,000
電通総研	9,800	6,190.000	60,662,000
A C C E S S	10,400	1,082.000	11,252,800
デジタルガレージ	16,300	4,425.000	72,127,500
イーエムシステムズ	20,600	792.000	16,315,200
ウェザーニューズ	7,300	3,510.000	25,623,000
C I J	23,700	488.000	11,565,600
ビジネスエンジニアリング	2,000	4,050.000	8,100,000
WOWOW	7,000	1,006.000	7,042,000
A N Y C O L O R	12,700	3,320.000	42,164,000
I M A G I C A G R O U P	9,900	516.000	5,108,400
アルゴグラフィックス	9,300	5,450.000	50,685,000
マーベラス	16,200	532.000	8,618,400
エイベックス	23,200	1,320.000	30,624,000
B I P R O G Y	31,200	4,341.000	135,439,200
都築電気	5,400	2,438.000	13,165,200
T B S ホールディングス	45,700	4,452.000	203,456,400
日本テレビホールディングス	81,900	2,964.000	242,751,600
朝日放送グループホールディングス	9,600	687.000	6,595,200
テレビ朝日ホールディングス	22,200	2,678.000	59,451,600
スカパーＪＳＡＴホールディングス	71,300	1,130.000	80,569,000
テレビ東京ホールディングス	6,000	3,645.000	21,870,000
ビジョン	14,300	1,133.000	16,201,900
U - N E X T H O L D I N G S	31,100	1,845.000	57,379,500
日本通信	91,400	157.000	14,349,800
日本電信電話	27,263,400	149.000	4,062,246,600
K D D I	674,200	4,982.000	3,358,864,400
ソフトバンク	14,677,400	211.200	3,099,866,880
光通信	10,700	37,750.000	403,925,000

エムティーアイ	7,400	934.000	6,911,600
GMOインターネットグループ	31,000	2,995.000	92,845,000
ファイバーゲート	5,000	1,010.000	5,050,000
KADOKAWA	49,100	3,661.000	179,755,100
学研ホールディングス	16,000	995.000	15,920,000
ゼンリン	14,500	982.000	14,239,000
アイネット	5,600	1,957.000	10,959,200
松竹	5,900	11,610.000	68,499,000
東宝	57,800	7,225.000	417,605,000
東映	15,500	5,310.000	82,305,000
NTTデータグループ	240,200	3,094.000	743,178,800
ピー・シー・エー	6,100	1,928.000	11,760,800
ビジネスブレイン太田昭和	4,300	2,531.000	10,883,300
DTS	17,700	4,410.000	78,057,000
スクウェア・エニックス・ホールディングス	46,200	6,984.000	322,660,800
シーイーシー	11,700	1,881.000	22,007,700
カプコン	182,000	3,892.000	708,344,000
アイ・エス・ピー	4,600	1,313.000	6,039,800
SCSK	75,400	3,590.000	270,686,000
NSW	4,400	2,982.000	13,120,800
アイネス	6,700	1,810.000	12,127,000
TKC	18,400	3,820.000	70,288,000
富士ソフト	24,100	9,815.000	236,541,500
NSD	35,700	3,555.000	126,913,500
コナミグループ	34,400	19,000.000	653,600,000
福井コンピュータホールディングス	6,000	3,060.000	18,360,000
JBCCHホールディングス	6,000	4,935.000	29,610,000
ミロク情報サービス	7,900	1,852.000	14,630,800
ソフトバンクグループ	451,600	9,839.000	4,443,292,400
リョーサン菱洋ホールディングス	17,300	2,605.000	45,066,500
高千穂交易	3,500	4,085.000	14,297,500
伊藤忠食品	2,300	7,500.000	17,250,000
あらた	14,700	3,270.000	48,069,000
トーメンデバイス	1,400	6,140.000	8,596,000
東京エレクトロン デバイス	9,400	3,245.000	30,503,000
円谷フィールズホールディングス	16,800	1,643.000	27,602,400
双日	108,300	3,289.000	356,198,700
アルフレッサ ホールディングス	90,500	2,081.500	188,375,750
横浜冷凍	24,600	838.000	20,614,800
ラサ商事	5,000	1,512.000	7,560,000
アルコニックス	12,800	1,488.000	19,046,400
神戸物産	75,000	3,323.000	249,225,000
あい ホールディングス	16,100	2,043.000	32,892,300
ダイワボウホールディングス	42,400	2,729.500	115,730,800
マクニカホールディングス	74,800	1,823.000	136,360,400
ラクト・ジャパン	4,300	2,903.000	12,482,900
バイタルケーエスケー・ホールディングス	14,700	1,203.000	17,684,100
八洲電機	7,800	1,806.000	14,086,800

メディアスホールディングス	7,000	889.000	6,223,000
レスター	8,000	2,435.000	19,480,000
ＴＯＫＡＩホールディングス	47,800	936.000	44,740,800
三洋貿易	9,900	1,457.000	14,424,300
ビューティガレージ	3,300	1,375.000	4,537,500
ウイン・パートナーズ	5,200	1,312.000	6,822,400
シップヘルスケアホールディングス	38,000	2,059.000	78,242,000
明治電機工業	1,300	1,486.000	1,931,800
コメダホールディングス	25,200	2,722.000	68,594,400
アセンテック	3,900	1,142.000	4,453,800
フルサト・マルカホールディングス	8,300	2,323.000	19,280,900
ヤマエグループホールディングス	10,600	2,244.000	23,786,400
小野建	9,300	1,480.000	13,764,000
佐島電機	6,700	1,685.000	11,289,500
伯東	5,300	4,555.000	24,141,500
コンドーテック	7,000	1,355.000	9,485,000
ナガイレーベン	12,000	1,864.000	22,368,000
三菱食品	9,300	4,810.000	44,733,000
松田産業	7,000	3,245.000	22,715,000
第一興商	36,000	1,622.500	58,410,000
メディバルホールディングス	106,400	2,274.000	241,953,600
ＳＰＫ	4,200	2,122.000	8,912,400
萩原電気ホールディングス	4,300	3,430.000	14,749,000
アズワン	29,600	2,482.500	73,482,000
スズデン	3,800	1,953.000	7,421,400
シモジマ	6,600	1,318.000	8,698,800
ドウシシャ	8,800	2,060.000	18,128,000
高速	5,700	2,193.000	12,500,100
たけびし	3,400	1,910.000	6,494,000
リックス	2,500	2,920.000	7,300,000
丸文	8,300	1,044.000	8,665,200
ハビネット	8,500	5,030.000	42,755,000
日本ライフライン	25,900	1,604.000	41,543,600
タカショー	11,900	402.000	4,783,800
ＩＤＯＭ	36,500	1,153.000	42,084,500
進和	5,800	2,856.000	16,564,800
ダイトロン	3,600	3,315.000	11,934,000
シークス	13,300	1,062.000	14,124,600
オーハシテクニカ	4,700	1,980.000	9,306,000
白銅	2,600	2,306.000	5,995,600
伊藤忠商事	648,600	6,373.000	4,133,527,800
丸紅	791,800	2,304.000	1,824,307,200
長瀬産業	42,500	2,759.000	117,257,500
蝶理	5,500	3,170.000	17,435,000
豊田通商	288,700	2,484.000	717,130,800
三共生興	14,800	642.000	9,501,600
兼松	39,200	2,480.000	97,216,000
三井物産	1,417,800	2,761.500	3,915,254,700

日本紙パルプ商事	46,000	597.000	27,462,000
カメイ	9,700	1,887.000	18,303,900
スターゼン	6,200	2,904.000	18,004,800
山善	39,200	1,281.000	50,215,200
椿本興業	6,000	2,177.000	13,062,000
住友商事	577,600	3,306.000	1,909,545,600
内田洋行	3,900	7,080.000	27,612,000
三菱商事	1,783,500	2,420.000	4,316,070,000
第一実業	9,200	2,463.000	22,659,600
キャノンマーケティングジャパン	19,000	5,140.000	97,660,000
西華産業	4,600	4,595.000	21,137,000
佐藤商事	6,200	1,496.000	9,275,200
東京産業	8,900	723.000	6,434,700
ユアサ商事	8,000	4,580.000	36,640,000
神鋼商事	2,300	6,010.000	13,823,000
阪和興業	16,100	4,985.000	80,258,500
正栄食品工業	6,100	3,840.000	23,424,000
カナデン	6,900	1,512.000	10,432,800
ＲＹＯＤＥＮ	7,100	2,452.000	17,409,200
岩谷産業	96,100	1,585.000	152,318,500
極東貿易	5,400	1,719.000	9,282,600
アステナホールディングス	18,300	444.000	8,125,200
三愛オブリ	22,200	1,786.000	39,649,200
稲畑産業	28,500	3,135.000	89,347,500
ＧＳＩクレオス	5,000	2,129.000	10,645,000
明和産業	13,000	720.000	9,360,000
ワキタ	16,100	1,739.000	27,997,900
東邦ホールディングス	26,400	4,202.000	110,932,800
サンゲツ	24,200	2,954.000	71,486,800
ミツウロコグループホールディングス	12,800	1,891.000	24,204,800
シナネンホールディングス	2,900	6,190.000	17,951,000
伊藤忠エネクス	23,800	1,625.000	38,675,000
サンリオ	78,700	7,180.000	565,066,000
サンワ テクノス	4,600	2,212.000	10,175,200
新光商事	13,700	1,001.000	13,713,700
トーヨー	4,400	2,715.000	11,946,000
三信電気	3,900	2,005.000	7,819,500
東陽テクニカ	9,100	1,434.000	13,049,400
モスフードサービス	13,300	3,560.000	47,348,000
加賀電子	19,100	2,803.000	53,537,300
ソーダニッカ	10,300	1,142.000	11,762,600
立花エレテック	6,400	2,633.000	16,851,200
フォーバル	2,200	1,393.000	3,064,600
ＰＡＬＴＡＣ	14,700	4,011.000	58,961,700
三谷産業	19,000	338.000	6,422,000
コーア商事ホールディングス	5,800	715.000	4,147,000
ＫＰＰグループホールディングス	24,800	698.000	17,310,400
ヤマタネ	4,500	3,790.000	17,055,000

泉州電業	6,500	5,090.000	33,085,000
トラスコ中山	20,000	2,046.000	40,920,000
オートバックスセブン	32,000	1,474.000	47,168,000
モリト	7,200	1,515.000	10,908,000
加藤産業	11,900	4,410.000	52,479,000
イエローハット	16,100	2,911.000	46,867,100
ＪＫホールディングス	7,800	1,010.000	7,878,000
日伝	6,400	2,919.000	18,681,600
杉本商事	8,600	1,280.000	11,008,000
因幡電機産業	27,000	3,868.000	104,436,000
東テク	9,700	2,566.000	24,890,200
ミスミグループ本社	146,200	2,356.000	344,447,200
スズケン	32,000	4,989.000	159,648,000
ジェコス	6,100	1,053.000	6,423,300
インターメスティック	5,500	1,974.000	10,857,000
サンエー	15,800	2,997.000	47,352,600
カワチ薬品	7,800	2,650.000	20,670,000
エーピーシー・マート	41,600	3,020.000	125,632,000
ハードオフコーポレーション	4,100	1,930.000	7,913,000
アスクル	22,800	1,628.000	37,118,400
ゲオホールディングス	11,200	1,741.000	19,499,200
アダストリア	13,300	3,120.000	41,496,000
くら寿司	11,500	2,602.000	29,923,000
キャンドウ	4,200	3,355.000	14,091,000
パルグループホールディングス	22,300	3,255.000	72,586,500
エディオン	41,500	1,754.000	72,791,000
サーラコーポレーション	20,100	792.000	15,919,200
ハローズ	4,200	3,965.000	16,653,000
フジオフードグループ本社	12,800	1,140.000	14,592,000
あみやき亭	7,200	1,596.000	11,491,200
大黒天物産	3,500	7,230.000	25,305,000
ハニーズホールディングス	8,000	1,663.000	13,304,000
アルペン	9,000	2,255.000	20,295,000
クオールホールディングス	12,600	1,588.000	20,008,800
ジンズホールディングス	7,500	7,120.000	53,400,000
ビックカメラ	58,200	1,648.000	95,913,600
ＤＣＭホールディングス	56,200	1,393.000	78,286,600
ベッパーフードサービス	33,700	177.000	5,964,900
Monotaro	136,800	2,657.500	363,546,000
Ｊ．フロント リテイリング	111,100	2,042.500	226,921,750
ドトール・日レスホールディングス	20,600	2,355.000	48,513,000
マツキヨココカラ＆カンパニー	170,500	2,241.500	382,175,750
ブロンコビリー	5,400	3,555.000	19,197,000
ＺＯＺＯ	71,700	4,847.000	347,529,900
トレジャー・ファクトリー	6,800	1,515.000	10,302,000
物語コーポレーション	19,400	3,245.000	62,953,000
三越伊勢丹ホールディングス	144,500	2,380.000	343,910,000
Hamee	4,900	1,314.000	6,438,600

ウエルシアホールディングス	50,200	2,202.000	110,540,400
クリエイトＳＤホールディングス	13,500	2,832.000	38,232,000
シュッピン	10,000	1,032.000	10,320,000
オイシックス・ラ・大地	15,900	1,340.000	21,306,000
ネクステージ	22,600	1,489.000	33,651,400
ジョイフル本田	25,700	1,920.000	49,344,000
エターナルホスピタリティグループ	3,800	2,574.000	9,781,200
ホットランド	7,400	2,104.000	15,569,600
すかいらくホールディングス	132,300	2,526.000	334,189,800
ＳＦＰホールディングス	4,800	2,169.000	10,411,200
綿半ホールディングス	7,300	1,640.000	11,972,000
ヨシックスホールディングス	2,600	2,823.000	7,339,800
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	45,300	791.000	35,832,300
あさひ	7,500	1,467.000	11,002,500
日本調剤	7,000	1,403.000	9,821,000
コスモス薬品	19,200	6,837.000	131,270,400
セブン＆アイ・ホールディングス	1,066,200	2,400.000	2,558,880,000
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	73,500	1,289.000	94,741,500
ツルハホールディングス	16,700	9,171.000	153,155,700
サンマルクホールディングス	7,000	2,321.000	16,247,000
トリドールホールディングス	27,000	3,828.000	103,356,000
ＴＯＫＹＯ　ＢＡＳＥ	11,600	333.000	3,862,800
ＪＭホールディングス	6,900	2,382.000	16,435,800
アレンザホールディングス	6,500	1,104.000	7,176,000
串カツ田中ホールディングス	2,200	1,339.000	2,945,800
パロックジャパンリミテッド	9,500	777.000	7,381,500
クスリのアオキホールディングス	25,100	3,193.000	80,144,300
力の源ホールディングス	7,600	1,368.000	10,396,800
ＦＯＯＤ　＆　ＬＩＦＥ　ＣＯＭＰＡＮＩＥＳ	51,700	4,220.000	218,174,000
メディカルシステムネットワーク	12,000	416.000	4,992,000
ノジマ	31,700	2,339.000	74,146,300
カップ・クリエイト	15,600	1,462.000	22,807,200
良品計画	115,200	3,982.000	458,726,400
アドヴァングループ	6,400	940.000	6,016,000
アルビス	2,600	2,625.000	6,825,000
Ｇ－７ホールディングス	10,600	1,301.000	13,790,600
イオン北海道	31,800	864.000	27,475,200
コジマ	18,900	1,016.000	19,202,400
コーナン商事	11,700	3,605.000	42,178,500
エコス	3,600	2,000.000	7,200,000
ワタミ	11,100	993.000	11,022,300
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	195,100	4,247.000	828,589,700
西松屋チェーン	21,100	2,271.000	47,918,100
ゼンショーホールディングス	54,900	7,937.000	435,741,300

幸楽苑	9,200	1,071.000	9,853,200		
サイゼリヤ	14,300	4,500.000	64,350,000		
V Tホールディングス	37,700	493.000	18,586,100		
魚力	600	2,425.000	1,455,000		
フジ・コーポレーション	4,500	1,919.000	8,635,500		
ユナイテッドアローズ	10,500	2,258.000	23,709,000		
ハイデイ日高	15,300	2,733.000	41,814,900		
コロワイド	54,400	1,705.500	92,779,200		
壱番屋	37,700	962.000	36,267,400		
スギホールディングス	51,700	2,700.500	139,615,850		
薬王堂ホールディングス	4,800	1,875.000	9,000,000		
ダブルエー	1,900	1,237.000	2,350,300		
スクロール	13,200	1,076.000	14,203,200		
ヨンドシーホールディングス	8,100	1,853.000	15,009,300		
木曽路	13,600	2,166.000	29,457,600		
S R Sホールディングス	14,900	1,244.000	18,535,600		
リテールパートナーズ	14,400	1,243.000	17,899,200		
上新電機	8,800	2,263.000	19,914,400		
日本瓦斯	46,500	2,209.500	102,741,750		
ロイヤルホールディングス	16,800	2,396.000	40,252,800		
チヨダ	9,600	1,127.000	10,819,200		
ライフコーポレーション	12,600	3,665.000	46,179,000		
リンガーハット	12,100	2,261.000	27,358,100		
M r M a x H D	12,000	682.000	8,184,000		
A O K Iホールディングス	27,300	1,290.000	35,217,000		
オークワ	17,100	785.000	13,423,500		
コメリ	14,100	2,870.000	40,467,000		
青山商事	21,000	2,143.000	45,003,000		
しまむら	22,000	9,070.000	199,540,000		
高島屋	134,000	1,262.500	169,175,000		
松屋	16,500	1,053.000	17,374,500		
エイチ・ツー・オー リテイリング	46,900	2,332.000	109,370,800		
近鉄百貨店	5,400	2,165.000	11,691,000		
丸井グループ	64,400	2,611.500	168,180,600		
アクシアル リテイリング	24,600	963.000	23,689,800		
イオン	356,700	3,659.000	1,305,165,300		
イズミ	15,100	3,018.000	45,571,800		
平和堂	15,400	2,378.000	36,621,200		
フジ	18,100	2,051.000	37,123,100		
ヤオコー	11,300	9,273.000	104,784,900		
ゼビオホールディングス	13,700	1,255.000	17,193,500		
ケーズホールディングス	66,500	1,410.000	93,765,000		
シルバーライフ	1,100	792.000	871,200		
Genky Drug Stores	8,400	2,935.000	24,654,000		
ブックオフグループホールディングス	7,500	1,336.000	10,020,000		
ギフトホールディングス	4,900	3,890.000	19,061,000		
アインホールディングス	9,900	4,480.000	44,352,000		

GENKI GLOBAL DINING CONCEPTS	5,800	3,180.000	18,444,000
ヤマダホールディングス	298,100	439.500	131,014,950
アークランズ	27,800	1,639.000	45,564,200
ニトリホールディングス	34,900	16,285.000	568,346,500
グルメ杵屋	7,600	1,090.000	8,284,000
ケーユーホールディングス	3,200	1,110.000	3,552,000
吉野家ホールディングス	37,300	2,897.000	108,058,100
松屋フーズホールディングス	4,600	5,850.000	26,910,000
サガミホールディングス	13,800	1,788.000	24,674,400
王将フードサービス	20,100	3,050.000	61,305,000
ミニストップ	8,400	1,716.000	14,414,400
アークス	16,800	2,743.000	46,082,400
パローホールディングス	17,200	2,232.000	38,390,400
ベルク	4,800	6,590.000	31,632,000
大 庄	5,500	1,091.000	6,000,500
ファーストリテイリング	54,300	49,200.000	2,671,560,000
サンドラッグ	32,600	4,197.000	136,822,200
サックスパー ホールディングス	8,000	923.000	7,384,000
ベルーナ	24,500	918.000	22,491,000
いよぎんホールディングス	117,700	1,669.500	196,500,150
しずおかフィナンシャルグループ	199,600	1,532.500	305,887,000
ちゅうぎんフィナンシャルグループ	76,200	1,630.000	124,206,000
楽天銀行	42,100	5,934.000	249,821,400
京都フィナンシャルグループ	113,900	2,151.000	244,998,900
めぶきフィナンシャルグループ	453,500	646.100	293,006,350
東京きらぼしフィナンシャルグループ	11,200	5,250.000	58,800,000
九州フィナンシャルグループ	159,000	772.100	122,763,900
ゆうちょ銀行	742,500	1,578.000	1,171,665,000
富山第一銀行	27,500	1,034.000	28,435,000
コンコルディア・フィナンシャルグループ	480,900	920.000	442,428,000
西日本フィナンシャルホールディングス	55,200	2,096.000	115,699,200
三十三フィナンシャルグループ	7,500	2,378.000	17,835,000
第四北越フィナンシャルグループ	27,800	2,872.000	79,841,600
ひろぎんホールディングス	124,600	1,221.500	152,198,900
おきなわフィナンシャルグループ	6,900	2,615.000	18,043,500
十六フィナンシャルグループ	12,200	4,635.000	56,547,000
北國フィナンシャルホールディングス	8,900	5,340.000	47,526,000
プロクレアホールディングス	10,800	1,772.000	19,137,600
あいちフィナンシャルグループ	17,900	2,796.000	50,048,400
あおぞら銀行	61,500	2,250.000	138,375,000
三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	5,765,100	2,022.000	11,657,032,200
りそなホールディングス	1,112,600	1,234.000	1,372,948,400
三井住友トラストグループ	320,200	3,914.000	1,253,262,800
三井住友フィナンシャルグループ	1,875,200	3,909.000	7,330,156,800
千葉銀行	279,100	1,378.000	384,599,800
群馬銀行	156,300	1,082.000	169,116,600
武蔵野銀行	13,600	3,310.000	45,016,000

千葉興業銀行	21,400	1,543.000	33,020,200		
筑波銀行	36,800	259.000	9,531,200		
七十七銀行	29,100	4,615.000	134,296,500		
秋田銀行	5,200	2,310.000	12,012,000		
山形銀行	9,700	1,432.000	13,890,400		
岩手銀行	5,800	3,230.000	18,734,000		
東邦銀行	75,700	319.000	24,148,300		
ふくおかフィナンシャルグループ	78,600	4,075.000	320,295,000		
スルガ銀行	61,600	1,312.000	80,819,200		
八十二銀行	210,000	1,005.000	211,050,000		
山梨中央銀行	10,000	2,251.000	22,510,000		
大垣共立銀行	16,500	2,258.000	37,257,000		
福井銀行	7,500	1,905.000	14,287,500		
清水銀行	3,600	1,546.000	5,565,600		
滋賀銀行	14,000	4,800.000	67,200,000		
南都銀行	12,900	3,630.000	46,827,000		
百五銀行	81,900	713.000	58,394,700		
紀陽銀行	31,900	2,255.000	71,934,500		
ほくほくフィナンシャルグループ	51,100	2,216.500	113,263,150		
山陰合同銀行	55,800	1,280.000	71,424,000		
百十四銀行	8,500	3,450.000	29,325,000		
四国銀行	13,300	1,206.000	16,039,800		
阿波銀行	12,100	2,810.000	34,001,000		
大分銀行	5,200	3,465.000	18,018,000		
宮崎銀行	5,200	3,415.000	17,758,000		
佐賀銀行	5,100	2,295.000	11,704,500		
琉球銀行	19,200	1,190.000	22,848,000		
セブン銀行	327,500	305.700	100,116,750		
みずほフィナンシャルグループ	1,213,400	4,420.000	5,363,228,000		
山口フィナンシャルグループ	88,200	1,700.000	149,940,000		
名古屋銀行	5,500	7,720.000	42,460,000		
北洋銀行	126,400	499.000	63,073,600		
愛媛銀行	12,000	1,119.000	13,428,000		
京葉銀行	38,500	834.000	32,109,000		
栃木銀行	42,100	309.000	13,008,900		
北日本銀行	2,800	3,515.000	9,842,000		
東和銀行	15,200	662.000	10,062,400		
トモニホールディングス	82,600	519.000	42,869,400		
フィデアホールディングス	8,500	1,566.000	13,311,000		
池田泉州ホールディングス	122,200	420.000	51,324,000		
F P G	32,000	2,518.000	80,576,000		
ジャパンインベストメントアドバイザー	15,200	1,802.000	27,390,400		
S B Iホールディングス	144,600	4,479.000	647,663,400		
ジャフコ グループ	26,600	2,265.500	60,262,300		
大和証券グループ本社	642,600	1,065.500	684,690,300		
野村ホールディングス	1,511,800	1,021.500	1,544,303,700		
岡三証券グループ	72,800	625.000	45,500,000		
丸三証券	29,100	1,000.000	29,100,000		

東洋証券	27,400	592.000	16,220,800
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	102,200	508.000	51,917,600
水戸証券	25,200	559.000	14,086,800
いちよし証券	17,500	794.000	13,895,000
松井証券	62,000	806.000	49,972,000
マネックスグループ	88,600	850.000	75,310,000
極東証券	11,200	1,639.000	18,356,800
岩井コスモホールディングス	9,800	2,612.000	25,597,600
アイザワ証券グループ	13,600	1,788.000	24,316,800
スパークス・グループ	9,200	1,560.000	14,352,000
かんぽ生命保険	105,800	2,917.000	308,618,600
F P パートナー	4,000	2,276.000	9,104,000
S O M P Oホールディングス	439,400	4,419.000	1,941,708,600
アニコム ホールディングス	30,300	559.000	16,937,700
M S & A D インシュアランスグループホールディングス	658,300	3,195.000	2,103,268,500
第一生命ホールディングス	422,900	4,617.000	1,952,529,300
東京海上ホールディングス	877,100	5,183.000	4,546,009,300
T & Dホールディングス	242,000	3,170.000	767,140,000
全国保証	23,400	5,460.000	127,764,000
ジェイリース	7,100	1,335.000	9,478,500
S B I アルヒ	11,000	847.000	9,317,000
プレミアグループ	15,300	2,290.000	35,037,000
ネットプロテクションズホールディングス	31,000	491.000	15,221,000
クレディセゾン	57,200	3,703.000	211,811,600
芙蓉総合リース	8,100	11,345.000	91,894,500
みずほリース	66,300	1,037.000	68,753,100
東京センチュリー	67,300	1,482.500	99,772,250
日本証券金融	33,300	1,814.000	60,406,200
アイフル	149,100	353.000	52,632,300
リコーリース	8,300	5,270.000	43,741,000
イオンフィナンシャルサービス	51,500	1,272.000	65,508,000
アコム	214,400	397.800	85,288,320
ジャックス	10,800	3,930.000	42,444,000
オリエントコーポレーション	28,300	814.000	23,036,200
オリックス	539,100	3,072.000	1,656,115,200
三菱ＨＣキャピタル	452,100	1,008.000	455,716,800
日本取引所グループ	536,100	1,607.000	861,512,700
イー・ギャランティ	15,100	1,740.000	26,274,000
N E C キャピタルソリューション	3,500	3,915.000	13,702,500
R o b o t Home	32,000	177.000	5,664,000
大東建託	30,700	15,545.000	477,231,500
いちご	96,700	361.000	34,908,700
日本駐車場開発	112,200	204.000	22,888,800
スター・マイカ・ホールディングス	11,000	859.000	9,449,000
S R Eホールディングス	4,000	3,455.000	13,820,000
ヒューリック	210,300	1,375.500	289,267,650
野村不動産ホールディングス	56,400	4,144.000	233,721,600

三重交通グループホールディングス	20,600	519.000	10,691,400
ディア・ライフ	14,200	1,073.000	15,236,600
地主	8,300	2,167.000	17,986,100
J P M C	5,400	1,121.000	6,053,400
フージャースホールディングス	12,200	1,092.000	13,322,400
オープンハウスグループ	33,000	5,342.000	176,286,000
東急不動産ホールディングス	269,400	998.200	268,915,080
飯田グループホールディングス	86,400	2,290.000	197,856,000
A n d D oホールディングス	6,200	1,205.000	7,471,000
ケイアイスター不動産	5,000	4,635.000	23,175,000
グッドコムアセット	8,900	856.000	7,618,400
ジェイ・エス・ピー	4,400	3,160.000	13,904,000
ロードスターキャピタル	5,900	2,548.000	15,033,200
霞ヶ関キャピタル	3,800	14,990.000	56,962,000
パーク２４	70,500	2,053.000	144,736,500
パラカ	3,200	1,850.000	5,920,000
宮越ホールディングス	4,600	1,276.000	5,869,600
三井不動産	1,234,400	1,322.000	1,631,876,800
三菱地所	512,900	2,201.000	1,128,892,900
平和不動産	14,700	4,765.000	70,045,500
東京建物	78,800	2,435.500	191,917,400
京阪神ビルディング	19,700	1,495.000	29,451,500
住友不動産	146,200	5,101.000	745,766,200
テーオーシー	18,100	653.000	11,819,300
レオパレス２１	81,100	600.000	48,660,000
スターツコーポレーション	14,400	4,145.000	59,688,000
フジ住宅	10,800	736.000	7,948,800
空港施設	12,000	593.000	7,116,000
明和地所	7,200	1,068.000	7,689,600
ゴールドクレスト	8,200	3,055.000	25,051,000
エスリード	4,000	4,505.000	18,020,000
日神グループホールディングス	15,200	544.000	8,268,800
日本エスコン	23,100	1,043.000	24,093,300
M I R A R T Hホールディングス	52,600	509.000	26,773,400
イオンモール	54,900	1,932.000	106,066,800
カチタス	24,300	2,162.000	52,536,600
トーセイ	14,800	2,447.000	36,215,600
サンフロンティア不動産	14,200	1,982.000	28,144,400
F Jネクストホールディングス	8,800	1,192.000	10,489,600
グランディハウス	5,900	590.000	3,481,000
日本空港ビルデング	32,000	4,705.000	150,560,000
L I F U L L	36,500	175.000	6,387,500
M I X I	19,400	3,695.000	71,683,000
ジェイエイシーリクルートメント	32,000	809.000	25,888,000
日本M & Aセンターホールディングス	137,800	612.500	84,402,500
メンバーズ	4,400	1,254.000	5,517,600
U Tグループ	12,300	2,387.000	29,360,100
アイティメディア	4,600	1,687.000	7,760,200

ケアネット	18,100	740.000	13,394,000		
Ｅ・Ｊホールディングス	5,400	1,611.000	8,699,400		
オープンアップグループ	31,300	1,886.000	59,031,800		
コシダカホールディングス	29,100	1,074.000	31,253,400		
パソナグループ	11,700	2,023.000	23,669,100		
リンクアンドモチベーション	26,700	572.000	15,272,400		
エス・エム・エス	35,500	1,260.000	44,730,000		
パーソルホールディングス	856,300	226.900	194,294,470		
クックパッド	23,200	144.000	3,340,800		
学情	4,700	2,080.000	9,776,000		
スタジオアリス	4,800	2,114.000	10,147,200		
ＮＪＳ	2,200	4,150.000	9,130,000		
総合警備保障	155,000	1,046.000	162,130,000		
カカクコム	67,700	2,332.500	157,910,250		
セントケア・ホールディング	7,500	751.000	5,632,500		
ルネサンス	7,900	1,053.000	8,318,700		
ディップ	16,400	2,242.000	36,768,800		
デジタルホールディングス	6,000	1,468.000	8,808,000		
新日本科学	10,100	1,620.000	16,362,000		
エムスリー	186,800	1,822.000	340,349,600		
ワールドホールディングス	4,200	2,094.000	8,794,800		
ディー・エヌ・エー	38,500	3,558.000	136,983,000		
博報堂ＤＹホールディングス	106,900	1,061.000	113,420,900		
タカミヤ	13,200	411.000	5,425,200		
ファンコミュニケーションズ	15,000	406.000	6,090,000		
ライク	4,800	1,421.000	6,820,800		
エスプール	31,200	307.000	9,578,400		
ＷＤＢホールディングス	4,500	1,802.000	8,109,000		
アドウェイズ	14,300	286.000	4,089,800		
バリューコマース	8,700	807.000	7,020,900		
インフォマート	94,600	390.000	36,894,000		
ＪＰホールディングス	26,200	543.000	14,226,600		
ＣＬホールディングス	1,600	763.000	1,220,800		
プレステージ・インターナショナル	43,300	725.000	31,392,500		
プロトコーポレーション	9,900	2,130.000	21,087,000		
アミューズ	6,800	1,568.000	10,662,400		
ドリームインキュベータ	3,100	3,990.000	12,369,000		
クイック	6,900	1,940.000	13,386,000		
電通グループ	100,600	3,091.000	310,954,600		
テイクアンドギヴ・ニーズ	4,500	967.000	4,351,500		
ぴあ	3,600	3,165.000	11,394,000		
イオンファンタジー	4,500	2,994.000	13,473,000		
シーティーエス	15,100	821.000	12,397,100		
Ｈ．Ｕ．グループホールディングス	26,800	2,616.000	70,108,800		
アルプス技研	8,200	2,565.000	21,033,000		
日本空調サービス	10,200	995.000	10,149,000		
オリエンタルランド	551,500	3,174.000	1,750,461,000		
ダスキン	21,500	3,760.000	80,840,000		

明光ネットワークジャパン	13,800	746.000	10,294,800
ファルコホールディングス	4,900	2,371.000	11,617,900
ラウンドワン	89,500	1,286.000	115,097,000
リゾートトラスト	38,100	3,128.000	119,176,800
ビー・エム・エル	11,500	2,926.000	33,649,000
リソー教育	61,800	278.000	17,180,400
早稲田アカデミー	5,500	2,014.000	11,077,000
ユー・エス・エス	192,900	1,393.000	268,709,700
東京個別指導学院	19,000	350.000	6,650,000
サイバーエージェント	208,100	1,156.500	240,667,650
楽天グループ	664,900	943.700	627,466,130
クリーク・アンド・リバー社	5,100	1,750.000	8,925,000
ＳＢＩグローバルアセットマネジメント	18,000	704.000	12,672,000
テー・オー・ダブリュー	23,800	323.000	7,687,400
山田コンサルティンググループ	4,500	1,782.000	8,019,000
セントラルスポーツ	3,700	2,421.000	8,957,700
フルキャストホールディングス	8,800	1,610.000	14,168,000
エン・ジャパン	15,200	1,695.000	25,764,000
テクノプロ・ホールディングス	56,900	3,112.000	177,072,800
アイ・アールジャパンホールディングス	5,400	774.000	4,179,600
K e e P e r 技研	5,700	4,010.000	22,857,000
G u n o s y	9,200	618.000	5,685,600
イー・ガーディアン	4,500	1,993.000	8,968,500
ジャパンマテリアル	28,300	1,559.000	44,119,700
ベクトル	12,700	1,005.000	12,763,500
チャーム・ケア・コーポレーション	8,000	1,332.000	10,656,000
キャリアリンク	3,600	2,333.000	8,398,800
I B J	8,600	670.000	5,762,000
アサンテ	5,200	1,656.000	8,611,200
バリュース・HR	8,700	1,481.000	12,884,700
M & A キャピタルパートナーズ	7,700	3,035.000	23,369,500
ライドオンエクスプレスホールディングス	6,200	1,049.000	6,503,800
シグマックス・ホールディングス	27,500	1,007.000	27,692,500
ウィルグループ	7,000	1,000.000	7,000,000
メドピア	9,400	530.000	4,982,000
リクルートホールディングス	731,700	10,125.000	7,408,462,500
エラン	12,000	801.000	9,612,000
日本郵政	1,052,300	1,612.500	1,696,833,750
ベルシステム 2 4 ホールディングス	11,300	1,266.000	14,305,800
鎌倉新書	9,900	498.000	4,930,200
エアトリ	7,300	1,170.000	8,541,000
アトラエ	7,800	811.000	6,325,800
ストライク	4,500	3,305.000	14,872,500
ソラスト	26,200	482.000	12,628,400
セラク	2,800	1,785.000	4,998,000
インソース	20,100	1,010.000	20,301,000
ペイカレント	69,200	7,023.000	485,991,600
O r c h e s t r a H o l d i n g s	2,500	746.000	1,865,000

アイモバイル	14,100	486.000	6,852,600
MS - J a p a n	4,000	1,029.000	4,116,000
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	36,800	3,000.000	110,400,000
エル・ティー・エス	1,400	2,165.000	3,031,000
ミダックホールディングス	6,000	1,867.000	11,202,000
キュービーネットホールディングス	5,900	1,021.000	6,023,900
オープングループ	16,600	287.000	4,764,200
マネジメントソリューションズ	4,700	2,014.000	9,465,800
プロレド・パートナーズ	4,400	437.000	1,922,800
フロンティア・マネジメント	3,600	666.000	2,397,600
アンビスホールディングス	20,900	684.000	14,295,600
カーブスホールディングス	25,700	697.000	17,912,900
フォーラムエンジニアリング	13,000	1,055.000	13,715,000
FAST FITNESS JAPAN	3,800	1,424.000	5,411,200
Mac bee Planet	2,600	3,385.000	8,801,000
ダイレクトマーケティングミックス	13,800	283.000	3,905,400
ポピンズ	1,600	1,180.000	1,888,000
LITALICO	8,700	1,162.000	10,109,400
リログループ	52,100	1,904.000	99,198,400
東祥	7,200	693.000	4,989,600
ビーウィズ	2,500	1,419.000	3,547,500
TREホールディングス	21,900	1,559.000	34,142,100
人・夢・技術グループ	3,700	1,570.000	5,809,000
NISSOホールディングス	9,000	793.000	7,137,000
大栄環境	20,700	2,802.000	58,001,400
GENOVA	3,200	1,067.000	3,414,400
日本管財ホールディングス	9,300	2,600.000	24,180,000
M&A総研ホールディングス	10,000	1,665.000	16,650,000
エイチ・アイ・エス	30,800	1,469.000	45,245,200
共立メンテナンス	29,400	3,040.000	89,376,000
イチネンホールディングス	9,100	1,749.000	15,915,900
建設技術研究所	9,200	2,429.000	22,346,800
スペース	7,100	1,086.000	7,710,600
燦ホールディングス	8,500	1,269.000	10,786,500
スバル興業	3,300	3,405.000	11,236,500
タナベコンサルティンググループ	1,000	1,298.000	1,298,000
ナガワ	2,700	6,670.000	18,009,000
東京都競馬	7,600	4,720.000	35,872,000
カナモト	14,500	3,070.000	44,515,000
ニシオホールディングス	8,300	4,195.000	34,818,500
トランス・コスモス	11,800	3,155.000	37,229,000
乃村工藝社	41,100	898.000	36,907,800
藤田観光	4,200	9,670.000	40,614,000
トーカイ	8,100	2,115.000	17,131,500
セコム	190,700	5,166.000	985,156,200
セントラル警備保障	5,000	2,876.000	14,380,000
丹青社	19,900	904.000	17,989,600

メイテックグループホールディングス	35,200	2,980.000	104,896,000	
応用地質	8,700	2,990.000	26,013,000	
船井総研ホールディングス	18,500	2,400.000	44,400,000	
学究社	4,200	2,047.000	8,597,400	
イオンディライト	10,100	4,510.000	45,551,000	
ナック	2,500	662.000	1,655,000	
ダイセキ	22,700	3,795.000	86,146,500	
ステップ	3,200	2,177.000	6,966,400	
合 計	171,563,200		361,477,157,590	

(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。

国内債券パッシブ・マザーファンド

(１) 貸借対照表

(単位：円)

(2025年2月18日現在)

資産の部

流動資産

金銭信託	3,490,832
コール・ローン	422,448,902
国債証券	99,230,505,620
地方債証券	11,147,018,450
特殊債券	10,088,506,527
社債券	7,776,906,600
未収入金	422,444,000
未収利息	357,626,633
前払費用	12,666,856

流動資産合計	129,461,614,420
--------	-----------------

資産合計	129,461,614,420
------	-----------------

負債の部

流動負債

未払金	68,013,000
未払解約金	375,870,000

流動負債合計	443,883,000
--------	-------------

負債合計	443,883,000
------	-------------

純資産の部

元本等

元本	110,855,589,021
----	-----------------

剰余金

剰余金又は欠損金 ()	18,162,142,399
--------------	----------------

元本等合計	129,017,731,420
-------	-----------------

純資産合計	129,017,731,420
-------	-----------------

負債純資産合計	129,461,614,420
---------	-----------------

（２）注記表

（重要な会計方針の注記）

項 目	自 2024年2月20日 至 2025年2月18日
１． 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券は個別法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。 (1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。 (2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。 (3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。

（重要な会計上の見積りに関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

項 目	（ 2025年2月18日現在 ）
１． 当計算期間の末日における 受益権の総数	110,855,589,021口
２． １単位当たり純資産の額	１口当たり純資産額 1.1638円 （ １万口当たりの純資産額11,638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 2024年2月20日 至 2025年2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、地方債証券、特殊債券、社債券を組み入れております。 2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。

	3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 (2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する会議をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。 また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、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。 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。

・金融商品の時価等に関する事項

項 目	(2025年2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、地方債証券、特殊債券、社債券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

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

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

自 2024年2月20日 至 2025年2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）

（2025年2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	108,788,622,566円
同期中における追加設定元本額	25,297,794,732円
同期中における一部解約元本額	23,230,828,277円
2025年2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）	11,075,505,070円
三井住友・ＤＣ年金バランス５０（標準型）	18,043,486,456円
三井住友・ＤＣ年金バランス７０（株式重点型）	4,773,958,081円
ＳＭＡＭ・グローバルバランスファンド（機動的資産配分型）	849,445,352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）	44,410,680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）	171,641,520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）	533,451,675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）	1,257,838,379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）	740,925,722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）	896,613,565円
三井住友・ＤＣ年金バランスゼロ（債券型）	122,939,548円
アセットアロケーション・ファンド（安定型）	825,351,749円
アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）	304,334,022円
アセットアロケーション・ファンド（成長型）	13,944,788円
三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０５０	280,782,082円
三井住友・資産最適化ファンド（１安定重視型）	4,163,367,866円
三井住友・資産最適化ファンド（２やや安定型）	1,286,856,935円
三井住友・資産最適化ファンド（３バランス型）	2,696,083,563円
三井住友・資産最適化ファンド（４やや成長型）	669,597,079円
三井住友・資産最適化ファンド（５成長重視型）	111,471,807円
三井住友・ＤＣつみたてＮＩＳＡ・世界分散ファンド	488,873,453円
三井住友ＤＳ・年金バランス３０（債券重点型）	508,576,034円
三井住友ＤＳ・年金バランス５０（標準型）	1,143,115,051円
三井住友ＤＳ・年金バランス７０（株式重点型）	396,507,993円
三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０６０	51,589,300円

三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０３５	738,228,631円
三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０４０	360,635,020円
三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０４５	209,589,331円
三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０５５	53,845,466円
三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０６５	42,353,384円
三井住友ＤＳ・ＦＷ専用ポートフォリオ・レベル１（保守型）	20,810,566円
三井住友ＤＳ・ＦＷ専用ポートフォリオ・レベル２（安定型）	152,034,504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）	488,308,922円
三井住友ＤＳ・ＦＷ専用ポートフォリオ・レベル４（成長型）	231,462,645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）	26,360,752円
三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０７０	584,592円
ＳＭＡＭ・年金グローバル債券ファンド＜適格機関投資家限定＞	952,873,379円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ２５＜適格機関投資家専用＞	6,292,523,873円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ３７．５＜適格機関投資家専用＞	5,830,638,516円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ５０＜適格機関投資家専用＞	15,491,755,616円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＬ３０＜適格機関投資家限定＞	287,320,892円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＬ５０＜適格機関投資家限定＞	496,234,409円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ７５＜適格機関投資家専用＞	313,711,942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＞	120,435,474円
ＳＭＡＭ・インデックス・バランスＶＡ２５＜適格機関投資家専用＞	1,725,793,883円
ＳＭＡＭ・インデックス・バランスＶＡ５０＜適格機関投資家専用＞	2,224,853,898円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ４０＜適格機関投資家専用＞	2,063,685,265円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ３５＜適格機関投資家専用＞	7,070,200,296円
三井住友・国内債券インデックスファンド・ＶＡＳ（適格機関投資家専用）	877,534,268円
ＳＭＡＭ・グローバルバランス４０ＶＡ＜適格機関投資家限定＞	356,302,221円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２０Ａ＜適格機関投資家専用＞	375,930,083円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ３５Ａ＜適格機関投資家専用＞	133,126,312円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ５０Ａ＜適格機関投資家専用＞	54,869,828円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２０Ｌ＜適格機関投資家専用＞	985,543,683円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２５Ｌ＜適格機関投資家専用＞	1,857,880,774円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２０Ａ２＜適格機関投資家専用＞	501,251,919円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ３５Ａ２＜適格機関投資家専用＞	214,912,227円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ５０Ａ２＜適格機関投資家専用＞	24,802,811円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ３０Ｌ２＜適格機関投資家専用＞	231,306,617円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２５Ｌ２＜適格機関投資家専用＞	4,336,743,738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＞	1,222,936,341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＞	589,524,455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＞	910,650,124円
ＳＭＡＭ・マルチアセット・ダイナミックアロケーション・ストラテジー・ファンド ＜適格機関投資家限定＞	1,011,112,804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＞	526,251,790円
合 計	110,855,589,021円

(3) 附属明細表

有価証券明細表

(a) 株式

該当事項はありません。

(b) 株式以外の有価証券

(単位：円)

種 類	銘 柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	4 6 5 2 年国債	1,600,000,000	1,590,304,000	
	4 6 6 2 年国債	190,000,000	189,074,700	
	4 6 7 2 年国債	300,000,000	298,944,000	
	4 6 8 2 年国債	1,040,000,000	1,035,985,600	
	1 4 9 5 年国債	1,090,000,000	1,077,116,200	
	1 5 0 5 年国債	2,390,000,000	2,356,516,100	
	1 5 1 5 年国債	100,000,000	98,363,000	
	1 5 2 5 年国債	730,000,000	719,473,400	
	1 5 3 5 年国債	800,000,000	784,904,000	
	1 5 4 5 年国債	1,220,000,000	1,196,856,600	
	1 5 6 5 年国債	1,290,000,000	1,266,096,300	
	1 5 7 5 年国債	370,000,000	362,237,400	
	1 5 8 5 年国債	880,000,000	858,897,600	
	1 5 9 5 年国債	200,000,000	194,634,000	
	1 6 0 5 年国債	690,000,000	673,722,900	
	1 6 1 5 年国債	670,000,000	656,358,800	
	1 6 2 5 年国債	380,000,000	371,309,400	
	1 6 3 5 年国債	570,000,000	558,936,300	
	1 6 4 5 年国債	240,000,000	232,953,600	
	1 6 5 5 年国債	620,000,000	604,090,800	
	1 6 6 5 年国債	440,000,000	430,333,200	
	1 6 7 5 年国債	140,000,000	136,599,400	
	1 6 8 5 年国債	690,000,000	678,780,600	
	1 6 9 5 年国債	410,000,000	401,648,300	
	1 7 0 5 年国債	610,000,000	598,745,500	
	1 7 1 5 年国債	290,000,000	282,190,300	
	1 7 3 5 年国債	270,000,000	264,454,200	
	1 7 4 5 年国債	910,000,000	895,285,300	
	1 7 5 5 年国債	80,000,000	79,338,400	
	1 4 0 年国債	40,000,000	41,606,400	
	2 4 0 年国債	242,000,000	242,000,000	
	3 4 0 年国債	185,000,000	184,106,450	
	4 4 0 年国債	247,000,000	243,766,770	
	5 4 0 年国債	235,000,000	221,388,800	
	6 4 0 年国債	240,000,000	219,868,800	
	7 4 0 年国債	265,000,000	230,271,750	
	8 4 0 年国債	310,000,000	247,628,000	
	9 4 0 年国債	548,000,000	313,543,680	
	1 0 4 0 年国債	460,000,000	309,676,600	

1 1	4 0 年国債	400,000,000	256,660,000	
1 2	4 0 年国債	390,000,000	219,234,600	
1 3	4 0 年国債	545,000,000	300,311,350	
1 4	4 0 年国債	495,000,000	289,708,650	
1 5	4 0 年国債	560,000,000	360,550,400	
1 6	4 0 年国債	530,000,000	372,499,900	
1 7	4 0 年国債	460,000,000	419,855,800	
3 4 4	1 0 年国債	811,000,000	802,622,370	
3 4 5	1 0 年国債	258,000,000	254,829,180	
3 4 6	1 0 年国債	340,000,000	335,097,200	
3 4 7	1 0 年国債	100,000,000	98,330,000	
3 4 8	1 0 年国債	145,000,000	142,249,350	
3 4 9	1 0 年国債	650,000,000	636,161,500	
3 5 0	1 0 年国債	510,000,000	497,770,200	
3 5 1	1 0 年国債	50,000,000	48,658,500	
3 5 2	1 0 年国債	150,000,000	145,504,500	
3 5 3	1 0 年国債	180,000,000	174,018,600	
3 5 4	1 0 年国債	265,000,000	255,399,050	
3 5 5	1 0 年国債	160,000,000	153,670,400	
3 5 6	1 0 年国債	130,000,000	124,434,700	
3 5 7	1 0 年国債	910,000,000	868,431,200	
3 5 8	1 0 年国債	870,000,000	827,944,200	
3 5 9	1 0 年国債	900,000,000	854,028,000	
3 6 0	1 0 年国債	870,000,000	823,150,500	
3 6 1	1 0 年国債	1,070,000,000	1,009,405,900	
3 6 2	1 0 年国債	860,000,000	808,916,000	
3 6 3	1 0 年国債	980,000,000	918,720,600	
3 6 4	1 0 年国債	1,010,000,000	943,643,000	
3 6 5	1 0 年国債	1,020,000,000	949,436,400	
3 6 6	1 0 年国債	1,170,000,000	1,092,932,100	
3 6 7	1 0 年国債	1,120,000,000	1,042,059,200	
3 6 8	1 0 年国債	1,270,000,000	1,176,807,400	
3 6 9	1 0 年国債	940,000,000	888,431,600	
3 7 0	1 0 年国債	1,050,000,000	988,942,500	
3 7 1	1 0 年国債	1,080,000,000	1,005,415,200	
3 7 2	1 0 年国債	1,050,000,000	1,007,506,500	
3 7 3	1 0 年国債	1,090,000,000	1,024,665,400	
3 7 4	1 0 年国債	1,000,000,000	953,580,000	
3 7 5	1 0 年国債	1,250,000,000	1,220,550,000	
3 7 6	1 0 年国債	1,090,000,000	1,042,181,700	
3 7 7	1 0 年国債	500,000,000	490,085,000	
2	3 0 年国債	440,000,000	468,120,400	
4	3 0 年国債	340,000,000	374,010,200	
5	3 0 年国債	290,000,000	308,823,900	
7	3 0 年国債	474,000,000	510,460,080	

9	30年国債	240,000,000	242,913,600	
10	30年国債	95,000,000	93,850,500	
11	30年国債	430,000,000	444,263,100	
12	30年国債	570,000,000	607,084,200	
14	30年国債	392,000,000	427,189,840	
16	30年国債	205,000,000	225,290,900	
18	30年国債	190,000,000	205,285,500	
19	30年国債	170,000,000	183,642,500	
21	30年国債	345,000,000	372,451,650	
22	30年国債	315,000,000	346,405,500	
23	30年国債	349,000,000	383,913,960	
24	30年国債	340,000,000	373,921,800	
25	30年国債	260,000,000	280,196,800	
26	30年国債	253,000,000	275,299,420	
27	30年国債	250,000,000	274,572,500	
28	30年国債	96,000,000	105,344,640	
29	30年国債	127,000,000	137,645,140	
30	30年国債	142,000,000	151,850,540	
31	30年国債	235,000,000	247,861,550	
32	30年国債	360,000,000	383,392,800	
33	30年国債	208,000,000	212,544,800	
34	30年国債	87,000,000	90,998,520	
35	30年国債	260,000,000	263,775,200	
36	30年国債	90,000,000	90,925,200	
37	30年国債	225,000,000	223,087,500	
38	30年国債	220,000,000	214,156,800	
39	30年国債	220,000,000	217,192,800	
40	30年国債	260,000,000	251,929,600	
41	30年国債	240,000,000	228,429,600	
42	30年国債	280,000,000	265,829,200	
43	30年国債	295,000,000	279,350,250	
44	30年国債	310,000,000	292,993,400	
45	30年国債	315,000,000	286,728,750	
46	30年国債	315,000,000	285,881,400	
47	30年国債	370,000,000	340,966,100	
48	30年国債	300,000,000	265,806,000	
49	30年国債	395,000,000	348,860,050	
50	30年国債	395,000,000	307,606,250	
51	30年国債	385,000,000	265,680,800	
52	30年国債	243,000,000	174,989,160	
53	30年国債	297,000,000	217,914,840	
54	30年国債	235,000,000	179,697,450	
55	30年国債	285,000,000	216,964,800	
56	30年国債	160,000,000	121,264,000	
57	30年国債	395,000,000	298,039,350	

5 8	3 0 年国債	410,000,000	307,992,000	
5 9	3 0 年国債	390,000,000	284,661,000	
6 0	3 0 年国債	330,000,000	251,849,400	
6 1	3 0 年国債	290,000,000	209,846,900	
6 2	3 0 年国債	275,000,000	187,948,750	
6 3	3 0 年国債	270,000,000	178,677,900	
6 4	3 0 年国債	285,000,000	187,587,000	
6 5	3 0 年国債	265,000,000	173,490,200	
6 6	3 0 年国債	360,000,000	234,082,800	
6 7	3 0 年国債	350,000,000	239,431,500	
6 8	3 0 年国債	340,000,000	231,261,200	
6 9	3 0 年国債	335,000,000	233,213,600	
7 0	3 0 年国債	380,000,000	263,286,800	
7 1	3 0 年国債	360,000,000	248,234,400	
7 2	3 0 年国債	370,000,000	253,905,100	
7 3	3 0 年国債	380,000,000	259,722,400	
7 4	3 0 年国債	380,000,000	281,591,400	
7 5	3 0 年国債	350,000,000	279,534,500	
7 6	3 0 年国債	350,000,000	285,978,000	
7 7	3 0 年国債	360,000,000	308,084,400	
7 8	3 0 年国債	340,000,000	276,471,000	
7 9	3 0 年国債	390,000,000	300,432,600	
8 0	3 0 年国債	360,000,000	321,199,200	
8 1	3 0 年国債	340,000,000	288,728,000	
8 2	3 0 年国債	360,000,000	320,263,200	
8 3	3 0 年国債	380,000,000	369,781,800	
8 4	3 0 年国債	350,000,000	332,986,500	
8 5	3 0 年国債	60,000,000	59,578,200	
9 0	2 0 年国債	580,000,000	593,160,200	
9 2	2 0 年国債	324,000,000	331,785,720	
9 3	2 0 年国債	632,000,000	647,572,480	
9 5	2 0 年国債	305,000,000	315,360,850	
9 7	2 0 年国債	327,000,000	338,288,040	
9 9	2 0 年国債	153,000,000	158,289,210	
1 0 0	2 0 年国債	207,000,000	215,190,990	
1 0 1	2 0 年国債	355,000,000	371,230,600	
1 0 2	2 0 年国債	457,000,000	479,169,070	
1 0 5	2 0 年国債	370,000,000	384,944,300	
1 0 6	2 0 年国債	370,000,000	386,228,200	
1 0 7	2 0 年国債	378,000,000	393,857,100	
1 0 9	2 0 年国債	40,000,000	41,418,800	
1 1 1	2 0 年国債	386,000,000	404,975,760	
1 1 3	2 0 年国債	27,000,000	28,251,990	
1 1 4	2 0 年国債	163,000,000	170,832,150	
1 1 8	2 0 年国債	200,000,000	209,434,000	

1 1 9	2 0 年国債	295,000,000	305,858,950	
1 2 0	2 0 年国債	200,000,000	205,294,000	
1 2 1	2 0 年国債	55,000,000	57,389,750	
1 2 2	2 0 年国債	130,000,000	134,963,400	
1 2 3	2 0 年国債	70,000,000	73,917,200	
1 2 5	2 0 年国債	205,000,000	218,035,950	
1 2 6	2 0 年国債	180,000,000	189,338,400	
1 2 7	2 0 年国債	145,000,000	151,696,100	
1 2 8	2 0 年国債	65,000,000	68,057,600	
1 3 0	2 0 年国債	155,000,000	161,511,550	
1 3 1	2 0 年国債	80,000,000	82,844,800	
1 3 2	2 0 年国債	450,000,000	465,970,500	
1 3 3	2 0 年国債	190,000,000	198,010,400	
1 3 4	2 0 年国債	200,000,000	208,510,000	
1 3 5	2 0 年国債	155,000,000	160,527,300	
1 3 6	2 0 年国債	120,000,000	123,494,400	
1 3 7	2 0 年国債	185,000,000	191,554,550	
1 3 9	2 0 年国債	100,000,000	102,834,000	
1 4 0	2 0 年国債	420,000,000	434,595,000	
1 4 1	2 0 年国債	360,000,000	372,351,600	
1 4 2	2 0 年国債	240,000,000	250,041,600	
1 4 3	2 0 年国債	150,000,000	153,909,000	
1 4 4	2 0 年国債	170,000,000	173,117,800	
1 4 5	2 0 年国債	110,000,000	113,648,700	
1 4 6	2 0 年国債	195,000,000	201,333,600	
1 4 7	2 0 年国債	840,000,000	859,278,000	
1 4 8	2 0 年国債	459,000,000	464,944,050	
1 4 9	2 0 年国債	625,000,000	631,981,250	
1 5 0	2 0 年国債	691,000,000	691,580,440	
1 5 1	2 0 年国債	680,000,000	666,515,600	
1 5 2	2 0 年国債	640,000,000	625,651,200	
1 5 3	2 0 年国債	617,000,000	607,590,750	
1 5 4	2 0 年国債	600,000,000	583,554,000	
1 5 5	2 0 年国債	430,000,000	408,629,000	
1 5 6	2 0 年国債	400,000,000	354,656,000	
1 5 7	2 0 年国債	445,000,000	383,398,650	
1 5 8	2 0 年国債	430,000,000	382,093,700	
1 5 9	2 0 年国債	428,000,000	383,128,480	
1 6 0	2 0 年国債	505,000,000	455,530,200	
1 6 1	2 0 年国債	480,000,000	425,952,000	
1 6 2	2 0 年国債	240,000,000	211,972,800	
1 6 3	2 0 年国債	620,000,000	544,992,400	
1 6 4	2 0 年国債	535,000,000	461,854,800	
1 6 5	2 0 年国債	620,000,000	532,480,800	
1 6 6	2 0 年国債	545,000,000	478,777,050	

	1 6 7	2 0 年国債	530,000,000	450,447,000	
	1 6 8	2 0 年国債	580,000,000	483,360,400	
	1 6 9	2 0 年国債	570,000,000	465,171,300	
	1 7 0	2 0 年国債	555,000,000	450,504,600	
	1 7 1	2 0 年国債	525,000,000	423,627,750	
	1 7 2	2 0 年国債	600,000,000	489,342,000	
	1 7 3	2 0 年国債	515,000,000	417,577,450	
	1 7 4	2 0 年国債	660,000,000	532,006,200	
	1 7 5	2 0 年国債	615,000,000	501,354,150	
	1 7 6	2 0 年国債	600,000,000	486,648,000	
	1 7 7	2 0 年国債	740,000,000	586,657,200	
	1 7 8	2 0 年国債	630,000,000	505,392,300	
	1 7 9	2 0 年国債	680,000,000	542,327,200	
	1 8 0	2 0 年国債	540,000,000	451,753,200	
	1 8 1	2 0 年国債	590,000,000	500,030,900	
	1 8 2	2 0 年国債	520,000,000	454,095,200	
	1 8 3	2 0 年国債	590,000,000	539,914,900	
	1 8 4	2 0 年国債	570,000,000	494,657,400	
	1 8 5	2 0 年国債	450,000,000	389,146,500	
	1 8 6	2 0 年国債	480,000,000	442,982,400	
	1 8 7	2 0 年国債	480,000,000	427,022,400	
	1 8 8	2 0 年国債	430,000,000	401,529,700	
	1 8 9	2 0 年国債	460,000,000	450,133,000	
	1 9 0	2 0 年国債	410,000,000	394,022,300	
	1 9 1	2 0 年国債	20,000,000	19,817,000	
	国債証券 小計			99,230,505,620	
地方債証券	7 5 5	東京都公債	400,000,000	397,126,000	
	1	東京都 3 0 年	100,000,000	106,642,300	
	8	東京都 3 0 年	400,000,000	419,453,600	
	1 3	東京都 3 0 年	500,000,000	492,590,500	
	3 0 - 8	北海道公債	200,000,000	194,400,400	
	3 0 - 1 8	北海道公債	200,000,000	192,348,600	
	2 2 6	神奈川県公債	200,000,000	197,105,600	
	3	神奈川県 2 0 年	100,000,000	100,545,600	
	7	神奈川県 2 0 年	100,000,000	102,717,500	
	1 3	神奈川県 2 0 年	100,000,000	104,874,900	
	8 9	神奈川県 5 年	200,000,000	197,283,600	
	1	大阪府 2 0 年	200,000,000	209,148,600	
	1 7 3	大阪府 5 年	300,000,000	299,314,500	
	1 7 9	大阪府 5 年	100,000,000	99,348,000	
	1 9 3	大阪府 5 年	300,000,000	294,367,500	
	2 7 - 4	京都府公債	100,000,000	100,019,800	
	2 9 - 4	京都府公債	100,000,000	98,309,600	
	4	兵庫県公債 1 5 年	100,000,000	100,964,200	
	5	兵庫県公債 1 5 年	300,000,000	302,902,500	

	10 兵庫県公債 20 年	100,000,000	105,169,300	
	27 - 8 静岡県公債	100,000,000	99,960,400	
	7 静岡県 30 年	100,000,000	98,633,700	
	1 静岡県 20 年	100,000,000	100,945,800	
	22 - 8 愛知県 20 年	200,000,000	207,482,600	
	27 - 16 愛知県公債	400,000,000	399,322,400	
	27 - 7 埼玉県公債	300,000,000	299,522,100	
	2 埼玉県公債	300,000,000	284,512,500	
	5 埼玉県 20 年	100,000,000	104,106,800	
	1 - 1 福岡県公債	200,000,000	190,651,600	
	1 - 3 福岡県 30 年	100,000,000	65,045,400	
	27 - 3 千葉県公債	100,000,000	100,010,000	
	27 - 4 千葉県公債	100,000,000	100,039,900	
	28 - 1 千葉県公債	100,000,000	99,100,800	
	1 - 9 千葉県公債	200,000,000	188,895,800	
	9 千葉県 20 年	200,000,000	206,981,400	
	148 共同発行地方	350,000,000	350,070,350	
	155 共同発行地方	100,000,000	99,494,700	
	170 共同発行地方	400,000,000	393,446,800	
	172 共同発行地方	500,000,000	491,594,500	
	179 共同発行地方	100,000,000	97,787,000	
	183 共同発行地方	600,000,000	584,037,000	
	184 共同発行地方	300,000,000	291,349,200	
	199 共同発行地方	100,000,000	94,939,800	
	494 名古屋市債	200,000,000	199,701,600	
	33 名古屋市 5 年	300,000,000	293,157,600	
	3 名古屋市 20 年	100,000,000	100,515,900	
	5 名古屋市 20 年	100,000,000	102,244,200	
	1 京都市 30 年	100,000,000	109,218,300	
	7 京都市 20 年	100,000,000	104,640,600	
	6 - 1 神戸市 5 年	200,000,000	194,743,400	
	7 横浜市 20 年	100,000,000	101,166,300	
	9 横浜市 20 年	100,000,000	102,019,500	
	14 横浜市 20 年	100,000,000	104,017,200	
	27 - 5 札幌市公債	100,000,000	99,950,500	
	2 - 7 札幌市公債	100,000,000	93,847,200	
	94 川崎市公債	100,000,000	92,820,400	
	6 - 1 北九州市 5 年	100,000,000	97,474,400	
	2019 - 10 福岡市公	100,000,000	94,435,600	
	2020 - 9 福岡市 5 年	100,000,000	99,451,400	
	1 - 2 岡山県公債	100,000,000	95,051,200	
	地方債証券 小計		11,147,018,450	
特殊債券	47 日本政策投資ＣＯ	100,000,000	99,273,800	
	124 日本政策投資	100,000,000	94,723,800	
	36 日本政策投資Ｂ	100,000,000	102,845,700	

1 8	道路機構	100,000,000	108,838,900	
2 2	道路機構	300,000,000	315,885,000	
2 7	道路機構	100,000,000	103,563,000	
3 7	道路機構	300,000,000	313,472,400	
4 7	道路機構	200,000,000	210,174,600	
1 3 5	道路機構	200,000,000	198,077,800	
7 4	政保道路機構	100,000,000	103,174,800	
7 9	政保道路機構	200,000,000	208,097,200	
8 1	政保道路機構	200,000,000	208,224,200	
8 8	政保道路機構	100,000,000	105,575,600	
9 0	政保道路機構	500,000,000	521,472,000	
9 9	政保道路機構	100,000,000	105,021,500	
1 2 7	政保道路機構	200,000,000	209,095,400	
1 7 6	政保道路機構	100,000,000	102,427,100	
1 9 6	政保道路機構	100,000,000	103,219,500	
2 1 0	政保道路機構	200,000,000	202,071,600	
2 8 8	政保道路機構	189,000,000	186,493,671	
9	道路債券	100,000,000	110,621,900	
2	地方公営２０年	100,000,000	104,620,800	
4	地方公共団２０年	100,000,000	104,328,100	
1 8	地方公共団２０	300,000,000	309,151,800	
F 9 6	地方公共団体	100,000,000	101,269,800	
F 1 4 3	地方公共団体	100,000,000	100,994,900	
F 2 2 8	地方公共団体	200,000,000	199,977,400	
7 6	政保地方公共団	300,000,000	299,851,200	
8 5	地方公共団体	100,000,000	98,955,900	
1 0 1	地方公共団体	100,000,000	98,046,800	
1 0 6	地方公共団体	200,000,000	195,067,600	
2 9	地方公共団５年	300,000,000	296,296,500	
1 5	公営企業２０年	100,000,000	100,915,800	
1 7	公営企業２０年	100,000,000	101,734,700	
2 0	公営企業２０年	100,000,000	102,786,100	
2 2	公営企業２０年	100,000,000	103,194,200	
2 4	公営企業２０年	200,000,000	207,851,000	
1 0	日本政策金融	100,000,000	104,659,700	
8 9	都市再生	100,000,000	99,863,200	
9 3	都市再生	100,000,000	99,727,700	
1 1 7	都市再生	100,000,000	97,529,100	
3 3	政保中部空港	200,000,000	195,708,600	
2 3 9	政保預金保険	600,000,000	596,716,800	
5 2	住宅支援機構	100,000,000	104,069,400	
9 3	住宅支援機構	100,000,000	101,220,800	
1 2 4	住宅支援機構	100,000,000	101,224,800	
1 3 0	住宅支援機構	200,000,000	205,343,600	
2 2 6	住宅支援機構	100,000,000	97,909,700	

	2 6 3 住宅支援機構	100,000,000	66,840,000	
	1 9 住宅機構ＲＭＢＳ	11,680,000	11,862,208	
	2 4 住宅機構ＲＭＢＳ	23,480,000	23,935,512	
	2 6 住宅機構ＲＭＢＳ	37,008,000	37,759,262	
	2 7 住宅機構ＲＭＢＳ	13,084,000	13,361,380	
	2 8 住宅機構ＲＭＢＳ	15,359,000	15,712,257	
	2 9 住宅機構ＲＭＢＳ	16,515,000	16,894,845	
	3 0 住宅機構ＲＭＢＳ	16,256,000	16,631,513	
	3 2 住宅機構ＲＭＢＳ	31,990,000	32,575,417	
	3 5 住宅機構ＲＭＢＳ	16,406,000	16,729,198	
	3 6 住宅機構ＲＭＢＳ	15,475,000	15,741,170	
	4 3 住宅機構ＲＭＢＳ	20,204,000	20,359,570	
	4 6 住宅機構ＲＭＢＳ	15,594,000	15,854,419	
	4 8 住宅機構ＲＭＢＳ	29,608,000	30,143,904	
	4 9 住宅機構ＲＭＢＳ	15,181,000	15,404,160	
	5 1 住宅機構ＲＭＢＳ	33,048,000	33,404,918	
	5 5 住宅機構ＲＭＢＳ	44,280,000	44,218,008	
	5 7 住宅機構ＲＭＢＳ	21,240,000	21,246,372	
	5 8 住宅機構ＲＭＢＳ	23,717,000	23,650,592	
	5 9 住宅機構ＲＭＢＳ	45,290,000	45,285,471	
	6 0 住宅機構ＲＭＢＳ	68,553,000	68,244,511	
	6 1 住宅機構ＲＭＢＳ	23,059,000	22,858,386	
	6 7 住宅機構ＲＭＢＳ	29,843,000	29,120,799	
	6 9 住宅機構ＲＭＢＳ	62,690,000	61,749,650	
	7 0 住宅機構ＲＭＢＳ	54,014,000	53,414,444	
	7 3 住宅機構ＲＭＢＳ	30,678,000	30,285,321	
	9 9 住宅機構ＲＭＢＳ	48,966,000	46,649,908	
	1 2 3 住宅機構ＲＭＢＳ	65,611,000	60,001,259	
	1 2 4 住宅機構ＲＭＢＳ	65,051,000	59,293,986	
	1 2 5 住宅機構ＲＭＢＳ	64,846,000	59,107,129	
	1 2 7 住宅機構ＲＭＢＳ	67,449,000	61,223,457	
	1 2 8 住宅機構ＲＭＢＳ	65,722,000	59,813,592	
	1 2 9 住宅機構ＲＭＢＳ	67,752,000	61,722,072	
	1 3 7 住宅機構ＲＭＢＳ	69,753,000	63,314,798	
	1 6 7 住宅機構ＲＭＢＳ	81,643,000	72,915,363	
	1 8 3 住宅機構ＲＭＢＳ	175,068,000	158,489,060	
	1 8 6 住宅機構ＲＭＢＳ	89,903,000	82,881,575	
	1 9 8 住宅機構ＲＭＢＳ	187,106,000	179,640,470	
	8 5 中日本高速道	300,000,000	298,805,100	
	特殊債券 小計		10,088,506,527	
社債券	8 6 東日本高速道	200,000,000	196,789,000	
	1 1 4 東日本高速道	100,000,000	97,967,600	
	1 0 7 中日本高速道	300,000,000	293,789,400	
	8 4 西日本高速道	200,000,000	195,113,600	
	8 7 西日本高速道	200,000,000	195,864,600	

1 3	大和ハウス	100,000,000	98,240,200	
1 7	アサヒグループHD	200,000,000	196,581,400	
3 0	東レ	100,000,000	98,259,500	
1 2	旭化成	200,000,000	190,385,400	
2 4	三菱ケミカルホールデイ	100,000,000	97,587,300	
2 1	富士フイルムホールデイ	100,000,000	97,969,200	
3 2	住友電工	100,000,000	96,282,300	
1 6	小松製作所	100,000,000	97,092,400	
2 2	日立製作所	100,000,000	96,746,800	
9	TDK	100,000,000	96,128,200	
6 3	三井物産	100,000,000	102,765,800	
8	みずほコーポレート	100,000,000	103,452,500	
8	住友信託 劣後	100,000,000	102,465,800	
3 1	三井住友TB	300,000,000	293,560,500	
9	みずほ銀行劣後	100,000,000	102,606,600	
1 7	NTTファイナンス	200,000,000	195,377,400	
1 8	NTTファイナンス	200,000,000	188,677,800	
1 0 1	トヨタファイナンス	200,000,000	195,479,400	
2 0 7	オリックス	200,000,000	196,423,400	
2	三菱HCキャピタル	200,000,000	196,366,200	
5 8	三菱地所	100,000,000	109,332,300	
1 3 5	三菱地所	200,000,000	185,536,000	
1 0	東急	100,000,000	91,883,400	
3 8	京王電鉄	100,000,000	97,807,200	
1 1 0	東日本旅客鉄	100,000,000	90,602,900	
1 6 9	東日本旅客鉄	200,000,000	185,105,400	
2 6	西日本旅客鉄	100,000,000	104,562,500	
6 0	西日本旅客鉄	200,000,000	189,086,000	
4 1	東海旅客鉄道	100,000,000	103,565,400	
4 2	東海旅客鉄道	100,000,000	104,228,800	
4 5	東京地下鉄	200,000,000	187,916,600	
6 4	阪急阪神HLDG	100,000,000	98,393,500	
1 5	九州旅客鉄道	200,000,000	195,179,800	
3 1	KDDI	200,000,000	196,532,600	
5 4 6	中部電力	200,000,000	185,264,200	
5 5 3	中部電力	200,000,000	196,968,800	
5 5 0	関西電力	300,000,000	295,505,400	
5 6 0	関西電力	200,000,000	194,354,400	
5 0 8	東北電力	200,000,000	193,171,000	
5 4 7	東北電力	100,000,000	96,532,900	
4 9 6	九州電力	300,000,000	277,457,100	
5 6	東京電力PG	200,000,000	198,279,000	
6 6	東京電力PG	100,000,000	94,183,600	
4 1	大阪瓦斯	200,000,000	186,092,600	
7	ファーストリテイリング	100,000,000	97,392,900	

	社債券 小計		7,776,906,600	
	合 計		128,242,937,197	

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

外国株式インデックス・マザーファンド

（１）貸借対照表

（単位：円）

（2025年2月18日現在）

資産の部

流動資産

預金	12,682,616,254
金銭信託	5,735,461
コール・ローン	694,086,534
株式	950,152,996,994
投資証券	17,685,783,771
派生商品評価勘定	457,663,967
未収入金	34,319,810
未収配当金	739,904,462
差入委託証拠金	2,897,693,346
流動資産合計	985,350,800,599

資産合計	985,350,800,599
------	-----------------

負債の部

流動負債

派生商品評価勘定	3,332,429
未払金	141,906,335
未払解約金	188,467,728
流動負債合計	333,706,492

負債合計	333,706,492
------	-------------

純資産の部

元本等

元本	95,961,877,478
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	889,055,216,629

元本等合計	985,017,094,107
-------	-----------------

純資産合計	985,017,094,107
-------	-----------------

負債純資産合計	985,350,800,599
---------	-----------------

（２）注記表

（重要な会計方針の注記）

項 目	自 2024年2月20日 至 2025年2月18日
１． 有価証券の評価基準及び評価方法	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。

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

（重要な会計上の見積りに関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

項 目	（2025年2月18日現在）
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	95,961,877,478口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 10.2647円 （1万口当たりの純資産額102,647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 2024年2月20日 至 2025年2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、新株予約権証券、投資証券を組み入れております。

	2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。 当計算期間については、先物取引、為替予約取引を行っております。 3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 (2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する会議をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。 また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、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。 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。

．金融商品の時価等に関する事項

項 目	(2025年2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)

(2025年2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 MAR25	13,413,412,315	-	13,671,594,468	258,182,153
	SPI 200 FUTURES MAR25	460,367,634	-	470,125,612	9,757,978
	FTSE 100 IDX FUT MAR25	595,441,337	-	618,661,331	23,219,994
	EURO STOXX 50 MAR25	2,049,084,607	-	2,215,149,829	166,065,222
	小計	16,518,305,893	-	16,975,531,240	457,225,347
	合 計	16,518,305,893	-	16,975,531,240	457,225,347

(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	408,866,776	-	405,975,616	2,891,160
	小計	408,866,776	-	405,975,616	2,891,160
	売建				
	アメリカ・ドル	62,774,820	-	62,777,469	2,649
	小計	62,774,820	-	62,777,469	2,649
合 計		471,641,596	-	468,753,085	2,893,809

（注）１．時価の算定方法

為替予約取引の時価の算定方法については以下のように評価しております。

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

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

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

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

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

- 3) 上記の算定方法にて、適正な時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認め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 2024年2月20日 至 2025年2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）

（2025年2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	83,796,577,402円
同期中における追加設定元本額	19,446,804,974円
同期中における一部解約元本額	7,281,504,898円
2025年2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	48,391,532,142円
三井住友・ＤＣ年金バランス３０（債券重点型）	231,095,467円
三井住友・ＤＣ年金バランス５０（標準型）	882,131,902円
三井住友・ＤＣ年金バランス７０（株式重点型）	721,900,949円
ＳＭＡＭ・グローバルバランスファンド（機動的資産配分型）	35,740,180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）	629,395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）	2,442,445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）	8,363,078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）	28,979,164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）	36,822,412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）	83,675,237円
外国株式指数ファンド	1,265,208,043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	26,047,968,637円
アセットアロケーション・ファンド（安定型）	69,699,485円

アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）	106,071,489円
アセットアロケーション・ファンド（成長型）	64,419,186円
イオン・バランス戦略ファンド	41,889,948円
三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０５０	38,633,718円
三井住友・資産最適化ファンド（１安定重視型）	144,865,953円
三井住友・資産最適化ファンド（２やや安定型）	140,077,389円
三井住友・資産最適化ファンド（３バランス型）	574,434,395円
三井住友・資産最適化ファンド（４やや成長型）	360,321,460円
三井住友・資産最適化ファンド（５成長重視型）	535,969,941円
三井住友・ＤＣつみたてＮＩＳＡ・世界分散ファンド	75,728,030円
三井住友ＤＳ・外国株式インデックス年金ファンド	3,549,549,785円
三井住友ＤＳ・年金バランス３０（債券重点型）	10,722,773円
三井住友ＤＳ・年金バランス５０（標準型）	55,942,436円
三井住友ＤＳ・年金バランス７０（株式重点型）	59,920,196円
三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０６０	9,405,766円
ＳＭＢＣ・ＤＣインデックスファンド（ＭＳＣＩコクサイ）	3,008,606,195円
日興ＦＷＳ・先進国株インデックス（為替ヘッジあり）	154,624,905円
日興ＦＷＳ・先進国株インデックス（為替ヘッジなし）	3,787,700,625円
三井住友ＤＳ・先進国株式インデックス・ファンド	192,960,940円
三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０３５	18,914,229円
三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０４０	12,853,824円
三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０４５	13,046,342円
三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０５５	9,502,604円
三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０６５	7,815,330円
三井住友ＤＳ・ＦＷ専用ポートフォリオ・レベル１（保守型）	232,804円
三井住友ＤＳ・ＦＷ専用ポートフォリオ・レベル２（安定型）	5,468,700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）	31,266,632円
三井住友ＤＳ・ＦＷ専用ポートフォリオ・レベル４（成長型）	30,443,799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）	11,779,674円
三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０７０	104,784円
ＳＭＡＭ・外国株式パッシブ・ファンド（適格機関投資家専用）	200,794,637円
バランスファンドＶＡ（安定運用型）＜適格機関投資家限定＞	1,567,743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＞	7,334,511円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ２５＜適格機関投資家専用＞	177,726,427円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ３７．５＜適格機関投資家専用＞	394,127,497円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ５０＜適格機関投資家専用＞	1,809,374,807円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＬ３０＜適格機関投資家限定＞	5,402,429円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＬ５０＜適格機関投資家限定＞	28,481,096円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ７５＜適格機関投資家専用＞	296,931,472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＞	21,384,239円
ＳＭＡＭ・インデックス・バランスＶＡ２５＜適格機関投資家専用＞	48,353,362円
ＳＭＡＭ・インデックス・バランスＶＡ５０＜適格機関投資家専用＞	267,297,723円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ４０＜適格機関投資家専用＞	159,090,070円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ３５＜適格機関投資家専用＞	346,118,233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）	151,283,088円
ＳＭＡＭ・グローバルバランス４０ＶＡ＜適格機関投資家限定＞	30,652,214円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２０Ａ＜適格機関投資家専用＞	3,346,335円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ３５Ａ＜適格機関投資家専用＞	3,033,356円

ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ５０Ａ＜適格機関投資家専用＞	2,696,766円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２０Ｌ＜適格機関投資家専用＞	7,804,434円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２５Ｌ＜適格機関投資家専用＞	27,863,060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＞	58,597,008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＞	24,254,985円
ＳＭＡＭ・世界バランスファンドＶＡ＜適格機関投資家限定＞	97,119,901円
ＳＭＡＭ・世界バランスファンドＶＡ２＜適格機関投資家限定＞	33,833,048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＞	557,779,198円
ＳＭＡＭ・年金Ｗリスクコントロールファンド＜適格機関投資家限定＞	24,299,249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＞	13,279,500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＞	20,477,211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＞	240,939,340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＞	41,172,151円
合 計	95,961,877,478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	23.140	638,849.12	
	BAKER HUGHES CO	87,866	46.400	4,076,982.40	
	CHENIERE ENERGY INC	21,482	213.520	4,586,836.64	
	CHEVRON CORP	160,368	155.340	24,911,565.12	
	CONOCOPHILLIPS	121,258	96.260	11,672,295.08	
	COTERRA ENERGY INC	73,375	27.520	2,019,280.00	
	DEVON ENERGY CORP	54,844	34.640	1,899,796.16	
	DIAMONDBACK ENERGY INC	17,520	156.990	2,750,464.80	
	EOG RESOURCES INC	53,473	129.310	6,914,593.63	
	EQT CORP	47,708	53.430	2,549,038.44	
	EXPAND ENERGY CORP	17,398	105.330	1,832,531.34	
	EXXON MOBIL CORP	408,498	108.240	44,215,823.52	
	HALLIBURTON CO	76,654	26.160	2,005,268.64	
	HESS CORP	26,211	146.550	3,841,222.05	
	HF SINCLAIR CORP	10,663	38.010	405,300.63	
	KINDER MORGAN INC	186,585	26.550	4,953,831.75	
	MARATHON PETROLEUM CORP	30,431	156.060	4,749,061.86	
	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	57,692	48.060	2,772,677.52	
	ONEOK INC	56,852	97.850	5,562,968.20	
	OVINTIV INC	23,075	44.130	1,018,299.75	
	PHILLIPS 66	39,040	128.040	4,998,681.60	
	SCHLUMBERGER LTD	132,013	41.750	5,511,542.75	

TARGA RESOURCES CORP	18,523	205.360	3,803,883.28	
TEXAS PACIFIC LAND CORP	1,661	1,372.400	2,279,556.40	
VALERO ENERGY CORP	27,819	135.310	3,764,188.89	
WILLIAMS COS INC	112,855	56.980	6,430,477.90	
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	20,558	316.120	6,498,794.96	
ALBEMARLE CORP	11,981	81.210	972,977.01	
AMCOR PLC	122,899	10.070	1,237,592.93	
AVERY DENNISON CORP	6,759	181.610	1,227,501.99	
BALL CORP	28,423	49.850	1,416,886.55	
CELANESE CORP	8,742	68.060	594,980.52	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	18,315	82.480	1,510,621.20	
CORTEVA INC	66,394	63.960	4,246,560.24	
CRH PLC	63,238	108.300	6,848,675.40	
CROWN HOLDINGS INC	9,413	88.030	828,626.39	
DOW INC	68,728	38.670	2,657,711.76	
DUPONT DE NEMOURS INC	36,397	83.250	3,030,050.25	
EASTMAN CHEMICAL CO	9,517	101.010	961,312.17	
ECOLAB INC	23,028	264.740	6,096,432.72	
FREEPORT-MCMORAN INC	131,805	39.470	5,202,343.35	
INTERNATIONAL PAPER CO	45,665	56.120	2,562,719.80	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	25,024	85.580	2,141,553.92	
LINDE PLC	44,172	457.000	20,186,604.00	
LYONDELLBASELL INDU-CL A	22,165	76.700	1,700,055.50	
MARTIN MARIETTA MATERIALS	5,394	527.380	2,844,687.72	
MOSAIC CO/THE	25,489	26.510	675,713.39	
NEWMONT CORP	101,538	46.540	4,725,578.52	
NUCOR CORP	20,787	137.770	2,863,824.99	
PACKAGING CORP OF AMERICA	8,569	212.500	1,820,912.50	
PPG INDUSTRIES INC	21,291	117.750	2,507,015.25	
RELIANCE INC	5,040	297.690	1,500,357.60	
RPM INTERNATIONAL INC	10,397	123.460	1,283,613.62	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	22,475	356.860	8,020,428.50	
SMURFIT WESTROCK PLC	47,029	53.650	2,523,105.85	
STEEL DYNAMICS INC	12,713	135.830	1,726,806.79	
VULCAN MATERIALS CO	12,521	270.460	3,386,429.66	
WESTLAKE CORP	4,430	115.270	510,646.10	
3M CO	50,826	148.620	7,553,760.12	
AECOM	13,635	100.410	1,369,090.35	
AERCAP HOLDINGS NV	18,294	100.700	1,842,205.80	
ALLEGION PLC	6,843	133.390	912,787.77	
AMETEK INC	20,578	183.540	3,776,886.12	
AXON ENTERPRISE INC	6,576	683.410	4,494,104.16	
BOEING CO/THE	66,804	184.420	12,319,993.68	
BUILDERS FIRSTSOURCE INC	9,801	153.900	1,508,373.90	

CARLISLE COS INC	4,354	357.810	1,557,904.74	
CARRIER GLOBAL CORP	72,815	65.130	4,742,440.95	
CATERPILLAR INC	44,096	353.320	15,579,998.72	
CNH INDUSTRIAL NV	87,561	12.810	1,121,656.41	
CUMMINS INC	12,497	373.780	4,671,128.66	
DEERE & CO	23,649	480.220	11,356,722.78	
DOVER CORP	12,242	202.330	2,476,923.86	
EATON CORP PLC	36,320	309.170	11,229,054.40	
EMCOR GROUP INC	4,293	426.290	1,830,062.97	
EMERSON ELECTRIC CO	52,927	123.340	6,528,016.18	
FASTENAL CO	52,052	74.780	3,892,448.56	
FERGUSON ENTERPRISES INC	18,035	184.250	3,322,948.75	
FORTIVE CORP	34,421	80.600	2,774,332.60	
FORTUNE BRANDS INNOVATIONS I	10,648	68.950	734,179.60	
GE VERNOVA INC	25,628	367.590	9,420,596.52	
GENERAL DYNAMICS CORP	20,853	241.940	5,045,174.82	
GENERAL ELECTRIC	98,595	208.270	20,534,380.65	
GRACO INC	15,068	85.800	1,292,834.40	
HEICO CORP	4,483	220.850	990,070.55	
HEICO CORP-CLASS A	6,593	177.680	1,171,444.24	
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	59,274	202.750	12,017,803.50	
HOWMET AEROSPACE INC	36,463	133.420	4,864,893.46	
HUBBELL INC	4,737	390.140	1,848,093.18	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	2,888	161.270	465,747.76	
IDEX CORP	6,048	195.210	1,180,630.08	
ILLINOIS TOOL WORKS	27,919	258.110	7,206,173.09	
INGERSOLL-RAND INC	38,066	85.720	3,263,017.52	
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	16,600	40.500	672,300.00	
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL	63,476	89.770	5,698,240.52	
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	17,821	197.610	3,521,607.81	
LENNOX INTERNATIONAL INC	2,750	622.200	1,711,050.00	
LOCKHEED MARTIN CORP	20,024	423.190	8,473,956.56	
MASCO CORP	19,187	78.390	1,504,068.93	
NORDSON CORP	5,282	216.420	1,143,130.44	
NORTHROP GRUMMAN CORP	13,101	438.900	5,750,028.90	
OTIS WORLDWIDE CORP	35,270	96.740	3,412,019.80	
OWENS CORNING	7,597	179.380	1,362,749.86	
PACCAR INC	47,203	105.960	5,001,629.88	
PARKER HANNIFIN CORP	12,065	700.250	8,448,516.25	
PENTAIR PLC	15,664	96.730	1,515,178.72	
QUANTA SERVICES INC	13,102	285.450	3,739,965.90	
ROCKWELL AUTOMATION INC	9,863	294.400	2,903,667.20	
RTX CORP	121,873	122.410	14,918,473.93	
SMITH (A.O.) CORP	10,652	66.220	705,375.44	

SNAP-ON INC	5,235	338.920	1,774,246.20	
STANLEY BLACK & DECKER INC	12,917	87.100	1,125,070.70	
TEXTRON INC	14,870	72.280	1,074,803.60	
TORO CO	8,097	80.540	652,132.38	
TRANE TECHNOLOGIES PLC	21,148	363.260	7,682,222.48	
TRANSDIGM GROUP INC	5,063	1,314.190	6,653,743.97	
UNITED RENTALS INC	6,163	741.260	4,568,385.38	
VERTIV HOLDINGS CO-A	32,504	108.050	3,512,057.20	
WABTEC CORP	15,150	188.190	2,851,078.50	
WATSCO INC	3,112	483.690	1,505,243.28	
WW GRAINGER INC	4,106	1,027.730	4,219,859.38	
XYLEM INC	22,408	129.380	2,899,147.04	
AUTOMATIC DATA PROCESSING	37,993	308.150	11,707,542.95	
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	10,637	117.730	1,252,294.01	
BROADRIDGE FINANCIAL Solutio	10,783	240.330	2,591,478.39	
CINTAS CORP	33,480	204.220	6,837,285.60	
COPART INC	80,906	59.390	4,805,007.34	
DAYFORCE INC	16,385	66.420	1,088,291.70	
EQUIFAX INC	12,025	249.500	3,000,237.50	
JACOBS SOLUTIONS INC	10,393	128.880	1,339,449.84	
LEIDOS HOLDINGS INC	11,403	132.260	1,508,160.78	
PAYCHEX INC	30,408	147.250	4,477,578.00	
PAYCOM SOFTWARE INC	5,427	209.220	1,135,436.94	
REPUBLIC SERVICES INC	19,598	231.370	4,534,389.26	
ROLLINS INC	25,137	50.730	1,275,200.01	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	19,314	88.660	1,712,379.24	
TRANSUNION	18,291	99.740	1,824,344.34	
VERALTO CORP	22,013	97.990	2,157,053.87	
VERISK ANALYTICS INC	12,690	293.480	3,724,261.20	
WASTE CONNECTIONS INC	24,689	189.040	4,667,208.56	
WASTE MANAGEMENT INC	37,648	227.730	8,573,579.04	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	12,525	99.490	1,246,112.25	
CSX CORP	179,500	33.370	5,989,915.00	
DELTA AIR LINES INC	14,192	65.390	928,014.88	
EXPEDITORS INTL WASH INC	13,237	113.650	1,504,385.05	
FEDEX CORP	20,814	267.770	5,573,364.78	
GRAB HOLDINGS LTD - CL A	216,253	4.900	1,059,639.70	
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	8,550	169.980	1,453,329.00	
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	12,089	54.170	654,861.13	
NORFOLK SOUTHERN CORP	19,928	255.990	5,101,368.72	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	18,170	206.340	3,749,197.80	
SOUTHWEST AIRLINES CO	14,057	30.280	425,645.96	
UBER TECHNOLOGIES INC	172,760	79.420	13,720,599.20	
U-HAUL HOLDING CO-NON VOTING	5,850	66.410	388,498.50	

UNION PACIFIC CORP	56,606	249.220	14,107,347.32	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	68,522	116.220	7,963,626.84	
APTIV PLC	23,575	67.000	1,579,525.00	
FORD MOTOR CO	367,930	9.480	3,487,976.40	
GENERAL MOTORS CO	99,425	48.370	4,809,187.25	
RIVIAN AUTOMOTIVE INC-A	72,072	14.030	1,011,170.16	
TESLA INC	263,858	355.840	93,891,230.72	
DECKERS OUTDOOR CORP	13,320	155.070	2,065,532.40	
DR HORTON INC	26,159	130.570	3,415,580.63	
GARMIN LTD	13,282	212.620	2,824,018.84	
LENNAR CORP-A	21,335	123.840	2,642,126.40	
LULULEMON ATHLETICA INC	10,287	366.680	3,772,037.16	
NIKE INC -CL B	111,643	73.040	8,154,404.72	
NVR INC	297	7,365.720	2,187,618.84	
PULTEGROUP INC	17,535	107.430	1,883,785.05	
AIRBNB INC-CLASS A	41,722	161.420	6,734,765.24	
BOOKING HOLDINGS INC	3,053	5,044.400	15,400,553.20	
CARNIVAL CORP	100,720	26.230	2,641,885.60	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	126,190	57.080	7,202,925.20	
DARDEN RESTAURANTS INC	11,771	191.190	2,250,497.49	
DOMINO'S PIZZA INC	2,875	476.660	1,370,397.50	
DOORDASH INC - A	27,685	213.380	5,907,425.30	
DRAFTKINGS INC-CL A	38,324	53.490	2,049,950.76	
EXPEDIA GROUP INC	12,455	202.380	2,520,642.90	
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC-DI	15,951	298.810	4,766,318.31	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	23,335	265.870	6,204,076.45	
HYATT HOTELS CORP - CL A	3,371	142.750	481,210.25	
LAS VEGAS SANDS CORP	35,621	43.370	1,544,882.77	
MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A	22,599	283.520	6,407,268.48	
MCDONALD'S CORP	65,189	308.550	20,114,065.95	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	22,198	39.810	883,702.38	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	21,669	263.090	5,700,897.21	
STARBUCKS CORP	105,735	112.550	11,900,474.25	
WYNN RESORTS LTD	7,730	88.820	686,578.60	
YUM! BRANDS INC	25,236	147.910	3,732,656.76	
AMAZON.COM INC	866,234	228.680	198,090,391.12	
AUTOZONE INC	1,622	3,458.550	5,609,768.10	
BEST BUY CO INC	19,353	91.100	1,763,058.30	
BURLINGTON STORES INC	6,047	245.100	1,482,119.70	
CARMAX INC	14,212	88.900	1,263,446.80	
CARVANA CO	9,993	285.330	2,851,302.69	
DICK'S SPORTING GOODS INC	4,406	238.360	1,050,214.16	
EBAY INC	46,827	69.900	3,273,207.30	
GENUINE PARTS CO	12,304	124.900	1,536,769.60	

GLOBAL-E ONLINE LTD	10,267	62.840	645,178.28	
HOME DEPOT INC	91,151	409.500	37,326,334.50	
LKQ CORP	24,732	39.110	967,268.52	
LOWE'S COS INC	51,731	251.790	13,025,348.49	
MERCADOLIBRE INC	4,194	2,109.990	8,849,298.06	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	5,267	1,318.800	6,946,119.60	
POOL CORP	3,252	344.280	1,119,598.56	
ROSS STORES INC	29,519	138.760	4,096,056.44	
TJX COMPANIES INC	104,854	124.340	13,037,546.36	
TRACTOR SUPPLY COMPANY	46,885	57.140	2,679,008.90	
ULTA BEAUTY INC	4,748	365.140	1,733,684.72	
WILLIAMS-SONOMA INC	10,952	214.600	2,350,299.20	
ALBERTSONS COS INC - CLASS A	31,907	20.830	664,622.81	
COSTCO WHOLESALE CORP	40,656	1,071.850	43,577,133.60	
DOLLAR GENERAL CORP	18,277	72.560	1,326,179.12	
DOLLAR TREE INC	21,255	71.560	1,521,007.80	
KROGER CO	62,609	65.130	4,077,724.17	
SYSCO CORP	44,624	71.100	3,172,766.40	
TARGET CORP	41,397	127.880	5,293,848.36	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	52,808	9.700	512,237.60	
WALMART INC	407,059	104.040	42,350,418.36	
ALTRIA GROUP INC	159,964	53.290	8,524,481.56	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	42,289	46.100	1,949,522.90	
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	18,548	31.150	577,770.20	
BUNGE GLOBAL SA	12,343	70.500	870,181.50	
COCA-COLA CO/THE	378,121	68.870	26,041,193.27	
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	19,969	84.900	1,695,368.10	
CONAGRA BRANDS INC	39,722	25.280	1,004,172.16	
CONSTELLATION BRANDS INC-A	15,993	162.940	2,605,899.42	
GENERAL MILLS INC	52,744	58.840	3,103,456.96	
HERSHEY CO/THE	12,733	157.880	2,010,286.04	
HORMEL FOODS CORP	25,536	28.460	726,754.56	
JM SMUCKER CO/THE	8,172	102.030	833,789.16	
KELLANOVA	25,249	82.260	2,076,982.74	
KEURIG DR PEPPER INC	106,561	31.650	3,372,655.65	
KRAFT HEINZ CO/THE	82,333	28.920	2,381,070.36	
LAMB WESTON HOLDINGS INC	10,534	58.460	615,817.64	
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	22,009	76.960	1,693,812.64	
MOLSON COORS BEVERAGE CO - B	16,433	60.360	991,895.88	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	125,639	60.820	7,641,363.98	
MONSTER BEVERAGE CORP	63,778	49.250	3,141,066.50	
PEPSICO INC	126,961	143.390	18,204,937.79	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	141,337	150.460	21,265,565.02	
THE CAMPBELL'S COMPANY	21,338	38.600	823,646.80	

TYSON FOODS INC-CL A	25,497	57.100	1,455,878.70	
CHURCH & DWIGHT CO INC	23,694	105.000	2,487,870.00	
CLOROX COMPANY	10,423	147.920	1,541,770.16	
COLGATE-PALMOLIVE CO	69,598	86.040	5,988,211.92	
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	19,241	68.690	1,321,664.29	
KENVUE INC	175,284	21.930	3,843,978.12	
KIMBERLY-CLARK CORP	31,626	132.670	4,195,821.42	
PROCTER & GAMBLE CO/THE	216,434	162.890	35,254,934.26	
ABBOTT LABORATORIES	158,167	130.610	20,658,191.87	
ALIGN TECHNOLOGY INC	5,703	206.770	1,179,209.31	
BAXTER INTERNATIONAL INC	51,487	30.820	1,586,829.34	
BECTON DICKINSON AND CO	25,861	224.800	5,813,552.80	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	134,586	106.110	14,280,920.46	
CARDINAL HEALTH INC	20,986	126.210	2,648,643.06	
CENCORA INC	15,601	242.630	3,785,270.63	
CENTENE CORP	51,140	56.860	2,907,820.40	
COOPER COS INC/THE	17,340	88.100	1,527,654.00	
CVS HEALTH CORP	112,203	65.830	7,386,323.49	
DAVITA INC	4,138	157.420	651,403.96	
DEXCOM INC	38,418	89.070	3,421,891.26	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	57,871	76.190	4,409,191.49	
ELEVANCE HEALTH INC	21,328	389.250	8,301,924.00	
GE HEALTHCARE TECHNOLOGY	39,727	92.210	3,663,226.67	
HCA HEALTHCARE INC	17,979	316.210	5,685,139.59	
HENRY SCHEIN INC	10,457	76.000	794,732.00	
HOLOGIC INC	19,730	63.240	1,247,725.20	
HUMANA INC	10,475	253.830	2,658,869.25	
IDEXX LABORATORIES INC	7,376	444.530	3,278,853.28	
INSULET CORP	6,832	280.560	1,916,785.92	
INTUITIVE SURGICAL INC	32,324	595.550	19,250,558.20	
LABCORP HOLDINGS INC	7,903	246.490	1,948,010.47	
MCKESSON CORP	11,625	593.690	6,901,646.25	
MEDTRONIC PLC	117,578	92.810	10,912,414.18	
MOLINA HEALTHCARE INC	5,999	272.280	1,633,407.72	
QUEST DIAGNOSTICS INC	9,647	168.770	1,628,124.19	
RESMED INC	14,203	232.980	3,309,014.94	
SOLVENTUM CORP	15,984	74.240	1,186,652.16	
STERIS PLC	9,126	219.340	2,001,696.84	
STRYKER CORP	31,341	385.180	12,071,926.38	
TELEFLEX INC	3,952	167.430	661,683.36	
THE CIGNA GROUP	26,262	292.320	7,676,907.84	
UNITEDHEALTH GROUP INC	84,958	523.510	44,476,362.58	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	5,785	181.540	1,050,208.90	
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	14,171	234.000	3,316,014.00	

ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	18,219	100.520	1,831,373.88	
ABBVIE INC	162,914	192.870	31,421,223.18	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	25,379	134.670	3,417,789.93	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	12,470	256.450	3,197,931.50	
AMGEN INC	49,021	291.160	14,272,954.36	
AVANTOR INC	56,039	17.870	1,001,416.93	
BIOGEN INC	12,779	137.330	1,754,940.07	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	18,017	64.850	1,168,402.45	
BIO-RAD LABORATORIES-A	1,728	277.160	478,932.48	
BIO-TECHNE CORP	13,296	65.940	876,738.24	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	189,034	53.900	10,188,932.60	
CHARLES RIVER LABORATORIES	4,795	151.990	728,792.05	
DANAHER CORP	59,282	206.300	12,229,876.60	
ELI LILLY & CO	74,266	844.270	62,700,555.82	
EXACT SCIENCES CORP	13,570	49.310	669,136.70	
GILEAD SCIENCES INC	116,081	104.080	12,081,710.48	
ILLUMINA INC	14,966	100.240	1,500,191.84	
INCYTE CORP	15,899	70.420	1,119,607.58	
IQVIA HOLDINGS INC	17,319	193.440	3,350,187.36	
JOHNSON & JOHNSON	221,811	156.150	34,635,787.65	
MERCK & CO. INC.	234,182	83.010	19,439,447.82	
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	2,098	1,271.910	2,668,467.18	
MODERNA INC	27,369	32.990	902,903.31	
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	8,744	115.020	1,005,734.88	
PFIZER INC	517,183	25.530	13,203,681.99	
REGENERON PHARMACEUTICALS	10,206	673.600	6,874,761.60	
REVVITY INC	10,411	112.260	1,168,738.86	
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	41,090	32.360	1,329,672.40	
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	102,259	16.250	1,661,708.75	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	34,742	531.850	18,477,532.70	
UNITED THERAPEUTICS CORP	3,537	370.580	1,310,741.46	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	23,625	459.000	10,843,875.00	
VIATRIS INC	99,736	10.800	1,077,148.80	
WATERS CORP	5,084	369.730	1,879,707.32	
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	6,204	214.730	1,332,184.92	
ZOETIS INC	40,634	157.520	6,400,667.68	
BANK OF AMERICA CORP	643,841	46.960	30,234,773.36	
CITIGROUP INC	174,352	84.610	14,751,922.72	
CITIZENS FINANCIAL GROUP	44,955	46.350	2,083,664.25	
FIFTH THIRD BANCORP	58,586	44.060	2,581,299.16	
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	845	2,141.490	1,809,559.05	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	128,600	16.730	2,151,478.00	
JPMORGAN CHASE & CO	261,379	276.590	72,294,817.61	
KEYCORP	84,828	17.720	1,503,152.16	

M & T BANK CORP	14,423	198.820	2,867,580.86	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	37,362	193.910	7,244,865.42	
REGIONS FINANCIAL CORP	79,089	24.320	1,923,444.48	
TRUIST FINANCIAL CORP	120,377	46.810	5,634,847.37	
US BANCORP	139,283	47.750	6,650,763.25	
WELLS FARGO & CO	314,254	79.980	25,134,034.92	
ALLY FINANCIAL INC	20,139	38.380	772,934.82	
AMERICAN EXPRESS CO	51,793	311.040	16,109,694.72	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	8,870	545.930	4,842,399.10	
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	36,928	162.810	6,012,247.68	
ARES MANAGEMENT CORP - A	16,991	186.180	3,163,384.38	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	66,444	87.840	5,836,440.96	
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	121,713	479.590	58,372,337.67	
BLACKROCK INC	13,512	973.920	13,159,607.04	
BLACKSTONE INC	65,772	164.840	10,841,856.48	
BLOCK INC	49,568	84.000	4,163,712.00	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	35,956	202.160	7,268,864.96	
CARLYLE GROUP INC/THE	24,269	51.770	1,256,406.13	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	9,059	202.330	1,832,907.47	
CME GROUP INC	33,799	245.480	8,296,978.52	
COINBASE GLOBAL INC -CLASS A	18,302	274.310	5,020,421.62	
COREBRIDGE FINANCIAL INC	19,925	33.180	661,111.50	
CORPAY INC	6,278	377.310	2,368,752.18	
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	23,994	195.970	4,702,104.18	
EQUITABLE HOLDINGS INC	31,450	55.340	1,740,443.00	
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	3,797	456.090	1,731,773.73	
FIDELITY NATIONAL INFO SERV	47,604	68.980	3,283,723.92	
FISERV INC	52,646	230.600	12,140,167.60	
FRANKLIN RESOURCES INC	21,778	20.530	447,102.34	
FUTU HOLDINGS LTD-ADR	6,660	121.820	811,321.20	
GLOBAL PAYMENTS INC	24,460	105.630	2,583,709.80	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	28,729	660.550	18,976,940.95	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	53,838	166.710	8,975,332.98	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	6,120	166.470	1,018,796.40	
KKR & CO INC	57,052	140.560	8,019,229.12	
LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	7,385	373.980	2,761,842.30	
MARKETAXESS HOLDINGS INC	2,653	193.490	513,328.97	
MASTERCARD INC - A	75,943	564.760	42,889,568.68	
MOODY'S CORP	14,668	522.840	7,669,017.12	
MORGAN STANLEY	110,616	138.950	15,370,093.20	
MSCI INC	7,510	572.630	4,300,451.30	
NASDAQ INC	41,014	80.910	3,318,442.74	
NORTHERN TRUST CORP	16,793	110.770	1,860,160.61	
PAYPAL HOLDINGS INC	91,070	77.970	7,100,727.90	

RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	17,112	159.840	2,735,182.08	
ROBINHOOD MARKETS INC - A	50,779	65.280	3,314,853.12	
S&P GLOBAL INC	29,704	539.690	16,030,951.76	
SCHWAB (CHARLES) CORP	157,767	80.340	12,675,000.78	
SEI INVESTMENTS COMPANY	12,351	82.280	1,016,240.28	
STATE STREET CORP	25,474	99.160	2,526,001.84	
SYNCHRONY FINANCIAL	38,295	65.210	2,497,216.95	
T ROWE PRICE GROUP INC	20,577	107.170	2,205,237.09	
TOAST INC-CLASS A	35,993	40.490	1,457,356.57	
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	11,810	127.030	1,500,224.30	
VISA INC-CLASS A SHARES	153,622	353.810	54,352,999.82	
AFLAC INC	48,525	103.340	5,014,573.50	
ALLSTATE CORP	25,179	187.630	4,724,335.77	
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	7,655	123.280	943,708.40	
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	61,493	74.340	4,571,389.62	
AON PLC-CLASS A	17,486	386.990	6,766,907.14	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	32,647	88.200	2,879,465.40	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	22,459	321.500	7,220,568.50	
ASSURANT INC	4,977	202.960	1,010,131.92	
BROWN & BROWN INC	20,402	110.600	2,256,461.20	
CHUBB LTD	35,193	264.520	9,309,252.36	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	13,251	136.970	1,814,989.47	
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	2,244	388.950	872,803.80	
EVEREST GROUP LTD	3,547	332.690	1,180,051.43	
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	24,937	57.950	1,445,099.15	
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	25,592	111.980	2,865,792.16	
LOEWS CORP	16,971	83.010	1,408,762.71	
MARKEL GROUP INC	1,175	1,868.010	2,194,911.75	
MARSH & MCLENNAN COS	45,913	228.830	10,506,271.79	
METLIFE INC	52,395	81.700	4,280,671.50	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	19,458	85.650	1,666,577.70	
PROGRESSIVE CORP	53,401	262.600	14,023,102.60	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	32,008	111.560	3,570,812.48	
TRAVELERS COS INC/THE	21,211	238.300	5,054,581.30	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	8,848	320.400	2,834,899.20	
WR BERKLEY CORP	27,229	60.350	1,643,270.15	
ACCENTURE PLC-CL A	56,750	388.000	22,019,000.00	
ADOBE INC	39,973	460.160	18,393,975.68	
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	13,226	100.010	1,322,732.26	
ANSYS INC	7,892	338.930	2,674,835.56	
APPLOVIN CORP-CLASS A	18,444	510.130	9,408,837.72	
ASPEN TECHNOLOGY INC	1,901	264.780	503,346.78	
ATLASSIAN CORP-CL A	14,770	313.100	4,624,487.00	
AUTODESK INC	19,029	302.720	5,760,458.88	

BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	15,779	47.250	745,557.75	
CADENCE DESIGN SYS INC	25,690	295.190	7,583,431.10	
CHECK POINT SOFTWARE TECH	8,287	222.090	1,840,459.83	
CLOUDFLARE INC - CLASS A	27,192	171.160	4,654,182.72	
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	46,873	90.700	4,251,381.10	
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	21,833	451.740	9,862,839.42	
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	4,025	413.310	1,663,572.75	
DATADOG INC - CLASS A	24,612	131.010	3,224,418.12	
DOCUSIGN INC	17,164	87.340	1,499,103.76	
DYNATRACE INC	29,487	61.300	1,807,553.10	
EPAM SYSTEMS INC	4,815	266.120	1,281,367.80	
FAIR ISAAC CORP	2,176	1,799.190	3,915,037.44	
FORTINET INC	58,618	111.640	6,544,113.52	
GARTNER INC	7,286	514.670	3,749,885.62	
GEN DIGITAL INC	55,784	27.720	1,546,332.48	
GODADDY INC - CLASS A	11,895	182.190	2,167,150.05	
HUBSPOT INC	4,278	811.950	3,473,522.10	
INTL BUSINESS MACHINES CORP	83,716	261.280	21,873,316.48	
INTUIT INC	25,517	587.380	14,988,175.46	
MANHATTAN ASSOCIATES INC	6,146	190.410	1,170,259.86	
MICROSOFT CORP	647,383	408.430	264,410,638.69	
MICROSTRATEGY INC-CL A	17,248	337.730	5,825,167.04	
MONDAY.COM LTD	3,694	318.500	1,176,539.00	
MONGODB INC	7,195	289.630	2,083,887.85	
NUTANIX INC - A	24,582	70.470	1,732,293.54	
OKTA INC	13,914	96.290	1,339,779.06	
ORACLE CORP	153,413	174.160	26,718,408.08	
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	185,980	119.160	22,161,376.80	
PALO ALTO NETWORKS INC	59,540	200.030	11,909,786.20	
PTC INC	11,347	171.100	1,941,471.70	
ROPER TECHNOLOGIES INC	10,175	573.580	5,836,176.50	
SALESFORCE INC	88,160	326.540	28,787,766.40	
SAMSARA INC-CL A	19,159	58.960	1,129,614.64	
SERVICENOW INC	18,714	986.630	18,463,793.82	
SNOWFLAKE INC-CLASS A	26,689	187.600	5,006,856.40	
SYNOPSYS INC	14,428	522.530	7,539,062.84	
TWILIO INC - A	15,028	125.170	1,881,054.76	
TYLER TECHNOLOGIES INC	3,550	641.700	2,278,035.00	
VERISIGN INC	7,316	229.240	1,677,119.84	
WIX.COM LTD	5,381	223.700	1,203,729.70	
WORKDAY INC-CLASS A	20,263	258.050	5,228,867.15	
ZOOM COMMUNICATIONS INC	23,688	85.100	2,015,848.80	
ZSCALER INC	7,508	212.700	1,596,951.60	
AMPHENOL CORP-CL A	112,914	68.880	7,777,516.32	

APPLE INC	1,393,801	244.600	340,923,724.60	
ARISTA NETWORKS INC	99,402	106.870	10,623,091.74	
CDW CORP/DE	12,480	189.390	2,363,587.20	
CISCO SYSTEMS INC	362,293	64.870	23,501,946.91	
CORNING INC	74,469	52.540	3,912,601.26	
DELL TECHNOLOGIES -C	29,087	114.380	3,326,971.06	
F5 INC	4,939	310.180	1,531,979.02	
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	113,897	21.710	2,472,703.87	
HP INC	85,880	33.640	2,889,003.20	
JABIL INC	9,808	169.650	1,663,927.20	
JUNIPER NETWORKS INC	30,061	36.550	1,098,729.55	
KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	15,964	183.460	2,928,755.44	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	15,528	438.140	6,803,437.92	
NETAPP INC	17,045	119.060	2,029,377.70	
PURE STORAGE INC - CLASS A	28,039	67.800	1,901,044.20	
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	18,460	101.470	1,873,136.20	
SUPER MICRO COMPUTER INC	47,438	47.910	2,272,754.58	
TE CONNECTIVITY PLC	28,578	152.770	4,365,861.06	
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	4,328	489.730	2,119,551.44	
TRIMBLE INC	20,783	74.290	1,543,969.07	
WESTERN DIGITAL CORP	29,044	68.390	1,986,319.16	
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	5,097	318.360	1,622,680.92	
ADVANCED MICRO DEVICES	147,015	113.100	16,627,396.50	
ANALOG DEVICES INC	45,527	214.610	9,770,549.47	
APPLIED MATERIALS INC	75,264	169.200	12,734,668.80	
BROADCOM INC	407,291	233.040	94,915,094.64	
ENPHASE ENERGY INC	10,381	63.940	663,761.14	
ENTEGRIS INC	12,569	107.120	1,346,391.28	
FIRST SOLAR INC	8,882	159.760	1,418,988.32	
INTEL CORP	400,373	23.600	9,448,802.80	
KLA CORP	12,519	750.740	9,398,514.06	
LAM RESEARCH CORP	121,048	82.750	10,016,722.00	
MARVELL TECHNOLOGY INC	79,934	106.510	8,513,770.34	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	50,967	55.760	2,841,919.92	
MICRON TECHNOLOGY INC	103,295	99.520	10,279,918.40	
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	4,760	684.930	3,260,266.80	
NVIDIA CORP	2,248,704	138.850	312,232,550.40	
NXP SEMICONDUCTORS NV	24,211	224.140	5,426,653.54	
ON SEMICONDUCTOR	35,773	51.830	1,854,114.59	
QORVO INC	7,835	76.160	596,713.60	
QUALCOMM INC	101,442	172.230	17,471,355.66	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	13,506	65.930	890,450.58	
TERADYNE INC	14,950	113.250	1,693,087.50	
TEXAS INSTRUMENTS INC	83,098	183.030	15,209,426.94	

AT&T INC	665,260	25.870	17,210,276.20	
T-MOBILE US INC	47,262	270.815	12,799,258.53	
VERIZON COMMUNICATIONS INC	390,472	40.990	16,005,447.28	
AES CORP	54,086	9.930	537,073.98	
ALLIANT ENERGY CORP	21,204	61.330	1,300,441.32	
AMEREN CORPORATION	22,382	98.070	2,195,002.74	
AMERICAN ELECTRIC POWER	47,591	101.830	4,846,191.53	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	17,778	125.660	2,233,983.48	
ATMOS ENERGY CORP	13,505	146.510	1,978,617.55	
CENTERPOINT ENERGY INC	54,717	33.410	1,828,094.97	
CMS ENERGY CORP	27,913	68.810	1,920,693.53	
CONSOLIDATED EDISON INC	32,957	94.920	3,128,278.44	
CONSTELLATION ENERGY	28,832	317.300	9,148,393.60	
DOMINION ENERGY INC	80,217	55.590	4,459,263.03	
DTE ENERGY COMPANY	18,974	129.040	2,448,404.96	
DUKE ENERGY CORP	72,441	111.600	8,084,415.60	
EDISON INTERNATIONAL	36,846	50.060	1,844,510.76	
ENTERGY CORP	39,680	82.490	3,273,203.20	
ESSENTIAL UTILITIES INC	25,795	35.200	907,984.00	
EVERGY INC	22,411	66.660	1,493,917.26	
EVERSOURCE ENERGY	30,845	61.540	1,898,201.30	
EXELON CORP	94,691	42.850	4,057,509.35	
FIRSTENERGY CORP	45,110	40.000	1,804,400.00	
NEXTERA ENERGY INC	187,372	68.060	12,752,538.32	
NISOURCE INC	43,994	39.680	1,745,681.92	
NRG ENERGY INC	18,864	107.600	2,029,766.40	
P G & E CORP	196,880	15.290	3,010,295.20	
PPL CORP	61,956	33.730	2,089,775.88	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	47,097	83.700	3,942,018.90	
SEMPRA	56,971	84.100	4,791,261.10	
SOUTHERN CO/THE	100,282	85.580	8,582,133.56	
VISTRA CORP	32,050	167.660	5,373,503.00	
WEC ENERGY GROUP INC	29,467	102.970	3,034,216.99	
XCEL ENERGY INC	51,007	68.610	3,499,590.27	
ALPHABET INC-CL A	537,733	185.230	99,604,283.59	
ALPHABET INC-CL C	461,454	186.870	86,231,908.98	
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	8,667	360.270	3,122,460.09	
COMCAST CORP-CLASS A	352,021	35.390	12,458,023.19	
ELECTRONIC ARTS INC	23,684	129.400	3,064,709.60	
FOX CORP - CLASS A	23,886	55.630	1,328,778.18	
FOX CORP - CLASS B	8,773	52.390	459,617.47	
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	32,096	27.050	868,196.80	
LIBERTY MEDIA CORP-FORMULA-C	20,572	98.500	2,026,342.00	
LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	13,554	153.760	2,084,063.04	

	MATCH GROUP INC	24,529	34.690	850,911.01	
	META PLATFORMS INC-CLASS A	200,531	736.670	147,725,171.77	
	NETFLIX INC	39,492	1,058.600	41,806,231.20	
	NEWS CORP - CLASS A	34,405	30.210	1,039,375.05	
	OMNICOM GROUP	18,370	82.170	1,509,462.90	
	PINTEREST INC- CLASS A	48,115	38.870	1,870,230.05	
	ROBLOX CORP -CLASS A	43,099	66.750	2,876,858.25	
	ROKU INC	9,945	99.070	985,251.15	
	SEA LTD-ADR	34,089	134.950	4,600,310.55	
	SNAP INC - A	86,463	10.850	938,123.55	
	SPOTIFY TECHNOLOGY SA	14,132	638.180	9,018,759.76	
	TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	14,811	208.760	3,091,944.36	
	TRADE DESK INC/THE -CLASS A	40,175	80.160	3,220,428.00	
	WALT DISNEY CO/THE	167,882	110.380	18,530,815.16	
	WARNER BROS DISCOVERY INC	201,390	10.340	2,082,372.60	
	CBRE GROUP INC - A	27,148	143.730	3,901,982.04	
	COSTAR GROUP INC	37,855	74.060	2,803,541.30	
	HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	79,100	4.490	355,159.00	
	ZILLOW GROUP INC - C	14,561	79.970	1,164,443.17	
	アメリカ・ドル小計	33,785,055		4,861,083,080.35 (737,280,470,797)	
カナダ・ドル	ARC RESOURCES LTD	62,147	26.610	1,653,731.67	
	CAMECO CORP	38,144	66.880	2,551,070.72	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	194,084	42.670	8,281,564.28	
	CENOVUS ENERGY INC	120,048	21.680	2,602,640.64	
	ENBRIDGE INC	199,400	61.080	12,179,352.00	
	IMPERIAL OIL LTD	16,267	98.250	1,598,232.75	
	KEYERA CORP	19,802	42.050	832,674.10	
	MEG ENERGY CORP	21,651	22.980	497,539.98	
	PARKLAND CORP	16,066	38.410	617,095.06	
	PEMBINA PIPELINE CORP	56,661	51.360	2,910,108.96	
	SUNCOR ENERGY INC	120,305	56.050	6,743,095.25	
	TC ENERGY CORP	90,192	65.140	5,875,106.88	
	TOURMALINE OIL CORP	34,280	67.580	2,316,642.40	
	AGNICO EAGLE MINES LTD	46,099	135.790	6,259,783.21	
	BARRICK GOLD CORP	157,839	25.430	4,013,845.77	
	CCL INDUSTRIES INC - CL B	13,268	69.910	927,565.88	
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	68,446	19.560	1,338,803.76	
	FRANCO-NEVADA CORP	18,349	196.120	3,598,605.88	
	IVANHOE MINES LTD-CL A	80,624	16.660	1,343,195.84	
	KINROSS GOLD CORP	110,156	15.990	1,761,394.44	
	LUNDIN MINING CORP	88,954	12.330	1,096,802.82	
	NUTRIEN LTD	42,180	72.150	3,043,287.00	
	PAN AMERICAN SILVER CORP	36,364	34.630	1,259,285.32	

TECK RESOURCES LTD-CLS B	40,547	61.080	2,476,610.76	
WEST FRASER TIMBER CO LTD	4,438	113.010	501,538.38	
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	40,353	95.710	3,862,185.63	
CAE INC	27,474	37.990	1,043,737.26	
STANTEC INC	9,939	109.560	1,088,916.84	
TOROMONT INDUSTRIES LTD	9,630	121.100	1,166,193.00	
WSP GLOBAL INC	12,764	249.230	3,181,171.72	
ELEMENT FLEET MANAGEMENT COR	32,674	28.620	935,129.88	
GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	21,852	65.990	1,442,013.48	
RB GLOBAL INC	15,569	136.430	2,124,078.67	
THOMSON REUTERS CORP	13,747	246.240	3,385,061.28	
AIR CANADA	12,083	17.750	214,473.25	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	50,830	144.040	7,321,553.20	
CANADIAN PACIFIC KANSAS CITY	84,180	109.880	9,249,698.40	
TFI INTERNATIONAL INC	6,995	182.500	1,276,587.50	
MAGNA INTERNATIONAL INC	22,436	53.610	1,202,793.96	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	11,302	72.200	816,004.40	
RESTAURANT BRANDS INTERN	28,570	91.450	2,612,726.50	
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	4,737	143.990	682,080.63	
DOLLARAMA INC	27,090	139.480	3,778,513.20	
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	69,802	72.350	5,050,174.70	
EMPIRE CO LTD 'A'	17,348	42.350	734,687.80	
LOBLAW COMPANIES LTD	14,057	178.360	2,507,206.52	
METRO INC/CN	18,929	91.430	1,730,678.47	
WESTON (GEORGE) LTD	4,984	222.170	1,107,295.28	
SAPUTO INC	18,270	24.330	444,509.10	
BANK OF MONTREAL	67,593	143.210	9,679,993.53	
BANK OF NOVA SCOTIA	110,271	72.590	8,004,571.89	
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	89,360	88.010	7,864,573.60	
NATIONAL BANK OF CANADA	29,961	126.230	3,781,977.03	
ROYAL BANK OF CANADA	128,586	168.670	21,688,600.62	
TORONTO-DOMINION BANK	163,410	84.640	13,831,022.40	
BROOKFIELD ASSET MGMT-A	31,451	84.780	2,666,415.78	
BROOKFIELD CORP	128,381	86.250	11,072,861.25	
IGM FINANCIAL INC	4,949	44.950	222,457.55	
ONEX CORPORATION	4,217	110.180	464,629.06	
TMX GROUP LTD	26,034	50.630	1,318,101.42	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	1,991	2,070.190	4,121,748.29	
GREAT-WEST LIFECO INC	22,964	51.590	1,184,712.76	
IA FINANCIAL CORP INC	8,268	130.320	1,077,485.76	
INTACT FINANCIAL CORP	16,097	288.210	4,639,316.37	
MANULIFE FINANCIAL CORP	158,627	42.070	6,673,437.89	
POWER CORP OF CANADA	50,268	47.620	2,393,762.16	
SUN LIFE FINANCIAL INC	53,341	78.200	4,171,266.20	

	CGI INC	18,609	170.710	3,176,742.39	
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	1,831	4,934.840	9,035,692.04	
	DESCARTES SYSTEMS GRP/THE	9,063	165.190	1,497,116.97	
	OPEN TEXT CORP	21,507	40.250	865,656.75	
	SHOPIFY INC - CLASS A	112,080	181.920	20,389,593.60	
	BCE INC	10,153	33.780	342,968.34	
	QUEBECOR INC -CL B	15,578	32.570	507,375.46	
	ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	39,463	39.750	1,568,654.25	
	TELUS CORP	15,222	21.800	331,839.60	
	ALTAGAS LTD	27,309	34.500	942,160.50	
	BROOKFIELD RENEWABLE CORP	11,200	39.290	440,048.00	
	CANADIAN UTILITIES LTD-A	7,344	33.890	248,888.16	
	EMERA INC	30,820	56.530	1,742,254.60	
	FORTIS INC	41,868	63.640	2,664,479.52	
	HYDRO ONE LTD	33,037	44.970	1,485,673.89	
	FIRSTSERVICE CORP	3,669	248.650	912,296.85	
	カナダ・ドル小計	3,766,448		284,245,418.90 (30,374,465,464)	
オーストラ リア・ドル	SANTOS LTD	313,144	6.900	2,160,693.60	
	WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	170,906	23.840	4,074,399.04	
	BHP GROUP LTD	470,076	40.800	19,179,100.80	
	BLUESCOPE STEEL LTD	37,214	25.250	939,653.50	
	FORTESCUE LTD	160,779	19.410	3,120,720.39	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	36,927	50.970	1,882,169.19	
	MINERAL RESOURCES LTD	17,115	32.480	555,895.20	
	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	116,618	17.910	2,088,628.38	
	ORICA LTD	36,212	17.150	621,035.80	
	RIO TINTO LTD	32,627	120.940	3,945,909.38	
	SOUTH32 LTD	394,239	3.690	1,454,741.91	
	REECE LTD	23,776	22.270	529,491.52	
	SGH LTD	16,425	54.450	894,341.25	
	BRAMBLES LTD	122,717	19.410	2,381,936.97	
	COMPUTERSHARE LTD	50,853	42.940	2,183,627.82	
	QANTAS AIRWAYS LTD	78,226	9.200	719,679.20	
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	50,442	78.320	3,950,617.44	
	LOTTERY CORP LTD/THE	224,832	4.970	1,117,415.04	
	WESFARMERS LTD	105,230	79.110	8,324,745.30	
	COLES GROUP LTD	111,645	19.780	2,208,338.10	
	ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALI	138,738	4.430	614,609.34	
	WOOLWORTHS GROUP LTD	117,922	30.880	3,641,431.36	
	TREASURY WINE ESTATES LTD	81,142	10.910	885,259.22	
	COCHLEAR LTD	6,946	275.000	1,910,150.00	
	PRO MEDICUS LTD	5,586	282.520	1,578,156.72	
	RAMSAY HEALTH CARE LTD	14,565	35.200	512,688.00	

	SONIC HEALTHCARE LTD	37,362	28.990	1,083,124.38	
	CSL LTD	44,347	258.300	11,454,830.10	
	ANZ GROUP HOLDINGS LTD	265,974	31.160	8,287,749.84	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	152,403	164.970	25,141,922.91	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	283,903	40.520	11,503,749.56	
	WESTPAC BANKING CORP	322,741	33.300	10,747,275.30	
	ASX LTD	15,385	68.240	1,049,872.40	
	MACQUARIE GROUP LTD	34,425	237.110	8,162,511.75	
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	22,786	34.100	777,002.60	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP	229,744	7.590	1,743,756.96	
	MEDIBANK PRIVATE LTD	193,702	3.950	765,122.90	
	QBE INSURANCE GROUP LTD	124,450	20.110	2,502,689.50	
	SUNCORP GROUP LTD	99,768	18.500	1,845,708.00	
	WISETECH GLOBAL LTD	16,426	123.710	2,032,060.46	
	XERO LTD	14,111	184.990	2,610,393.89	
	TELSTRA GROUP LTD	367,025	3.880	1,424,057.00	
	ORIGIN ENERGY LTD	177,211	10.600	1,878,436.60	
	CAR GROUP LTD	35,130	38.250	1,343,722.50	
	REA GROUP LTD	3,813	267.650	1,020,549.45	
	SEEK LTD	29,833	24.230	722,853.59	
	オーストラリア・ドル小計	5,405,441		167,572,824.16 (16,133,911,510)	
香港・ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	235,424	39.450	9,287,476.80	
	SWIRE PACIFIC LTD - CL A	27,000	65.800	1,776,600.00	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	121,500	106.000	12,879,000.00	
	MTR CORP	118,500	25.100	2,974,350.00	
	SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	160,000	18.060	2,889,600.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	176,000	30.050	5,288,800.00	
	SANDS CHINA LTD	238,000	17.240	4,103,120.00	
	WH GROUP LTD	722,000	5.880	4,245,360.00	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	347,000	27.050	9,386,350.00	
	HANG SENG BANK LTD	63,400	105.000	6,657,000.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	109,900	340.800	37,453,920.00	
	AIA GROUP LTD	1,001,600	55.250	55,338,400.00	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	62,000	51.950	3,220,900.00	
	CLP HOLDINGS LTD	142,100	64.550	9,172,555.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	1,186,389	6.100	7,236,972.90	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	111,000	49.500	5,494,500.00	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	160,924	33.650	5,415,092.60	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	140,384	21.750	3,053,352.00	
	SINO LAND CO	530,200	7.790	4,130,258.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	135,500	71.650	9,708,575.00	
	WHARF HOLDINGS LTD	113,000	18.360	2,074,680.00	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	125,000	19.920	2,490,000.00	

香港・ドル小計		6,026,821		204,276,862.30 (3,981,356,046)	
シンガポール・ドル	KEPPEL LTD	115,000	6.850	787,750.00	
	SINGAPORE TECH ENGINEERING	108,600	5.000	543,000.00	
	YANGZIJANG SHIPBUILDING	258,100	3.090	797,529.00	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	113,566	6.420	729,093.72	
	GENTING SINGAPORE LTD	675,000	0.780	526,500.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	159,600	3.270	521,892.00	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	181,670	45.000	8,175,150.00	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	310,200	17.580	5,453,316.00	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	113,600	38.610	4,386,096.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	94,600	12.970	1,226,962.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	673,815	3.320	2,237,065.80	
	SEMBCORP INDUSTRIES LTD	89,200	5.430	484,356.00	
	CAPITALAND INVESTMENT LTD/SI	220,100	2.540	559,054.00	
シンガポール・ドル小計		3,113,051		26,427,764.52 (2,986,865,946)	
ニュージーランド・ドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	192,208	8.550	1,643,378.40	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	50,850	35.780	1,819,413.00	
	INFRATIL LTD	83,472	10.975	916,105.20	
	MERCURY NZ LTD	44,611	6.490	289,525.39	
	MERIDIAN ENERGY LTD	102,546	6.060	621,428.76	
ニュージーランド・ドル小計		473,687		5,289,850.75 (459,423,539)	
イギリス・ポンド	BP PLC	1,481,800	4.627	6,856,288.60	
	SHELL PLC	563,859	26.870	15,150,891.33	
	ANGLO AMERICAN PLC	115,927	24.735	2,867,454.34	
	ANTOFAGASTA PLC	30,983	18.360	568,847.88	
	CRODA INTERNATIONAL PLC	10,296	32.000	329,472.00	
	ENDEAVOUR MINING PLC	17,507	17.450	305,497.15	
	GLENCORE PLC	971,910	3.504	3,405,572.64	
	MONDI PLC	45,625	13.195	602,021.87	
	RIO TINTO PLC	106,317	50.850	5,406,219.45	
	ASHTREAD GROUP PLC	38,037	51.120	1,944,451.44	
	BAE SYSTEMS PLC	267,719	13.380	3,582,080.22	
	BUNZL PLC	35,202	34.400	1,210,948.80	
	DCC PLC	10,153	54.250	550,800.25	
	MELROSE INDUSTRIES PLC	119,456	6.434	768,579.90	
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	763,008	6.354	4,848,152.83	
	SMITHS GROUP PLC	36,853	21.040	775,387.12	
	SPIRAX GROUP PLC	5,904	78.350	462,578.40	
	EXPERIAN PLC	81,296	39.440	3,206,314.24	
	INTERTEK GROUP PLC	17,824	53.000	944,672.00	
	RELX PLC	171,624	40.480	6,947,339.52	
	RENTOKIL INITIAL PLC	263,366	4.239	1,116,408.47	

BARRATT REDROW PLC	139,211	4.479	623,526.06	
BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE	10,362	37.740	391,061.88	
PERSIMMON PLC	27,665	12.330	341,109.45	
TAYLOR WIMPEY PLC	353,772	1.155	408,606.66	
COMPASS GROUP PLC	149,241	28.430	4,242,921.63	
ENTAIN PLC	42,158	7.644	322,255.75	
INTERCONTINENTAL HOTELS GROU	14,491	106.950	1,549,812.45	
PEARSON PLC	46,942	13.550	636,064.10	
WHITBREAD PLC	16,522	26.780	442,459.16	
JD SPORTS FASHION PLC	251,482	0.858	215,771.55	
KINGFISHER PLC	179,593	2.564	460,476.45	
NEXT PLC	12,208	101.450	1,238,501.60	
MARKS & SPENCER GROUP PLC	180,525	3.585	647,182.12	
SAINSBURY (J) PLC	220,253	2.614	575,741.34	
TESCO PLC	623,187	3.970	2,474,052.39	
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	30,992	19.350	599,695.20	
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	178,083	30.250	5,387,010.75	
COCA-COLA HBC AG-DI	17,866	32.620	582,788.92	
DIAGEO PLC	206,442	21.515	4,441,599.63	
IMPERIAL BRANDS PLC	69,831	27.800	1,941,301.80	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	63,456	53.240	3,378,397.44	
UNILEVER PLC	226,556	43.800	9,923,152.80	
NMC HEALTH PLC	3,940	0.010	39.40	
SMITH & NEPHEW PLC	85,977	10.315	886,852.75	
ASTRAZENECA PLC	143,051	117.140	16,756,994.14	
GSK PLC	379,207	14.195	5,382,843.36	
HALEON PLC	820,026	3.940	3,230,902.44	
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	14,590	23.180	338,196.20	
BARCLAYS PLC	1,314,907	3.044	4,002,576.90	
HSBC HOLDINGS PLC	1,658,564	8.813	14,616,924.53	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	5,664,640	0.629	3,563,058.56	
NATWEST GROUP PLC	672,603	4.390	2,952,727.17	
STANDARD CHARTERED PLC	206,587	11.250	2,324,103.75	
3I GROUP PLC	88,975	41.310	3,675,557.25	
HARGREAVES LANSDOWN PLC	31,008	11.000	341,088.00	
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	44,339	117.250	5,198,747.75	
M&G PLC	217,201	2.128	462,203.72	
SCHRODERS PLC	61,711	3.848	237,463.92	
WISE PLC - A	66,680	10.910	727,478.80	
ADMIRAL GROUP PLC	19,808	28.590	566,310.72	
AVIVA PLC	217,835	5.108	1,112,701.18	
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	561,409	2.418	1,357,486.96	
PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	59,286	5.045	299,097.87	
PRUDENTIAL PLC	232,133	7.302	1,695,035.16	

	SAGE GROUP PLC/THE	90,085	13.245	1,193,175.82	
	HALMA PLC	32,277	29.490	951,848.73	
	BT GROUP PLC	540,623	1.515	819,043.84	
	VODAFONE GROUP PLC	1,981,261	0.654	1,295,744.69	
	CENTRICA PLC	527,715	1.363	719,275.54	
	NATIONAL GRID PLC	436,382	9.554	4,169,193.62	
	SEVERN TRENT PLC	20,117	24.730	497,493.41	
	SSE PLC	102,323	14.970	1,531,775.31	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	77,666	9.904	769,204.06	
	AUTO TRADER GROUP PLC	77,901	7.854	611,834.45	
	INFORMA PLC	130,979	8.960	1,173,571.84	
	WPP PLC	109,824	7.752	851,355.64	
イギリス・bond小計		24,907,134		186,985,375.06 (35,770,302,249)	
イスラエル・シュケル	ICL GROUP LTD	67,143	20.610	1,383,817.23	
	ELBIT SYSTEMS LTD	2,213	1,039.700	2,300,856.10	
	BANK HAPOLIM BM	127,980	48.000	6,143,040.00	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	135,088	46.710	6,309,960.48	
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	118,638	27.380	3,248,308.44	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	11,916	170.100	2,026,911.60	
	NICE LTD	4,458	620.300	2,765,297.40	
	AZRIELI GROUP LTD	3,527	301.900	1,064,801.30	
イスラエル・シュケル小計		470,963		25,242,992.55 (1,074,730,505)	
スイス・フラン	CLARIANT AG-REG	28,111	10.840	304,723.24	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	538	651.500	350,507.00	
	GIVAUDAN-REG	803	4,042.000	3,245,726.00	
	HOLCIM LTD	46,179	99.340	4,587,421.86	
	SIG GROUP AG	30,936	20.420	631,713.12	
	SIKA AG-REG	14,407	240.200	3,460,561.40	
	ABB LTD-REG	143,356	51.860	7,434,442.16	
	GEBERIT AG-REG	2,873	536.000	1,539,928.00	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	1,766	262.500	463,575.00	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	4,092	273.600	1,119,571.20	
	VAT GROUP AG	2,969	356.800	1,059,339.20	
	ADECCO GROUP AG-REG	14,810	22.020	326,116.20	
	SGS SA-REG	14,405	96.720	1,393,251.60	
	KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG	4,194	209.700	879,481.80	
	CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG	50,243	182.900	9,189,444.70	
	SWATCH GROUP AG/THE-BR	2,619	169.950	445,099.05	
	AVOLTA AG	8,656	42.040	363,898.24	
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	382	1,039.000	396,898.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	97	10,720.000	1,039,840.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	8	104,200.000	833,600.00	

	NESTLE SA-REG	242,311	82.420	19,971,272.62	
	ALCON INC	45,885	81.680	3,747,886.80	
	SONOVA HOLDING AG-REG	5,194	299.000	1,553,006.00	
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	11,159	128.850	1,437,837.15	
	BACHEM HOLDING AG	1,756	58.100	102,023.60	
	GALDERMA GROUP AG	8,231	114.500	942,449.50	
	LONZA GROUP AG-REG	6,471	601.800	3,894,247.80	
	NOVARTIS AG-REG	179,175	95.740	17,154,214.50	
	ROCHE HOLDING AG-BR	2,584	316.200	817,060.80	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	63,885	294.300	18,801,355.50	
	SANDOZ GROUP AG	38,614	42.940	1,658,085.16	
	BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	3,006	94.400	283,766.40	
	JULIUS BAER GROUP LTD	15,168	59.500	902,496.00	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	2,044	1,420.500	2,903,502.00	
	UBS GROUP AG-REG	300,233	30.430	9,136,090.19	
	BALOISE HOLDING AG - REG	3,909	168.800	659,839.20	
	HELVETIA HOLDING AG-REG	4,111	161.000	661,871.00	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	2,811	773.000	2,172,903.00	
	SWISS RE AG	27,559	140.900	3,883,063.10	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	13,449	567.800	7,636,342.20	
	TEMENOS AG - REG	7,049	78.800	555,461.20	
	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	13,555	94.180	1,276,609.90	
	SWISSCOM AG-REG	2,373	495.800	1,176,533.40	
	BKW AG	1,385	152.600	211,351.00	
	SWISS PRIME SITE-REG	7,190	107.600	773,644.00	
	スイス・フラン小計	1,380,551		141,378,049.79 (23,785,443,097)	
デンマーク・クローネ	NOVONESIS (NOVOZYMES) B	30,327	407.500	12,358,252.50	
	ROCKWOOL A/S-B SHS	849	2,846.000	2,416,254.00	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	86,250	96.820	8,350,725.00	
	AP MOLLER-MAERSK A/S-A	292	11,730.000	3,425,160.00	
	AP MOLLER-MAERSK A/S-B	412	12,000.000	4,944,000.00	
	DSV A/S	19,123	1,454.000	27,804,842.00	
	PANDORA A/S	7,823	1,257.500	9,837,422.50	
	CARLSBERG AS-B	8,080	845.200	6,829,216.00	
	COLOPLAST-B	10,365	793.800	8,227,737.00	
	DEMANT A/S	8,178	268.200	2,193,339.60	
	GENMAB A/S	6,634	1,509.500	10,014,023.00	
	NOVO NORDISK A/S-B	296,713	569.400	168,948,382.20	
	ZEALAND PHARMA A/S	5,299	772.000	4,090,828.00	
	DANSKE BANK A/S	59,312	232.000	13,760,384.00	
	TRYG A/S	35,873	150.500	5,398,886.50	
	ORSTED A/S	14,988	298.400	4,472,419.20	
	デンマーク・クローネ小計	590,518		293,071,871.50	

				(6,242,430,863)	
ノルウェー・クロネ	AKER BP ASA	27,948	237.100	6,626,470.80	
	EQUINOR ASA	77,381	252.650	19,550,309.65	
	NORSK HYDRO ASA	126,874	67.520	8,566,532.48	
	YARA INTERNATIONAL ASA	12,718	327.200	4,161,329.60	
	KONGSBERG GRUPPEN ASA	7,896	1,230.000	9,712,080.00	
	MOWI ASA	49,017	221.000	10,832,757.00	
	ORKLA ASA	63,195	108.000	6,825,060.00	
	SALMAR ASA	6,204	589.000	3,654,156.00	
	DNB BANK ASA	79,182	242.800	19,225,389.60	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	18,691	230.000	4,298,930.00	
	TELENOR ASA	60,262	138.600	8,352,313.20	
ノルウェー・クロネ小計		529,368		101,805,328.33 (1,389,642,732)	
スウェーデン・クロナ	BOLIDEN AB	27,135	388.400	10,539,234.00	
	HOLMEN AB-B SHARES	7,024	433.800	3,047,011.20	
	SVENSKA CELLULOSA AB SCA-B	45,662	153.000	6,986,286.00	
	ADDTECH AB-B SHARES	27,319	345.200	9,430,518.80	
	ALFA LAVAL AB	23,093	471.500	10,888,349.50	
	ASSA ABLOY AB-B	91,021	332.600	30,273,584.60	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	254,022	187.650	47,667,228.30	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	147,186	163.950	24,131,144.70	
	BEIJER REF AB	27,042	170.400	4,607,956.80	
	EPIROC AB-A	56,566	216.900	12,269,165.40	
	EPIROC AB-B	33,182	191.500	6,354,353.00	
	INDUTRADE AB	27,951	325.600	9,100,845.60	
	INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	19,067	306.700	5,847,848.90	
	LIFCO AB-B SHS	24,912	396.800	9,885,081.60	
	NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	109,274	42.770	4,673,648.98	
	SAAB AB-B	27,812	284.150	7,902,779.80	
	SANDVIK AB	102,321	238.500	24,403,558.50	
	SKANSKA AB-B SHS	26,915	257.700	6,935,995.50	
	SKF AB-B SHARES	31,715	234.900	7,449,853.50	
	TRELLEBORG AB-B SHS	21,827	430.800	9,403,071.60	
	VOLVO AB-A SHS	13,283	331.200	4,399,329.60	
	VOLVO AB-B SHS	150,503	331.100	49,831,543.30	
	SECURITAS AB-B SHS	41,010	156.800	6,430,368.00	
	EVOLUTION AB	14,444	848.800	12,260,067.20	
	HENNES & MAURITZ AB-B SHS	52,210	150.450	7,854,994.50	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	61,047	285.300	17,416,709.10	
	GETINGE AB-B SHS	21,124	212.300	4,484,625.20	
	SWEDISH ORPHAN BIOVITRUM AB	13,513	316.000	4,270,108.00	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	150,072	168.100	25,227,103.20	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	126,700	132.050	16,730,735.00	

	SWEDBANK AB - A SHARES	72,723	257.000	18,689,811.00	
	EQT AB	40,143	367.800	14,764,595.40	
	INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	10,598	409.600	4,340,940.80	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	14,289	408.700	5,839,914.30	
	INVESTOR AB-B SHS	155,801	324.050	50,487,314.05	
	LUNDBERGS AB-B SHS	6,081	555.500	3,377,995.50	
	ERICSSON LM-B SHS	253,908	85.120	21,612,648.96	
	HEXAGON AB-B SHS	207,482	129.850	26,941,537.70	
	TELE2 AB-B SHS	58,043	123.100	7,145,093.30	
	TELIA CO AB	187,675	33.870	6,356,552.25	
	FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	60,454	78.340	4,735,966.36	
	SAGAX AB-B	14,721	233.800	3,441,769.80	
	スウェーデン・クロナ小計	2,856,870		568,437,238.80 (8,060,440,046)	
ユーロ	ENI SPA	201,031	14.076	2,829,712.35	
	GALP ENERGIA SGPS SA	47,345	15.540	735,741.30	
	NESTE OYJ	49,566	9.654	478,510.16	
	OMV AG	10,860	40.800	443,088.00	
	REPSOL SA	119,400	12.120	1,447,128.00	
	TENARIS SA	41,201	18.760	772,930.76	
	TOTALENERGIES SE	197,702	58.900	11,644,647.80	
	AIR LIQUIDE SA	52,976	174.000	9,217,824.00	
	AKZO NOBEL N.V.	14,109	59.840	844,282.56	
	ARCELORMITTAL	45,707	27.870	1,273,854.09	
	ARKEMA	5,145	83.300	428,578.50	
	BASF SE	81,122	50.870	4,126,676.14	
	COVESTRO AG-TEND	19,192	59.200	1,136,166.40	
	DSM-FIRMENICH AG	18,403	106.050	1,951,638.15	
	EVONIK INDUSTRIES AG	17,669	19.695	347,990.95	
	HEIDELBERG MATERIALS AG	12,541	147.550	1,850,424.55	
	STORA ENSO OYJ-R SHS	47,758	11.205	535,128.39	
	SYENQO SA	6,353	83.460	530,221.38	
	SYMRISE AG	13,622	98.820	1,346,126.04	
	UPM-KYMMENE OYJ	50,585	29.740	1,504,397.90	
	ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	19,741	51.000	1,006,791.00	
	AIRBUS SE	53,661	170.500	9,149,200.50	
	ALSTOM	25,574	20.590	526,568.66	
	BOUYGUES SA	17,123	32.380	554,442.74	
	BRENNTAG SE	12,153	64.340	781,924.02	
	COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN	43,605	97.560	4,254,103.80	
	DAIMLER TRUCK HOLDING AG	44,374	42.930	1,904,975.82	
	DASSAULT AVIATION SA	1,720	233.000	400,760.00	
	EIFFAGE	6,641	90.760	602,737.16	
	FERROVIAL SE	42,157	43.180	1,820,339.26	

GEA GROUP AG	17,874	53.900	963,408.60	
IMCD NV	4,340	150.550	653,387.00	
KINGSPAN GROUP PLC	13,412	69.000	925,428.00	
KNORR-BREMSE AG	7,217	80.750	582,772.75	
KONE OYJ-B	30,595	53.320	1,631,325.40	
LEGRAND SA	23,046	107.600	2,479,749.60	
LEONARDO SPA	35,486	34.260	1,215,750.36	
METSO CORP	50,483	10.860	548,245.38	
MTU AERO ENGINES AG	4,961	342.000	1,696,662.00	
PRYSMIAN SPA	24,541	68.980	1,692,838.18	
RATIONAL AG	350	862.500	301,875.00	
REXEL SA	23,491	26.550	623,686.05	
RHEINMETALL AG	3,996	931.600	3,722,673.60	
SAFRAN SA	32,618	252.100	8,222,997.80	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	50,273	245.950	12,364,644.35	
SIEMENS AG-REG	68,981	227.000	15,658,687.00	
SIEMENS ENERGY AG	62,072	63.600	3,947,779.20	
THALES SA	8,928	178.300	1,591,862.40	
VINCI SA	46,788	109.200	5,109,249.60	
WARTSILA OYJ ABP	45,125	18.310	826,238.75	
BUREAU VERITAS SA	30,794	31.040	955,845.76	
RANDSTAD NV	8,946	38.400	343,526.40	
TELEPERFORMANCE	4,299	100.800	433,339.20	
WOLTERS KLUWER	22,774	178.300	4,060,604.20	
ADP	3,679	117.300	431,546.70	
AENA SME SA	5,921	219.000	1,296,699.00	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	50,885	6.748	343,371.98	
DHL GROUP	90,860	36.860	3,349,099.60	
GETLINK SE	30,428	15.905	483,957.34	
INPOST SA	24,153	17.140	413,982.42	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	27,028	84.080	2,272,514.24	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF	6,498	78.800	512,042.40	
CONTINENTAL AG	12,741	69.880	890,341.08	
DR ING HC F PORSCHE AG	8,498	57.840	491,524.32	
FERRARI NV	11,346	487.900	5,535,713.40	
MERCEDES-BENZ GROUP AG	66,276	61.500	4,075,974.00	
MICHELIN (CGDE)	59,151	33.600	1,987,473.60	
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF	14,142	38.060	538,244.52	
RENAULT SA	14,764	52.360	773,043.04	
STELLANTIS NV	190,785	13.432	2,562,624.12	
VOLKSWAGEN AG-PREF	19,688	100.400	1,976,675.20	
ADIDAS AG	15,367	259.800	3,992,346.60	
HERMES INTERNATIONAL	2,970	2,809.000	8,342,730.00	
KERING	6,767	280.100	1,895,436.70	

LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	25,459	701.500	17,859,488.50	
MONCLER SPA	19,596	65.660	1,286,673.36	
PUMA SE	9,601	29.720	285,341.72	
SEB SA	3,786	91.000	344,526.00	
ACCOR SA	16,469	50.140	825,755.66	
AMADEUS IT GROUP SA	40,884	71.940	2,941,194.96	
DELIVERY HERO SE	13,293	32.350	430,028.55	
LA FRANCAISE DES JEUX SACA	5,785	37.140	214,854.90	
SODEXO SA	6,960	72.900	507,384.00	
D'IETEREN GROUP	1,244	162.300	201,901.20	
INDUSTRIA DE DISEÑO TEXTIL	100,439	55.080	5,532,180.12	
PROSUS NV	123,303	44.495	5,486,366.98	
ZALANDO SE	17,418	39.860	694,281.48	
CARREFOUR SA	49,914	13.970	697,298.58	
JERONIMO MARTINS	25,491	19.670	501,407.97	
KESKO OYJ-B SHS	20,250	17.945	363,386.25	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	85,144	34.300	2,920,439.20	
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	82,988	50.720	4,209,151.36	
DANONE	60,824	68.020	4,137,248.48	
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	48,521	5.346	259,393.26	
HEINEKEN HOLDING NV	10,567	68.850	727,537.95	
HEINEKEN NV	25,241	79.060	1,995,553.46	
JDE PEET'S NV	13,317	16.980	226,122.66	
KERRY GROUP PLC-A	13,493	98.400	1,327,711.20	
LOTUS BAKERIES	42	9,260.000	388,920.00	
PERNOD RICARD SA	17,848	99.720	1,779,802.56	
BEIERSDORF AG	8,764	127.200	1,114,780.80	
HENKEL AG & CO KGAA	8,714	74.400	648,321.60	
HENKEL AG & CO KGAA VOR-PREF	15,381	84.920	1,306,154.52	
L'OREAL	22,001	343.000	7,546,343.00	
AMPLIFON SPA	10,123	26.290	266,133.67	
BIOMERIEUX	2,791	115.500	322,360.50	
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	3,583	55.100	197,423.30	
DIASORIN SPA	1,313	100.550	132,022.15	
ESSILORLUXOTTICA	27,954	294.100	8,221,271.40	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG	17,125	45.130	772,851.25	
FRESENIUS SE & CO KGAA	41,370	37.270	1,541,859.90	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	71,360	27.000	1,926,720.00	
SIEMENS HEALTHINEERS AG	23,498	57.420	1,349,255.16	
ARGENX SE	5,529	614.600	3,398,123.40	
BAYER AG-REG	97,644	21.395	2,089,093.38	
EUROFINS SCIENTIFIC	14,665	49.640	727,970.60	
GRIFOLS SA	15,169	9.454	143,407.72	
IPSEN	3,380	111.800	377,884.00	

MERCK KGAA	11,293	135.450	1,529,636.85	
ORION OYJ-CLASS B	10,542	51.840	546,497.28	
QIAGEN N.V.	20,369	38.265	779,419.78	
RECORDATI INDUSTRIA CHIMICA	12,539	59.750	749,205.25	
SANOFI	104,609	104.040	10,883,520.36	
SARTORIUS AG-VORZUG	2,164	244.900	529,963.60	
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	2,207	208.600	460,380.20	
UCB SA	11,200	182.250	2,041,200.00	
ABN AMRO BANK NV-CVA	43,340	16.915	733,096.10	
AIB GROUP PLC	196,550	6.175	1,213,696.25	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	514,281	12.195	6,271,656.79	
BANCO BPM SPA	108,163	8.812	953,132.35	
BANCO DE SABADELL SA	515,705	2.485	1,281,526.92	
BANCO SANTANDER SA	1,432,545	5.810	8,323,086.45	
BANK OF IRELAND GROUP PLC	87,661	9.776	856,973.93	
BNP PARIBAS	94,708	69.830	6,613,459.64	
BPER BANCA SPA	93,906	6.612	620,906.47	
CAIXABANK SA	398,379	6.380	2,541,658.02	
COMMERZBANK AG	82,105	19.470	1,598,584.35	
CREDIT AGRICOLE SA	90,899	15.335	1,393,936.16	
ERSTE GROUP BANK AG	32,991	67.500	2,226,892.50	
FINECOBANK SPA	60,333	18.000	1,085,994.00	
ING GROEP NV	297,353	16.386	4,872,426.25	
INTESA SANPAOLO	1,312,161	4.469	5,864,047.50	
KBC GROUP NV	20,304	82.000	1,664,928.00	
MEDIOBANCA SPA	47,708	16.665	795,053.82	
NORDEA BANK ABP	289,012	12.130	3,505,715.56	
SOCIETE GENERALE SA	68,477	36.995	2,533,306.61	
UNICREDIT SPA	134,978	47.610	6,426,302.58	
ADYEN NV	2,001	1,841.200	3,684,241.20	
AMUNDI SA	3,955	69.250	273,883.75	
CVC CAPITAL PARTNERS PLC	21,438	23.200	497,361.60	
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	175,203	19.692	3,450,097.47	
DEUTSCHE BOERSE AG	17,252	245.200	4,230,190.40	
EDENRED	20,297	33.770	685,429.69	
EURAZEO SE	3,897	80.400	313,318.80	
EURONEXT NV	7,818	117.600	919,396.80	
EXOR NV	8,669	96.450	836,125.05	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT NV	7,933	68.450	543,013.85	
NEXI SPA	57,060	4.785	273,032.10	
SOFINA	1,314	234.000	307,476.00	
AEGON LTD	127,748	6.350	811,199.80	
AGEAS	15,700	50.450	792,065.00	
ALLIANZ SE-REG	35,861	327.400	11,740,891.40	

ASR NEDERLAND NV	14,593	48.280	704,550.04	
AXA SA	158,098	37.590	5,942,903.82	
GENERALI	88,834	32.280	2,867,561.52	
HANNOVER RUECK SE	5,315	254.900	1,354,793.50	
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	12,394	532.800	6,603,523.20	
NN GROUP NV	26,955	45.000	1,212,975.00	
POSTE ITALIANE SPA	34,720	14.830	514,897.60	
SAMPO OYJ-A SHS	209,065	8.046	1,682,136.99	
TALANX AG	5,345	86.500	462,342.50	
UNIPOL ASSICURAZIONI SPA	49,021	14.300	701,000.30	
BECHTLE AG	8,953	34.460	308,520.38	
CAPGEMINI SE	13,512	185.450	2,505,800.40	
DASSAULT SYSTEMES SE	57,951	40.400	2,341,220.40	
NEMETSCHKE SE	5,941	123.800	735,495.80	
SAP SE	95,669	280.100	26,796,886.90	
NOKIA OYJ	498,412	4.794	2,389,387.12	
ASM INTERNATIONAL NV	4,006	577.400	2,313,064.40	
ASML HOLDING NV	36,764	727.800	26,756,839.20	
BE SEMICONDUCTOR INDUSTRIES	6,286	119.050	748,348.30	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	117,552	37.920	4,457,571.84	
STMICROELECTRONICS NV	67,591	23.215	1,569,125.06	
CELLNEX TELECOM SA	44,410	31.240	1,387,368.40	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	317,697	34.040	10,814,405.88	
ELISA OYJ	15,579	43.040	670,520.16	
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	28,190	9.490	267,523.10	
KONINKLIJKE KPN NV	367,935	3.466	1,275,262.71	
ORANGE	153,827	10.930	1,681,329.11	
TELECOM ITALIA SPA	1,266,466	0.273	345,745.21	
TELEFONICA SA	375,409	4.144	1,555,694.89	
ACCIONA SA	1,810	109.500	198,195.00	
E.ON SE	196,435	11.525	2,263,913.37	
EDP RENOVAVEIS SA	27,294	8.635	235,683.69	
EDP SA	267,744	2.907	778,331.80	
ELIA GROUP SA/NV	3,348	63.850	213,769.80	
ENDESA SA	25,535	21.470	548,236.45	
ENEL SPA	750,963	6.834	5,132,081.14	
ENGIE	165,196	15.590	2,575,405.64	
FORTUM OYJ	42,339	14.450	611,798.55	
IBERDROLA SA	576,976	13.365	7,711,284.24	
REDEIA CORP SA	34,539	16.530	570,929.67	
RWE AG	58,449	28.470	1,664,043.03	
SNAM SPA	168,809	4.421	746,304.58	
TERNA-RETE ELETTRICA NAZIONALE	139,628	7.814	1,091,053.19	
VEOLIA ENVIRONNEMENT	70,962	27.710	1,966,357.02	

	VERBUND AG	5,841	70.550	412,082.55	
	BOLLORE SE	69,288	5.835	404,295.48	
	CTS EVENTIM AG & CO KGAA	6,099	100.400	612,339.60	
	PUBLICIS GROUPE	20,799	106.150	2,207,813.85	
	SCOUT24 SE	6,149	95.400	586,614.60	
	UNIVERSAL MUSIC GROUP NV	78,956	28.730	2,268,405.88	
	LEG IMMOBILIEN SE	7,909	77.280	611,207.52	
	VONOVIA SE	68,250	29.090	1,985,392.50	
ユーロ小計		17,313,050		520,007,013.29 (82,613,514,201)	
合 計		100,618,957		950,152,996,994 (950,152,996,994)	

（注）金額欄の（ ）内は、外貨建の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	569銘柄	74.8%	77.6%
カナダ・ドル	株式	83銘柄	3.1%	3.2%
オーストラリア・ドル	株式	46銘柄	1.6%	1.7%
香港・ドル	株式	22銘柄	0.4%	0.4%
シンガポール・ドル	株式	13銘柄	0.3%	0.3%
ニュージーランド・ドル	株式	5銘柄	0.0%	0.0%
イギリス・ポンド	株式	77銘柄	3.6%	3.8%
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	2.4%	2.5%
デンマーク・クローネ	株式	16銘柄	0.6%	0.7%
ノルウェー・クローネ	株式	11銘柄	0.1%	0.1%
スウェーデン・クローナ	株式	42銘柄	0.8%	0.8%
ユーロ	株式	214銘柄	8.4%	8.7%

(b) 株式以外の有価証券

種 類	通 貨	銘 柄	券面総額	評価額	備考
新株予約権証券	カナダ・ドル	CONSTELLATION SOFTWARE INC-CW40	1,480.00	-	
	カナダ・ドル小計		1,480.00	- (-)	
新株予約権証券合計				- (-)	
投資証券	アメリカ・ドル	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	13,343.00	1,265,583.55	
		AMERICAN HOMES 4 RENT- A	26,290.00	926,459.60	
		AMERICAN TOWER CORP	42,567.00	8,061,338.46	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	47,203.00	1,002,119.69	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	13,579.00	2,964,974.65	
		BXP INC	13,802.00	978,285.76	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	10,720.00	1,276,430.40	
		CROWN CASTLE INC	39,800.00	3,500,808.00	

	DIGITAL REALTY TRUST INC	29,656.00	4,871,887.68	
	EQUINIX INC	8,733.00	8,153,128.80	
	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	14,256.00	932,627.52	
	EQUITY RESIDENTIAL	29,734.00	2,117,952.82	
	ESSEX PROPERTY TRUST INC	5,455.00	1,573,058.35	
	EXTRA SPACE STORAGE INC	20,142.00	3,120,398.64	
	GAMING AND LEISURE PROPERTIE	22,625.00	1,099,801.25	
	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	65,292.00	1,279,070.28	
	HOST HOTELS & RESORTS INC	59,277.00	971,550.03	
	INVITATION HOMES INC	55,309.00	1,738,361.87	
	IRON MOUNTAIN INC	26,844.00	2,561,186.04	
	KIMCO REALTY CORP	57,934.00	1,262,961.20	
	MID-AMERICA APARTMENT COMM	11,954.00	1,876,778.00	
	PROLOGIS INC	84,920.00	10,262,582.00	
	PUBLIC STORAGE	13,973.00	4,155,570.20	
	REALTY INCOME CORP	76,815.00	4,185,649.35	
	REGENCY CENTERS CORP	17,959.00	1,299,154.06	
	SBA COMMUNICATIONS CORP	10,393.00	2,134,410.41	
	SIMON PROPERTY GROUP INC	30,345.00	5,615,342.25	
	SUN COMMUNITIES INC	12,887.00	1,610,746.13	
	UDR INC	27,406.00	1,177,087.70	
	VENTAS INC	41,109.00	2,734,981.77	
	VICI PROPERTIES INC	96,070.00	2,917,645.90	
	WELLTOWER INC	55,522.00	8,326,634.34	
	WEYERHAEUSER CO	65,282.00	1,933,000.02	
	WP CAREY INC	23,349.00	1,370,352.81	
	アメリカ・ドル小計	1,170,545.00	99,257,919.53 (15,054,448,655)	
カナダ・ドル	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	8,170.00	331,947.10	
	カナダ・ドル小計	8,170.00	331,947.10 (35,471,867)	
オーストラリア・ドル	APA GROUP	108,912.00	731,888.64	
	GOODMAN GROUP	161,517.00	5,690,243.91	
	GPT GROUP	159,776.00	776,511.36	
	MIRVAC GROUP	326,863.00	725,635.86	
	SCENTRE GROUP	452,086.00	1,681,759.92	
	STOCKLAND	193,824.00	1,048,587.84	
	TRANSURBAN GROUP	291,488.00	3,914,683.84	
	VICINITY CENTRES	372,431.00	852,866.99	
	オーストラリア・ドル小計	2,066,897.00	15,422,178.36 (1,484,847,334)	
香港・ドル	HKT TRUST AND HKT LTD-SS	437,000.00	4,252,010.00	
	LINK REIT	238,500.00	8,275,950.00	

香港・ドル小計		675,500.00	12,527,960.00 (244,169,940)	
シンガポール・ドル	CAPITALAND ASCENDAS REIT	322,200.00	828,054.00	
	CAPITALAND INTEGRATED COMMER	588,116.00	1,164,469.68	
シンガポール・ドル小計		910,316.00	1,992,523.68 (225,195,026)	
イギリス・ ポンド	LAND SECURITIES GROUP PLC	59,857.00	351,659.87	
	SEGRO PLC	115,483.00	827,320.21	
イギリス・ポンド小計		175,340.00	1,178,980.08 (225,538,889)	
ユーロ	COVIVIO	7,110.00	358,699.50	
	GECINA SA	3,082.00	287,242.40	
	KLEPIERRE	18,172.00	542,979.36	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	12,610.00	1,008,800.00	
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	19,881.00	421,477.20	
ユーロ小計		60,855.00	2,619,198.46 (416,112,059)	
投資証券合計			17,685,783,771 (17,685,783,771)	
合 計			17,685,783,771 (17,685,783,771)	

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

通 貨	銘柄数		組入 新株予約権証券 時価比率	組入 投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカ・ドル	投資証券	34銘柄	-	1.5%	85.1%
カナダ・ドル	新株予約権証券	1銘柄	-	-	-
	投資証券	1銘柄	-	0.0%	0.2%
オーストラリア・ドル	投資証券	8銘柄	-	0.2%	8.4%
香港・ドル	投資証券	2銘柄	-	0.0%	1.4%
シンガポール・ドル	投資証券	2銘柄	-	0.0%	1.3%
イギリス・ポンド	投資証券	2銘柄	-	0.0%	1.3%
ユーロ	投資証券	5銘柄	-	0.0%	2.4%

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

外国債券パッシブ・マザーファンド

（１）貸借対照表

（単位：円）

（2025年2月18日現在）

資産の部

流動資産

預金

294,047,327

金銭信託

12,842,585

コール・ローン

1,554,167,195

国債証券	196,387,160,307
未収利息	1,811,034,319
前払費用	195,380,494
流動資産合計	200,254,632,227
資産合計	200,254,632,227
負債の部	
流動負債	
未払解約金	14,573,632
流動負債合計	14,573,632
負債合計	14,573,632
純資産の部	
元本等	
元本	86,893,730,348
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	113,346,328,247
元本等合計	200,240,058,595
純資産合計	200,240,058,595
負債純資産合計	200,254,632,227

(２) 注記表

(重要な会計方針の注記)

項 目	自 2024年2月20日 至 2025年2月18日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券は個別法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。 (1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。 (2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。 (3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。
3. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	外貨建資産等の会計処理 「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。

(重要な会計上の見積りに関する注記)

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

（貸借対照表に関する注記）

項 目	（ 2025年2月18日現在 ）
1 . 当計算期間の末日における 受益権の総数	86,893,730,348口
2 . 1 単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 2.3044円 （ 1 万口当たりの純資産額23,044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 2024年2月20日 至 2025年2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。

３． 金融商品に係るリスク管理体制	リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する会議をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。 また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、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。 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。
--------------------------	--

．金融商品の時価等に関する事項

項 目	(2025年2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。 (2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。
３． 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

自 2024年2月20日 至 2025年2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）

（2025年2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	80,415,247,995円
同期中における追加設定元本額	17,559,152,174円
同期中における一部解約元本額	11,080,669,821円
2025年2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	30,551,304,714円
三井住友・ＤＣ年金バランス３０（債券重点型）	1,021,544,125円
三井住友・ＤＣ年金バランス５０（標準型）	2,599,103,841円
三井住友・ＤＣ年金バランス７０（株式重点型）	1,598,315,394円
ＳＭＡＭ・グローバルバランスファンド（機動的資産配分型）	167,901,339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）	5,480,477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）	21,529,829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）	67,085,965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）	235,343,913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）	200,942,892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）	339,250,415円
三井住友・ＤＣ年金バランスゼロ（債券型）	16,455,586円
アセットアロケーション・ファンド（安定型）	75,787,774円
アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）	123,753,800円
アセットアロケーション・ファンド（成長型）	74,708,507円
イオン・バランス戦略ファンド	104,744,666円
三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０５０	69,414,516円
三井住友・資産最適化ファンド（１安定重視型）	408,906,182円
三井住友・資産最適化ファンド（２やや安定型）	294,005,105円
三井住友・資産最適化ファンド（３バランス型）	874,374,163円
三井住友・資産最適化ファンド（４やや成長型）	288,696,684円
三井住友・資産最適化ファンド（５成長重視型）	161,945,234円
三井住友・ＤＣつみたてＮＩＳＡ・世界分散ファンド	332,721,926円
三井住友ＤＳ・外国債券インデックス年金ファンド	1,581,854,517円
三井住友ＤＳ・年金バランス３０（債券重点型）	47,324,115円
三井住友ＤＳ・年金バランス５０（標準型）	164,844,435円
三井住友ＤＳ・年金バランス７０（株式重点型）	131,776,316円
三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０６０	16,595,122円
日興ＦＷＳ・先進国債インデックス（為替ヘッジなし）	4,936,801,556円
三井住友ＤＳ・先進国債インデックス・ファンド	256,171,508円
三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０３５	37,650,743円
三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０４０	24,078,901円
三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０４５	23,959,098円

三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０５５	16,848,493円
三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０６５	13,909,606円
三井住友ＤＳ・ＦＷ専用ポートフォリオ・レベル１（保守型）	1,439,574円
三井住友ＤＳ・ＦＷ専用ポートフォリオ・レベル２（安定型）	4,975,464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）	26,019,480円
三井住友ＤＳ・ＦＷ専用ポートフォリオ・レベル４（成長型）	25,816,432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）	9,517,490円
三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０７０	188,688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＞	7,315,147,428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＞	16,637,845円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ２５＜適格機関投資家専用＞	2,806,277,031円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ３７．５＜適格機関投資家専用＞	3,229,177,888円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ５０＜適格機関投資家専用＞	7,963,032,582円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＬ３０＜適格機関投資家限定＞	23,930,035円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＬ５０＜適格機関投資家限定＞	61,137,390円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ７５＜適格機関投資家専用＞	651,010,516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＞	93,052,590円
ＳＭＡＭ・インデックス・バランスＶＡ２５＜適格機関投資家専用＞	757,803,461円
ＳＭＡＭ・インデックス・バランスＶＡ５０＜適格機関投資家専用＞	1,156,935,664円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ４０＜適格機関投資家専用＞	1,054,585,024円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ３５＜適格機関投資家専用＞	3,069,199,264円
ＳＭＡＭ・外国債券パッシブファンドＶＡ＜適格機関投資家限定＞	5,341,797,043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）	266,145,167円
ＳＭＡＭ・グローバルバランス４０ＶＡ＜適格機関投資家限定＞	88,837,191円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２０Ａ＜適格機関投資家専用＞	44,246,886円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ３５Ａ＜適格機関投資家専用＞	20,041,970円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ５０Ａ＜適格機関投資家専用＞	11,816,161円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２０Ｌ＜適格機関投資家専用＞	51,258,216円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２５Ｌ＜適格機関投資家専用＞	284,559,928円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２０Ａ２＜適格機関投資家専用＞	56,681,997円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ３５Ａ２＜適格機関投資家専用＞	31,870,269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＞	652,041,108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＞	420,114,916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＞	548,829,995円
ＳＭＡＭ・世界バランスファンドＶＡ＜適格機関投資家限定＞	208,618,455円
ＳＭＡＭ・世界バランスファンドＶＡ２＜適格機関投資家限定＞	173,684,278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＞	192,672,981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＞	106,239,848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＞	164,079,614円
ＳＭＡＭ・マルチアセット・ダイナミックアロケーション・ストラテジー・ファンド ＜適格機関投資家限定＞	2,761,472,182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＞	311,983,310円
合 計	86,893,730,348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 0.375 01/31/26	2,500,000.00	2,409,725.00	
		T 0.375 07/31/27	900,000.00	819,279.00	
		T 0.375 09/30/27	1,000,000.00	904,680.00	
		T 0.5 04/30/27	1,200,000.00	1,106,052.00	
		T 0.5 05/31/27	2,500,000.00	2,297,250.00	
		T 0.5 06/30/27	2,600,000.00	2,382,042.00	
		T 0.5 08/31/27	1,800,000.00	1,638,738.00	
		T 0.5 10/31/27	950,000.00	859,370.00	
		T 0.625 03/31/27	2,400,000.00	2,225,232.00	
		T 0.625 05/15/30	5,000,000.00	4,134,550.00	
		T 0.625 07/31/26	800,000.00	759,416.00	
		T 0.625 08/15/30	4,800,000.00	3,932,016.00	
		T 0.625 11/30/27	3,400,000.00	3,077,374.00	
		T 0.625 12/31/27	3,100,000.00	2,797,502.00	
		T 0.75 01/31/28	4,200,000.00	3,792,768.00	
		T 0.75 04/30/26	1,500,000.00	1,438,740.00	
		T 0.75 05/31/26	2,000,000.00	1,912,800.00	
		T 0.75 08/31/26	1,500,000.00	1,422,360.00	
		T 0.875 06/30/26	2,000,000.00	1,910,700.00	
		T 0.875 09/30/26	2,500,000.00	2,368,700.00	
		T 0.875 11/15/30	4,900,000.00	4,041,912.00	
		T 1 07/31/28	2,900,000.00	2,596,225.00	
		T 1.125 02/15/31	5,700,000.00	4,740,120.00	
		T 1.125 02/28/27	2,000,000.00	1,879,440.00	
		T 1.125 05/15/40	2,250,000.00	1,386,562.50	
		T 1.125 08/15/40	3,100,000.00	1,892,023.00	
		T 1.125 08/31/28	3,500,000.00	3,138,485.00	
		T 1.125 10/31/26	3,700,000.00	3,511,004.00	
		T 1.25 05/15/50	3,100,000.00	1,503,066.00	
		T 1.25 05/31/28	3,000,000.00	2,723,250.00	
		T 1.25 06/30/28	3,000,000.00	2,716,230.00	
		T 1.25 08/15/31	5,200,000.00	4,282,876.00	
		T 1.25 09/30/28	3,000,000.00	2,695,590.00	
		T 1.25 11/30/26	4,200,000.00	3,984,666.00	
		T 1.25 12/31/26	2,600,000.00	2,460,744.00	
		T 1.375 08/15/50	4,500,000.00	2,242,665.00	
		T 1.375 08/31/26	600,000.00	574,590.00	
		T 1.375 10/31/28	3,000,000.00	2,701,380.00	

T 1.375 11/15/31	4,900,000.00	4,041,030.00	
T 1.375 11/15/40	3,500,000.00	2,215,640.00	
T 1.375 12/31/28	1,000,000.00	896,250.00	
T 1.5 01/31/27	3,400,000.00	3,225,614.00	
T 1.5 02/15/30	2,100,000.00	1,834,623.00	
T 1.5 11/30/28	4,500,000.00	4,061,745.00	
T 1.625 02/15/26	2,900,000.00	2,824,890.00	
T 1.625 05/15/26	11,450,000.00	11,087,378.50	
T 1.625 05/15/31	5,500,000.00	4,677,530.00	
T 1.625 08/15/29	6,250,000.00	5,574,562.50	
T 1.625 09/30/26	900,000.00	863,469.00	
T 1.625 11/15/50	3,200,000.00	1,705,312.00	
T 1.625 11/30/26	200,000.00	191,038.00	
T 1.75 01/31/29	3,300,000.00	2,994,915.00	
T 1.75 08/15/41	3,400,000.00	2,249,032.00	
T 1.75 11/15/29	1,300,000.00	1,159,301.00	
T 1.75 12/31/26	2,500,000.00	2,389,150.00	
T 1.875 02/15/32	4,700,000.00	3,988,561.00	
T 1.875 02/15/41	3,300,000.00	2,259,972.00	
T 1.875 02/15/51	3,800,000.00	2,158,856.00	
T 1.875 02/28/27	3,400,000.00	3,243,532.00	
T 1.875 02/28/29	2,800,000.00	2,548,924.00	
T 1.875 07/31/26	2,500,000.00	2,416,975.00	
T 1.875 11/15/51	3,300,000.00	1,859,451.00	
T 2 02/15/50	2,800,000.00	1,659,980.00	
T 2 08/15/51	2,900,000.00	1,692,179.00	
T 2 11/15/26	1,000,000.00	962,220.00	
T 2 11/15/41	2,800,000.00	1,920,324.00	
T 2.25 02/15/27	4,400,000.00	4,232,052.00	
T 2.25 02/15/52	1,700,000.00	1,051,195.00	
T 2.25 03/31/26	8,200,000.00	8,020,420.00	
T 2.25 05/15/41	3,000,000.00	2,172,630.00	
T 2.25 08/15/27	2,200,000.00	2,096,270.00	
T 2.25 08/15/46	1,950,000.00	1,285,381.50	
T 2.25 08/15/49	1,500,000.00	948,390.00	
T 2.25 11/15/27	1,900,000.00	1,801,352.00	
T 2.375 02/15/42	2,800,000.00	2,031,960.00	
T 2.375 03/31/29	5,000,000.00	4,635,600.00	
T 2.375 05/15/27	3,000,000.00	2,879,760.00	
T 2.375 05/15/29	2,400,000.00	2,220,600.00	
T 2.375 05/15/51	3,900,000.00	2,501,148.00	
T 2.375 11/15/49	1,900,000.00	1,232,245.00	
T 2.5 02/15/45	1,400,000.00	989,898.00	
T 2.5 02/15/46	1,000,000.00	697,610.00	

T 2.5 02/28/26	2,100,000.00	2,062,305.00	
T 2.5 03/31/27	3,000,000.00	2,894,700.00	
T 2.5 05/15/46	1,000,000.00	694,760.00	
T 2.625 01/31/26	2,200,000.00	2,166,208.00	
T 2.625 02/15/29	1,800,000.00	1,688,940.00	
T 2.625 05/31/27	4,800,000.00	4,629,648.00	
T 2.625 07/31/29	1,100,000.00	1,024,606.00	
T 2.75 02/15/28	5,300,000.00	5,073,478.00	
T 2.75 04/30/27	1,600,000.00	1,549,744.00	
T 2.75 05/31/29	1,400,000.00	1,314,222.00	
T 2.75 07/31/27	2,400,000.00	2,315,904.00	
T 2.75 08/15/32	4,200,000.00	3,756,270.00	
T 2.75 08/15/42	1,000,000.00	764,880.00	
T 2.75 08/15/47	1,800,000.00	1,291,428.00	
T 2.75 11/15/42	300,000.00	228,384.00	
T 2.75 11/15/47	1,500,000.00	1,073,550.00	
T 2.875 04/30/29	3,500,000.00	3,306,590.00	
T 2.875 05/15/28	3,500,000.00	3,350,340.00	
T 2.875 05/15/32	5,700,000.00	5,160,267.00	
T 2.875 05/15/43	1,200,000.00	925,500.00	
T 2.875 05/15/49	1,400,000.00	1,012,074.00	
T 2.875 05/15/52	3,200,000.00	2,277,856.00	
T 2.875 08/15/28	4,500,000.00	4,292,820.00	
T 2.875 08/15/45	800,000.00	601,120.00	
T 2.875 11/15/46	1,000,000.00	740,700.00	
T 3 02/15/47	1,500,000.00	1,133,310.00	
T 3 02/15/48	2,400,000.00	1,795,680.00	
T 3 02/15/49	2,300,000.00	1,706,485.00	
T 3 05/15/42	800,000.00	638,592.00	
T 3 05/15/45	900,000.00	692,469.00	
T 3 05/15/47	1,700,000.00	1,281,375.00	
T 3 08/15/48	2,000,000.00	1,489,280.00	
T 3 08/15/52	3,000,000.00	2,191,170.00	
T 3 11/15/44	1,000,000.00	772,920.00	
T 3 11/15/45	800,000.00	612,744.00	
T 3.125 02/15/42	1,000,000.00	815,890.00	
T 3.125 02/15/43	1,800,000.00	1,446,948.00	
T 3.125 05/15/48	2,400,000.00	1,832,712.00	
T 3.125 08/15/44	700,000.00	553,651.00	
T 3.125 08/31/27	2,200,000.00	2,139,830.00	
T 3.125 08/31/29	2,700,000.00	2,566,836.00	
T 3.125 11/15/28	2,900,000.00	2,781,448.00	
T 3.125 11/15/41	1,000,000.00	818,670.00	
T 3.25 05/15/42	2,200,000.00	1,821,182.00	

T 3.25 06/30/27	2,300,000.00	2,248,917.00	
T 3.25 06/30/29	3,000,000.00	2,871,540.00	
T 3.375 05/15/33	5,500,000.00	5,097,455.00	
T 3.375 05/15/44	500,000.00	412,440.00	
T 3.375 08/15/42	2,000,000.00	1,680,220.00	
T 3.375 09/15/27	2,500,000.00	2,445,875.00	
T 3.375 11/15/48	3,100,000.00	2,467,693.00	
T 3.5 01/31/28	1,000,000.00	978,630.00	
T 3.5 01/31/30	2,500,000.00	2,406,200.00	
T 3.5 02/15/33	4,200,000.00	3,938,214.00	
T 3.5 02/15/39	200,000.00	178,296.00	
T 3.5 04/30/28	3,000,000.00	2,929,920.00	
T 3.5 04/30/30	2,500,000.00	2,401,100.00	
T 3.5 09/30/29	3,100,000.00	2,992,523.00	
T 3.625 02/15/44	300,000.00	257,505.00	
T 3.625 02/15/53	2,700,000.00	2,232,117.00	
T 3.625 03/31/28	3,000,000.00	2,943,450.00	
T 3.625 03/31/30	1,200,000.00	1,160,124.00	
T 3.625 05/15/26	2,500,000.00	2,480,175.00	
T 3.625 05/15/53	2,900,000.00	2,397,807.00	
T 3.625 05/31/28	2,000,000.00	1,959,320.00	
T 3.625 08/15/43	500,000.00	430,835.00	
T 3.625 08/31/29	2,500,000.00	2,428,150.00	
T 3.625 09/30/31	2,000,000.00	1,911,700.00	
T 3.75 04/15/26	3,300,000.00	3,280,134.00	
T 3.75 05/31/30	3,000,000.00	2,914,140.00	
T 3.75 06/30/30	4,400,000.00	4,271,740.00	
T 3.75 08/15/27	2,500,000.00	2,469,525.00	
T 3.75 08/15/41	1,100,000.00	983,125.00	
T 3.75 08/31/31	2,800,000.00	2,697,380.00	
T 3.75 11/15/43	700,000.00	612,962.00	
T 3.75 12/31/28	1,000,000.00	979,860.00	
T 3.75 12/31/30	2,400,000.00	2,322,360.00	
T 3.875 02/15/43	2,600,000.00	2,332,382.00	
T 3.875 05/15/43	2,200,000.00	1,969,066.00	
T 3.875 08/15/33	5,000,000.00	4,798,400.00	
T 3.875 08/15/34	6,870,000.00	6,553,842.60	
T 3.875 08/15/40	500,000.00	457,360.00	
T 3.875 09/30/29	2,300,000.00	2,255,656.00	
T 3.875 10/15/27	2,800,000.00	2,772,196.00	
T 3.875 11/30/27	1,800,000.00	1,781,118.00	
T 3.875 11/30/29	1,900,000.00	1,861,962.00	
T 3.875 12/31/27	2,200,000.00	2,176,922.00	
T 3.875 12/31/29	1,500,000.00	1,468,995.00	

T 4 01/15/27	4,900,000.00	4,876,137.00	
T 4 01/31/29	4,100,000.00	4,052,563.00	
T 4 02/15/26	2,000,000.00	1,994,500.00	
T 4 02/15/34	5,100,000.00	4,926,039.00	
T 4 02/28/30	1,500,000.00	1,476,465.00	
T 4 02/29/28	5,000,000.00	4,960,150.00	
T 4 06/30/28	3,000,000.00	2,972,610.00	
T 4 07/31/29	2,500,000.00	2,466,975.00	
T 4 07/31/30	2,200,000.00	2,161,280.00	
T 4 10/31/29	1,600,000.00	1,576,896.00	
T 4 11/15/42	2,000,000.00	1,829,060.00	
T 4 11/15/52	2,600,000.00	2,300,792.00	
T 4 12/15/27	2,600,000.00	2,581,410.00	
T 4.125 02/15/27	5,500,000.00	5,485,810.00	
T 4.125 03/31/29	3,000,000.00	2,977,140.00	
T 4.125 03/31/31	2,000,000.00	1,971,940.00	
T 4.125 06/15/26	2,000,000.00	1,996,200.00	
T 4.125 07/31/28	1,000,000.00	994,510.00	
T 4.125 07/31/31	2,000,000.00	1,970,020.00	
T 4.125 08/15/44	1,100,000.00	1,011,648.00	
T 4.125 08/15/53	3,100,000.00	2,806,089.00	
T 4.125 08/31/30	1,700,000.00	1,679,600.00	
T 4.125 09/30/27	2,100,000.00	2,092,818.00	
T 4.125 10/31/27	2,000,000.00	1,992,880.00	
T 4.125 10/31/29	2,900,000.00	2,874,219.00	
T 4.125 10/31/31	2,900,000.00	2,853,658.00	
T 4.125 11/15/27	3,200,000.00	3,187,296.00	
T 4.125 11/15/32	5,600,000.00	5,496,512.00	
T 4.125 11/30/29	4,300,000.00	4,262,031.00	
T 4.125 11/30/31	2,000,000.00	1,967,500.00	
T 4.25 01/15/28	1,600,000.00	1,598,560.00	
T 4.25 01/31/26	3,300,000.00	3,298,713.00	
T 4.25 02/15/54	3,500,000.00	3,238,865.00	
T 4.25 02/28/29	2,500,000.00	2,493,200.00	
T 4.25 02/28/31	2,000,000.00	1,986,120.00	
T 4.25 03/15/27	3,900,000.00	3,898,596.00	
T 4.25 05/15/39	100,000.00	96,417.00	
T 4.25 06/30/29	3,700,000.00	3,687,753.00	
T 4.25 06/30/31	2,100,000.00	2,083,536.00	
T 4.25 08/15/54	3,220,000.00	2,984,521.40	
T 4.25 11/15/34	6,350,000.00	6,235,382.50	
T 4.25 11/15/40	600,000.00	572,760.00	
T 4.375 05/15/34	5,500,000.00	5,461,005.00	
T 4.375 05/15/40	900,000.00	873,999.00	

T 4.375 05/15/41	300,000.00	289,932.00	
T 4.375 07/15/27	3,750,000.00	3,759,075.00	
T 4.375 07/31/26	2,600,000.00	2,603,432.00	
T 4.375 08/15/26	4,000,000.00	4,006,000.00	
T 4.375 08/15/43	2,000,000.00	1,912,100.00	
T 4.375 08/31/28	1,000,000.00	1,002,030.00	
T 4.375 11/15/39	300,000.00	292,263.00	
T 4.375 11/30/28	1,900,000.00	1,903,781.00	
T 4.375 11/30/30	1,900,000.00	1,899,696.00	
T 4.375 12/15/26	4,000,000.00	4,006,760.00	
T 4.375 12/31/29	2,500,000.00	2,504,100.00	
T 4.5 02/15/44	2,100,000.00	2,034,522.00	
T 4.5 03/31/26	2,500,000.00	2,505,550.00	
T 4.5 04/15/27	1,700,000.00	1,707,922.00	
T 4.5 05/15/27	2,700,000.00	2,712,744.00	
T 4.5 05/15/38	1,200,000.00	1,197,468.00	
T 4.5 05/31/29	1,500,000.00	1,509,870.00	
T 4.5 07/15/26	3,900,000.00	3,912,168.00	
T 4.5 08/15/39	300,000.00	296,601.00	
T 4.5 11/15/33	4,800,000.00	4,815,840.00	
T 4.5 11/15/54	3,300,000.00	3,191,958.00	
T 4.5 12/31/31	2,800,000.00	2,815,736.00	
T 4.625 02/15/40	1,000,000.00	999,450.00	
T 4.625 03/15/26	2,500,000.00	2,508,725.00	
T 4.625 04/30/29	2,500,000.00	2,528,300.00	
T 4.625 04/30/31	1,000,000.00	1,012,610.00	
T 4.625 05/15/44	1,700,000.00	1,672,902.00	
T 4.625 05/15/54	3,000,000.00	2,956,620.00	
T 4.625 05/31/31	2,900,000.00	2,936,250.00	
T 4.625 09/15/26	4,000,000.00	4,021,480.00	
T 4.625 09/30/28	2,500,000.00	2,526,150.00	
T 4.625 09/30/30	1,500,000.00	1,518,795.00	
T 4.625 10/15/26	2,300,000.00	2,312,604.00	
T 4.625 11/15/26	4,800,000.00	4,827,984.00	
T 4.625 11/15/44	2,000,000.00	1,966,700.00	
T 4.75 02/15/41	900,000.00	909,279.00	
T 4.75 11/15/43	2,200,000.00	2,205,830.00	
T 4.75 11/15/53	3,300,000.00	3,312,738.00	
T 4.875 04/30/26	8,000,000.00	8,053,680.00	
T 4.875 10/31/28	1,400,000.00	1,426,600.00	
T 5.25 11/15/28	500,000.00	515,995.00	
T 5.375 02/15/31	320,000.00	336,835.20	
T 6 02/15/26	1,000,000.00	1,017,150.00	
T 6.125 11/15/27	1,000,000.00	1,048,280.00	

アメリカ・ドル小計		672,360,000.00	612,054,586.70 (92,830,319,165)	
カナダ・ドル	CAN 0.5 12/01/30	1,200,000.00	1,049,280.00	
	CAN 1 06/01/27	800,000.00	770,792.00	
	CAN 1.25 03/01/27	400,000.00	388,648.00	
	CAN 1.25 06/01/30	2,100,000.00	1,936,473.00	
	CAN 1.5 06/01/26	2,600,000.00	2,561,260.00	
	CAN 1.5 06/01/31	1,700,000.00	1,562,079.00	
	CAN 1.5 12/01/31	2,100,000.00	1,912,176.00	
	CAN 1.75 12/01/53	1,100,000.00	788,128.00	
	CAN 2 06/01/28	700,000.00	684,831.00	
	CAN 2 06/01/32	2,000,000.00	1,872,840.00	
	CAN 2 12/01/51	600,000.00	462,888.00	
	CAN 2.25 06/01/29	1,100,000.00	1,079,826.00	
	CAN 2.25 12/01/29	300,000.00	292,764.00	
	CAN 2.5 12/01/32	830,000.00	801,365.00	
	CAN 2.75 06/01/33	1,800,000.00	1,764,558.00	
	CAN 2.75 09/01/27	350,000.00	350,336.00	
	CAN 2.75 12/01/48	1,300,000.00	1,188,304.00	
	CAN 2.75 12/01/55	800,000.00	717,160.00	
	CAN 3 02/01/27	1,300,000.00	1,306,877.00	
	CAN 3 04/01/26	400,000.00	400,976.00	
	CAN 3.25 11/01/26	3,100,000.00	3,126,567.00	
	CAN 3.25 12/01/33	880,000.00	893,763.20	
	CAN 3.25 12/01/34	1,800,000.00	1,823,400.00	
	CAN 3.5 03/01/34	700,000.00	724,143.00	
	CAN 3.5 09/01/29	1,770,000.00	1,822,834.50	
	CAN 3.5 12/01/45	1,200,000.00	1,244,892.00	
	CAN 3.5 12/01/57	400,000.00	414,172.00	
	CAN 4 03/01/29	1,700,000.00	1,779,713.00	
	CAN 4 06/01/41	300,000.00	329,436.00	
	CAN 4 08/01/26	1,100,000.00	1,119,503.00	
	CAN 5 06/01/37	400,000.00	474,832.00	
	CAN 5.75 06/01/29	250,000.00	280,580.00	
	CAN 5.75 06/01/33	300,000.00	358,875.00	
	CANADA 2.75 12/01/64	700,000.00	631,911.00	
カナダ・ドル小計		38,080,000.00	36,916,182.70 (3,944,863,283)	
オーストラリア・ドル	ACGB 0.5 09/21/26	200,000.00	189,696.00	
	ACGB 1.25 05/21/32	1,300,000.00	1,056,731.00	
	ACGB 1.5 06/21/31	3,400,000.00	2,898,398.00	
	ACGB 1.75 06/21/51	500,000.00	263,620.00	
	ACGB 1.75 11/21/32	1,400,000.00	1,164,842.00	
	ACGB 2.25 05/21/28	1,300,000.00	1,236,066.00	

	ACGB 2.5 05/21/30	1,600,000.00	1,484,592.00	
	ACGB 2.75 05/21/41	600,000.00	464,082.00	
	ACGB 2.75 06/21/35	800,000.00	686,400.00	
	ACGB 2.75 11/21/27	1,200,000.00	1,165,452.00	
	ACGB 2.75 11/21/28	400,000.00	384,128.00	
	ACGB 2.75 11/21/29	1,400,000.00	1,326,094.00	
	ACGB 3 03/21/47	1,200,000.00	889,404.00	
	ACGB 3 11/21/33	900,000.00	809,586.00	
	ACGB 3.25 04/21/29	1,140,000.00	1,110,451.20	
	ACGB 3.25 06/21/39	2,000,000.00	1,708,620.00	
	ACGB 3.5 12/21/34	850,000.00	786,173.50	
	ACGB 3.75 04/21/37	1,100,000.00	1,018,061.00	
	ACGB 3.75 05/21/34	1,500,000.00	1,424,475.00	
	ACGB 4.25 04/21/26	2,150,000.00	2,158,019.50	
	ACGB 4.25 06/21/34	250,000.00	246,807.50	
	ACGB 4.5 04/21/33	1,500,000.00	1,516,710.00	
	ACGB 4.75 04/21/27	800,000.00	814,728.00	
	オーストラリア・ドル小計	27,490,000.00	24,803,136.70 (2,388,046,000)	
シンガポール・ドル	SIGB 1.25 11/01/26	800,000.00	780,280.00	
	SIGB 1.625 07/01/31	300,000.00	279,600.00	
	SIGB 2.625 05/01/28	800,000.00	797,200.00	
	SIGB 2.625 08/01/32	200,000.00	197,400.00	
	SIGB 2.75 03/01/46	1,000,000.00	989,350.00	
	SIGB 2.75 04/01/42	550,000.00	543,125.00	
	SIGB 2.875 07/01/29	100,000.00	100,602.00	
	SIGB 2.875 09/01/30	600,000.00	603,600.00	
	SIGB 3.25 06/01/54	800,000.00	872,024.00	
	SIGB 3.375 05/01/34	200,000.00	208,974.00	
	SIGB 3.375 09/01/33	400,000.00	416,400.00	
	SIGB 3.5 03/01/27	880,000.00	893,675.20	
	シンガポール・ドル小計	6,630,000.00	6,682,230.20 (755,225,657)	
ニュージーランド・ドル	NZGB 0.5 05/15/26	200,000.00	192,520.00	
	NZGB 1.5 05/15/31	800,000.00	680,040.00	
	NZGB 1.75 05/15/41	1,200,000.00	767,712.00	
	NZGB 2 05/15/32	1,120,000.00	956,468.80	
	NZGB 2.75 05/15/51	500,000.00	326,745.00	
	NZGB 3 04/20/29	1,000,000.00	962,740.00	
	NZGB 3.5 04/14/33	100,000.00	93,486.00	
	NZGB 4.25 05/15/34	400,000.00	391,336.00	
	NZGB 4.5 04/15/27	1,100,000.00	1,118,150.00	
	NZGB 4.5 05/15/30	720,000.00	732,729.60	

ニュージーランド・ドル小計		7,140,000.00	6,221,927.40 (540,374,395)	
イギリス・ ボンド	UK TSY GILT 1.125 01/31/39	600,000.00	379,758.00	
	UKT 0.125 01/31/28	1,800,000.00	1,613,754.00	
	UKT 0.25 07/31/31	1,400,000.00	1,092,014.00	
	UKT 0.375 10/22/26	1,600,000.00	1,509,488.00	
	UKT 0.375 10/22/30	1,100,000.00	894,586.00	
	UKT 0.5 01/31/29	1,850,000.00	1,613,237.00	
	UKT 0.5 10/22/61	1,200,000.00	342,336.00	
	UKT 0.625 07/31/35	1,100,000.00	744,887.00	
	UKT 0.875 01/31/46	400,000.00	188,236.00	
	UKT 0.875 07/31/33	1,300,000.00	977,886.00	
	UKT 0.875 10/22/29	800,000.00	693,592.00	
	UKT 1 01/31/32	2,100,000.00	1,687,623.00	
	UKT 1.125 10/22/73	1,300,000.00	454,818.00	
	UKT 1.25 07/22/27	900,000.00	843,795.00	
	UKT 1.25 07/31/51	1,400,000.00	632,226.00	
	UKT 1.25 10/22/41	800,000.00	472,480.00	
	UKT 1.5 07/22/26	1,100,000.00	1,062,490.00	
	UKT 1.5 07/22/47	1,000,000.00	530,790.00	
	UKT 1.625 10/22/28	900,000.00	827,649.00	
	UKT 1.625 10/22/54	500,000.00	240,325.00	
	UKT 1.75 01/22/49	1,950,000.00	1,068,990.00	
	UKT 1.75 09/07/37	700,000.00	507,479.00	
	UKT 2.5 07/22/65	1,600,000.00	919,664.00	
	UKT 3.25 01/22/44	1,600,000.00	1,256,352.00	
	UKT 3.25 01/31/33	2,150,000.00	1,982,558.00	
	UKT 3.5 01/22/45	1,250,000.00	1,010,725.00	
	UKT 3.5 07/22/68	1,300,000.00	964,301.00	
	UKT 3.75 01/29/38	1,100,000.00	997,271.00	
	UKT 3.75 03/07/27	1,200,000.00	1,189,596.00	
	UKT 3.75 07/22/52	1,200,000.00	963,312.00	
	UKT 3.75 10/22/53	1,300,000.00	1,035,736.00	
	UKT 4 01/22/60	1,300,000.00	1,078,753.00	
	UKT 4 10/22/31	1,000,000.00	980,440.00	
	UKT 4 10/22/63	600,000.00	494,556.00	
	UKT 4.125 01/29/27	1,700,000.00	1,697,994.00	
	UKT 4.125 07/22/29	1,570,000.00	1,564,489.30	
	UKT 4.25 03/07/36	700,000.00	678,027.00	
	UKT 4.25 06/07/32	500,000.00	498,500.00	
	UKT 4.25 07/31/34	1,600,000.00	1,567,184.00	
	UKT 4.25 09/07/39	600,000.00	564,360.00	
	UKT 4.25 12/07/27	1,200,000.00	1,208,376.00	
	UKT 4.25 12/07/40	600,000.00	558,294.00	

	UKT 4.25 12/07/46	1,500,000.00	1,339,500.00	
	UKT 4.25 12/07/49	900,000.00	795,249.00	
	UKT 4.25 12/07/55	1,700,000.00	1,480,088.00	
	UKT 4.375 03/07/28	400,000.00	401,736.00	
	UKT 4.375 07/31/54	350,000.00	310,936.50	
	UKT 4.5 06/07/28	1,150,000.00	1,160,902.00	
	UKT 4.5 09/07/34	600,000.00	599,952.00	
	UKT 4.5 12/07/42	1,050,000.00	993,153.00	
	UKT 4.625 01/31/34	1,800,000.00	1,817,244.00	
	UKT 4.75 10/22/43	2,000,000.00	1,937,780.00	
	UKT 4.75 12/07/30	1,000,000.00	1,028,750.00	
	UKT 4.75 12/07/38	1,000,000.00	998,190.00	
	UKT 6 12/07/28	650,000.00	695,266.00	
イギリス・ポンド小計		63,970,000.00	53,147,673.80 (10,167,149,998)	
イスラエル・シュケル	ILGOV 1 03/31/30	2,400,000.00	2,058,600.00	
	ILGOV 1.3 04/30/32	2,100,000.00	1,728,006.00	
	ILGOV 1.5 05/31/37	1,200,000.00	876,876.00	
	ILGOV 2 03/31/27	800,000.00	765,216.00	
	ILGOV 2.25 09/28/28	1,900,000.00	1,781,193.00	
	ILGOV 3.75 02/28/29	1,600,000.00	1,576,672.00	
	ILGOV 3.75 03/31/47	3,600,000.00	3,186,036.00	
	ILGOV 3.75 09/30/27	1,000,000.00	989,520.00	
	ILGOV 4 03/30/35	1,050,000.00	1,025,346.00	
	ILGOV 6.25 10/30/26	2,600,000.00	2,687,282.00	
イスラエル・シュケル小計		18,250,000.00	16,674,747.00 (709,934,023)	
デンマーク・クローネ	DGB 0 11/15/31	500,000.00	434,825.00	
	DGB 0.25 11/15/52	2,300,000.00	1,301,363.00	
	DGB 0.5 11/15/27	4,600,000.00	4,431,410.00	
	DGB 0.5 11/15/29	2,400,000.00	2,239,104.00	
	DGB 2.25 11/15/33	3,400,000.00	3,412,512.00	
	DGB 4.5 11/15/39	7,000,000.00	8,792,490.00	
デンマーク・クローネ小計		20,200,000.00	20,611,704.00 (439,029,295)	
ノルウェー・クローネ	NGB 1.375 08/19/30	4,200,000.00	3,692,388.00	
	NGB 1.5 02/19/26	1,700,000.00	1,658,809.00	
	NGB 1.75 02/17/27	700,000.00	673,582.00	
	NGB 1.75 09/06/29	5,000,000.00	4,573,150.00	
	NGB 2 04/26/28	6,600,000.00	6,257,922.00	
	NGB 2.125 05/18/32	1,200,000.00	1,067,784.00	
	NGB 3 08/15/33	1,100,000.00	1,028,104.00	
	NGB 3.5 10/06/42	2,300,000.00	2,193,901.00	
	NGB 3.625 04/13/34	1,000,000.00	976,930.00	

ノルウェー・クローネ小計		23,800,000.00	22,122,570.00 (301,973,081)	
スウェーデン・クローナ	SGB 0.125 05/12/31	1,500,000.00	1,321,215.00	
	SGB 0.75 05/12/28	3,700,000.00	3,553,850.00	
	SGB 0.75 11/12/29	4,200,000.00	3,945,060.00	
	SGB 1 11/12/26	6,400,000.00	6,296,320.00	
	SGB 1.75 11/11/33	3,250,000.00	3,106,870.00	
	SGB 3.5 03/30/39	4,900,000.00	5,461,883.00	
スウェーデン・クローナ小計		23,950,000.00	23,685,198.00 (335,856,108)	
メキシコ・ペソ	MBONO 5.5 03/04/27	23,000,000.00	21,464,980.00	
	MBONO 5.75 03/05/26	19,000,000.00	18,374,520.00	
	MBONO 7.5 05/26/33	8,000,000.00	6,996,640.00	
	MBONO 7.5 06/03/27	22,000,000.00	21,266,740.00	
	MBONO 7.75 05/29/31	32,000,000.00	29,314,560.00	
	MBONO 7.75 11/23/34	31,000,000.00	27,120,350.00	
	MBONO 8 11/07/47	13,000,000.00	10,465,520.00	
	MBONO 8.5 05/31/29	37,000,000.00	35,801,940.00	
	MBONO 8.5 11/18/38	40,000,000.00	35,654,800.00	
メキシコ・ペソ小計		225,000,000.00	206,460,050.00 (1,542,070,759)	
オフショア・人民元	CGB 1.42 11/15/27	17,000,000.00	17,011,050.00	
	CGB 1.62 08/15/27	1,800,000.00	1,811,268.00	
	CGB 1.74 10/15/29	34,600,000.00	34,930,430.00	
	CGB 1.85 05/15/27	11,000,000.00	11,116,380.00	
	CGB 1.87 09/15/31	16,500,000.00	16,780,830.00	
	CGB 1.91 07/15/29	14,500,000.00	14,761,435.00	
	CGB 1.99 03/15/26	35,000,000.00	35,246,050.00	
	CGB 2.04 02/25/27	68,600,000.00	69,510,322.00	
	CGB 2.04 11/25/34	7,000,000.00	7,219,380.00	
	CGB 2.05 04/15/29	25,000,000.00	25,551,000.00	
	CGB 2.11 08/25/34	43,500,000.00	45,232,170.00	
	CGB 2.18 08/15/26	22,800,000.00	23,076,564.00	
	CGB 2.27 05/25/34	20,000,000.00	21,050,200.00	
	CGB 2.28 03/25/31	28,000,000.00	29,092,840.00	
	CGB 2.3 05/15/26	17,000,000.00	17,199,580.00	
	CGB 2.35 02/25/34	22,000,000.00	23,220,780.00	
	CGB 2.37 01/15/29	19,000,000.00	19,622,820.00	
	CGB 2.39 11/15/26	72,000,000.00	73,243,440.00	
	CGB 2.4 07/15/28	38,000,000.00	39,161,660.00	
	CGB 2.46 02/15/26	6,000,000.00	6,065,040.00	
	CGB 2.48 04/15/27	9,000,000.00	9,206,100.00	
	CGB 2.5 07/25/27	11,000,000.00	11,264,990.00	
	CGB 2.52 08/25/33	11,000,000.00	11,726,770.00	

	CGB 2.54 12/25/30	27,000,000.00	28,411,560.00	
	CGB 2.55 10/15/28	11,000,000.00	11,412,720.00	
	CGB 2.6 09/15/30	32,000,000.00	33,726,720.00	
	CGB 2.62 04/15/28	27,000,000.00	27,983,610.00	
	CGB 2.62 06/25/30	22,000,000.00	23,174,360.00	
	CGB 2.62 09/25/29	19,000,000.00	19,928,340.00	
	CGB 2.64 01/15/28	31,500,000.00	32,640,615.00	
	CGB 2.67 05/25/33	14,000,000.00	15,048,180.00	
	CGB 2.67 11/25/33	15,000,000.00	16,189,200.00	
	CGB 2.69 08/12/26	50,000,000.00	51,008,000.00	
	CGB 2.8 03/24/29	22,000,000.00	23,137,840.00	
	CGB 2.8 03/25/30	6,000,000.00	6,370,260.00	
	CGB 2.8 11/15/32	29,000,000.00	31,414,830.00	
	CGB 2.88 02/25/33	10,900,000.00	11,909,558.00	
	CGB 2.91 10/14/28	21,000,000.00	22,077,510.00	
	CGB 3 10/15/53	13,500,000.00	16,735,275.00	
	CGB 3.02 05/27/31	32,400,000.00	35,173,116.00	
	CGB 3.12 10/25/52	17,000,000.00	21,288,760.00	
	CGB 3.19 04/15/53	13,000,000.00	16,519,750.00	
	CGB 3.39 03/16/50	4,000,000.00	5,157,000.00	
	CGB 3.72 04/12/51	44,700,000.00	61,011,030.00	
オフショア・人民元小計		1,012,300,000.00	1,073,419,333.00 (22,400,329,325)	
マレーシ ア・リン ギット	MGS 3.502 05/31/27	5,100,000.00	5,105,814.00	
	MGS 3.582 07/15/32	2,500,000.00	2,469,400.00	
	MGS 3.757 05/22/40	1,400,000.00	1,365,000.00	
	MGS 3.828 07/05/34	1,400,000.00	1,403,290.00	
	MGS 3.9 11/30/26	3,100,000.00	3,129,977.00	
	MGS 4.054 04/18/39	800,000.00	807,840.00	
	MGS 4.498 04/15/30	4,000,000.00	4,154,800.00	
	MGS 4.504 04/30/29	700,000.00	725,039.00	
	MGS 4.696 10/15/42	2,200,000.00	2,382,556.00	
	MGS 4.736 03/15/46	6,700,000.00	7,299,315.00	
マレーシア・リングgit小計		27,900,000.00	28,843,031.00 (985,554,832)	
ポーラン ド・ズロチ	POLGB 0.25 10/25/26	7,900,000.00	7,280,956.00	
	POLGB 1.25 10/25/30	10,200,000.00	8,116,344.00	
	POLGB 2.75 04/25/28	4,000,000.00	3,707,600.00	
	POLGB 2.75 10/25/29	2,150,000.00	1,914,446.00	
	POLGB 4.75 07/25/29	2,000,000.00	1,942,740.00	
	POLGB 5 10/25/34	500,000.00	471,505.00	
	POLGB 6 10/25/33	2,800,000.00	2,848,748.00	
	POLGB 7.5 07/25/28	2,750,000.00	2,929,520.00	

ポーランド・ズロチ小計		32,300,000.00	29,211,859.00 (1,115,828,748)	
ユーロ	BGB 0 10/22/27	650,000.00	611,819.00	
	BGB 0 10/22/31	900,000.00	754,326.00	
	BGB 0.1 06/22/30	700,000.00	615,356.00	
	BGB 0.35 06/22/32	1,200,000.00	1,009,692.00	
	BGB 0.4 06/22/40	800,000.00	521,632.00	
	BGB 0.65 06/22/71	400,000.00	154,740.00	
	BGB 0.8 06/22/27	800,000.00	773,696.00	
	BGB 0.8 06/22/28	700,000.00	665,301.00	
	BGB 0.9 06/22/29	900,000.00	842,859.00	
	BGB 1 06/22/26	700,000.00	689,143.00	
	BGB 1 06/22/31	1,100,000.00	995,401.00	
	BGB 1.25 04/22/33	900,000.00	801,423.00	
	BGB 1.45 06/22/37	1,000,000.00	826,920.00	
	BGB 1.6 06/22/47	650,000.00	462,007.00	
	BGB 1.7 06/22/50	1,000,000.00	695,750.00	
	BGB 1.9 06/22/38	700,000.00	601,209.00	
	BGB 2.15 06/22/66	500,000.00	350,455.00	
	BGB 2.25 06/22/57	500,000.00	370,765.00	
	BGB 2.7 10/22/29	150,000.00	151,285.50	
	BGB 2.75 04/22/39	600,000.00	567,024.00	
	BGB 2.85 10/22/34	700,000.00	693,042.00	
	BGB 3 06/22/33	800,000.00	808,984.00	
	BGB 3 06/22/34	200,000.00	201,332.00	
	BGB 3.45 06/22/43	500,000.00	502,280.00	
	BGB 3.75 06/22/45	600,000.00	626,190.00	
	BGB 4 03/28/32	300,000.00	324,144.00	
	BGB 4.25 03/28/41	680,000.00	755,384.80	
	BGB 4.5 03/28/26	550,000.00	563,447.50	
	BGB 5 03/28/35	1,000,000.00	1,173,780.00	
	BGB 5.5 03/28/28	1,000,000.00	1,093,090.00	
	BK0 2 12/10/26	500,000.00	498,835.00	
	BK0 2.5 03/19/26	2,100,000.00	2,107,182.00	
	BTPS 0 08/01/26	1,300,000.00	1,258,413.00	
	BTPS 0.45 02/15/29	1,750,000.00	1,604,505.00	
	BTPS 0.6 08/01/31	1,300,000.00	1,113,957.00	
	BTPS 0.85 01/15/27	900,000.00	875,637.00	
	BTPS 0.9 04/01/31	2,000,000.00	1,763,960.00	
	BTPS 0.95 03/01/37	1,000,000.00	740,410.00	
	BTPS 0.95 06/01/32	3,300,000.00	2,828,793.00	
	BTPS 0.95 08/01/30	1,200,000.00	1,081,440.00	
	BTPS 0.95 09/15/27	800,000.00	770,880.00	
	BTPS 0.95 12/01/31	1,400,000.00	1,216,768.00	

BTPS 1.1 04/01/27	1,500,000.00	1,461,120.00	
BTPS 1.25 12/01/26	800,000.00	785,592.00	
BTPS 1.35 04/01/30	1,900,000.00	1,764,777.00	
BTPS 1.45 03/01/36	400,000.00	323,284.00	
BTPS 1.6 06/01/26	1,200,000.00	1,189,920.00	
BTPS 1.65 12/01/30	1,100,000.00	1,022,670.00	
BTPS 1.7 09/01/51	1,500,000.00	947,565.00	
BTPS 2 02/01/28	1,500,000.00	1,479,615.00	
BTPS 2.05 08/01/27	600,000.00	595,074.00	
BTPS 2.1 07/15/26	1,000,000.00	997,800.00	
BTPS 2.2 06/01/27	900,000.00	896,904.00	
BTPS 2.25 09/01/36	500,000.00	437,190.00	
BTPS 2.45 09/01/33	600,000.00	562,626.00	
BTPS 2.45 09/01/50	1,700,000.00	1,273,912.00	
BTPS 2.65 12/01/27	400,000.00	401,848.00	
BTPS 2.7 03/01/47	950,000.00	771,628.00	
BTPS 2.7 10/15/27	650,000.00	653,243.50	
BTPS 2.8 03/01/67	700,000.00	526,239.00	
BTPS 2.8 06/15/29	1,000,000.00	1,002,620.00	
BTPS 2.8 12/01/28	1,300,000.00	1,309,009.00	
BTPS 2.95 02/15/27	2,000,000.00	2,020,920.00	
BTPS 2.95 09/01/38	1,000,000.00	917,360.00	
BTPS 3 08/01/29	2,000,000.00	2,022,240.00	
BTPS 3 10/01/29	1,450,000.00	1,460,222.50	
BTPS 3.1 03/01/40	700,000.00	641,193.00	
BTPS 3.25 03/01/38	800,000.00	760,152.00	
BTPS 3.25 09/01/46	1,100,000.00	982,443.00	
BTPS 3.35 03/01/35	1,120,000.00	1,107,769.60	
BTPS 3.35 07/01/29	600,000.00	613,578.00	
BTPS 3.45 03/01/48	1,000,000.00	914,080.00	
BTPS 3.45 07/15/31	270,000.00	275,270.40	
BTPS 3.5 02/15/31	1,000,000.00	1,024,330.00	
BTPS 3.5 03/01/30	1,000,000.00	1,032,660.00	
BTPS 3.65 08/01/35	550,000.00	554,075.50	
BTPS 3.7 06/15/30	1,900,000.00	1,970,338.00	
BTPS 3.8 08/01/28	1,700,000.00	1,765,688.00	
BTPS 3.85 02/01/35	1,350,000.00	1,388,380.50	
BTPS 3.85 07/01/34	1,000,000.00	1,032,460.00	
BTPS 3.85 09/01/49	1,100,000.00	1,064,206.00	
BTPS 3.85 09/15/26	2,900,000.00	2,965,076.00	
BTPS 3.85 12/15/29	1,300,000.00	1,359,215.00	
BTPS 4 02/01/37	2,000,000.00	2,078,640.00	
BTPS 4 04/30/35	500,000.00	524,110.00	
BTPS 4.1 02/01/29	1,500,000.00	1,577,115.00	

BTPS 4.1 04/30/46	500,000.00	507,595.00	
BTPS 4.15 10/01/39	300,000.00	310,065.00	
BTPS 4.3 10/01/54	700,000.00	713,622.00	
BTPS 4.4 05/01/33	3,000,000.00	3,238,470.00	
BTPS 4.5 03/01/26	1,300,000.00	1,328,197.00	
BTPS 4.5 10/01/53	200,000.00	211,444.00	
BTPS 4.75 09/01/28	1,800,000.00	1,930,590.00	
BTPS 4.75 09/01/44	1,200,000.00	1,323,696.00	
BTPS 5 08/01/34	1,570,000.00	1,768,840.50	
BTPS 5 08/01/39	1,800,000.00	2,035,260.00	
BTPS 5 09/01/40	1,700,000.00	1,919,589.00	
BTPS 5.75 02/01/33	1,700,000.00	1,992,417.00	
BTPS 6 05/01/31	1,200,000.00	1,403,220.00	
BTPS 6.5 11/01/27	1,700,000.00	1,878,075.00	
BTPS 7.25 11/01/26	400,000.00	432,860.00	
DBR 0 02/15/30	1,500,000.00	1,346,565.00	
DBR 0 02/15/31	1,000,000.00	876,280.00	
DBR 0 02/15/32	2,700,000.00	2,303,451.00	
DBR 0 05/15/35	1,200,000.00	931,860.00	
DBR 0 05/15/36	800,000.00	602,392.00	
DBR 0 08/15/29	1,950,000.00	1,772,257.50	
DBR 0 08/15/30	2,100,000.00	1,863,351.00	
DBR 0 08/15/31	1,300,000.00	1,124,864.00	
DBR 0 08/15/31	1,500,000.00	1,298,280.00	
DBR 0 08/15/50	2,000,000.00	1,017,400.00	
DBR 0 08/15/50	2,100,000.00	1,070,202.00	
DBR 0 08/15/52	450,000.00	217,296.00	
DBR 0 11/15/27	600,000.00	566,862.00	
DBR 0 11/15/28	1,100,000.00	1,017,522.00	
DBR 0.25 02/15/27	300,000.00	289,425.00	
DBR 0.25 02/15/29	1,200,000.00	1,115,220.00	
DBR 0.25 08/15/28	1,500,000.00	1,408,005.00	
DBR 0.5 02/15/26	3,200,000.00	3,149,792.00	
DBR 0.5 02/15/28	1,000,000.00	954,560.00	
DBR 0.5 08/15/27	2,100,000.00	2,021,166.00	
DBR 1 05/15/38	1,600,000.00	1,309,536.00	
DBR 1.25 08/15/48	1,650,000.00	1,235,586.00	
DBR 1.7 08/15/32	1,400,000.00	1,340,892.00	
DBR 1.8 08/15/53	1,200,000.00	981,684.00	
DBR 1.8 08/15/53	1,000,000.00	819,700.00	
DBR 2.1 11/15/29	1,400,000.00	1,392,076.00	
DBR 2.2 02/15/34	1,500,000.00	1,472,940.00	
DBR 2.3 02/15/33	1,600,000.00	1,592,496.00	
DBR 2.3 02/15/33	1,300,000.00	1,294,163.00	

DBR 2.4 11/15/30	1,100,000.00	1,107,755.00	
DBR 2.5 02/15/35	300,000.00	300,549.00	
DBR 2.5 07/04/44	1,600,000.00	1,547,744.00	
DBR 2.5 08/15/46	1,500,000.00	1,446,750.00	
DBR 2.5 08/15/54	1,000,000.00	952,330.00	
DBR 2.6 05/15/41	600,000.00	590,826.00	
DBR 2.6 08/15/33	900,000.00	913,815.00	
DBR 2.6 08/15/34	1,680,000.00	1,700,731.20	
DBR 3.25 07/04/42	800,000.00	858,704.00	
DBR 4 01/04/37	1,300,000.00	1,487,512.00	
DBR 4.25 07/04/39	700,000.00	830,984.00	
DBR 4.75 07/04/28	600,000.00	650,934.00	
DBR 4.75 07/04/34	600,000.00	715,890.00	
DBR 4.75 07/04/40	1,450,000.00	1,823,810.00	
DBR 5.5 01/04/31	900,000.00	1,058,346.00	
DBR 5.625 01/04/28	1,000,000.00	1,096,850.00	
DBR 6.25 01/04/30	500,000.00	591,460.00	
DBR 6.5 07/04/27	1,000,000.00	1,100,680.00	
FRTR 0 02/25/26	1,600,000.00	1,564,576.00	
FRTR 0 02/25/27	1,100,000.00	1,050,753.00	
FRTR 0 05/25/32	2,900,000.00	2,353,524.00	
FRTR 0 11/25/29	2,500,000.00	2,207,425.00	
FRTR 0 11/25/30	3,550,000.00	3,037,238.00	
FRTR 0 11/25/31	3,000,000.00	2,480,250.00	
FRTR 0.25 11/25/26	2,900,000.00	2,800,559.00	
FRTR 0.5 05/25/26	3,100,000.00	3,034,466.00	
FRTR 0.5 05/25/29	3,000,000.00	2,749,050.00	
FRTR 0.5 05/25/40	1,300,000.00	849,147.00	
FRTR 0.5 05/25/72	500,000.00	166,510.00	
FRTR 0.5 06/25/44	350,000.00	203,822.50	
FRTR 0.75 02/25/28	4,200,000.00	3,996,426.00	
FRTR 0.75 05/25/28	2,500,000.00	2,366,850.00	
FRTR 0.75 05/25/52	3,000,000.00	1,519,320.00	
FRTR 0.75 11/25/28	3,400,000.00	3,184,066.00	
FRTR 1 05/25/27	2,000,000.00	1,942,500.00	
FRTR 1.25 05/25/34	2,750,000.00	2,344,595.00	
FRTR 1.25 05/25/36	1,850,000.00	1,503,495.00	
FRTR 1.25 05/25/38	2,600,000.00	2,012,582.00	
FRTR 1.5 05/25/31	2,650,000.00	2,455,198.50	
FRTR 1.5 05/25/50	2,400,000.00	1,559,448.00	
FRTR 1.75 05/25/66	800,000.00	479,824.00	
FRTR 1.75 06/25/39	2,000,000.00	1,631,740.00	
FRTR 2 05/25/48	2,000,000.00	1,499,160.00	
FRTR 2 11/25/32	2,700,000.00	2,520,072.00	

FRTR 2.5 05/25/30	2,100,000.00	2,080,575.00	
FRTR 2.5 05/25/43	1,100,000.00	946,814.00	
FRTR 2.5 09/24/26	3,100,000.00	3,112,028.00	
FRTR 2.5 09/24/27	1,400,000.00	1,404,522.00	
FRTR 2.75 02/25/29	1,600,000.00	1,610,592.00	
FRTR 2.75 02/25/30	2,150,000.00	2,155,740.50	
FRTR 2.75 10/25/27	2,650,000.00	2,675,917.00	
FRTR 3 05/25/33	2,200,000.00	2,195,842.00	
FRTR 3 05/25/54	1,300,000.00	1,133,951.00	
FRTR 3 06/25/49	570,000.00	513,609.90	
FRTR 3 11/25/34	2,230,000.00	2,200,586.30	
FRTR 3.25 05/25/45	900,000.00	860,535.00	
FRTR 3.25 05/25/55	200,000.00	182,266.00	
FRTR 3.5 04/25/26	1,800,000.00	1,826,316.00	
FRTR 3.5 11/25/33	3,400,000.00	3,510,636.00	
FRTR 3.6 05/25/42	1,100,000.00	1,109,900.00	
FRTR 4 04/25/55	1,370,000.00	1,435,705.20	
FRTR 4 04/25/60	1,400,000.00	1,466,444.00	
FRTR 4 10/25/38	2,000,000.00	2,133,260.00	
FRTR 4.5 04/25/41	1,900,000.00	2,138,336.00	
FRTR 4.75 04/25/35	800,000.00	908,576.00	
FRTR 5.5 04/25/29	1,650,000.00	1,838,397.00	
FRTR 5.75 10/25/32	400,000.00	476,488.00	
IRISH 0 10/18/31	500,000.00	422,605.00	
IRISH 0.2 05/15/27	100,000.00	95,685.00	
IRISH 0.9 05/15/28	500,000.00	479,445.00	
IRISH 1 05/15/26	850,000.00	837,607.00	
IRISH 1.1 05/15/29	500,000.00	474,885.00	
IRISH 1.3 05/15/33	250,000.00	225,792.50	
IRISH 1.35 03/18/31	500,000.00	468,395.00	
IRISH 1.5 05/15/50	500,000.00	366,260.00	
IRISH 1.7 05/15/37	300,000.00	263,040.00	
IRISH 2 02/18/45	1,000,000.00	851,820.00	
IRISH 2.4 05/15/30	600,000.00	598,932.00	
IRISH 2.6 10/18/34	590,000.00	582,312.30	
IRISH 3.15 10/18/55	100,000.00	101,186.00	
NETHER 0 01/15/27	700,000.00	672,084.00	
NETHER 0 01/15/38	700,000.00	487,956.00	
NETHER 0 07/15/30	1,700,000.00	1,495,745.00	
NETHER 0.25 07/15/29	750,000.00	685,305.00	
NETHER 0.5 01/15/40	1,200,000.00	863,652.00	
NETHER 0.5 07/15/26	1,050,000.00	1,026,312.00	
NETHER 0.5 07/15/32	1,200,000.00	1,037,964.00	
NETHER 0.75 07/15/27	400,000.00	386,724.00	

NETHER 0.75 07/15/28	1,700,000.00	1,616,309.00	
NETHER 2 01/15/54	300,000.00	250,188.00	
NETHER 2.5 01/15/30	150,000.00	150,819.00	
NETHER 2.5 01/15/33	600,000.00	597,594.00	
NETHER 2.5 07/15/33	800,000.00	793,944.00	
NETHER 2.5 07/15/34	230,000.00	226,897.30	
NETHER 2.75 01/15/47	2,300,000.00	2,263,798.00	
NETHER 3.25 01/15/44	200,000.00	210,938.00	
NETHER 3.75 01/15/42	1,300,000.00	1,452,451.00	
NETHER 4 01/15/37	300,000.00	336,978.00	
NETHER 5.5 01/15/28	700,000.00	763,602.00	
OBL 0 04/10/26	2,100,000.00	2,050,314.00	
OBL 0 04/16/27	1,050,000.00	1,004,314.50	
OBL 0 10/09/26	2,700,000.00	2,610,522.00	
OBL 1.3 10/15/27	300,000.00	294,054.00	
OBL 1.3 10/15/27	1,200,000.00	1,176,324.00	
OBL 2.1 04/12/29	1,000,000.00	996,240.00	
OBL 2.1 04/12/29	600,000.00	597,864.00	
OBL 2.2 04/13/28	1,200,000.00	1,202,460.00	
OBL 2.4 04/18/30	1,100,000.00	1,107,645.00	
OBL 2.4 10/19/28	1,600,000.00	1,613,152.00	
OBL 2.5 10/11/29	1,050,000.00	1,062,348.00	
PGB 0.3 10/17/31	500,000.00	431,680.00	
PGB 0.475 10/18/30	400,000.00	358,680.00	
PGB 0.7 10/15/27	450,000.00	434,016.00	
PGB 0.9 10/12/35	300,000.00	243,210.00	
PGB 1 04/12/52	300,000.00	170,787.00	
PGB 1.15 04/11/42	350,000.00	249,812.50	
PGB 1.65 07/16/32	300,000.00	279,759.00	
PGB 1.95 06/15/29	600,000.00	590,850.00	
PGB 2.125 10/17/28	750,000.00	746,917.50	
PGB 2.25 04/18/34	400,000.00	381,684.00	
PGB 2.875 07/21/26	500,000.00	505,715.00	
PGB 2.875 10/20/34	410,000.00	409,098.00	
PGB 3 06/15/35	250,000.00	250,442.50	
PGB 3.5 06/18/38	320,000.00	330,115.20	
PGB 3.625 06/12/54	100,000.00	100,664.00	
PGB 3.875 02/15/30	400,000.00	427,692.00	
PGB 4.1 02/15/45	300,000.00	327,267.00	
PGB 4.1 04/15/37	500,000.00	549,345.00	
PGB 4.125 04/14/27	400,000.00	417,344.00	
RAGB 0 02/20/30	800,000.00	707,024.00	
RAGB 0 02/20/31	1,400,000.00	1,200,206.00	
RAGB 0 10/20/28	150,000.00	137,740.50	

RAGB 0 10/20/40	300,000.00	186,348.00	
RAGB 0.25 10/20/36	700,000.00	513,716.00	
RAGB 0.5 02/20/29	1,220,000.00	1,132,794.40	
RAGB 0.5 04/20/27	700,000.00	674,513.00	
RAGB 0.75 02/20/28	600,000.00	573,204.00	
RAGB 0.75 03/20/51	900,000.00	521,784.00	
RAGB 0.75 10/20/26	600,000.00	585,606.00	
RAGB 0.85 06/30/20	250,000.00	99,482.50	
RAGB 0.9 02/20/32	600,000.00	532,854.00	
RAGB 1.5 02/20/47	700,000.00	520,576.00	
RAGB 1.5 11/02/86	200,000.00	116,032.00	
RAGB 2.4 05/23/34	700,000.00	676,473.00	
RAGB 2.9 02/20/33	650,000.00	657,416.50	
RAGB 2.9 02/20/34	460,000.00	463,210.80	
RAGB 3.15 06/20/44	500,000.00	499,550.00	
RAGB 3.15 10/20/53	350,000.00	345,366.00	
RAGB 3.2 07/15/39	200,000.00	202,690.00	
RAGB 3.8 01/26/62	700,000.00	788,515.00	
RAGB 4.15 03/15/37	300,000.00	334,944.00	
RAGB 4.85 03/15/26	800,000.00	821,760.00	
RAGB 6.25 07/15/27	1,000,000.00	1,091,620.00	
RFGB 0 09/15/26	300,000.00	290,040.00	
RFGB 0 09/15/30	400,000.00	347,768.00	
RFGB 0.25 09/15/40	700,000.00	455,147.00	
RFGB 0.5 04/15/26	300,000.00	294,288.00	
RFGB 0.5 09/15/27	700,000.00	670,586.00	
RFGB 0.5 09/15/28	300,000.00	281,130.00	
RFGB 0.5 09/15/29	200,000.00	183,296.00	
RFGB 0.75 04/15/31	800,000.00	716,952.00	
RFGB 1.375 04/15/47	640,000.00	462,252.80	
RFGB 2.625 07/04/42	700,000.00	655,354.00	
RFGB 2.75 04/15/38	200,000.00	193,418.00	
RFGB 2.75 07/04/28	200,000.00	202,858.00	
RFGB 2.875 04/15/29	250,000.00	254,397.50	
RFGB 3 09/15/33	800,000.00	813,224.00	
RFGB 3 09/15/34	260,000.00	263,304.60	
SPGB 0 01/31/27	1,050,000.00	1,005,133.50	
SPGB 0.1 04/30/31	800,000.00	681,640.00	
SPGB 0.5 04/30/30	1,600,000.00	1,436,624.00	
SPGB 0.5 10/31/31	1,400,000.00	1,207,612.00	
SPGB 0.6 10/31/29	150,000.00	136,978.50	
SPGB 0.7 04/30/32	1,400,000.00	1,208,256.00	
SPGB 0.8 07/30/27	1,100,000.00	1,060,598.00	
SPGB 0.8 07/30/29	700,000.00	648,501.00	

	SPGB 0.85 07/30/37	500,000.00	375,370.00	
	SPGB 1 07/30/42	500,000.00	337,180.00	
	SPGB 1 10/31/50	800,000.00	450,928.00	
	SPGB 1.2 10/31/40	1,400,000.00	1,015,910.00	
	SPGB 1.25 10/31/30	3,000,000.00	2,774,910.00	
	SPGB 1.3 10/31/26	1,400,000.00	1,379,322.00	
	SPGB 1.4 04/30/28	1,500,000.00	1,454,715.00	
	SPGB 1.4 07/30/28	1,200,000.00	1,159,404.00	
	SPGB 1.45 04/30/29	2,100,000.00	2,011,653.00	
	SPGB 1.45 10/31/27	1,300,000.00	1,270,165.00	
	SPGB 1.45 10/31/71	400,000.00	199,856.00	
	SPGB 1.5 04/30/27	1,500,000.00	1,476,165.00	
	SPGB 1.85 07/30/35	600,000.00	532,002.00	
	SPGB 1.95 04/30/26	2,300,000.00	2,292,249.00	
	SPGB 1.95 07/30/30	700,000.00	675,577.00	
	SPGB 2.35 07/30/33	700,000.00	668,521.00	
	SPGB 2.4 05/31/28	550,000.00	549,499.50	
	SPGB 2.5 05/31/27	1,400,000.00	1,405,460.00	
	SPGB 2.55 10/31/32	1,450,000.00	1,417,012.50	
	SPGB 2.7 10/31/48	750,000.00	638,437.50	
	SPGB 2.8 05/31/26	1,100,000.00	1,107,205.00	
	SPGB 2.9 10/31/46	1,700,000.00	1,520,089.00	
	SPGB 3.15 04/30/33	1,550,000.00	1,573,296.50	
	SPGB 3.15 04/30/35	400,000.00	400,504.00	
	SPGB 3.45 07/30/43	700,000.00	684,635.00	
	SPGB 3.45 07/30/66	1,300,000.00	1,199,835.00	
	SPGB 3.45 10/31/34	2,300,000.00	2,368,333.00	
	SPGB 3.5 05/31/29	1,500,000.00	1,556,805.00	
	SPGB 3.55 10/31/33	1,800,000.00	1,874,772.00	
	SPGB 3.9 07/30/39	700,000.00	736,260.00	
	SPGB 4 10/31/54	300,000.00	310,992.00	
	SPGB 4.2 01/31/37	1,050,000.00	1,147,912.50	
	SPGB 4.7 07/30/41	1,100,000.00	1,263,273.00	
	SPGB 4.9 07/30/40	1,400,000.00	1,636,124.00	
	SPGB 5.15 10/31/28	1,500,000.00	1,639,860.00	
	SPGB 5.15 10/31/44	1,400,000.00	1,705,158.00	
	SPGB 5.75 07/30/32	1,000,000.00	1,193,540.00	
	SPGB 5.9 07/30/26	500,000.00	525,785.00	
	SPGB 6 01/31/29	1,900,000.00	2,150,040.00	
	ユーロ小計	386,570,000.00	364,641,566.30 (57,930,605,638)	
国債証券合計			196,387,160,307 (196,387,160,307)	

合 計		196,387,160,307 (196,387,160,307)	
-----	--	--------------------------------------	--

（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	258銘柄	46.4%	47.3%
カナダ・ドル	国債証券	34銘柄	2.0%	2.0%
オーストラリア・ドル	国債証券	23銘柄	1.2%	1.2%
シンガポール・ドル	国債証券	12銘柄	0.4%	0.4%
ニュージーランド・ドル	国債証券	10銘柄	0.3%	0.3%
イギリス・ポンド	国債証券	55銘柄	5.1%	5.2%
イスラエル・シェケル	国債証券	10銘柄	0.4%	0.4%
デンマーク・クローネ	国債証券	6銘柄	0.2%	0.2%
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	6銘柄	0.2%	0.2%
メキシコ・ペソ	国債証券	9銘柄	0.8%	0.8%
オフショア・人民元	国債証券	44銘柄	11.2%	11.4%
マレーシア・リンギット	国債証券	10銘柄	0.5%	0.5%
ポーランド・ズロチ	国債証券	8銘柄	0.6%	0.6%
ユーロ	国債証券	345銘柄	28.9%	29.5%

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

該当事項はありません。

２【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

三井住友ＤＳ・年金バランス３０（債券重点型）

2025年2月28日現在

資産総額	1,064,304,850円
負債総額	6,557,580円
純資産総額（ - ）	1,057,747,270円
発行済口数	854,655,961口
１口当たり純資産額（ / ） （１万口当たり純資産額）	1.2376円 (12,376円)

三井住友ＤＳ・年金バランス５０（標準型）

2025年2月28日現在

資産総額	3,757,413,646円
負債総額	1,561,080円
純資産総額（ - ）	3,755,852,566円
発行済口数	2,547,924,201口
１口当たり純資産額（ / ） （１万口当たり純資産額）	1.4741円 (14,741円)

三井住友ＤＳ・年金バランス７０（株式重点型）

2025年2月28日現在

資産総額	2,995,793,183円
負債総額	3,456,985円
純資産総額（ - ）	2,992,336,198円
発行済口数	1,711,565,157口
１口当たり純資産額（ / ） （１万口当たり純資産額）	1.7483円 (17,483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。

二 受益権の譲渡および譲渡制限等

（イ）受益権の譲渡

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

（ロ）受益権の譲渡制限および譲渡の対抗要件

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

ホ 受益権の再分割

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

ヘ 償還金

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

ト 質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

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

第二部【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

	2025年2月28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。

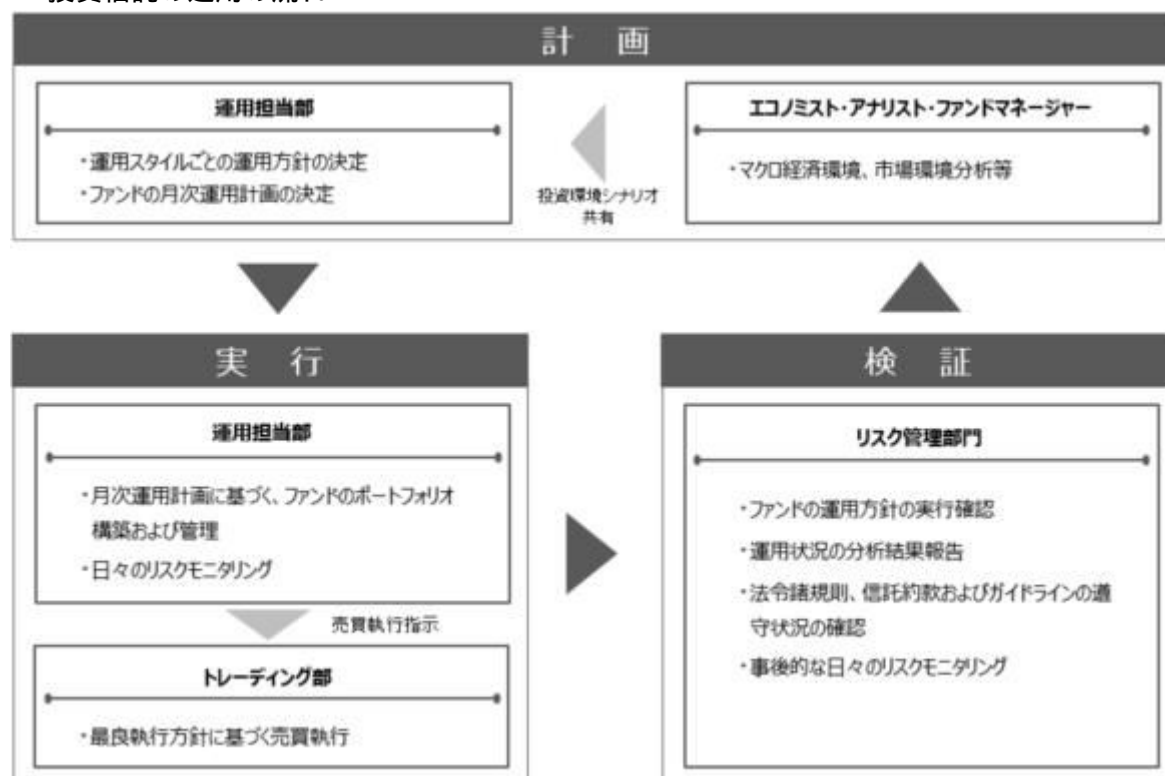
取締役の任期は、選任後１年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会の終結の時までとし、補欠または増員によって選任された取締役の任期は、他の現任取締役の任期の満了する時までとします。

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。

2025年2月28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	13,399,503
単位型株式投資信託	79	643,572
追加型公社債投資信託	1	22,382
単位型公社債投資信託	137	204,475
合 計	873	14,269,934

3【委託会社等の経理状況】

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

また、当社の中間財務諸表は、「財務諸表等規則」並びに同規則第2条、第282条及び第306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、第39期（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、第40期中間会計期間（2024年4月1日から2024年9月30日まで）の中間財務諸表については、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、有限責任 あずさ監査法人の中間監査を受けております。

（１）【貸借対照表】

(単位：千円)		
	前事業年度 (2023年3月31日)	当事業年度 (2024年3月31日)
資産の部		
流動資産		
現金及び預金	37,742,400	66,540,261
金銭の信託	12,645,575	23,435,831
顧客分別金信託	300,046	300,051
前払費用	546,900	583,635
未収入金	437,880	193,837
未収委託者報酬	11,563,662	14,480,419
未収運用受託報酬	2,138,030	3,342,186
未収投資助言報酬	344,586	406,420
未収収益	35,477	84,166
その他の流動資産	8,423	43,391
流動資産合計	65,762,982	109,410,202
固定資産		

有形固定資産	1		
建物		1,361,305	1,265,924
器具備品		559,057	516,485
土地		710	710
リース資産		4,114	1,782
建設仮勘定		81,240	-
有形固定資産合計		2,006,427	1,784,901
無形固定資産			
ソフトウェア		2,414,295	2,606,617
ソフトウェア仮勘定		508,956	101,101
のれん		3,045,409	2,740,868
顧客関連資産		11,445,340	9,332,065
電話加入権		12,706	12,706
商標権		36	30
無形固定資産合計		17,426,744	14,793,389
投資その他の資産			
投資有価証券		9,222,276	9,976,957
関係会社株式		11,850,598	1,927,221
長期差入保証金		1,388,987	1,361,654
長期前払費用		80,207	44,009
会員権		90,479	90,479
繰延税金資産		-	716,093
貸倒引当金		20,750	20,750
投資その他の資産合計		22,611,799	14,095,666
固定資産合計		42,044,971	30,673,957
資産合計		107,807,953	140,084,160

(単位：千円)

	前事業年度 (2023年3月31日)	当事業年度 (2024年3月31日)
負債の部		
流動負債		
リース債務	2,564	1,960
顧客からの預り金	11,094	21,728
その他の預り金	128,069	166,944
未払金		
未払収益分配金	2,013	1,927
未払償還金	1,312	1,253
未払手数料	5,194,011	6,580,971
その他未払金	259,542	642,514
未払費用	6,370,986	7,405,559
未払消費税等	406,770	937,155
未払法人税等	333,009	5,104,541
賞与引当金	1,801,492	2,854,060
資産除去債務	13,940	-
その他の流動負債	73,657	17,443
流動負債合計	14,598,465	23,736,060
固定負債		
リース債務	1,960	-
繰延税金負債	550,493	-
退職給付引当金	5,027,832	4,941,989
固定負債合計	5,580,287	4,941,989
負債合計	20,178,752	28,678,050

純資産の部

株主資本		
資本金	2,000,000	2,000,000
資本剰余金		
資本準備金	8,628,984	8,628,984
その他資本剰余金	73,466,962	73,466,962
資本剰余金合計	82,095,946	82,095,946
利益剰余金		
利益準備金	284,245	284,245
その他利益剰余金		
繰越利益剰余金	3,391,568	27,075,963
利益剰余金合計	3,675,814	27,360,208
株主資本計	87,771,760	111,456,155
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	142,558	50,045
評価・換算差額等合計	142,558	50,045
純資産合計	87,629,201	111,406,109
負債・純資産合計	107,807,953	140,084,160

（２）【損益計算書】

	(単位：千円)	
	前事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)	当事業年度 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	61,471,271	69,953,226
運用受託報酬	8,978,419	11,147,187
投資助言報酬	1,273,386	1,302,916
その他営業収益		
サービス支援手数料	208,222	319,553
その他	22,995	8,758
営業収益計	71,954,296	82,731,642
営業費用		
支払手数料	28,036,456	32,014,851
広告宣伝費	294,588	320,694
調査費		
調査費	3,749,357	4,637,211
委託調査費	11,455,987	12,412,033
営業雑経費		
通信費	61,068	56,291
印刷費	452,951	457,187
協会費	38,701	38,305
諸会費	33,447	30,484
情報機器関連費	5,067,617	5,268,275
販売促進費	29,621	31,339
その他	197,696	253,344
営業費用合計	49,417,495	55,520,019
一般管理費		
給料		
役員報酬	219,872	232,329
給料・手当	7,807,797	8,043,456
賞与	1,042,472	1,073,375
賞与引当金繰入額	1,798,492	2,854,060
交際費	27,713	57,134
寄付金	25,518	26,400

事務委託費	1,727,189	2,022,734
旅費交通費	99,733	166,596
租税公課	352,030	600,468
不動産賃借料	1,268,303	1,249,392
退職給付費用	624,551	712,228
固定資産減価償却費	3,247,869	3,281,572
のれん償却費	304,540	304,540
諸経費	200,758	215,455
一般管理費合計	18,746,845	20,839,745
営業利益	3,789,956	6,371,877

(単位：千円)

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

(3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）

（単位：千円）

	株主資本					
	資本金	資本剰余金			利益剰余金	
		資本準備金	その他資本 剰余金	資本剰余金 合計	利益準備金	その他利益剰余金
						繰越利益剰余金
当期首残高	2,000,000	8,628,984	73,466,962	82,095,946	284,245	3,834,794
当期変動額						
剰余金の配当						2,540,254
当期純利益						2,097,028
株主資本以外の 項目の当期変動 額（純額）						
当期変動額合計	-	-	-	-	-	443,225
当期末残高	2,000,000	8,628,984	73,466,962	82,095,946	284,245	3,391,568

	株主資本		評価・換算差額等		純資産合計
	利益剰余金	株主資本合計	その他有価証券 評価差額金	評価・換算 差額等合計	
	利益剰余金 合計				
当期首残高	4,119,040	88,214,986	297,138	297,138	88,512,124
当期変動額					
剰余金の配当	2,540,254	2,540,254			2,540,254
当期純利益	2,097,028	2,097,028			2,097,028
株主資本以外の 項目の当期変動 額（純額）			439,697	439,697	439,697
当期変動額合計	443,225	443,225	439,697	439,697	882,923
当期末残高	3,675,814	87,771,760	142,558	142,558	87,629,201

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、配当の効力発生が翌事業年度になるもの

決議	株式の種類	配当金の総額 (千円)	一株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
2023年6月28日 定時株主総会	普通株式	1,591,892	47.00	2023年 3月31日	2023年 6月29日

当事業年度(自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)

1. 発行済株式数に関する事項

	当期首株式数	当期増加株式数	当期減少株式数	当期末株式数
普通株式	33,870,060株	-	-	33,870,060株

2. 剰余金の配当に関する事項

配当金支払額等

決議	株式の種類	配当金の総額 (千円)	一株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
2023年6月28日 定時株主総会	普通株式	1,591,892	47.00	2023年 3月31日	2023年 6月29日

基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生が翌事業年度になるもの

決議	株式の種類	配当金の総額 (千円)	一株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
2024年6月26日 定時株主総会	普通株式	10,838,419	320.00	2024年 3月31日	2024年 6月27日

(リース取引関係)

オペレーティング・リース取引

(借主側)

オペレーティング・リース取引のうち解約不能のものに係る未経過リース料

(単位：千円)

	前事業年度 (2023年3月31日)	当事業年度 (2024年3月31日)
1年以内	1,161,545	1,161,545
1年超	1,161,545	-
合計	2,323,090	1,161,545

(金融商品関係)

１.金融商品の状況に関する事項

(1)金融商品に対する取組方針

当社は、投資運用業及び投資助言業などの金融サービス事業を行っており、当社が設定する投資信託の事業推進等を目的として、直接または特定金外信託を通じて当該投資信託を保有しております。特定金外信託を通じ行っているデリバティブ取引については、保有する投資信託にかかる将来の為替及び価格の変動によるリスクの軽減を目的としているため、投資信託保有残高の範囲内で行うこととし、投機目的のためのデリバティブ取引は行わない方針であります。

なお、資金運用については、短期的で安全性の高い金融資産に限定し、財務体質の健全性、安全性、流動性の確保を第一とし、顧客利益に反しない運用を行っています。

また、資金調達はありません。

(2)金融商品の内容及びそのリスク

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

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

営業債務である未払手数料は、すべて1年以内の支払期日であります。

(3)金融商品に係るリスク管理体制

信用リスクの管理

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

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

市場リスクの管理

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

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

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

２.金融商品の時価等に関する事項

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

前事業年度（2023年3月31日）

（単位：千円）

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

当事業年度（2024年3月31日）

（単位：千円）

区分	貸借対照表計上額	時価	差額
(1)金銭の信託	23,435,831	23,435,831	-
(2)投資有価証券 その他有価証券	9,292,678	9,292,678	-
資産計	32,728,510	32,728,510	-

(注1)市場価格のない金融商品の貸借対照表計上額

(単位：千円)

区分	前事業年度 (2023年3月31日)	当事業年度 (2024年3月31日)
その他有価証券		
(1)非上場株式	39,809	40,370
(2)組合出資金等	-	643,909
合計	39,809	684,279
子会社株式		
非上場株式	11,850,598	1,927,221
合計	11,850,598	1,927,221

3.金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項

金融商品の時価を、時価の算定に係るインプットの観察可能性及び重要性に応じて、以下の3つのレベルに分類しております。なお、時価算定会計基準適用指針27-3項に定める経過的な取扱いに従って、前事業年度に係る「金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項」については記載しておりません。

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

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

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

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

時価で貸借対照表に計上している金融商品

前事業年度（2023年3月31日）

(単位：千円)

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

当事業年度（2024年3月31日）

(単位：千円)

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

時価の算定に用いた評価技法及び時価の算定に係るインプットの説明

(1) 金銭の信託

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

(2) 投資有価証券 その他有価証券

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

(有価証券関係)

1.子会社株式

前事業年度（2023年3月31日）

子会社株式（貸借対照表計上額 関係会社株式11,850,598千円）は、市場価格がないことから、記載しておりません。

当事業年度（2024年3月31日）

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

2.その他有価証券

前事業年度（2023年3月31日）

（単位：千円）

区分	貸借対照表計上額	取得原価	差額
(1)貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの 投資信託等	3,144,004	3,054,367	89,637
小計	3,144,004	3,054,367	89,637
(2)貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの 投資信託等	6,038,462	6,295,278	256,815
小計	6,038,462	6,295,278	256,815
合計	9,182,466	9,349,645	167,178

（注）非上場株式等（貸借対照表計上額 39,809千円）については、市場価格がないことから、記載しておりません。

当事業年度（2024年3月31日）

（単位：千円）

区分	貸借対照表計上額	取得原価	差額
(1)貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの 投資信託等	3,489,939	3,297,367	192,572
小計	3,489,939	3,297,367	192,572
(2)貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの 投資信託等	5,802,739	6,025,562	222,822
小計	5,802,739	6,025,562	222,822
合計	9,292,678	9,322,929	30,250

（注）非上場株式等（貸借対照表計上額 684,279千円）については、市場価格がないことから、記載しておりません。

3.事業年度中に売却したその他有価証券

前事業年度(自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)

（単位：千円）

売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
1,675,637	25,848	152,691

（単位：千円）

償還額	償還益の合計額	償還損の合計額
6,449,143	119,033	83,598

当事業年度(自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)

（単位：千円）

売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
801,686	12,261	48,575

（単位：千円）

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

(退職給付関係)

1.採用している退職給付制度の概要

当社は、確定給付型の制度として、退職一時金制度を設けております。また、確定拠出型の制度として、確定拠出年金制度を設けております。

2.確定給付制度

(1)退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

（単位：千円）

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

(2)退職給付債務の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金の調整表

（単位：千円）

	前事業年度 （2023年3月31日）	当事業年度 （2024年3月31日）
非積立型制度の退職給付債務	5,027,832	4,941,989
未認識数理計算上の差異	-	-
未認識過去勤務費用	-	-
退職給付引当金	5,027,832	4,941,989

(3)退職給付費用及びその内訳項目の金額

（単位：千円）

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

（注）その他は、その他の関係会社等からの出向者の年金掛金負担分及び退職給付引当額相当額負担分、退職定年制度適用による割増退職金であります。

(4)数理計算上の計算基礎に関する事項

主要な数理計算上の計算基礎（加重平均で表わしております。）

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

3．確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、前事業年度241,556千円、当事業年度264,552千円であります。

(税効果会計関係)

1．繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

（単位：千円）

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

２．法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間に重要な差異があるときの、当該差異の原因となった主要な項目別の内訳

	前事業年度 (2023年3月31日)	当事業年度 (2024年3月31日)
法定実効税率	30.6%	30.6%
(調整)		
受取配当等永久に益金に算入されない項目	0.0	10.6
のれん償却費	2.9	0.2
交際費等永久に損金に算入されない項目	3.0	0.1
所得税額控除による税額控除	1.3	-
その他	1.2	0.0
税効果会計適用後の法人税等の負担率	34.0	20.4

(収益認識関係)

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

(セグメント情報等)

前事業年度(自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)

１．セグメント情報

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

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

２．関連情報

(1)製品及びサービスごとの情報

(単位：千円)

	委託者報酬	運用受託報酬	投資助言報酬	その他	合計
外部顧客への 営業収益	61,471,271	8,978,419	1,273,386	231,218	71,954,296

(2)地域ごとの情報

営業収益

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

有形固定資産

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

(3)主要な顧客ごとの情報

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

３．報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

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

４．報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

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

５．報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

該当事項はありません。

当事業年度(自 2023年4月1日 至2024年3月31日)

１．セグメント情報

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

従って、当社の事業区分は、「投資・金融サービス業」という単一の事業セグメントに属しており、事業の種類別セ

グメント情報の記載を省略しております。

2. 関連情報

(1) 製品及びサービスごとの情報

（単位：千円）

	委託者報酬	運用受託報酬	投資助言報酬	その他	合計
外部顧客への 営業収益	69,953,226	11,147,187	1,302,916	328,311	82,731,642

(2) 地域ごとの情報

営業収益

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

有形固定資産

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

(3) 主要な顧客ごとの情報

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

3. 報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

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

4. 報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

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

5. 報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

該当事項はありません。

(関連当事者情報)

前事業年度(自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)

1. 関連当事者との取引

(1) 兄弟会社等

（単位：千円）

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

(注) 取引条件及び取引条件の決定方針等

投信の販売委託については、一般取引条件を基に、協議の上決定しております。

2. 親会社に関する注記

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

当事業年度(自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)

1. 関連当事者との取引

(1) 兄弟会社等

（単位：千円）

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

(注) 取引条件及び取引条件の決定方針等

投信の販売委託については、一般取引条件を基に、協議の上決定しております。

２．親会社に関する注記

（単位：千円）

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

（注）子会社株式の売却及び子会社株式売却益

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

（１株当たり情報）

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

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

２．１株当たり当期純利益の算定上の基礎は、次のとおりであります。

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

中間財務諸表

(1)中間貸借対照表

（単位：千円）

第40期中間会計期間 （2024年9月30日）		
資産の部		
流動資産		
現金及び預金		47,554,844
金銭の信託		32,385,266
顧客分別金信託		500,088
前払費用		668,897
未収委託者報酬		14,766,695
未収運用受託報酬		3,912,269
未収投資助言報酬		414,955
未収収益		95,923
その他		107,185
流動資産合計		100,406,126
固定資産		
有形固定資産	1	1,723,779
無形固定資産		
のれん		2,588,598
顧客関連資産		8,275,427
その他		2,669,494

無形固定資産合計		13,533,520
投資その他の資産		
投資有価証券		8,628,900
関係会社株式		1,927,221
繰延税金資産		851,984
その他		1,484,455
貸倒引当金		20,750
投資その他の資産合計		12,871,811
固定資産合計		28,129,111
資産合計		128,535,237
負債の部		
流動負債		
顧客からの預り金		35,815
その他の預り金		102,081
未払金		6,905,143
未払費用		6,996,236
未払法人税等		1,639,174
前受収益		20,339
賞与引当金		2,605,528
その他	2	864,362
流動負債合計		19,168,682
固定負債		
退職給付引当金		5,101,556
固定負債合計		5,101,556
負債合計		24,270,238
純資産の部		
株主資本		
資本金		2,000,000
資本剰余金		
資本準備金		8,628,984
その他資本剰余金		73,466,962
資本剰余金合計		82,095,946
利益剰余金		
利益準備金		284,245
その他利益剰余金		
繰越利益剰余金		19,992,998
利益剰余金合計		20,277,244
株主資本合計		104,373,190
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金		108,191
評価・換算差額等合計		108,191
純資産合計		104,264,998
負債純資産合計		128,535,237

(2) 中間損益計算書

(単位：千円)

	第40期中間会計期間 (自 2024年4月1日 至 2024年9月30日)
営業収益	

委託者報酬		38,900,518
運用受託報酬		5,763,952
投資助言報酬		699,359
その他の営業収益		206,638
営業収益計		45,570,468
営業費用		30,344,119
一般管理費	1	10,363,314
営業利益		4,863,035
営業外収益	2	482,490
営業外費用	3	179,370
経常利益		5,166,155
特別損失	4	0
税引前中間純利益		5,166,155
法人税、住民税及び事業税		1,475,655
法人税等調整額		64,954
法人税等合計		1,410,700
中間純利益		3,755,454

(3)中間株主資本等変動計算書

第40期中間会計期間（自 2024年4月1日 至 2024年9月30日）

（単位：千円）

	株主資本					
	資本金	資本剰余金			利益剰余金	
		資本準備金	その他資本 剰余金	資本剰余金 合計	利益 準備金	その他利益剰余金
						繰越利益 剰余金
当期首残高	2,000,000	8,628,984	73,466,962	82,095,946	284,245	27,075,963
当中間期変動額						
剰余金の配当						10,838,419
中間純利益						3,755,454
株主資本以外の 項目の当中間期 変動額（純額）						
当中間期変動額合計	-	-	-	-	-	7,082,964
当中間期末残高	2,000,000	8,628,984	73,466,962	82,095,946	284,245	19,992,998

	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	27,360,208	111,456,155	50,045	50,045	111,406,109
当中間期変動額					
剰余金の配当	10,838,419	10,838,419			10,838,419
中間純利益	3,755,454	3,755,454			3,755,454
株主資本以外の 項目の当中間期 変動額（純額）			58,146	58,146	58,146
当中間期変動額合計	7,082,964	7,082,964	58,146	58,146	7,141,110
当中間期末残高	20,277,244	104,373,190	108,191	108,191	104,264,998

注記事項

（重要な会計方針）

１．資産の評価基準及び評価方法

(1)有価証券

子会社株式

移動平均法による原価法

その他有価証券

市場価格のない株式等以外

中間会計期間末日の市場価格等に基づく時価法

（評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定）

市場価格のない株式等

移動平均法による原価法

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、当中間会計期間の負担額を計上しております。

(3)退職給付引当金

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

退職給付見込額の期間帰属方法

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

数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法

過去勤務費用については、その発生時において一時に費用処理しております。

数理計算上の差異については、その発生時において一時に費用処理しております。

４．収益及び費用の計上基準

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

(1)委託者報酬

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

(2)運用受託報酬

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

(3)投資助言報酬

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

(中間貸借対照表関係)

第40期中間会計期間 (2024年9月30日)	
1.有形固定資産の減価償却累計額	1,996,227千円
2.消費税等の取扱い	仮払消費税等及び仮受消費税等は、相殺のうえ、金額的重要性が乏しいため、流動負債のその他に含めて表示しております。
3.当社は、運転資金の効率的な調達を行うため取引銀行1行と当座借越契約を締結しております。 当中間会計期間末における当座借越契約に係る借入金未実行残高等は次のとおりであります。	
当座借越極度額の総額	10,000,000千円
借入実行残高	-
差引額	10,000,000千円

(中間損益計算書関係)

第40期中間会計期間 (自 2024年4月1日 至 2024年9月30日)	
1.一般管理費のうち主要なもの	
のれん償却費	152,270千円
減価償却実施額	
有形固定資産	134,998千円
無形固定資産	1,537,662千円
2.営業外収益のうち主要なもの	
受取配当金	387,174千円
投資有価証券売却益	798千円
為替差益	6,926千円
3.営業外費用のうち主要なもの	
金銭の信託運用損	11,765千円
投資有価証券償還損	124,882千円
投資有価証券売却損	93千円
投資事業組合運用損	42,628千円
4.特別損失のうち主要なもの	
固定資産除却損	0千円

(中間株主資本等変動計算書関係)

第40期中間会計期間（自 2024年4月1日 至 2024年9月30日）

1．発行済株式数に関する事項

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

2．剰余金の配当に関する事項

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

第40期中間会計期間 （自 2024年4月1日 至 2024年9月30日）	
１．オペレーティング・リース取引 （借主側）	
未経過リース料（解約不能のもの）	
１年以内	1,145,406千円
１年超	5,081,701千円
合 計	6,227,108千円

（金融商品関係）

１．金融商品の時価等に関する事項

第40期中間会計期間（2024年9月30日）

2024年9月30日における中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。なお、市場価格のないものは、次表には含まれておりません（（注1）参照）。また、現金及び預金、顧客分別金信託、未収委託者報酬、未収運用受託報酬、未収投資助言報酬、顧客からの預り金、未払金は、短期間で決済されるため時価が帳簿価額に近似することから、注記を省略しております。

（単位：千円）

区分	中間貸借対照表計上額	時価	差額
(1)金銭の信託	32,385,266	32,385,266	-
(2)投資有価証券 その他有価証券	7,511,892	7,511,892	-
資産計	39,897,158	39,897,158	-

（注1）市場価格のない金融商品

（単位：千円）

区分	中間貸借対照表計上額
その他有価証券	
(1)非上場株式	40,367
(2)組合出資金等	1,076,640
合計	1,117,008
子会社株式	
非上場株式	1,927,221
合計	1,927,221

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

２．金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項

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

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

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

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

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

時価で中間貸借対照表に計上している金融商品

（単位：千円）

区分	時価			
	レベル1	レベル2	レベル3	合計
(1)金銭の信託	-	32,385,266	-	32,385,266
(2)投資有価証券 その他有価証券	-	7,511,892	-	7,511,892
資産計	-	39,897,158	-	39,897,158

（注１）時価の算定に用いた評価技法及び時価の算定に係るインプットの説明

（１）金銭の信託

信託財産は、主として投資信託、デリバティブ取引、その他の資産（コールローン・委託証拠金等）で構成され

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

（２）投資有価証券 その他有価証券

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

（有価証券関係）

第40期中間会計期間（2024年9月30日）

１．子会社株式

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

２．その他有価証券

（単位：千円）

区分	中間貸借対照表計上額	取得原価	差額
(1)中間貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの 投資信託等	3,313,926	3,300,367	13,559
小計	3,313,926	3,300,367	13,559
(2)中間貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの 投資信託等	4,197,965	4,313,296	115,330
小計	4,197,965	4,313,296	115,330
合計	7,511,892	7,613,663	101,770

（注）組合出資金等（中間貸借対照表計上額 1,117,008千円）については、市場価格がないことから、記載しておりません。

（デリバティブ取引関係）

当社は、デリバティブ取引を全く行っておりませんので、該当事項はありません。

（収益認識関係）

第40期中間会計期間（自 2024年4月1日 至 2024年9月30日）

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

（セグメント情報等）

第40期中間会計期間（自 2024年4月1日 至 2024年9月30日）

１．セグメント情報

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

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

２．関連情報

（1）製品及びサービスごとの情報

（単位：千円）

	委託者報酬	運用受託報酬	投資助言報酬	その他	合計
外部顧客への営業収益	38,900,518	5,763,952	699,359	206,638	45,570,468

（2）地域ごとの情報

営業収益

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

有形固定資産

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

(3) 主要な顧客ごとの情報

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

3. 報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

該当事項はありません。

4. 報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

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

5. 報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

該当事項はありません。

(1株当たり情報)

第40期中間会計期間 (自 2024年4月1日 至 2024年9月30日)	
1株当たり純資産額	3,078円38銭
1株当たり中間純利益	110円87銭
なお、潜在株式調整後1株当たり中間純利益については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。	

4【利害関係人との取引制限】

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

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

5【その他】

イ 定款の変更、その他の重要事項

(イ) 定款の変更

該当ありません。

(ロ) その他の重要事項

該当ありません。

ロ 訴訟事件その他会社に重要な影響を与えることが予想される事実

該当ありません。

第２【その他の関係法人の概況】

１【名称、資本金の額及び事業の内容】

イ 受託会社

- （イ）名称 三井住友信託銀行株式会社
- （ロ）資本金の額 342,037百万円（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
株式会社三井住友銀行	1,770,996	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【参考情報】

ファンドについては、当計算期間において以下の書類が提出されております。

提出年月日	提出書類
2024年 5月16日	有価証券届出書
2024年 5月16日	有価証券報告書
2024年11月14日	有価証券届出書
2024年11月14日	半期報告書

独立監査人の監査報告書

2024年 6 月14日

三井住友DSアセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士 佐 藤 栄 裕

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士 深 井 康 治

監査意見

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

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三井住友DSアセットマネジメント株式会社の2024年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

その他の記載内容は、監査した財務諸表を含む開示書類に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。

当監査法人は、その他の記載内容が存在しないと判断したため、その他の記載内容に対するいかなる作業も実施していない。

財務諸表に対する経営者並びに監査役及び監査役会の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

- ・不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。

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

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

利害関係

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

以 上

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

２．XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

2025年4月30日

三井住友DSアセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

PwC Japan有限責任監査法人

東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士 和田 渉

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士 榊原 康太

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている三井住友DS・年金バランス30（債券重点型）の2024年2月20日から2025年2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・年金バランス30（債券重点型）の2025年2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、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

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

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

利害関係

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

以 上

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

独立監査人の監査報告書

2025年4月30日

三井住友DSアセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

PwC Japan有限責任監査法人

東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士 和田 渉

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士 榊原 康太

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている三井住友DS・年金バランス50（標準型）の2024年2月20日から2025年2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・年金バランス50（標準型）の2025年2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、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

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

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

利害関係

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

以 上

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

独立監査人の監査報告書

2025年4月30日

三井住友DSアセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

PwC Japan有限責任監査法人

東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士 和田 渉

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士 榊原 康太

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている三井住友DS・年金バランス70（株式重点型）の2024年2月20日から2025年2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・年金バランス70（株式重点型）の2025年2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、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

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

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

利害関係

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

以 上

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

独立監査人の中間監査報告書

2024年11月18日

三井住友DSアセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士

佐 藤 栄 裕

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士

深 井 康 治

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている三井住友DSアセットマネジメント株式会社の2024年4月1日から2025年3月31日までの第40期事業年度の中間会計期間（2024年4月1日から2024年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、三井住友DSアセットマネジメント株式会社の2024年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（2024年4月1日から2024年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

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

中間財務諸表に対する経営者並びに監査役及び監査役会の責任

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

中間財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき中間財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

- ・不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。
- ・中間財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間

財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。

- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、企業は継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 中間財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。

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

利害関係

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

以 上

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

２．XBRLデータは中間監査の対象には含まれていません。