

【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2023年1月10日提出
【発行者名】	三井住友D Sアセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 猿田 隆
【本店の所在の場所】	東京都港区虎ノ門一丁目17番1号
【事務連絡者氏名】	土屋 裕子
【電話番号】	03-6205-1649
【届出の対象とした募集(売出)内国投資 信託受益証券に係るファンドの名称】	S M A M ・ グローバルバランスファンド(機動的資産配分型)
【届出の対象とした募集(売出)内国投資 信託受益証券の金額】	5兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【証券情報】

（１）【ファンドの名称】

S M A M ・ グローバルバランスファンド（機動的資産配分型）
（愛称として「資産配分おまかせくん」という名称を用いることがあります。）
以下「当ファンド」といいます。

（２）【内国投資信託受益証券の形態等】

追加型証券投資信託の受益権です。

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

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

（３）【発行（売出）価額の総額】

5兆円を上限とします。

（４）【発行（売出）価格】

取得申込受付日の翌営業日の基準価額となります。

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

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

基準価額は、組入有価証券の値動き等により日々変動します。

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

委託会社に対する照会は下記においてできます。

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

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

（５）【申込手数料】

ありません。

(6) 【申込単位】

お申込単位の詳細は、お申込みの販売会社にお問い合わせください。

(7) 【申込期間】

2023年1月11日から2023年7月10日まで

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

(8) 【申込取扱場所】

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

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

(9) 【払込期日】

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

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

(10) 【払込取扱場所】

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

(11) 【振替機関に関する事項】

当ファンドの振替機関は下記の通りです。

株式会社証券保管振替機構

(12) 【その他】

イ 申込証拠金
ありません。

ロ 日本以外の地域における募集
ありません。

ハ クーリング・オフ制度(金融商品取引法第37条の6)の適用
ありません。

ニ 振替受益権について

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

(参考：投資信託振替制度)

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

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

（1）【ファンドの目的及び基本的性格】

イ 当ファンドは、国内株式インデックス・マザーファンド（B号）、国内債券パッシブ・マザーファンド、外国株式インデックス・マザーファンド、外国債券パッシブ・マザーファンドおよびマネーインカム・マザーファンドの受益証券への投資を通じて、日本を含む世界各国の株式、公社債および短期金融資産に分散投資を行うことにより、信託財産の着実な成長を目指した運用を行います。

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

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

ハ 当ファンドが該当する商品分類、属性区分は次の通りです。

（イ）当ファンドが該当する商品分類

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

（ロ）当ファンドが該当する属性区分

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

為替ヘッジ	為替ヘッジなし	目論見書または信託約款において、対円での為替のヘッジを行わない旨の記載があるものまたは対円での為替のヘッジを行う旨の記載がないものをいいます。
-------	---------	---

商品分類表

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

属性区分表

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

資産配分変更			
--------	--	--	--

（注）当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

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

（２）【ファンドの沿革】

2008年3月31日 信託契約締結、設定、運用開始。
 2015年2月27日 「スミセイ・DCバランスファンド（機動的資産配分型）」から「SMAM・グローバルバランスファンド（機動的資産配分型）」に名称を変更。

（３）【ファンドの仕組み】

イ 当ファンドの関係法人とその役割

（イ）委託会社 「三井住友D Sアセットマネジメント株式会社」

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

（ロ）受託会社 「三井住友信託銀行株式会社」

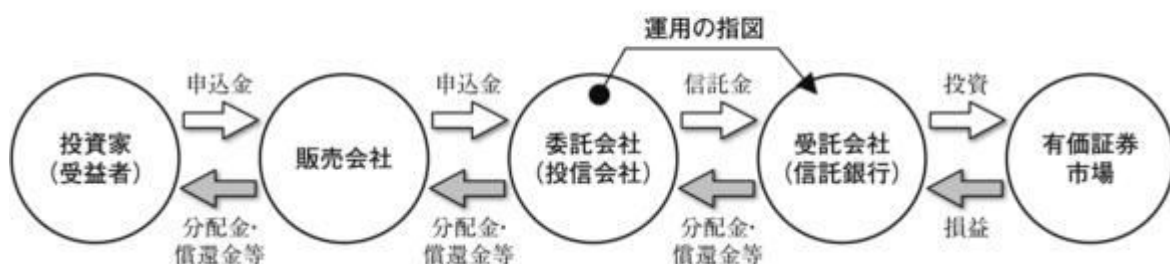
証券投資信託契約に基づき、信託財産の保管・管理・計算等を行います。なお、信託事務の一部につき、株式会社日本カストディ銀行に委託することがあります。また、外国における資産の保管は、その業務を行うに十分な能力を有すると認められる外国の金融機関が行う場合があります。

（ハ）販売会社

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

委託会社は販売会社としての役割も有します。

運営の仕組み



ロ 委託会社の概況

（イ）資本金の額

20億円（2022年10月31日現在）

(ロ) 会社の沿革

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

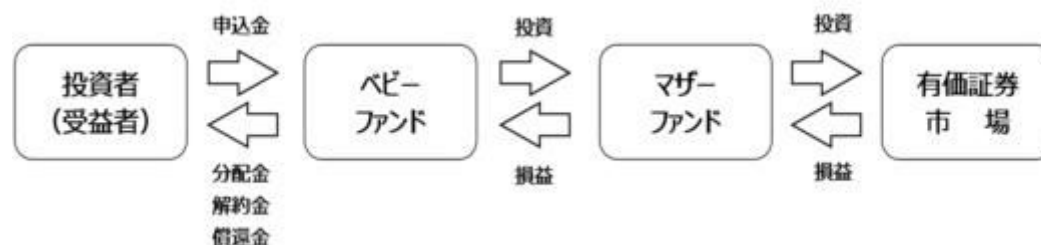
(ハ) 大株主の状況

(2022年10月31日現在)

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

八 ファンドの運用形態（ファミリーファンド方式による運用）

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



2【投資方針】

(1)【投資方針】

イ 基本方針

当ファンドは、マザーファンドの受益証券への投資を通じて、信託財産の着実な成長を目指した

運用を行います。

□ 投資態度

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

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

(ロ) 委託会社が独自に作成する基本資産配分に対し一定の許容変動幅内で機動的に資産配分を変更します。

ファンドの基本資産配分ならびに各資産の許容変動幅

資産配分					
	国内株式	国内債券	外国株式	外国債券	短期金融資産
基本	20%	50%	10%	15%	5%
上限	35%	65%	25%	30%	20%
下限	5%	35%	0%	0%	0%

(注) 基本資産配分は、5年に一回程度検証を行い、必要であれば見直しを行います。

(ハ) 運用にあたっては、基本資産配分に基づいて、以下の指数を合成したベンチマークを上回る投資成果を目指します。

国内株式	国内債券	外国株式	外国債券	短期金融資産
TOPIX (東証株価指数、 配当込み)	NOMURA - BPI (総合)	MSCIコクサイ インデックス (円ベース)	FTSE世界国債 インデックス (除く日本、 円ベース)	無担保コール 翌日物
20%	50%	10%	15%	5%

(注) 基本資産配分の見直しに伴い見直しを行います。

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

(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 日本を含む世界各国の株式、公社債および短期金融資産に分散投資することにより、信託財産の着実な成長を目指した運用を行います。

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

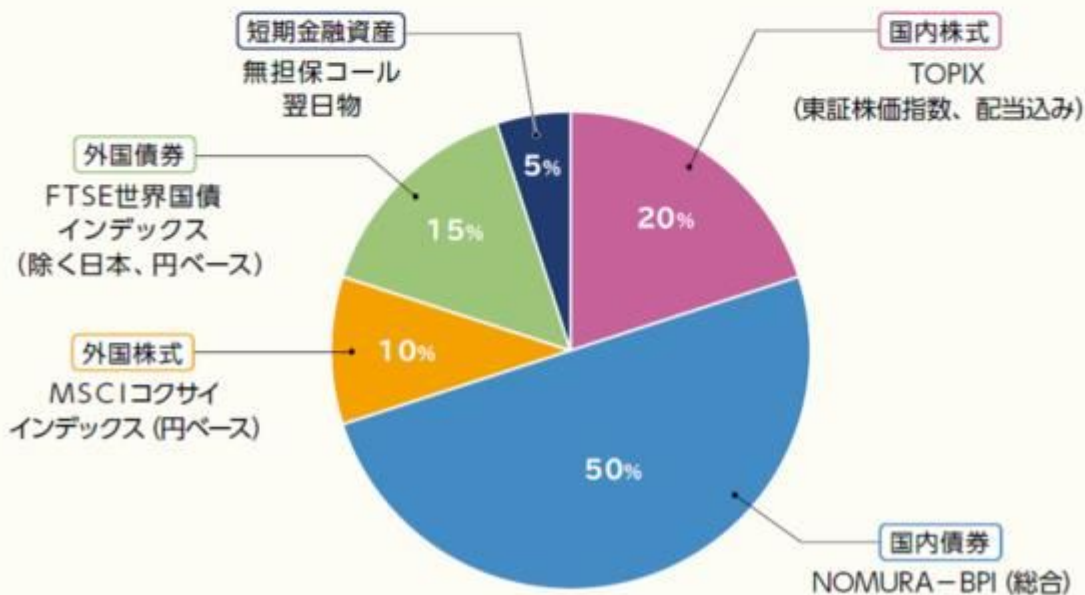
2 委託会社が独自に作成する基本資産配分に対し、一定の許容変動幅内で機動的に資産配分を変更します。

- 基本資産配分は、5年に一回程度検証を行い、必要であれば見直しを行います。

〔ファンドの基本資産配分ならびに各資産の許容変動幅〕

	国内株式	国内債券	外国株式	外国債券	短期金融資産
基本資産配分	20%	50%	10%	15%	5%
変動幅	5～35%	35～65%	0～25%	0～30%	0～20%

3 運用にあたっては、基本資産配分に基づいて、以下の指数を合成したベンチマークを上回る投資成果を目指します。



※基本資産配分の見直しに伴い、ベンチマークの合成比率の見直しも行います。

4 実質外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行いません。

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

- TOPIX(東証株価指数、配当込み)、NOMURA-BPI(総合)、MSCIコクサイインデックス、FTSE世界国債インデックスは、それぞれ株式会社JPX総研、野村證券株式会社、MSCI Inc.、FTSE Fixed Income LLCが公表している指数で各社の知的財産です。
- 指数を公表する各社は当ファンドの運用と何ら関係ありません。

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。



※許容変動幅内で機動的に資産配分を変更するため、すべてのマザーファンドに投資するとは限りません。

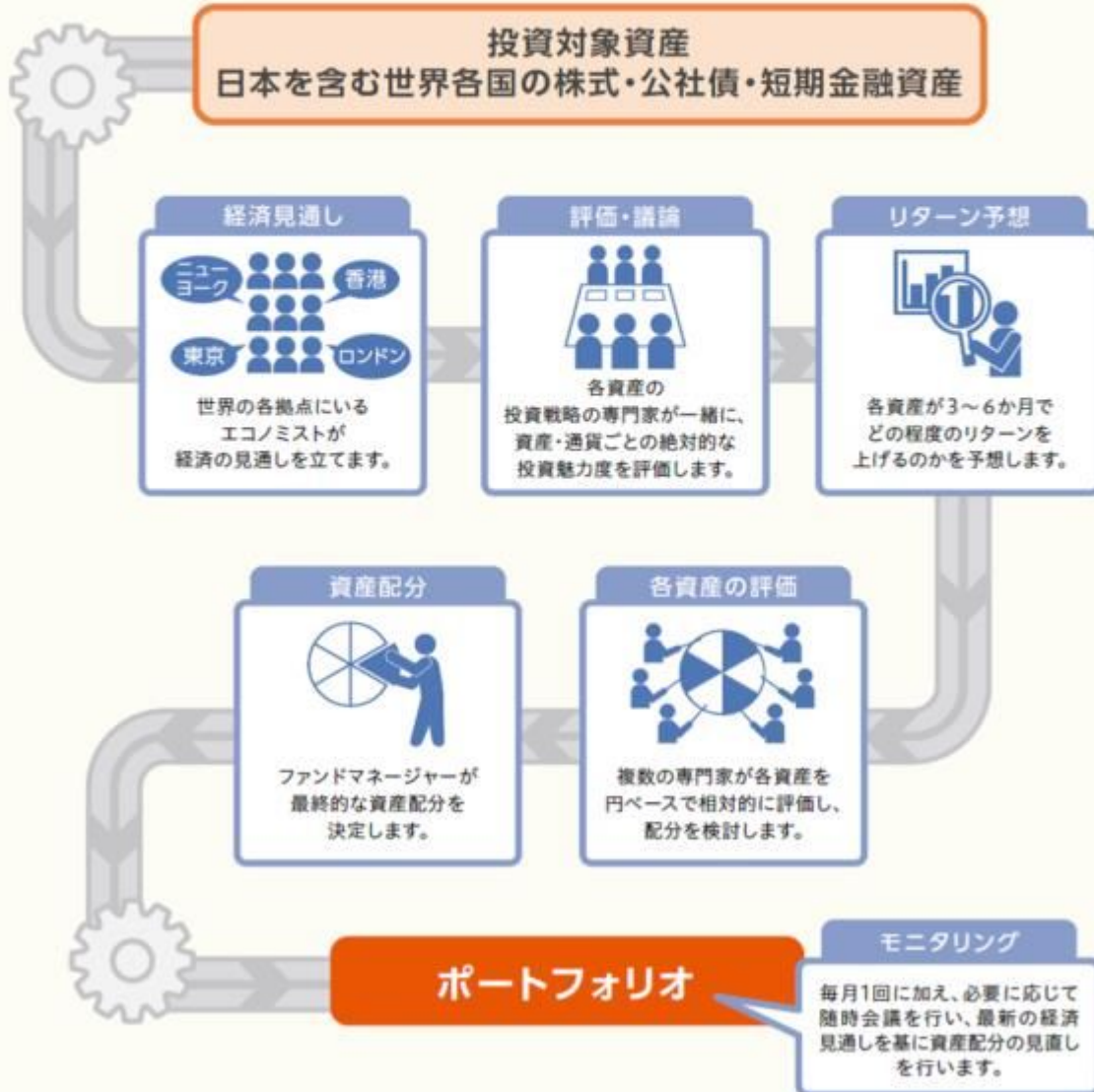
運用(資産配分)プロセス

Voice

運用担当者からのメッセージ

当ファンドは、株式や債券といった伝統的な資産に分散投資を行い、これから投資を始める方にとってわかりやすいしくみのファンドです。

また、愛称の「資産配分おまかせくん」の通り、市場の動きに合わせて資産配分比率を機動的に変更し、相場が上がるときにはその恩恵を受け、下がる時には損失を抑えることを目指しています。そのため、長期的な資産形成にご活用いただけるファンドです。



※上記は、投資者の皆さまに当ファンドの運用プロセスについてわかりやすくお伝えするため、専門用語等を言い換えたり、省略している場合があります。

※上記の運用プロセスは2022年10月末現在のものであり、今後変更される場合があります。

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（円ベース）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、円ベース）に近づけたポートフォリオを構築します。

▶マネーインカム・マザーファンド

- 主として円貨建の短期公社債および短期金融商品に投資し、安定した収益の確保を目指した運用を行います。



最適化法とは

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

層化抽出法とは

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

デュレーションとは

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

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

1. 株券または新株引受権証書

2. 国債証券

3. 地方債証券

4. 特別の法律により法人の発行する債券

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

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

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

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

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

10. コマーシャル・ペーパー

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

12. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前各号の証券または証書の性質を有するもの

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

14. 投資証券もしくは投資法人債券または外国投資証券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。)

15. 外国貸付債権信託受益証券(金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。)

16. オプションを表示する証券または証書(金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券にかかるものに限りません。)

17. 預託証書(金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。)

18. 外国法人が発行する譲渡性預金証書

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

20. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの

21. 外国の者に対する権利で前号の有価証券の性質を有するもの

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

八 投資対象とする金融商品

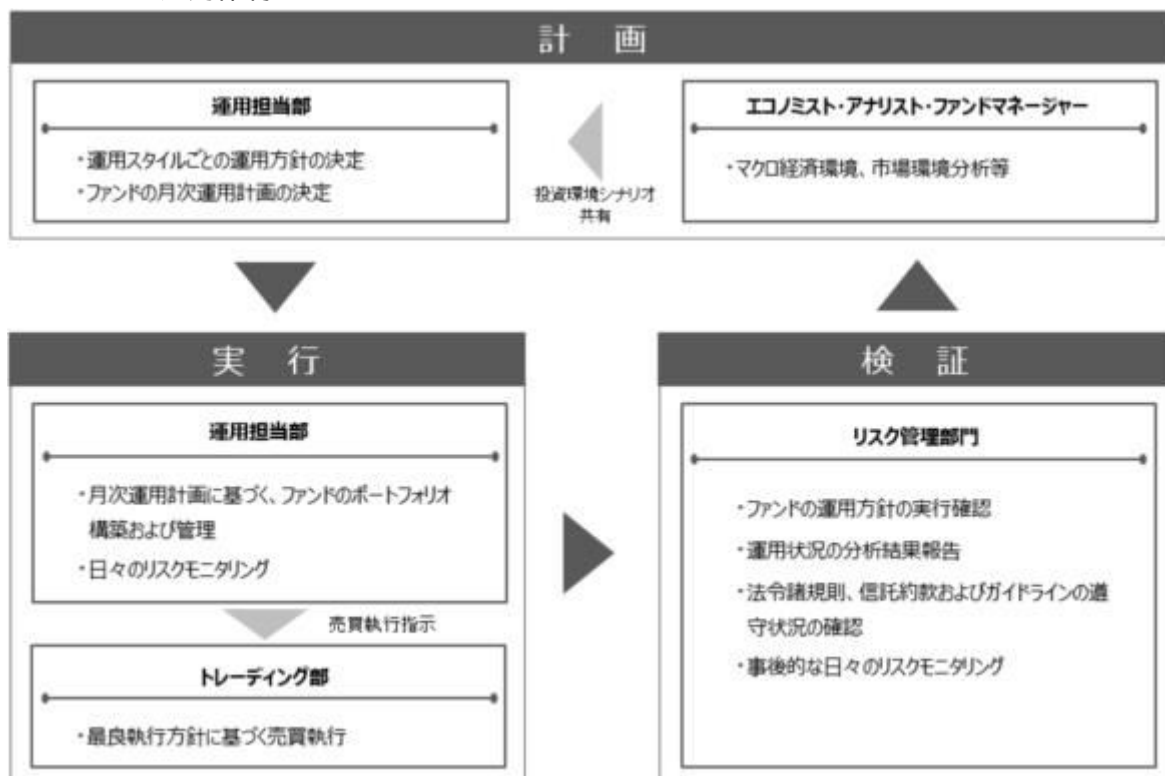
委託会社は、信託金を、上記口に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品(金融商品取引法

第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。)により運用することを指図することができます。

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

(3) 【運用体制】

イ ファンドの運用体制



リスク管理部門の人員数は、約50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) 【配分方針】

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

- イ 分配対象額は、経費控除後の配当等収益と有価証券売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。
- ロ 収益分配金額は、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象収益が少額の場合等には、委託会社の判断により収益分配を行わない場合もあるため、将来の

分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

八 留保益の運用については、前記「(1)投資方針」に基づいて運用を行います。

ファンドは複利効果による信託財産の成長を優先するため、分配を極力抑制します。(基準価額水準、市況動向等によっては変更する場合があります。)

(5)【投資制限】

ファンドの信託約款に基づく主要な投資制限

- イ 株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の70%以下とします。
実質投資割合とは、当ファンドが保有するある種類の資産の評価額が当ファンドの純資産総額に占める比率(「組入比率」といいます。)と、当該同一種類の資産のマザーファンドにおける組入比率に当該マザーファンド受益証券の当ファンドにおける組入比率を乗じて得た率を合計したものをいいます(以下同じ。)
- ロ 新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。
- ハ マザーファンド受益証券以外の投資信託証券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- ニ 外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の70%以下とします。
- ホ 同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- ヘ 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

ファンドの信託約款に基づくその他の投資制限

- イ 投資する株式等の範囲
 - (イ) 委託会社が投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、取引所に上場している株式の発行会社の発行するもの、取引所に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。
 - (ロ) 上記(イ)にかかわらず、上場予定または登録予定の株式、新株引受権証券および新株予約権証券で目論見書等において上場または登録することが確認できるものについては委託会社が投資することを指図することができるものとします。
- ロ 信用取引の指図
 - (イ) 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売り付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、株券の引渡しまたは買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。
 - (ロ) 信用取引の指図は、当該売付けにかかる建玉の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する当該売付けにかかる建玉の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
 - (ハ) 上記(ロ)において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める当該売付けにかかる建玉の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
 - (ニ) 信託財産の一部解約等の事由により、上記(ロ)の売付けにかかる建玉の時価総額の合計額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する売付けの一部を決済するための指図をするものとします。

ハ 先物取引等の指図

- (イ) 委託会社は、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。

ニ 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合計額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記純資産総額が減少して、スワップ取引の想定元本の合計額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当するスワップ取引の一部の解約を指図するものとします。
- (ニ) スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額により行うものとします。
- (ホ) 委託会社は、スワップ取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

ホ 金利先渡取引および為替先渡取引の指図

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

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

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

へ 有価証券の貸付けの指図

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

ト 有価証券の空売りの指図

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

チ 有価証券の借入れの指図

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

リ 特別の場合の外貨建有価証券への投資制限

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

ヌ 外国為替予約取引の指図

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

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

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

ル 資金の借入れ

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

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

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

(ニ) 借入金の利息は、信託財産中から支弁します。

ヲ デリバティブ取引等にかかる投資制限

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

法令に基づく投資制限

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

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

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

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

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

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

(参考情報:マザーファンドの投資方針等)

(国内株式インデックス・マザーファンド(B号))

(1)投資方針等

イ 基本方針

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

ロ 投資態度

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

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

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

(2)投資対象

イ 投資対象とする資産の種類

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

ロ 投資対象とする有価証券

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

ハ 投資対象とする金融商品

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

(3)投資制限

イ ファンドの信託約款に基づく主要な投資制限

(イ)外貨建資産への投資は行いません。

(ロ)株式への投資割合には制限を設けません。

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

(ニ)デリバティブ取引(法人税法第61条の5に定めるものをいいます。)は、価格変動リスクおよ

び金利変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。

(国内債券パッシブ・マザーファンド)

(1) 投資方針等

イ 基本方針

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

ロ 投資態度

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

(ロ) 公社債の組入比率は原則として高位を保ちます。

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

(2) 投資対象

イ 投資対象とする資産の種類

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

ロ 投資対象とする有価証券

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

ハ 投資対象とする金融商品

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

(3) 投資制限

イ ファンドの信託約款に基づく主要な投資制限

(イ) 株式(新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。)への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。

(ロ) 新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。

(ハ) 投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。

(ニ) 外貨建資産への投資は行いません。

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

(ヘ) デリバティブ取引(法人税法第61条の5に定めるものをいいます。)は、価格変動リスク、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。

(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

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、円ベース)の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。

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

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

(2) 投資対象

イ 投資対象とする資産の種類

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

ロ 投資対象とする有価証券

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

ハ 投資対象とする金融商品

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

(3) 投資制限

イ ファンドの信託約款に基づく主要な投資制限

(イ) 株式への投資割合には制限を設けません。

(ロ) 外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

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

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

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

(外国債券パッシブ・マザーファンド)

(1) 投資方針等

イ 基本方針

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

ロ 投資態度

(イ) FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)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、原則として対円で為替ヘッジを行いません。

(ホ) 公社債の組入比率は原則として高位を保ちます。

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

(2) 投資対象

イ 投資対象とする資産の種類

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

ロ 投資対象とする有価証券

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

ハ 投資対象とする金融商品

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

(3) 投資制限

イ ファンドの信託約款に基づく主要な投資制限

(イ) 株式(新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。)への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。

(ロ) 投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。

(ハ) 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

(ニ) 同一発行体の発行する債券への投資割合は、国債を除き、信託財産の純資産総額の5%以内とします。

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

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

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

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

(マネーインカム・マザーファンド)

(1) 投資方針等

イ 基本方針

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

ロ 投資態度

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

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

（２）投資対象

イ 投資対象とする資産の種類

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

ロ 投資対象とする有価証券

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

ハ 投資対象とする金融商品

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

（３）投資制限

イ ファンドの信託約款に基づく主要な投資制限

（イ）株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

（ロ）投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

（ハ）外貨建資産への投資は行いません。

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

3【投資リスク】

イ ファンドのもつリスクの特性

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

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

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

当ファンドの主要なリスクは以下の通りです。

（イ）株式市場リスク

内外の政治、経済、社会情勢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、これらに対する外部的評価の変化等によって変動し、ファンドの基準価額が下落する要因となります。特に、企業が倒産や大幅な業績悪化に陥った場合、当該企業の株式の価値が大きく下落し、基準価額が大きく下落する要因となります。

（ロ）債券市場リスク

内外の政治、経済、社会情勢等の影響により債券相場が下落（金利が上昇）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、ファンドが保有する個々の債券については、下記「信用リスク」を負うことにもなります。

（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債務不履行が発生あるいは懸念される場合に、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。有価証券等の格付けが低い場合は、格付けの高い場合に比べてこうしたリスクがより高いものになると想定されます。

（ニ）為替変動リスク

外貨建資産への投資は、円建資産に投資する場合の通常のリスクのほかに、為替変動による影響を受けます。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（円高）する場合、円ベースでの評価額は下落することがあります。為替の変動（円高）は、ファンドの基準価額が下落する要因となります。

（ホ）カントリーリスク

海外に投資を行う場合には、投資する有価証券の発行者に起因するリスクのほか、投資先の国の政治・経済・社会状況の不安定化や混乱など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）市場流動性リスク

ファンドの資金流入に伴い、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は、必要な取引ができなかったり、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。

（ト）ファミリーファンド方式にかかる留意点

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。

（チ）換金制限等に関する留意点

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

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

（リ）収益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。

□ 投資リスクの管理体制

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

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

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

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

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

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

（参考情報）投資リスクの定量的比較

〔 ファンドの年間騰落率および 分配金再投資基準価額の推移 〕

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



〔 ファンドと他の代表的な 資産クラスとの騰落率の比較 〕

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



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

※分配実績がない場合は、分配金再投資基準価額は基準価額と同じです。

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

※すべての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。

各資産クラスの指数

日本株	TOPIX(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) 野村證券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0.649%（税抜き0.59%）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0.21%	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0.35%	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0.03%	ファンドの財産の保管および管理、委託会社からの指図の実行等の対価

上記の配分には別途消費税等相当額がかかります。

委託会社が販売会社として申込みの取扱い等をした部分については、販売会社配分相当額を委託会社が収受します。

(4) 【その他の手数料等】

- イ 信託財産の財務諸表の監査に要する費用は、原則として、計算期間を通じて毎日、純資産総額に年0.0055%（税抜き0.005%）以内の率を乗じて得た金額が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。監査費用は、将来、監査法人との契約等により変更となることがあります。2023年4月以降の決算等にかかる財務諸表の監査を行う監査法人を、PwCあらた有限責任監査法人に変更します。
- 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。

上記ロ、ハにかかる費用に関しましては、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ります。したがって、あらかじめ、その金額、上限額、計算方法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。

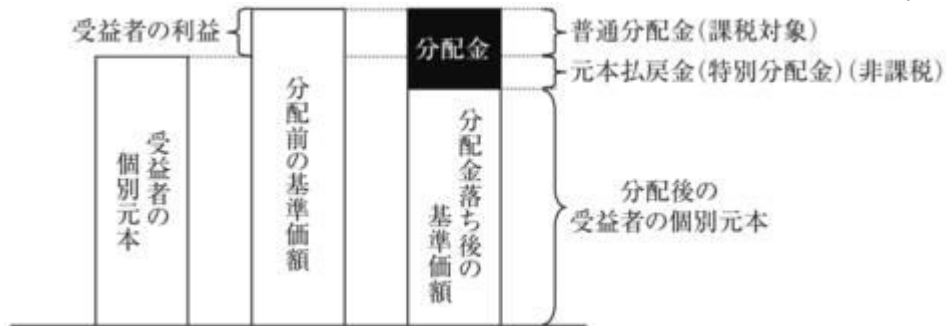
ハ 収益分配金の課税について

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(課税対象)となります。



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



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

二 個人、法人別の課税の取扱いについて

(イ) 個人の受益者に対する課税

・収益分配時

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

・一部解約時および償還時

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

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

(ロ) 法人の受益者に対する課税

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

当ファンドは、課税上は株式投資信託として取り扱われます。

なお、当ファンドは、配当控除および益金不算入制度の適用はありません。

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

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

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

公募株式投資信託は税法上、少額投資非課税制度「NISA（ニーサ）」、未成年者少額投資非課税制度「ジュニアNISA（ニーサ）」の適用対象です。ただし、販売会社によっては当ファンドをNISA、ジュニアNISAでの取扱い対象としない場合があります。

※NISA、ジュニアNISAをご利用になる場合、各制度の違いにご留意ください。
また、販売会社での専用口座の開設等、一定の要件があります。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

	少額投資非課税制度 NISA	未成年者少額投資非課税制度 ジュニアNISA
対象となる投資信託	公募株式投資信託	
非課税対象	公募株式投資信託から生じる配当所得および譲渡所得	
利用対象となる方	18歳以上の日本居住者 (専用口座が開設される年の1月1日現在)	0～17歳の日本居住者 (専用口座が開設される年の1月1日現在)
非課税の期間	最長5年間(新規の購入は2023年まで)*	
利用できる限度額	120万円/年 (最大600万円)	80万円/年 (最大400万円)

*2024年以降、ジュニアNISAで新規の購入ができなくなります。
なお、今後NISA制度は見直しされる予定です。

上記「(5)課税上の取扱い」ほか税制に関する本書の記載は、2022年10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。

5【運用状況】

(1)【投資状況】

S M A M ・ グローバルバランスファンド（機動的資産配分型）

2022年10月31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	2,076,733,297	99.28
現金・預金・その他の資産（負債控除後）	-	15,070,973	0.72
合計（純資産総額）		2,091,804,270	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。

(2)【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

S M A M ・ グローバルバランスファンド（機動的資産配分型）

イ 主要投資銘柄

2022年10月31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	840,442,123	1.2547	1,054,475,878	1.2344	1,037,441,756	49.60

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）	150,037,258	3.2016	480,354,011	3.3100	496,623,323	23.74
日本	親投資 信託受 益証券	外国債券バッシ ブ・マザーファ ンド	150,760,960	1.9921	300,334,859	2.0591	310,431,892	14.84
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	33,638,895	6.1986	208,513,491	6.3111	212,298,430	10.15
日本	親投資 信託受 益証券	マネーインカ ム・マザーファ ンド	19,783,585	1.0080	19,941,895	1.0078	19,937,896	0.95

以上が、当ファンドが保有する有価証券のすべてです。

ロ 種類別投資比率

2022年10月31日現在

種類	投資比率（%）
親投資信託受益証券	99.28
合計	99.28

【投資不動産物件】

S M A M ・グローバルバランスファンド（機動的資産配分型）

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

S M A M ・グローバルバランスファンド（機動的資産配分型）

該当事項はありません。

（3）【運用実績】

【純資産の推移】

S M A M ・グローバルバランスファンド（機動的資産配分型）

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5期（2013年 4月15日）	344,598,682	344,598,682	11,105	11,105
第6期（2014年 4月14日）	505,145,631	505,145,631	11,474	11,474
第7期（2015年 4月13日）	715,784,521	715,784,521	13,405	13,405
第8期（2016年 4月13日）	796,414,981	796,414,981	12,610	12,610
第9期（2017年 4月13日）	977,932,730	977,932,730	12,972	12,972

第10期 (2018年 4月13日)	1,320,853,588	1,320,853,588	13,760	13,760
第11期 (2019年 4月15日)	1,552,047,413	1,552,047,413	13,725	13,725
第12期 (2020年 4月13日)	1,600,674,239	1,600,674,239	13,151	13,151
第13期 (2021年 4月13日)	1,936,918,108	1,936,918,108	14,953	14,953
第14期 (2022年 4月13日)	2,101,944,664	2,101,944,664	15,117	15,117
2021年10月末日	2,071,226,548	-	15,414	-
11月末日	2,069,401,045	-	15,290	-
12月末日	2,113,856,238	-	15,516	-
2022年 1月末日	2,054,120,718	-	15,034	-
2月末日	2,043,780,237	-	14,948	-
3月末日	2,124,917,497	-	15,281	-
4月末日	2,118,326,581	-	15,073	-
5月末日	2,031,698,605	-	15,033	-
6月末日	2,025,875,155	-	14,871	-
7月末日	2,033,902,351	-	15,073	-
8月末日	2,059,520,300	-	15,048	-
9月末日	2,028,836,247	-	14,640	-
10月末日	2,091,804,270	-	14,992	-

【分配の推移】

S M A M ・ グローバルバランスファンド (機動的資産配分型)

	計算期間	1万口当たり分配金(円)
第5期	2012年 4月14日 ~ 2013年 4月15日	0
第6期	2013年 4月16日 ~ 2014年 4月14日	0
第7期	2014年 4月15日 ~ 2015年 4月13日	0
第8期	2015年 4月14日 ~ 2016年 4月13日	0
第9期	2016年 4月14日 ~ 2017年 4月13日	0
第10期	2017年 4月14日 ~ 2018年 4月13日	0
第11期	2018年 4月14日 ~ 2019年 4月15日	0
第12期	2019年 4月16日 ~ 2020年 4月13日	0
第13期	2020年 4月14日 ~ 2021年 4月13日	0
第14期	2021年 4月14日 ~ 2022年 4月13日	0

【収益率の推移】

S M A M ・ グローバルバランスファンド (機動的資産配分型)

	収益率(%)
第5期	16.8
第6期	3.3
第7期	16.8
第8期	5.9
第9期	2.9

第10期	6.1
第11期	0.3
第12期	4.2
第13期	13.7
第14期	1.1
第15期（中間期）	3.2

（注）収益率とは、計算期間末の分配基準価額から前期末分配基準価額を控除した額を前期末分配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】

S M A M ・ グローバルバランスファンド（機動的資産配分型）

	設定口数（口）	解約口数（口）
第5期	106,946,027	28,043,591
第6期	160,191,612	30,265,804
第7期	136,804,546	43,095,045
第8期	194,983,589	97,382,992
第9期	197,626,505	75,293,446
第10期	320,825,769	114,799,604
第11期	279,269,689	108,335,313
第12期	242,872,998	156,591,024
第13期	265,845,857	187,659,232
第14期	269,771,610	174,665,780
第15期（中間期）	143,653,994	149,947,678

（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）

2022年10月31日現在

資産の種類	国／地域	時価合計 （円）	投資比率 （％）
株式	日本	212,063,185,550	97.70
現金・預金・その他の資産（負債控除後）	-	4,994,270,589	2.30
合計（純資産総額）		217,057,456,139	100.00

その他以下の取引を行っております。

種類	買建/ 売建	国／地域	時価合計（円）	投資比率 （％）
株価指数先物取引	買建	日本	5,026,860,000	2.32
合計	買建	-	5,026,860,000	2.32

国内債券パッシブ・マザーファンド

2022年10月31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	103,832,120,250	79.38
地方債証券	日本	10,037,778,200	7.67
特殊債券	日本	9,463,998,226	7.24
社債券	日本	6,614,764,300	5.06
	フランス	199,956,400	0.15
	小計	6,814,720,700	5.21
現金・預金・その他の資産（負債控除後）	-	648,109,871	0.50
合計（純資産総額）		130,796,727,247	100.00

外国株式インデックス・マザーファンド

2022年10月31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	298,362,029,091	67.65
	イギリス	17,595,197,481	3.99
	カナダ	16,089,294,123	3.65
	スイス	13,740,550,660	3.12
	フランス	12,817,978,177	2.91
	ドイツ	9,333,883,096	2.12
	オーストラリア	8,383,820,419	1.90
	アイルランド	7,642,348,519	1.73
	オランダ	7,208,171,808	1.63
	スウェーデン	3,833,274,301	0.87
	デンマーク	3,259,773,172	0.74
	スペイン	2,963,899,617	0.67
	香港	2,125,584,237	0.48
	イタリア	2,083,703,239	0.47
	ジャージー	1,622,193,622	0.37
	フィンランド	1,499,446,782	0.34
	シンガポール	1,380,654,143	0.31
	イスラエル	1,021,753,722	0.23
	ノルウェー	973,416,342	0.22
	ベルギー	957,241,016	0.22
	ケイマン諸島	736,639,101	0.17
	バミューダ	654,444,751	0.15
	オランダ領キュ ラソー	634,347,319	0.14
	ルクセンブルグ	292,336,287	0.07
	ニュージーラン ド	275,505,238	0.06
	オーストリア	214,950,256	0.05
	ポルトガル	212,073,487	0.05
リベリア	92,847,276	0.02	
パナマ	92,443,119	0.02	
マン島	90,636,200	0.02	
小計	416,190,436,601	94.37	

投資証券	アメリカ	8,434,980,470	1.91
	オーストラリア	837,323,796	0.19
	香港	190,880,144	0.04
	イギリス	177,720,237	0.04
	シンガポール	173,615,163	0.04
	フランス	149,194,678	0.03
	ベルギー	38,536,991	0.01
	カナダ	34,279,831	0.01
	小計	10,036,531,310	2.28
現金・預金・その他の資産（負債控除後）	-	14,787,637,962	3.35
合計（純資産総額）		441,014,605,873	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	630,747,936	0.14
株価指数先物取引	買建	ドイツ	2,045,384,870	0.46
株価指数先物取引	買建	アメリカ	11,423,673,922	2.59
株価指数先物取引	買建	オーストラリア	483,044,100	0.11
合計	買建	-	14,582,850,828	3.31

種類	買建 / 売建	国 / 地域	時価合計（円）	投資比率（％）
為替予約取引	買建	-	1,234,483,402	0.28

外国債券パッシブ・マザーファンド

2022年10月31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	79,916,962,482	50.78
	フランス	13,543,624,244	8.61
	イタリア	11,911,431,083	7.57
	ドイツ	9,883,612,448	6.28
	スペイン	7,841,111,265	4.98
	イギリス	6,978,432,638	4.43
	中国	5,001,954,062	3.18
	カナダ	3,202,737,986	2.04
	ベルギー	3,006,790,484	1.91
	オランダ	2,478,017,798	1.57
	オーストラリア	2,365,942,825	1.50
	オーストリア	1,873,222,832	1.19
	メキシコ	1,277,448,975	0.81
	アイルランド	980,114,786	0.62
	マレーシア	796,806,537	0.51
	フィンランド	764,934,765	0.49
	シンガポール	713,011,447	0.45
	ポーランド	658,238,498	0.42
	イスラエル	589,116,463	0.37

	デンマーク	562,177,565	0.36
	スウェーデン	399,722,085	0.25
	ノルウェー	324,944,270	0.21
	小計	155,070,355,538	98.54
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	-	2,303,772,419	1.46
合計(純資産総額)		157,374,127,957	100.00

マネーインカム・マザーファンド

2022年10月31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	100,589,000	5.32
特殊債券	日本	1,271,873,301	67.28
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	-	517,962,699	27.40
合計(純資産総額)		1,890,425,000	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)

2022年10月31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	4,175,600	2,009.93	8,392,645,451	2,059.50	8,599,648,200	3.96
日本	株式	ソニーグループ	電気機器	537,900	13,514.78	7,269,601,680	9,988.00	5,372,545,200	2.48
日本	株式	キーエンス	電気機器	76,100	67,945.08	5,170,620,214	56,320.00	4,285,952,000	1.97
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	977,200	3,291.09	3,216,053,485	4,094.00	4,000,656,800	1.84
日本	株式	三菱UFJ フィナンシャル・グループ	銀行業	4,906,500	609.84	2,992,202,725	699.50	3,432,096,750	1.58
日本	株式	第一三共	医薬品	664,400	2,964.15	1,969,381,698	4,767.00	3,167,194,800	1.46
日本	株式	任天堂	その他製品	480,200	5,124.99	2,461,019,550	6,070.00	2,914,814,000	1.34
日本	株式	ソフトバンク グループ	情報・通信業	441,100	5,913.54	2,608,461,564	6,400.00	2,823,040,000	1.30
日本	株式	リクルート ホールディングス	サービス業	578,700	6,764.45	3,914,587,706	4,590.00	2,656,233,000	1.22
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	675,000	3,119.99	2,105,993,550	3,918.00	2,644,650,000	1.22
日本	株式	日立製作所	電気機器	385,500	6,649.33	2,563,316,909	6,760.00	2,605,980,000	1.20
日本	株式	KDDI	情報・通信業	589,400	3,427.40	2,020,112,299	4,395.00	2,590,413,000	1.19
日本	株式	三井住友フィ ナンシャルグ ループ	銀行業	546,500	3,733.95	2,040,604,100	4,173.00	2,280,544,500	1.05
日本	株式	HOYA	精密機器	164,300	17,417.64	2,861,718,466	13,875.00	2,279,662,500	1.05

日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	53,600	58,753.97	3,149,212,752	39,490.00	2,116,664,000	0.98
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	618,000	3,118.23	1,927,067,204	3,373.00	2,084,514,000	0.96
日本	株式	ダイキン工業	機械	91,700	23,176.98	2,125,329,325	22,385.00	2,052,704,500	0.95
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	753,500	1,985.67	1,496,199,058	2,691.00	2,027,668,500	0.93
日本	株式	三菱商事	卸売業	502,500	3,435.82	1,726,500,100	4,031.00	2,025,577,500	0.93
日本	株式	信越化学工業	化学	130,300	18,911.26	2,464,136,737	15,540.00	2,024,862,000	0.93
日本	株式	三井物産	卸売業	588,600	2,590.26	1,524,624,639	3,293.00	1,938,259,800	0.89
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	495,400	3,294.38	1,632,038,169	3,849.00	1,906,794,600	0.88
日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	1,225,300	1,552.63	1,902,442,539	1,465.50	1,795,677,150	0.83
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	1,081,300	1,425.90	1,541,824,530	1,606.00	1,736,567,800	0.80
日本	株式	村田製作所	電気機器	230,500	8,360.82	1,927,168,168	7,300.00	1,682,650,000	0.78
日本	株式	オリエンタルランド	サービス業	82,800	17,981.96	1,488,906,144	19,950.00	1,651,860,000	0.76
日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	277,300	4,613.21	1,279,242,516	5,554.00	1,540,124,200	0.71
日本	株式	日本電産	電気機器	186,600	12,797.13	2,387,943,848	8,238.00	1,537,210,800	0.71
日本	株式	S M C	機械	24,900	71,588.65	1,782,557,301	60,120.00	1,496,988,000	0.69
日本	株式	アステラス製薬	医薬品	730,900	1,810.80	1,323,515,954	2,046.50	1,495,786,850	0.69

□ 種類別・業種別投資比率

2022年10月31日現在

種類	業種	投資比率(%)
株式(国内)	水産・農林業	0.10
	鉱業	0.32
	建設業	1.90
	食料品	3.35
	繊維製品	0.43
	パルプ・紙	0.17
	化学	5.81
	医薬品	5.78
	石油・石炭製品	0.50
	ゴム製品	0.77
	ガラス・土石製品	0.68
	鉄鋼	0.74
	非鉄金属	0.68
	金属製品	0.56
	機械	4.98
	電気機器	16.53
	輸送用機器	7.79
精密機器	2.87	
その他製品	2.43	

電気・ガス業	1.20
陸運業	3.22
海運業	0.53
空運業	0.52
倉庫・運輸関連業	0.14
情報・通信業	9.12
卸売業	5.33
小売業	4.46
銀行業	5.16
証券、商品先物取引業	0.72
保険業	2.26
その他金融業	1.10
不動産業	2.09
サービス業	5.44
合計	97.70

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)

2022年10月31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	438 2年国債	4,610,000,000	100.13	4,616,006,500	100.09	4,614,195,100	0.005	2024/07/01	3.53
日本	国債 証券	367 10年国 債	2,520,000,000	99.87	2,516,816,200	99.62	2,510,499,600	0.200	2032/06/20	1.92
日本	国債 証券	153 5年国債	1,900,000,000	99.94	1,898,945,900	99.77	1,895,592,000	0.005	2027/06/20	1.45
日本	国債 証券	147 5年国債	1,540,000,000	100.17	1,542,648,800	100.14	1,542,079,000	0.005	2026/03/20	1.18
日本	国債 証券	148 5年国債	1,530,000,000	100.15	1,532,306,600	100.09	1,531,377,000	0.005	2026/06/20	1.17
日本	国債 証券	357 10年国 債	1,410,000,000	99.73	1,406,181,500	99.37	1,401,060,600	0.100	2029/12/20	1.07
日本	国債 証券	363 10年国 債	1,350,000,000	99.17	1,338,859,500	98.65	1,331,761,500	0.100	2031/06/20	1.02
日本	国債 証券	149 5年国債	1,240,000,000	100.15	1,241,872,400	100.02	1,240,235,600	0.005	2026/09/20	0.95
日本	国債 証券	150 5年国債	1,240,000,000	100.13	1,241,655,400	99.94	1,239,231,200	0.005	2026/12/20	0.95
日本	国債 証券	361 10年国 債	1,250,000,000	99.38	1,242,276,100	98.80	1,235,050,000	0.100	2030/12/20	0.94
日本	国債 証券	145 5年国債	1,180,000,000	100.49	1,185,778,800	100.40	1,184,767,200	0.100	2025/09/20	0.91

日本	国債証券	358 10年国債	1,140,000,000	99.70	1,136,583,600	99.16	1,130,469,600	0.100	2030/03/20	0.86
日本	国債証券	360 10年国債	1,110,000,000	99.57	1,105,193,600	98.92	1,097,967,600	0.100	2030/09/20	0.84
日本	国債証券	362 10年国債	1,080,000,000	99.33	1,072,764,000	98.73	1,066,262,400	0.100	2031/03/20	0.82
日本	国債証券	359 10年国債	1,020,000,000	99.52	1,015,077,000	99.02	1,010,044,800	0.100	2030/06/20	0.77
日本	国債証券	146 5年国債	1,000,000,000	100.52	1,005,167,200	100.44	1,004,390,000	0.100	2025/12/20	0.77
日本	国債証券	439 2年国債	1,000,000,000	100.19	1,001,890,000	100.10	1,000,960,000	0.005	2024/08/01	0.77
日本	国債証券	144 5年国債	980,000,000	100.48	984,664,800	100.38	983,743,600	0.100	2025/06/20	0.75
日本	国債証券	365 10年国債	930,000,000	99.06	921,258,000	98.70	917,947,200	0.100	2031/12/20	0.70
日本	国債証券	174 20年国債	990,000,000	94.24	932,988,200	90.62	897,157,800	0.400	2040/09/20	0.69
日本	国債証券	349 10年国債	870,000,000	100.32	872,784,000	100.08	870,661,200	0.100	2027/12/20	0.67
日本	国債証券	344 10年国債	811,000,000	100.56	815,557,820	100.39	814,146,680	0.100	2026/09/20	0.62
日本	国債証券	338 10年国債	805,000,000	101.30	815,440,850	101.06	813,533,000	0.400	2025/03/20	0.62
日本	国債証券	882 0年国債	742,000,000	109.51	812,586,460	108.43	804,580,280	2.300	2026/06/20	0.62
日本	国債証券	141 5年国債	795,000,000	100.38	798,044,850	100.27	797,170,350	0.100	2024/09/20	0.61
日本	国債証券	339 10年国債	785,000,000	101.40	795,974,300	101.17	794,208,050	0.400	2025/06/20	0.61
日本	国債証券	722 0年国債	753,000,000	105.03	790,883,430	104.05	783,466,380	2.100	2024/09/20	0.60
日本	国債証券	441 2年国債	780,000,000	100.14	781,064,900	100.11	780,819,000	0.005	2024/10/01	0.60
日本	国債証券	340 10年国債	770,000,000	101.50	781,519,200	101.27	779,779,000	0.400	2025/09/20	0.60
日本	国債証券	143 5年国債	770,000,000	100.45	773,472,700	100.35	772,656,500	0.100	2025/03/20	0.59

□ 種類別投資比率

2022年10月31日現在

種類	投資比率(%)
----	---------

国債証券	79.38
地方債証券	7.67
特殊債証券	7.24
社債証券	5.21
合計	99.50

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)

2022年10月31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	1,002,446	23,729.12	23,787,161,695	23,090.01	23,146,490,570	5.25
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	440,399	48,655.56	21,427,859,363	34,970.09	15,400,790,992	3.49
アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	小売	567,204	25,386.77	14,399,479,591	15,331.57	8,696,125,901	1.97
アメリカ	株式	TESLA INC	自動車・自動車部品	163,939	53,399.07	8,754,189,488	33,880.38	5,554,314,829	1.26
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	372,562	21,048.02	7,841,691,443	14,275.96	5,318,678,495	1.21
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	349,001	21,202.31	7,399,625,714	14,318.95	4,997,328,148	1.13
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	58,276	68,373.19	3,984,516,300	81,726.84	4,762,713,467	1.08
アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORP	エネルギー	260,440	9,753.23	2,540,130,840	16,412.38	4,274,440,768	0.97
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	163,529	24,014.93	3,927,138,056	25,926.23	4,239,689,844	0.96
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	各種金融	79,448	42,440.53	3,371,815,462	44,423.14	3,529,329,928	0.80
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	181,762	23,132.35	4,204,581,346	18,692.62	3,397,608,141	0.77
アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導体・半導体製造装置	155,657	46,367.86	7,217,482,249	20,510.29	3,192,569,961	0.72
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	ソフトウェア・サービス	101,644	29,502.43	2,998,745,423	31,036.75	3,154,699,254	0.72

アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギー	116,154	18,133.75	2,106,307,526	26,683.83	3,099,434,147	0.70
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO/THE	家庭用品・パーソナル用品	149,109	22,049.61	3,287,794,624	20,047.72	2,989,295,063	0.68
アメリカ	株式	HOME DEPOT INC	小売	63,655	58,090.35	3,697,740,913	44,277.85	2,818,506,478	0.64
スイス	株式	NESTLE SA-REG	食品・飲料・タバコ	175,046	17,780.87	3,112,469,732	16,026.07	2,805,298,959	0.64
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	49,897	38,897.64	1,940,875,707	53,358.77	2,662,442,746	0.60
アメリカ	株式	MASTERCARD INC - A	ソフトウェア・サービス	53,491	48,525.79	2,595,692,927	48,847.22	2,612,886,762	0.59
アメリカ	株式	PFIZER INC	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	346,479	7,756.48	2,687,458,117	7,031.97	2,436,430,557	0.55
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	447,882	6,575.42	2,945,014,498	5,364.05	2,402,460,008	0.54
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	109,052	18,026.00	1,965,771,267	21,884.66	2,386,565,789	0.54
アメリカ	株式	MERCK & CO. INC.	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	155,959	11,388.99	1,776,216,102	14,940.16	2,330,052,444	0.53
アメリカ	株式	PEPSICO INC	食品・飲料・タバコ	86,152	24,459.76	2,107,257,097	27,017.42	2,327,604,750	0.53
アメリカ	株式	COCA-COLA CO/THE	食品・飲料・タバコ	256,502	8,281.88	2,124,318,438	9,008.28	2,310,641,220	0.52
スイス	株式	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	43,193	52,736.60	2,277,852,033	49,330.42	2,130,729,003	0.48
アメリカ	株式	META PLATFORMS INC-CLASS A	メディア・娯楽	142,089	47,571.90	6,759,443,563	14,707.39	2,089,758,621	0.47

アメリカ	株式	COSTCO WHOLESALE CORP	食品・生活必需品 小売り	27,292	81,392.53	2,221,364,851	75,741.59	2,067,139,370	0.47
アメリカ	株式	WALMART INC	食品・生活必需品 小売り	94,190	20,962.47	1,974,454,839	21,128.53	1,990,096,485	0.45
イギリス	株式	SHELL PLC	エネルギー	463,201	2,901.09	1,343,788,120	4,164.66	1,929,073,286	0.44

ロ 種類別・業種別投資比率

2022年10月31日現在

種類	業種	投資比率（％）
株式（外国）	エネルギー	5.87
	素材	3.99
	資本財	6.19
	商業・専門サービス	1.19
	運輸	1.77
	自動車・自動車部品	2.09
	耐久消費財・アパレル	1.38
	消費者サービス	1.84
	小売	4.53
	食品・生活必需品小売り	1.56
	食品・飲料・タバコ	4.24
	家庭用品・パーソナル用品	1.68
	ヘルスケア機器・サービス	4.97
	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	8.96
	銀行	5.79
	各種金融	4.60
	保険	3.13
	不動産	0.30
	ソフトウェア・サービス	10.37
	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	6.68
半導体・半導体製造装置	3.93	
電気通信サービス	1.40	
公益事業	3.01	
メディア・娯楽	4.90	
投資証券	-	2.28
合計		96.65

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）

2022年10月31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	14,950,000	15,120.15	2,260,462,102	13,515.38	2,020,549,549	1.625	2026/05/15	1.28

アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	13,300,000	15,516.30	2,063,667,708	13,846.00	1,841,518,186	2.250	2026/03/31	1.17
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	9,000,000	16,254.04	1,462,863,628	13,841.41	1,245,726,480	2.875	2028/05/15	0.79
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	7,700,000	14,649.87	1,128,039,768	14,001.23	1,078,094,680	0.125	2024/02/15	0.69
中国	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	51,000,000	2,048.43	1,044,700,113	2,058.09	1,049,625,652	2.690	2026/08/12	0.67
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,500,000	14,495.82	1,232,145,123	11,914.03	1,012,692,153	1.125	2031/02/15	0.64
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	7,100,000	14,974.26	1,063,172,460	13,300.40	944,328,726	1.375	2026/08/31	0.60
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,500,000	15,290.94	993,911,318	14,331.40	931,541,301	2.125	2024/03/31	0.59
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	7,200,000	14,258.31	1,026,598,497	12,385.49	891,755,434	0.625	2027/12/31	0.57
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,200,000	15,180.34	941,181,166	14,169.21	878,490,908	1.750	2024/06/30	0.56
中国	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	42,000,000	2,069.80	869,314,528	2,084.86	875,643,181	3.020	2031/05/27	0.56
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	7,500,000	13,953.79	1,046,533,981	11,568.88	867,665,704	0.625	2030/05/15	0.55
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	7,000,000	14,200.49	994,034,374	11,702.01	819,140,947	0.875	2030/11/15	0.52
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,700,000	15,438.61	880,000,788	14,364.91	818,799,949	2.500	2024/05/15	0.52
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,700,000	14,699.09	837,848,098	14,216.65	810,349,129	0.125	2023/10/15	0.51
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	7,000,000	13,923.69	974,658,274	11,496.97	804,787,897	0.625	2030/08/15	0.51
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,600,000	15,431.20	864,147,049	14,270.03	799,121,400	2.375	2024/08/15	0.51
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,500,000	15,085.46	829,700,025	14,001.23	770,067,629	1.500	2024/10/31	0.49
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,700,000	14,780.51	842,489,094	13,497.44	769,354,201	2.875	2032/05/15	0.49
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,000,000	14,858.32	891,499,240	12,625.23	757,513,713	1.375	2028/10/31	0.48
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,100,000	15,480.86	789,524,085	14,484.26	738,697,295	2.750	2024/02/15	0.47
ドイツ	国債証券	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	5,800,000	15,307.59	887,840,337	12,665.73	734,612,399	0.000	2030/08/15	0.47
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,900,000	14,353.35	846,847,480	12,422.56	732,930,871	0.750	2028/01/31	0.47
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,900,000	14,517.77	856,548,280	12,416.78	732,589,725	1.000	2028/07/31	0.47
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,100,000	15,403.92	785,599,791	14,198.12	724,104,063	2.250	2024/11/15	0.46
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,200,000	14,768.03	767,937,577	13,764.90	715,774,965	0.750	2024/11/15	0.45

フランス	国債証券	FRANCE OAT.	4,800,000	14,970.05	718,562,577	14,353.87	688,985,541	0.000	2024/03/25	0.44
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,000,000	15,399.32	769,966,071	13,577.35	678,867,714	2.000	2026/11/15	0.43
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,500,000	14,670.24	806,863,129	12,295.05	676,227,944	1.625	2031/05/15	0.43
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,800,000	16,110.52	773,305,182	13,804.34	662,608,336	2.750	2028/02/15	0.42

□ 種類別投資比率

2022年10月31日現在

種類	投資比率(%)
国債証券	98.54
合計	98.54

マネーインカム・マザーファンド

イ 主要投資銘柄

2022年10月31日現在

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価(円)	帳簿価額(円)	評価額単価(円)	評価額(円)	利率(%)	償還期限	投資比率(%)
日本	特殊債券	182 政保道路機構	223,000,000	100.49	224,089,102	100.22	223,497,513	0.834	2023/01/31	11.82
日本	特殊債券	189 政保道路機構	200,000,000	100.48	200,961,000	100.31	200,617,800	0.541	2023/04/28	10.61
日本	特殊債券	190 政保道路機構	127,000,000	100.59	127,748,030	100.39	127,496,570	0.605	2023/05/31	6.74
日本	特殊債券	2 政保新関西空港	118,000,000	100.92	119,084,420	100.63	118,743,518	0.882	2023/06/27	6.28
日本	特殊債券	200 政保道路機構	100,000,000	100.89	100,892,000	100.77	100,771,300	0.801	2023/09/29	5.33
日本	国債証券	329 10年国債	100,000,000	100.93	100,929,000	100.59	100,589,000	0.800	2023/06/20	5.32
日本	特殊債券	184 政保道路機構	100,000,000	100.44	100,441,000	100.28	100,284,000	0.815	2023/02/28	5.30
日本	特殊債券	19 政保政策投資C	100,000,000	100.67	100,667,700	100.28	100,275,500	0.668	2023/03/15	5.30
日本	特殊債券	180 政保道路機構	100,000,000	100.56	100,557,200	100.12	100,123,500	0.734	2022/12/28	5.30
日本	特殊債券	177 政保道路機構	100,000,000	100.55	100,546,300	100.06	100,063,600	0.805	2022/11/30	5.29
日本	特殊債券	36 政保政策投資C	100,000,000	100.01	100,009,000	100.00	100,000,000	0.001	2022/11/18	5.29

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

2022年10月31日現在

種類	投資比率(%)
国債証券	5.32
特殊債券	67.28
合計	72.60

投資不動産物件

国内株式インデックス・マザーファンド(B号)

該当事項はありません。

国内債券パッシブ・マザーファンド

該当事項はありません。

外国株式インデックス・マザーファンド

該当事項はありません。

外国債券パッシブ・マザーファンド

該当事項はありません。

マネーインカム・マザーファンド

該当事項はありません。

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)

2022年10月31日現在

種類	国/地域	取引所等	名称	買建/売建	数量	通貨	簿価(円)	時価(円)	投資比率(%)
株価指数 先物取引	日本	大阪取引 所	TOPIX 先 物 0412 月 2022年 12月	買建	261	日本・円	4,910,097,100	5,026,860,000	2.32

(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

2022年10月31日現在

種類	国/地域	取引所等	名称	買建/売建	数量	通貨	帳簿価額	簿価(円)	評価額	時価(円)	投資比率(%)
株価 指数 先物 取引	イギ リス	ICE EU	FTSE 10 0 ID X FU T DE C 2 2 2022年12 月	買建	52	イギリ ス・ポ ンド	3,717,509.00	640,155,049	3,662,880.00	630,747,936	0.14

ドイツ	EU RE X	EUR O S T O X X 5 0 D E C 2 2 2022年12 月	買建	384	ユーロ	13,433,763.00	1,982,689,081	13,858,560.00	2,045,384,870	0.46
アメリカ	シカ ゴ商 品取 引所	S & P 5 0 0 E M I N I F U T D E C 2 2 2022年12 月	買建	394	アメリ カ・ド ル	76,335,607.00	11,317,517,093	77,051,625.00	11,423,673,922	2.59
オース トラ リア	シド ニー 先物 取引 所	S P I 2 0 0 F U T U R E S D E C 2 2 2022 年12月	買建	30	オース トラリ ア・ド ル	5,067,560.00	481,671,578	5,082,000.00	483,044,100	0.11

(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。

2022年10月31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	6,800,000.00	995,435,090	1,007,991,218	0.23
	ユーロ	買建	737,000.00	108,327,026	108,763,690	0.02
	イギリス・ポンド	買建	216,000.00	37,183,449	37,182,520	0.01
	スイス・フラン	買建	182,000.00	26,928,337	27,066,676	0.01
	カナダ・ドル	買建	246,000.00	26,477,103	26,779,240	0.01
	オーストラリア・ドル	買建	281,000.00	26,699,552	26,700,058	0.01

(注) 日本における対顧客先物相場の仲値で評価しております。

外国債券パッシブ・マザーファンド

該当事項はありません。

マネーインカム・マザーファンド

該当事項はありません。

参考情報

基準日:2022年10月31日

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

基準価額・純資産の推移



※基準価額は、1万口当たり、信託報酬控除後です。

分配の推移

決算期	分配金
2022年4月	0円
2021年4月	0円
2020年4月	0円
2019年4月	0円
2018年4月	0円
設定来累計	0円

※分配金は1万口当たり、税引前です。
※直近5計算期間を記載しています。

主要な資産の状況

■SMAM・グローバルバランスファンド(機動的資産配分型)

資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
親投資信託受益証券	日本	99.28
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		0.72
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	49.60
日本	親投資信託受益証券	国内株式インデックス・マザーファンド(B号)	23.74
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	14.84
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	10.15
日本	親投資信託受益証券	マネーインカム・マザーファンド	0.95

■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	97.70
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		2.30
合計(純資産総額)		100.00

※株価指数先物取引の買建て 2.32%

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	3.96
日本	株式	ソニーグループ	電気機器	2.48
日本	株式	キーエンス	電気機器	1.97
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	1.84
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	1.58
日本	株式	第一三共	医薬品	1.46
日本	株式	任天堂	その他製品	1.34
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	1.30
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	1.22
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	1.22

※比率は、ファンド、マザーファンドのそれぞれの純資産総額に対する時価の比率です。

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

■国内債券パッシブ・マザーファンド

資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
国債証券	日本	79.38
地方債証券	日本	7.67
特殊債証券	日本	7.24
社債券	日本	5.06
	フランス	0.15
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		0.50
合計(純資産総額)		100.00

主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	利率(%)	償還期限	比率(%)
日本	国債証券	438 2年国債	0.005	2024/07/01	3.53
日本	国債証券	367 10年国債	0.200	2032/06/20	1.92
日本	国債証券	153 5年国債	0.005	2027/06/20	1.45
日本	国債証券	147 5年国債	0.005	2026/03/20	1.18
日本	国債証券	148 5年国債	0.005	2026/06/20	1.17
日本	国債証券	357 10年国債	0.100	2029/12/20	1.07
日本	国債証券	363 10年国債	0.100	2031/06/20	1.02
日本	国債証券	149 5年国債	0.005	2026/09/20	0.95
日本	国債証券	150 5年国債	0.005	2026/12/20	0.95
日本	国債証券	361 10年国債	0.100	2030/12/20	0.94

■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	67.65
	イギリス	3.99
	カナダ	3.65
	スイス	3.12
	フランス	2.91
	ドイツ	2.12
	その他	10.94
投資証券	アメリカ・その他	2.28
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		3.35
合計(純資産総額)		100.00

*株価指数先物取引の買建て 3.31%

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	5.25
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	3.49
アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	小売	1.97
アメリカ	株式	TESLA INC	自動車・自動車部品	1.26
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	1.21
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	1.13
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	1.08
アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORP	エネルギー	0.97
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	0.96
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	各種金融	0.80

■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	50.78
	フランス	8.61
	イタリア	7.57
	ドイツ	6.28
	スペイン	4.98
	イギリス	4.43
	中国	3.18
	その他	12.70
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1.46
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	1.28
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.250	2026/03/31	1.17
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.875	2028/05/15	0.79
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	0.125	2024/02/15	0.69
中国	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	2.690	2026/08/12	0.67
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1.125	2031/02/15	0.64
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1.375	2026/08/31	0.60
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.125	2024/03/31	0.59
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	0.625	2027/12/31	0.57
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1.750	2024/06/30	0.56

*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。

■マネーインカム・マザーファンド

資産別構成

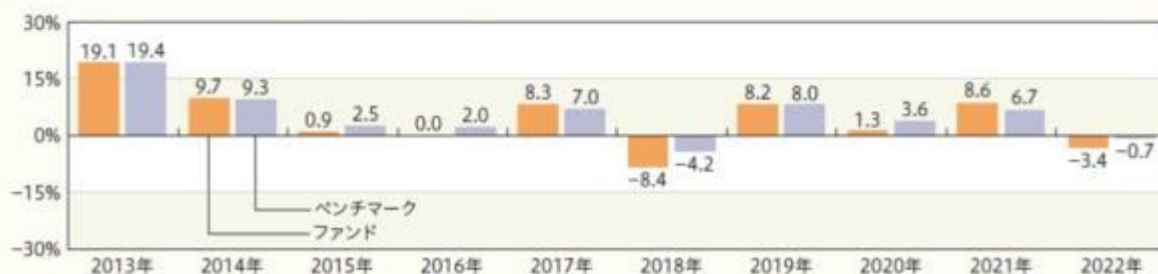
資産の種類	国・地域	比率(%)
特殊債券	日本	67.28
国債証券	日本	5.32
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		27.40
合計(純資産総額)		100.00

主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	利率(%)	償還期限	比率(%)
日本	特殊債券	182 政保道路機構	0.834	2023/01/31	11.82
日本	特殊債券	189 政保道路機構	0.541	2023/04/28	10.61
日本	特殊債券	190 政保道路機構	0.605	2023/05/31	6.74
日本	特殊債券	2 政保新関西空港	0.882	2023/06/27	6.28
日本	特殊債券	200 政保道路機構	0.801	2023/09/29	5.33
日本	国債証券	329 10年国債	0.800	2023/06/20	5.32
日本	特殊債券	184 政保道路機構	0.815	2023/02/28	5.30
日本	特殊債券	19 政保政策投資C	0.668	2023/03/15	5.30
日本	特殊債券	180 政保道路機構	0.734	2022/12/28	5.30
日本	特殊債券	177 政保道路機構	0.805	2022/11/30	5.29

※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)



※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。

※2022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に取引口座を開設の上、当ファンドの取得申込みを行っていただきます。

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

(ロ) 原則として午後3時までに取得申込みが行われ、販売会社所定の事務手続きが完了したものを当日の申込受付分とします。

なお、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。

(ニ) 定時定額で取得申込みをする「定時定額購入サービス」(販売会社によっては、名称が異なる

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

ロ 申込価額

取得申込受付日の翌営業日の基準価額となります。

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

ハ 申込手数料

ありません。

ニ 申込単位

お申込単位の詳細は、取扱いの販売会社にお問い合わせください。

ホ 照会先

手続き等のご不明な点についての委託会社に対する照会は下記においてできます。

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

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

ヘ 申込取扱場所・払込取扱場所

販売会社において申込み・払込みを取り扱います。

ト 払込期日

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

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

2【換金(解約)手続等】

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

お買付けの販売会社にお申し出ください。

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

なお、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の証券欄「オープン基準価格」の紙面に、「おまかせ」として掲載されます。

委託会社に対する照会は下記においてできます。

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

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

(2)【保管】

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

(3)【信託期間】

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

(4)【計算期間】

毎年4月14日から翌年4月13日までとすることを原則としますが、各計算期間終了日に該当する日(以下「該当日」といいます。)が休業日のとき、各計算期間終了日は、該当日の翌営業日とし、その翌日より次の計算期間が開始するものとします。なお、最終計算期間の終了日は、信託期間の終了日とします。

(5)【その他】

イ 信託の終了

(イ) 信託契約の解約

- a. 委託会社は、当ファンドの信託契約を解約することが受益者にとって有利であると認めるとき、残存口数が1億口を下回るようになったとき、その他やむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意の上、当ファンドの信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。
- b. 委託会社は、上記aの事項について、書面による決議(以下「書面決議」といいます。)を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに信託契約の解約の理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、当ファンドの知っている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。
- c. 書面決議において、受益者(委託会社等を除きます。)は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、知っている受益者が議決権を行使しないときは、当該知っている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
- d. 書面決議は議決権を行使することができる受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います。
- e. 上記b～dまでの取扱いは、委託会社が信託契約の解約について提案をした場合において、当該提案につき、当ファンドのすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。また、信託財産の状況に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、上記b～dまでの取扱いを行うことが困難な場合も同様とします。

(ロ) 信託契約に関する監督官庁の命令

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

(ハ) 委託会社の登録取消等に伴う取扱い

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

(ニ) 受託会社の辞任および解任に伴う取扱い

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

ロ 収益分配金、償還金の支払い

(イ) 収益分配金

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

(ロ) 償還金

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

八 信託約款の変更等

- (イ) 委託会社は、当ファンドの信託約款を変更することが受益者の利益のため必要と認めるとき、監督官庁より変更の命令を受けたとき、その他やむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意の上、当ファンドの信託約款を変更すること、または当ファンドと他のファンドとの併合(投資信託及び投資法人に関する法律第16条第2号に規定する「委託者指図型投資信託の併合」をいいます。)を行うことができるものとし、あらかじめ、変更または併合しようとする旨および内容を監督官庁に届け出ます。
- (ロ) 委託会社は、上記(イ)の事項(変更についてはその内容が重大なものに該当する場合に限り、併合にあっては、その併合が受益者の利益に及ぼす影響が軽微なものに該当する場合を除きます。以下、合わせて「重大な信託約款の変更等」といいます。)について、書面決議を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに重大な信託約款の変更等の内容およびその理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、当ファンドの知っている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発送します。
- (ハ) 上記(ロ)の書面決議において、受益者(委託会社等を除きます。)は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行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。
- (ニ) 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(ニ)までの取扱いは、委託会社が重大な信託約款の変更等について提案をした場合において、当該提案につき、当ファンドのすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。
- (ヘ) 上記にかかわらず、当ファンドと他のファンドとの併合の場合は、当ファンドにおいて併合の書面決議が可決された場合にあっても、相手方となる他のファンドにおいて当該併合の書面決議が否決された場合は、併合を行うことはできません。

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 運用にかかる報告書の開示方法

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

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

4【受益者の権利等】

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

受益者の有する主な権利は次の通りです。

イ 分配金請求権

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

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

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

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

ロ 償還金請求権

受益者は、持分に応じて償還金を請求する権利を有します。

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

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

ハ 一部解約実行請求権

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

ニ 書面決議における議決権

委託会社が、当ファンドの解約(監督官庁の命令による解約等の場合を除きます。)または、重大な信託約款の変更等を行おうとする場合において、受益者は、それぞれの書面決議手続きにおいて、受益権の口数に応じて議決権を有しこれを行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14期(2021年4月14日から2022年4月13日まで)の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

1【財務諸表】

【SMAM・グローバルバランスファンド(機動的資産配分型)】

(1)【貸借対照表】

(単位:円)

	第13期 (2021年 4月13日現在)	第14期 (2022年 4月13日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	9,580,417	321,669
コール・ローン	4,965,129	12,339,012
親投資信託受益証券	1,929,003,191	2,093,898,903
未収入金	590,000	5,000,000
流動資産合計	1,944,138,737	2,111,559,584
資産合計	1,944,138,737	2,111,559,584
負債の部		
流動負債		
未払解約金	1,299,994	2,849,560
未払受託者報酬	298,516	341,072
未払委託者報酬	5,572,250	6,367,451
未払利息	13	-
その他未払費用	49,856	56,837
流動負債合計	7,220,629	9,614,920
負債合計	7,220,629	9,614,920
純資産の部		
元本等		
元本	1,295,316,193	1,390,422,023
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	641,601,915	711,522,641
(分配準備積立金)	241,336,223	229,117,187
元本等合計	1,936,918,108	2,101,944,664
純資産合計	1,936,918,108	2,101,944,664
負債純資産合計	1,944,138,737	2,111,559,584

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位 : 円)

	第13期		第14期	
	自	2020年 4月14日	自	2021年 4月14日
	至	2021年 4月13日	至	2022年 4月13日
営業収益				
受取利息		-		138
有価証券売買等損益		237,544,023		33,615,712
営業収益合計		237,544,023		33,615,850
営業費用				
支払利息		7,253		8,398
受託者報酬		576,793		668,164
委託者報酬		10,766,713		12,473,185
その他費用		97,679		112,477
営業費用合計		11,448,438		13,262,224
営業利益又は営業損失()		226,095,585		20,353,626
経常利益又は経常損失()		226,095,585		20,353,626
当期純利益又は当期純損失()		226,095,585		20,353,626
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()		15,640,884		2,947,910
期首剰余金又は期首欠損金()		383,544,671		641,601,915
剰余金増加額又は欠損金減少額		107,783,384		139,342,167
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		107,783,384		139,342,167
剰余金減少額又は欠損金増加額		60,180,841		86,827,157
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		60,180,841		86,827,157
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()		641,601,915		711,522,641

(3)【注記表】

(重要な会計方針の注記)

項目	第14期
	自 2021年4月14日 至 2022年4月13日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>

(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13期	第14期
	(2021年4月13日現在)	(2022年4月13日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	1,295,316,193口	1,390,422,023口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.4953円 (1万口当たりの純資産額14,953円)	1口当たり純資産額 1.5117円 (1万口当たりの純資産額15,117円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第13期	第14期
	自 2020年4月14日 至 2021年4月13日	自 2021年4月14日 至 2022年4月13日
分配金の計算過程	<p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(23,963,314円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(102,543,630円)、収益調整金(574,306,815円)、および分配準備積立金(114,829,279円)より、分配対象収益は815,643,038円(1万口当たり6,296.83円)であります。分配を行っておりません。</p>	<p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(17,288,267円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(117,449円)、収益調整金(664,138,264円)、および分配準備積立金(211,711,471円)より、分配対象収益は893,255,451円(1万口当たり6,424.35円)であります。分配を行っておりません。</p>

（金融商品に関する注記）

．金融商品の状況に関する事項

項 目	第14期 自 2021年4月14日 至 2022年4月13日
1． 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2． 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、親投資信託受益証券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>

3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する会議をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用部署に是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用部署は、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。なお、投資信託協会の流動性リスク管理規制に抵触する場合には、流動性リスクを管理する会議で審議の上、流動性リスクの管理責任者が対処方針を決定します。その後、決定した対処方針やその実施等について、リスク管理会議に報告を行う体制となっております。</p> <p>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する会議にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。</p>
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。</p>

・金融商品の時価等に関する事項

項 目	第14期 (2022年4月13日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	<p>金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p>
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券（親投資信託受益証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

第13期（自 2020年4月14日 至 2021年4月13日）

種 類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	154,862,082円
合計	154,862,082円

第14期（自 2021年4月14日 至 2022年4月13日）

種 類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	1,489,971円
合計	1,489,971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14期 自 2021年4月14日 至 2022年4月13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13期 (2021年4月13日現在)	第14期 (2022年4月13日現在)
期首元本額	1,217,129,568円	1,295,316,193円
期中追加設定元本額	265,845,857円	269,771,610円
期中一部解約元本額	187,659,232円	174,665,780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）	128,286,319	410,426,420	
	外国株式インデックス・マザー ファンド	48,029,718	293,000,491	

外国債券パッシブ・マザーファンド	158,413,037	313,942,956	
国内債券パッシブ・マザーファンド	839,744,278	1,054,550,864	
マネーインカム・マザーファンド	21,805,906	21,978,172	
親投資信託受益証券 小計		2,093,898,903	
合計		2,093,898,903	

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)

S M A M ・ グローバルバランスファンド(機動的資産配分型)は、「国内株式インデックス・マザーファンド(B号)」、「国内債券パッシブ・マザーファンド」、「外国株式インデックス・マザーファンド」、「外国債券パッシブ・マザーファンド」および「マネーインカム・マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同マザーファンドの受益証券です。

なお、以下に記載した状況は、監査の対象外です。

国内株式インデックス・マザーファンド(B号)

(1) 貸借対照表

(単位:円)

	(2021年4月13日現在)	(2022年4月13日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	1,169,715,889	35,806,941
コール・ローン	605,779,870	1,373,532,285
株式	191,803,100,950	197,920,121,230
派生商品評価勘定	5,553,800	19,744,700
未収入金	1,085,600	-
未収配当金	1,738,508,396	2,365,057,715
前払金	7,000,000	139,360,000
差入委託証拠金	3,460,000	157,590,000
流動資産合計	195,334,204,505	202,011,212,871
資産合計	195,334,204,505	202,011,212,871
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	12,745,200	92,875,700
未払解約金	62,155,249	51,245,960
未払利息	1,659	-
その他未払費用	15,207	9,440
流動負債合計	74,917,315	144,131,100
負債合計	74,917,315	144,131,100
純資産の部		

元本等		
元本	60,307,285,983	63,097,233,521
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	134,952,001,207	138,769,848,250
元本等合計	195,259,287,190	201,867,081,771
純資産合計	195,259,287,190	201,867,081,771
負債純資産合計	195,334,204,505	202,011,212,871

(2) 注記表

(重要な会計方針の注記)

項目	自 2021年4月14日 至 2022年4月13日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算期間末日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場によっております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金の計上基準 受取配当金は原則として、配当落ち日において、確定配当金額または予想配当金額を計上しております。なお、配当金額が未確定の場合は、入金日基準で計上しております。</p>

(重要な会計上の見積りに関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

項目	(2021年4月13日現在)	(2022年4月13日現在)
1. 担保資産	<p>デリバティブ取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として担保に供している資産は次の通りであります。</p>	

	株式	3,402,800,000円	
2. 当計算期間の末日における受益権の総数		60,307,285,983口	63,097,233,521口
3. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たりの純資産額32,377円)	3.2377円	1口当たり純資産額 (1万口当たりの純資産額31,993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 2021年4月14日 至 2022年4月13日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、株式を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。当計算期間については、先物取引を行っております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>

<p>3. 金融商品に係るリスク管理体制</p>	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する会議をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用部署に是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用部署は、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。なお、投資信託協会の流動性リスク管理規制に抵触する場合には、流動性リスクを管理する会議で審議の上、流動性リスクの管理責任者が対処方針を決定します。その後、決定した対処方針やその実施等について、リスク管理会議に報告を行う体制となっております。</p> <p>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する会議にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。</p>
<p>4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明</p>	<p>金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。</p>

・金融商品の時価等に関する事項

項目	(2022年4月13日現在)
<p>1. 貸借対照表計上額、時価及び差額</p>	<p>金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p>
<p>2. 時価の算定方法</p>	<p>(1) 有価証券（株式） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

(デリバティブ取引に関する注記)

(2021年4月13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	3,420,201,400	-	3,413,010,000	7,191,400
	小計	3,420,201,400	-	3,413,010,000	7,191,400
合 計		3,420,201,400	-	3,413,010,000	7,191,400

(2022年4月13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 0406 月	4,049,481,000	-	3,976,350,000	73,131,000
	小計	4,049,481,000	-	3,976,350,000	73,131,000
合 計		4,049,481,000	-	3,976,350,000	73,131,000

(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 2021年4月14日 至 2022年4月13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)

(2021年4月13日現在)
開示対象ファンドの

期首における当該親投資信託の元本額	66,999,567,497円
同期中における追加設定元本額	10,234,596,277円
同期中における一部解約元本額	16,926,877,791円
2021年4月13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	9,403,817,844円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	874,307,630円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	4,236,443,718円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	3,147,333,103円
SMAM・グローバルバランスファンド(機動的資産配分型)	140,818,938円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2020(4資産タイプ)	4,731,866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)	21,315,752円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2030(4資産タイプ)	62,804,297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)	128,333,283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)	101,569,258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)	197,544,642円
国内株式指数ファンド(TOPIX)	1,143,235,519円
三井住友・DCつみたてNISA・日本株インデックスファンド	15,940,892,855円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	453,355,694円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	484,073,352円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	312,771,346円
イオン・バランス戦略ファンド	55,063,082円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050	22,865,709円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	126,712,529円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	108,999,096円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	355,046,751円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	180,069,347円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	206,194,976円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	23,499,186円
三井住友DS・国内株式インデックス年金ファンド	215,426,585円
三井住友DS・年金バランス30(債券重点型)	11,380,243円
三井住友DS・年金バランス50(標準型)	50,121,313円
三井住友DS・年金バランス70(株式重点型)	46,060,070円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	3,257,418円
SMAM・国内株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	3,060,853,074円
バランスファンドVA(安定運用型) <適格機関投資家限定>	22,670,796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>	129,489,749円
SMAM・バランスファンドVA25 <適格機関投資家専用>	2,117,411,933円
SMAM・バランスファンドVA37.5 <適格機関投資家専用>	1,802,540,670円
SMAM・バランスファンドVA50 <適格機関投資家専用>	6,769,935,339円
SMAM・バランスファンドVL30 <適格機関投資家限定>	42,846,949円
SMAM・バランスファンドVL50 <適格機関投資家限定>	175,681,640円
SMAM・バランスファンドVA75 <適格機関投資家専用>	783,916,156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>	49,447,751円
SMAM・インデックス・バランスVA25 <適格機関投資家専用>	279,517,682円
SMAM・インデックス・バランスVA50 <適格機関投資家専用>	882,228,687円
SMAM・バランスファンドVA40 <適格機関投資家専用>	687,469,840円
SMAM・バランスファンドVA35 <適格機関投資家専用>	2,094,565,514円

SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定>	367,759円
SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	45,653,025円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>	54,101,733円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>	35,682,955円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用>	17,007,263円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>	134,126,377円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	271,614,480円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A2<適格機関投資家専用>	72,459,636円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A2<適格機関投資家専用>	43,489,672円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A2<適格機関投資家専用>	7,479,610円
SMAM・アセットバランスファンドVA30L2<適格機関投資家専用>	50,100,640円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L2<適格機関投資家専用>	670,876,217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)	175,567,216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>	291,264,191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>	127,955,140円
SMAM・世界バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	735,634,579円
SMAM・世界バランスファンドVA2<適格機関投資家限定>	74,013,645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>	20,287,354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>	50,751,185円
SMAM・マルチアセットストラテジー・オープン<適格機関投資家限定>	42,473,420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>	429,758,704円
合計	60,307,285,983円

(2022年4月13日現在)

開示対象ファンドの

期首における当該親投資信託の元本額	60,307,285,983円
同期中における追加設定元本額	11,806,523,474円
同期中における一部解約元本額	9,016,575,936円

2022年4月13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	9,524,501,074円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	980,498,940円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	4,538,348,289円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	3,440,118,395円
SMAM・グローバルバランスファンド(機動的資産配分型)	128,286,319円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2020(4資産タイプ)	4,784,541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)	20,797,656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)	64,462,163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)	154,781,571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)	133,882,770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)	242,084,389円
国内株式指数ファンド(TOPIX)	1,489,236,000円
三井住友・DCつみたてNISA・日本株インデックスファンド	19,582,111,751円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	146,334,176円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	231,330,362円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	152,943,467円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050	31,895,783円

三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	182,885,633円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	165,851,866円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	584,008,251円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	318,357,546円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	360,155,415円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	41,466,339円
三井住友DS・国内株式インデックス年金ファンド	547,071,614円
三井住友DS・年金バランス30(債券重点型)	17,456,337円
三井住友DS・年金バランス50(標準型)	88,881,884円
三井住友DS・年金バランス70(株式重点型)	94,685,297円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	4,047,832円
日興FWS・日本株インデックス	582,504,321円
三井住友DS・TOPIXインデックス・ファンド	5,086,487円
SMAM・国内株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	2,743,586,165円
バランスファンドVA(安定運用型)〈適格機関投資家限定〉	12,823,736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〉	97,797,524円
SMAM・バランスファンドVA25〈適格機関投資家専用〉	1,769,964,821円
SMAM・バランスファンドVA37.5〈適格機関投資家専用〉	1,640,393,274円
SMAM・バランスファンドVA50〈適格機関投資家専用〉	6,218,766,294円
SMAM・バランスファンドVL30〈適格機関投資家限定〉	40,740,210円
SMAM・バランスファンドVL50〈適格機関投資家限定〉	159,471,500円
SMAM・バランスファンドVA75〈適格機関投資家専用〉	735,491,821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〉	46,826,720円
SMAM・インデックス・バランスVA25〈適格機関投資家専用〉	257,810,451円
SMAM・インデックス・バランスVA50〈適格機関投資家専用〉	839,187,037円
SMAM・バランスファンドVA40〈適格機関投資家専用〉	607,019,790円
SMAM・バランスファンドVA35〈適格機関投資家専用〉	1,876,743,832円
SMAM・バランスVA株40T〈適格機関投資家限定〉	374,931円
SMAM・グローバルバランス40VA〈適格機関投資家限定〉	42,725,221円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A〈適格機関投資家専用〉	47,564,568円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A〈適格機関投資家専用〉	34,436,924円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A〈適格機関投資家専用〉	16,874,370円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L〈適格機関投資家専用〉	113,224,715円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L〈適格機関投資家専用〉	245,176,007円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A2〈適格機関投資家専用〉	60,459,399円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A2〈適格機関投資家専用〉	41,778,678円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A2〈適格機関投資家専用〉	7,630,596円
SMAM・アセットバランスファンドVA30L2〈適格機関投資家専用〉	44,249,093円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L2〈適格機関投資家専用〉	601,227,185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)	181,398,201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〉	228,400,003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〉	101,339,489円
SMAM・世界バランスファンドVA〈適格機関投資家限定〉	181,801,332円
SMAM・世界バランスファンドVA2〈適格機関投資家限定〉	55,617,287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〉	43,072,081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〉	28,371,625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〉	36,568,156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 >	67,859,289円
SMDAM・日米3資産バランスオープン<適格機関投資家限定>	11,604,728円
合 計	63,097,233,521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	3,700	3,260.000	12,062,000	
日本水産	102,500	558.000	57,195,000	
マルハニチロ	15,800	2,374.000	37,509,200	
雪国まいたけ	8,300	1,146.000	9,511,800	
カネコ種苗	5,000	1,582.000	7,910,000	
サカタのタネ	12,100	4,155.000	50,275,500	
ホクト	8,700	1,991.000	17,321,700	
日鉄鉱業	2,400	6,730.000	16,152,000	
三井松島ホールディングス	4,800	2,025.000	9,720,000	
INPEX	396,200	1,517.000	601,035,400	
石油資源開発	12,300	2,719.000	33,443,700	
K&Oエナジーグループ	5,600	1,638.000	9,172,800	
ヒノキヤグループ	2,900	2,324.000	6,739,600	
ショーボンドホールディングス	14,700	5,360.000	78,792,000	
ミライト・ホールディングス	33,100	1,841.000	60,937,100	
タマホーム	6,300	2,373.000	14,949,900	
ベステラ	4,200	1,192.000	5,006,400	
Robot Home	22,100	206.000	4,552,600	
安藤・間	51,300	884.000	45,349,200	
東急建設	32,200	660.000	21,252,000	
コムシスホールディングス	33,100	2,625.000	86,887,500	
ビーアールホールディングス	19,200	297.000	5,702,400	
高松コンストラクショングループ	6,900	2,166.000	14,945,400	
東建コーポレーション	2,900	8,770.000	25,433,000	
ヤマウラ	4,000	932.000	3,728,000	
オリエンタル白石	38,500	230.000	8,855,000	
大成建設	69,200	3,510.000	242,892,000	
大林組	239,100	898.000	214,711,800	
清水建設	224,100	723.000	162,024,300	
飛島建設	9,200	1,005.000	9,246,000	
長谷工コーポレーション	70,500	1,376.000	97,008,000	
松井建設	11,900	648.000	7,711,200	
銭高組	1,800	3,880.000	6,984,000	
鹿島建設	175,300	1,480.000	259,444,000	
不動テトラ	6,200	1,541.000	9,554,200	

大末建設	4,100	1,317.000	5,399,700
鉄建建設	7,100	1,835.000	13,028,500
西松建設	14,700	3,710.000	54,537,000
三井住友建設	56,900	420.000	23,898,000
大豊建設	3,800	4,525.000	17,195,000
奥村組	14,000	2,997.000	41,958,000
東鉄工業	10,800	2,153.000	23,252,400
浅沼組	2,900	5,080.000	14,732,000
戸田建設	99,700	744.000	74,176,800
熊谷組	11,900	2,680.000	31,892,000
北野建設	3,000	2,128.000	6,384,000
矢作建設工業	12,900	777.000	10,023,300
ピーエス三菱	9,900	558.000	5,524,200
日本ハウスホールディングス	20,200	451.000	9,110,200
大東建託	24,500	12,220.000	299,390,000
新日本建設	10,900	728.000	7,935,200
東亜道路工業	1,600	4,945.000	7,912,000
日本道路	2,400	7,540.000	18,096,000
東亜建設工業	6,400	2,822.000	18,060,800
日本国土開発	24,000	542.000	13,008,000
若築建設	5,200	1,965.000	10,218,000
五洋建設	95,400	629.000	60,006,600
世紀東急工業	13,000	720.000	9,360,000
福田組	2,800	4,370.000	12,236,000
住友林業	61,100	2,020.000	123,422,000
日本基礎技術	8,100	810.000	6,561,000
巴コーポレーション	14,600	460.000	6,716,000
大和ハウス工業	221,600	3,015.000	668,124,000
ライト工業	14,700	1,918.000	28,194,600
積水ハウス	260,300	2,205.000	573,961,500
北陸電気工事	6,600	750.000	4,950,000
ユアテック	14,900	672.000	10,012,800
日本リーテック	6,100	1,202.000	7,332,200
四電工	3,000	1,720.000	5,160,000
中電工	10,900	2,073.000	22,595,700
関電工	37,500	816.000	30,600,000
きんでん	52,900	1,565.000	82,788,500
東京エネシス	9,700	988.000	9,583,600
トーエネック	2,900	3,165.000	9,178,500
住友電設	6,300	2,182.000	13,746,600
日本電設工業	12,700	1,549.000	19,672,300
エクシオグループ	35,500	2,158.000	76,609,000
新日本空調	6,800	1,864.000	12,675,200
九電工	18,500	2,844.000	52,614,000
三機工業	15,000	1,416.000	21,240,000
日揮ホールディングス	73,900	1,497.000	110,628,300
中外炉工業	3,900	1,478.000	5,764,200
ヤマト	9,800	765.000	7,497,000

太平電業	5,700	2,693.000	15,350,100
高砂熱学工業	21,100	1,682.000	35,490,200
朝日工業社	4,600	1,516.000	6,973,600
明星工業	17,400	674.000	11,727,600
大気社	11,700	3,005.000	35,158,500
ダイダン	5,700	2,042.000	11,639,400
日比谷総合設備	8,100	1,876.000	15,195,600
テスホールディングス	5,900	1,495.000	8,820,500
インフロニア・ホールディングス	102,000	982.000	100,164,000
東洋エンジニアリング	12,400	636.000	7,886,400
レイズネクスト	11,800	1,056.000	12,460,800
ニッポン	20,900	1,671.000	34,923,900
日清製粉グループ本社	86,300	1,741.000	150,248,300
昭和産業	7,100	2,603.000	18,481,300
鳥越製粉	4,900	640.000	3,136,000
中部飼料	9,400	985.000	9,259,000
フィード・ワン	11,400	648.000	7,387,200
日本甜菜製糖	5,300	1,615.000	8,559,500
D M三井製糖ホールディングス	6,400	1,904.000	12,185,600
日新製糖	4,400	1,691.000	7,440,400
森永製菓	18,100	3,950.000	71,495,000
中村屋	3,200	3,130.000	10,016,000
江崎グリコ	21,100	3,700.000	78,070,000
名糖産業	5,100	1,592.000	8,119,200
井村屋グループ	4,900	2,187.000	10,716,300
不二家	4,400	2,375.000	10,450,000
山崎製パン	58,000	1,514.000	87,812,000
モロゾフ	3,000	2,909.000	8,727,000
亀田製菓	4,400	4,030.000	17,732,000
寿スピリッツ	7,400	6,700.000	49,580,000
カルビー	35,100	2,345.000	82,309,500
森永乳業	14,300	5,170.000	73,931,000
六甲バター	6,600	1,491.000	9,840,600
ヤクルト本社	57,000	6,430.000	366,510,000
明治ホールディングス	50,600	6,460.000	326,876,000
雪印メグミルク	18,700	1,957.000	36,595,900
プリマハム	9,100	2,163.000	19,683,300
日本ハム	29,300	4,120.000	120,716,000
丸大食品	8,400	1,467.000	12,322,800
S Foods	6,800	3,200.000	21,760,000
柿安本店	3,000	2,294.000	6,882,000
伊藤ハム米久ホールディングス	45,600	651.000	29,685,600
サッポロホールディングス	26,100	2,313.000	60,369,300
アサヒグループホールディングス	180,900	4,475.000	809,527,500
キリンホールディングス	282,700	1,783.000	504,054,100
宝ホールディングス	52,100	1,058.000	55,121,800
オエノンホールディングス	25,700	309.000	7,941,300
養命酒製造	3,800	1,744.000	6,627,200

コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	54,100	1,417.000	76,659,700
サントリー食品インターナショナル	51,300	4,765.000	244,444,500
ダイドグループホールディングス	3,900	4,730.000	18,447,000
伊藤園	23,300	5,380.000	125,354,000
キーコーヒー	7,700	1,986.000	15,292,200
日清オイリオグループ	9,000	2,864.000	25,776,000
不二製油グループ本社	16,900	1,826.000	30,859,400
かどや製油	1,400	3,655.000	5,117,000
J・オイルミルズ	7,700	1,563.000	12,035,100
キッコーマン	55,300	8,570.000	473,921,000
味の素	169,700	3,478.000	590,216,600
ブルドックソース	4,200	1,959.000	8,227,800
キューピー	40,400	2,167.000	87,546,800
ハウス食品グループ本社	28,600	2,923.000	83,597,800
カゴメ	29,300	3,225.000	94,492,500
焼津水産化学工業	6,500	895.000	5,817,500
アリアケジャパン	7,100	4,810.000	34,151,000
ニチレイ	35,100	2,388.000	83,818,800
東洋水産	36,900	4,105.000	151,474,500
イトアンドホールディングス	3,900	2,053.000	8,006,700
日清食品ホールディングス	30,100	8,850.000	266,385,000
永谷園ホールディングス	4,200	1,904.000	7,996,800
一正蒲鉾	3,100	818.000	2,535,800
フジッコ	7,700	2,016.000	15,523,200
ロック・フィールド	8,200	1,450.000	11,890,000
日本たばこ産業	412,300	2,139.000	881,909,700
ケンコーマヨネーズ	5,500	1,418.000	7,799,000
わらべや日洋ホールディングス	5,400	1,710.000	9,234,000
なとり	5,200	1,941.000	10,093,200
ピクルスコーポレーション	4,200	1,542.000	6,476,400
ファーマフーズ	7,400	1,935.000	14,319,000
ユーグレナ	39,700	863.000	34,261,100
紀文食品	5,400	1,077.000	5,815,800
ミヨシ油脂	5,300	1,122.000	5,946,600
理研ビタミン	8,100	1,638.000	13,267,800
片倉工業	8,700	2,149.000	18,696,300
グンゼ	5,100	3,675.000	18,742,500
東洋紡	30,400	1,028.000	31,251,200
ユニチカ	24,300	273.000	6,633,900
富士紡ホールディングス	3,600	3,070.000	11,052,000
倉敷紡績	7,100	1,720.000	12,212,000
シキボウ	8,500	875.000	7,437,500
日本毛織	22,700	942.000	21,383,400
帝国繊維	8,900	1,647.000	14,658,300
帝人	70,000	1,320.000	92,400,000
東レ	541,100	606.700	328,285,370
住江織物	2,600	1,831.000	4,760,600

アツギ	10,200	531.000	5,416,200
ダイニツク	7,400	705.000	5,217,000
セーレン	15,500	2,039.000	31,604,500
小松マテーレ	13,000	1,399.000	18,187,000
ワコールホールディングス	19,500	1,826.000	35,607,000
ホギメディカル	10,200	3,265.000	33,303,000
T S Iホールディングス	29,400	328.000	9,643,200
マツオカコーポレーション	3,500	1,148.000	4,018,000
ワールド	11,000	1,308.000	14,388,000
オンワードホールディングス	47,400	236.000	11,186,400
ゴールドウイン	13,500	6,110.000	82,485,000
デサント	14,500	2,666.000	38,657,000
特種東海製紙	4,800	3,355.000	16,104,000
王子ホールディングス	313,700	594.000	186,337,800
日本製紙	36,700	1,019.000	37,397,300
北越コーポレーション	49,800	653.000	32,519,400
大王製紙	37,000	1,532.000	56,684,000
レンゴー	72,300	735.000	53,140,500
トーモク	5,800	1,493.000	8,659,400
ザ・バック	6,200	2,436.000	15,103,200
北の達人コーポレーション	28,600	230.000	6,578,000
クラレ	109,000	1,009.000	109,981,000
旭化成	497,600	1,057.500	526,212,000
昭和電工	65,000	2,349.000	152,685,000
住友化学	548,700	539.000	295,749,300
住友精化	3,700	3,055.000	11,303,500
日産化学	40,800	7,130.000	290,904,000
クレハ	5,800	9,430.000	54,694,000
多木化学	3,100	5,120.000	15,872,000
テイカ	6,300	1,200.000	7,560,000
石原産業	12,800	1,010.000	12,928,000
日本曹達	9,500	3,290.000	31,255,000
東ソー	107,700	1,713.000	184,490,100
トクヤマ	24,100	1,643.000	39,596,300
セントラル硝子	12,000	2,283.000	27,396,000
東亜合成	42,100	1,079.000	45,425,900
大阪ソーダ	6,900	3,130.000	21,597,000
関東電化工業	16,700	971.000	16,215,700
デンカ	27,400	3,275.000	89,735,000
信越化学工業	128,900	17,475.000	2,252,527,500
堺化学工業	5,600	1,853.000	10,376,800
第一稀元素化学工業	8,400	946.000	7,946,400
エア・ウォーター	71,200	1,639.000	116,696,800
日本酸素ホールディングス	72,100	2,192.000	158,043,200
日本化学工業	2,800	2,230.000	6,244,000
日本パーカライジング	37,400	895.000	33,473,000
高圧ガス工業	13,900	645.000	8,965,500
四国化成工業	10,000	1,292.000	12,920,000

ステラ ケミファ	4,100	2,447.000	10,032,700
保土谷化学工業	2,600	3,880.000	10,088,000
日本触媒	12,700	5,190.000	65,913,000
大日精化工業	6,400	1,938.000	12,403,200
カネカ	19,300	3,395.000	65,523,500
三菱瓦斯化学	69,500	1,853.000	128,783,500
三井化学	67,700	2,900.000	196,330,000
J S R	69,900	3,455.000	241,504,500
東京応化工業	12,200	6,860.000	83,692,000
大阪有機化学工業	6,400	2,990.000	19,136,000
三菱ケミカルホールディングス	502,400	776.400	390,063,360
K Hネオケム	12,300	2,536.000	31,192,800
ダイセル	108,600	761.000	82,644,600
住友ベークライト	11,800	4,390.000	51,802,000
積水化学工業	156,500	1,649.000	258,068,500
日本ゼオン	67,800	1,306.000	88,546,800
アイカ工業	21,100	2,898.000	61,147,800
U B E	35,100	1,930.000	67,743,000
積水樹脂	11,300	1,730.000	19,549,000
タキロンシーアイ	17,600	545.000	9,592,000
旭有機材	4,900	1,910.000	9,359,000
ニチバン	5,600	1,684.000	9,430,400
リケンテクノス	20,300	442.000	8,972,600
大倉工業	4,500	1,774.000	7,983,000
群栄化学工業	2,300	2,769.000	6,368,700
ミライアル	3,100	1,640.000	5,084,000
ダイキョーニシカワ	17,700	517.000	9,150,900
森六ホールディングス	5,000	1,759.000	8,795,000
恵和	2,100	5,300.000	11,130,000
日本化薬	59,800	1,119.000	66,916,200
カーリットホールディングス	9,600	626.000	6,009,600
日本精化	6,300	2,188.000	13,784,400
扶桑化学工業	6,700	3,990.000	26,733,000
トリケミカル研究所	7,700	2,773.000	21,352,100
A D E K A	34,400	2,624.000	90,265,600
日油	25,600	4,775.000	122,240,000
新日本理化	20,100	231.000	4,643,100
ハリマ化成グループ	8,000	791.000	6,328,000
花王	169,800	4,965.000	843,057,000
第一工業製薬	3,100	2,598.000	8,053,800
石原ケミカル	5,000	1,266.000	6,330,000
ニイタカ	2,400	2,426.000	5,822,400
三洋化成工業	4,300	4,970.000	21,371,000
大日本塗料	12,000	768.000	9,216,000
日本ペイントホールディングス	282,400	1,089.000	307,533,600
関西ペイント	78,000	1,924.000	150,072,000
中国塗料	18,800	911.000	17,126,800
日本特殊塗料	7,600	809.000	6,148,400

藤倉化成	12,900	446.000	5,753,400
太陽ホールディングス	11,000	3,215.000	35,365,000
D I C	31,700	2,389.000	75,731,300
サカタインクス	15,100	914.000	13,801,400
東洋インキS Cホールディングス	14,800	1,893.000	28,016,400
T & K T O K A	8,700	808.000	7,029,600
富士フイルムホールディングス	134,900	7,324.000	988,007,600
資生堂	142,900	6,161.000	880,406,900
ライオン	93,200	1,316.000	122,651,200
高砂香料工業	5,400	2,586.000	13,964,400
マンダム	16,600	1,307.000	21,696,200
ミルボン	9,600	5,340.000	51,264,000
ファンケル	31,100	2,616.000	81,357,600
コーセー	14,500	12,930.000	187,485,000
コタ	6,490	1,419.000	9,209,310
ポーラ・オルビスホールディングス	33,000	1,532.000	50,556,000
ノエビアホールディングス	6,600	4,990.000	32,934,000
エステー	6,100	1,511.000	9,217,100
コニシ	12,900	1,516.000	19,556,400
長谷川香料	13,300	2,560.000	34,048,000
小林製薬	21,500	9,360.000	201,240,000
荒川化学工業	7,900	1,033.000	8,160,700
メック	5,800	2,925.000	16,965,000
タカラバイオ	20,100	2,270.000	45,627,000
J C U	8,500	3,655.000	31,067,500
O A Tアグリオ	4,200	1,080.000	4,536,000
デクセリアルズ	20,000	3,125.000	62,500,000
アース製薬	6,300	5,410.000	34,083,000
北興化学工業	8,100	1,018.000	8,245,800
大成ラミック	3,500	2,547.000	8,914,500
クミアイ化学工業	29,000	891.000	25,839,000
日本農薬	16,600	603.000	10,009,800
アキレス	6,800	1,309.000	8,901,200
有沢製作所	12,300	899.000	11,057,700
日東電工	46,200	8,390.000	387,618,000
レック	11,600	864.000	10,022,400
藤森工業	6,700	3,520.000	23,584,000
前澤化成工業	6,900	1,261.000	8,700,900
未来工業	4,000	1,482.000	5,928,000
J S P	5,400	1,485.000	8,019,000
エフピコ	14,600	2,773.000	40,485,800
天馬	6,100	2,201.000	13,426,100
信越ポリマー	13,700	1,080.000	14,796,000
東リ	29,700	224.000	6,652,800
ニフコ	25,700	2,581.000	66,331,700
バルカー	6,200	2,540.000	15,748,000
ユニ・チャーム	147,700	4,362.000	644,267,400
協和キリン	89,600	2,882.000	258,227,200

武田薬品工業	602,300	3,737.000	2,250,795,100
アステラス製薬	664,300	2,076.500	1,379,418,950
住友ファーマ	47,500	1,188.000	56,430,000
塩野義製薬	96,300	6,611.000	636,639,300
日本新薬	20,100	9,010.000	181,101,000
中外製薬	239,600	4,256.000	1,019,737,600
科研製薬	12,300	3,895.000	47,908,500
エーザイ	91,600	5,745.000	526,242,000
ロート製薬	39,300	3,475.000	136,567,500
小野薬品工業	175,800	3,183.000	559,571,400
久光製薬	20,300	3,505.000	71,151,500
持田製薬	9,900	3,720.000	36,828,000
参天製薬	142,700	1,099.000	156,827,300
扶桑薬品工業	3,600	2,110.000	7,596,000
日本ケミファ	2,500	1,999.000	4,997,500
ツムラ	23,900	3,230.000	77,197,000
日医工	25,100	764.000	19,176,400
キッセイ薬品工業	13,300	2,464.000	32,771,200
生化学工業	13,400	865.000	11,591,000
栄研化学	13,300	1,712.000	22,769,600
鳥居薬品	4,300	3,130.000	13,459,000
JCRファーマ	22,000	2,319.000	51,018,000
東和薬品	10,900	2,659.000	28,983,100
富士製薬工業	6,800	965.000	6,562,000
ゼリア新薬工業	13,900	1,958.000	27,216,200
第一三共	602,300	2,926.000	1,762,329,800
キョーリン製薬ホールディングス	15,000	1,815.000	27,225,000
大幸薬品	13,400	613.000	8,214,200
ダイト	5,100	2,818.000	14,371,800
大塚ホールディングス	159,200	4,199.000	668,480,800
大正製薬ホールディングス	18,100	5,080.000	91,948,000
ペプチドリーム	40,600	2,246.000	91,187,600
あすか製薬ホールディングス	9,500	1,266.000	12,027,000
サイグループホールディングス	16,800	4,320.000	72,576,000
日本コークス工業	75,000	143.000	10,725,000
ニチレキ	10,500	1,170.000	12,285,000
ユシロ化学工業	7,200	1,009.000	7,264,800
富士石油	18,000	308.000	5,544,000
MORESCO	5,800	1,138.000	6,600,400
出光興産	84,500	3,390.000	286,455,000
ENEOSホールディングス	1,148,900	447.600	514,247,640
コスモエネルギーホールディングス	22,100	3,210.000	70,941,000
横浜ゴム	43,500	1,681.000	73,123,500
TOYO TIRE	40,200	1,419.000	57,043,800
ブリヂストン	220,700	4,577.000	1,010,143,900
住友ゴム工業	68,800	1,094.000	75,267,200
藤倉コンポジット	7,400	726.000	5,372,400
オカモト	4,700	3,910.000	18,377,000

ニッタ	7,700	2,711.000	20,874,700
住友理工	16,600	554.000	9,196,400
三ツ星ベルト	9,400	1,941.000	18,245,400
バンドー化学	13,500	833.000	11,245,500
日東紡績	11,700	2,619.000	30,642,300
A G C	70,200	4,825.000	338,715,000
日本電気硝子	31,000	2,579.000	79,949,000
オハラ	4,300	1,121.000	4,820,300
住友大阪セメント	14,600	3,165.000	46,209,000
太平洋セメント	43,600	1,948.000	84,932,800
日本ヒューム	12,500	680.000	8,500,000
日本コンクリート工業	22,900	303.000	6,938,700
三谷セキサン	3,700	5,700.000	21,090,000
アジアパイルホールディングス	17,100	420.000	7,182,000
東海カーボン	64,500	1,088.000	70,176,000
日本カーボン	4,000	4,150.000	16,600,000
東洋炭素	5,100	2,927.000	14,927,700
ノリタケカンパニーリミテド	4,400	4,100.000	18,040,000
T O T O	54,700	4,470.000	244,509,000
日本碍子	82,500	1,661.000	137,032,500
日本特殊陶業	58,300	1,875.000	109,312,500
M A R U W A	2,600	14,250.000	37,050,000
品川リフラクトリーズ	2,000	3,590.000	7,180,000
黒崎播磨	1,600	4,035.000	6,456,000
ヨータイ	5,800	1,255.000	7,279,000
東京窯業	16,100	288.000	4,636,800
フジインコーポレーテッド	6,100	5,850.000	35,685,000
ニチアス	17,500	2,390.000	41,825,000
ニチハ	10,700	2,322.000	24,845,400
日本製鉄	339,000	2,077.500	704,272,500
神戸製鋼所	139,700	558.000	77,952,600
中山製鋼所	14,900	426.000	6,347,400
合同製鐵	5,500	1,335.000	7,342,500
ジェイ エフ イー ホールディングス	204,000	1,651.000	336,804,000
東京製鐵	25,700	1,123.000	28,861,100
共英製鋼	9,100	1,336.000	12,157,600
大和工業	14,500	3,605.000	52,272,500
東京鐵鋼	4,900	1,289.000	6,316,100
大阪製鐵	4,800	1,552.000	7,449,600
淀川製鋼所	9,700	2,656.000	25,763,200
丸一鋼管	24,000	2,778.000	66,672,000
モリ工業	2,800	2,518.000	7,050,400
大同特殊鋼	12,500	3,530.000	44,125,000
日本冶金工業	5,700	2,572.000	14,660,400
山陽特殊製鋼	7,900	1,973.000	15,586,700
愛知製鋼	4,800	2,325.000	11,160,000
日立金属	81,600	1,950.000	159,120,000
大平洋金属	4,900	3,630.000	17,787,000

新日本電工	49,600	325.000	16,120,000
栗本鐵工所	5,000	1,577.000	7,885,000
三菱製鋼	6,300	1,079.000	6,797,700
日本精線	1,500	4,200.000	6,300,000
エンビプロ・ホールディングス	2,900	2,148.000	6,229,200
大紀アルミニウム工業所	11,300	1,535.000	17,345,500
日本軽金属ホールディングス	19,300	1,655.000	31,941,500
三井金属鉱業	20,200	3,340.000	67,468,000
東邦亜鉛	4,600	2,838.000	13,054,800
三菱マテリアル	50,000	2,075.000	103,750,000
住友金属鉱山	96,900	6,171.000	597,969,900
D O W Aホールディングス	20,500	5,760.000	118,080,000
古河機械金属	12,500	1,270.000	15,875,000
大阪チタニウムテクノロジーズ	11,000	1,323.000	14,553,000
東邦チタニウム	14,400	1,491.000	21,470,400
U A C J	11,300	2,225.000	25,142,500
C Kサンエツ	1,900	4,040.000	7,676,000
古河電気工業	23,700	2,083.000	49,367,100
住友電気工業	283,500	1,379.500	391,088,250
フジクラ	84,100	556.000	46,759,600
昭和電線ホールディングス	6,900	1,735.000	11,971,500
タツタ電線	15,600	450.000	7,020,000
平河ヒューテック	5,400	1,084.000	5,853,600
リョービ	10,200	1,055.000	10,761,000
アサヒホールディングス	30,200	2,203.000	66,530,600
宮地エンジニアリンググループ	2,700	3,485.000	9,409,500
トーカロ	19,400	1,275.000	24,735,000
アルファ	5,600	954.000	5,342,400
S U M C O	116,600	1,870.000	218,042,000
川田テクノロジーズ	2,100	3,550.000	7,455,000
R S T E C H N O L O G I E S	2,500	6,010.000	15,025,000
東洋製罐グループホールディングス	48,600	1,339.000	65,075,400
ホッカンホールディングス	6,300	1,228.000	7,736,400
横河ブリッジホールディングス	12,900	1,902.000	24,535,800
駒井ハルテック	2,100	1,980.000	4,158,000
三和ホールディングス	71,500	1,129.000	80,723,500
文化シャッター	24,200	948.000	22,941,600
三協立山	12,000	591.000	7,092,000
アルインコ	8,600	853.000	7,335,800
L I X I L	119,200	2,095.000	249,724,000
ノーリツ	14,600	1,451.000	21,184,600
長府製作所	8,400	1,910.000	16,044,000
リンナイ	14,300	8,200.000	117,260,000
日東精工	13,000	483.000	6,279,000
岡部	17,100	663.000	11,337,300
ジーテクト	9,300	1,218.000	11,327,400
東プレ	14,200	1,055.000	14,981,000
高周波熱錬	15,700	573.000	8,996,100

東京製綱	6,500	877.000	5,700,500
サンコール	9,900	493.000	4,880,700
パイオラックス	11,000	1,464.000	16,104,000
エイチワン	10,100	586.000	5,918,600
日本発条	70,200	828.000	58,125,600
立川ブラインド工業	5,000	1,070.000	5,350,000
三益半導体工業	5,800	2,323.000	13,473,400
日本製鋼所	23,100	3,685.000	85,123,500
三浦工業	32,900	2,689.000	88,468,100
タクマ	25,700	1,449.000	37,239,300
ツガミ	17,400	1,227.000	21,349,800
オークマ	8,700	4,675.000	40,672,500
芝浦機械	8,600	3,210.000	27,606,000
アマダ	118,500	984.000	116,604,000
アイダエンジニアリング	19,700	963.000	18,971,100
F U J I	34,700	2,130.000	73,911,000
牧野フライス製作所	8,100	3,810.000	30,861,000
オーエスジー	35,400	1,607.000	56,887,800
旭ダイヤモンド工業	21,700	565.000	12,260,500
D M G 森精機	44,700	1,520.000	67,944,000
ソディック	17,300	719.000	12,438,700
ディスコ	11,200	30,450.000	341,040,000
日東工器	5,300	1,495.000	7,923,500
日進工具	6,500	1,426.000	9,269,000
石川製作所	2,500	1,431.000	3,577,500
島精機製作所	11,400	1,831.000	20,873,400
オプトラン	9,700	2,033.000	19,720,100
N C ホールディングス	3,000	1,595.000	4,785,000
フリュー	7,400	1,025.000	7,585,000
ヤマシンフィルタ	18,900	340.000	6,426,000
日阪製作所	11,600	768.000	8,908,800
やまびこ	14,700	1,361.000	20,006,700
野村マイクロ・サイエンス	2,200	3,840.000	8,448,000
平田機工	3,600	4,895.000	17,622,000
マルマエ	3,500	2,093.000	7,325,500
タツモ	4,500	1,542.000	6,939,000
ナブテスコ	43,200	3,060.000	132,192,000
三井海洋開発	8,800	1,226.000	10,788,800
レオン自動機	9,400	1,030.000	9,682,000
S M C	22,500	64,940.000	1,461,150,000
ホソカワミクロン	5,400	2,510.000	13,554,000
ユニオンツール	3,000	3,680.000	11,040,000
オイレス工業	10,500	1,474.000	15,477,000
日精エー・エス・ビー機械	2,900	2,912.000	8,444,800
サトーホールディングス	10,100	1,695.000	17,119,500
技研製作所	6,700	3,530.000	23,651,000
日本エアーテック	4,900	1,042.000	5,105,800
日精樹脂工業	6,900	965.000	6,658,500

ワイエイシイホールディングス	3,900	1,631.000	6,360,900
小松製作所	347,500	2,874.500	998,888,750
住友重機械工業	43,600	2,651.000	115,583,600
日立建機	30,700	3,035.000	93,174,500
日工	14,300	605.000	8,651,500
巴工業	3,800	2,324.000	8,831,200
井関農機	7,900	1,244.000	9,827,600
TOWA	6,700	2,226.000	14,914,200
北川鉄工所	4,900	1,277.000	6,257,300
ローツェ	3,800	13,430.000	51,034,000
クボタ	371,200	2,186.500	811,628,800
荏原実業	4,000	2,334.000	9,336,000
三菱化工機	3,200	1,978.000	6,329,600
月島機械	14,300	1,038.000	14,843,400
帝国電機製作所	6,200	1,555.000	9,641,000
新東工業	18,900	672.000	12,700,800
澁谷工業	6,700	2,328.000	15,597,600
アイチコーポレーション	12,200	887.000	10,821,400
小森コーポレーション	21,000	692.000	14,532,000
鶴見製作所	6,600	1,785.000	11,781,000
荏原製作所	31,400	6,090.000	191,226,000
西島製作所	10,000	1,142.000	11,420,000
北越工業	9,300	829.000	7,709,700
ダイキン工業	97,700	20,405.000	1,993,568,500
オルガノ	2,100	9,570.000	20,097,000
トーヨーカネツ	3,500	2,457.000	8,599,500
栗田工業	41,500	4,300.000	178,450,000
椿本チエイン	9,600	2,898.000	27,820,800
大同工業	5,300	892.000	4,727,600
木村化工機	7,500	815.000	6,112,500
アネスト岩田	13,800	812.000	11,205,600
ダイフク	42,100	7,960.000	335,116,000
サムコ	2,400	2,541.000	6,098,400
タダノ	41,200	939.000	38,686,800
フジテック	28,600	3,015.000	86,229,000
CKD	22,300	1,713.000	38,199,900
キトー	7,200	1,667.000	12,002,400
平和	21,500	1,861.000	40,011,500
理想科学工業	6,700	2,208.000	14,793,600
SANKYO	16,700	3,600.000	60,120,000
日本金銭機械	10,800	678.000	7,322,400
マースグループホールディングス	6,400	1,663.000	10,643,200
フクシマガリレイ	5,300	3,660.000	19,398,000
ダイコク電機	5,600	1,218.000	6,820,800
竹内製作所	11,400	2,287.000	26,071,800
アマノ	20,400	2,028.000	41,371,200
JUKI	11,800	799.000	9,428,200
ジャノメ	8,100	669.000	5,418,900

マックス	10,300	1,577.000	16,243,100
グローリー	19,800	1,994.000	39,481,200
新晃工業	7,300	1,593.000	11,628,900
大和冷機工業	11,000	1,067.000	11,737,000
セガサミーホールディングス	76,200	2,247.000	171,221,400
日本ピストンリング	4,400	1,252.000	5,508,800
リケン	3,800	2,320.000	8,816,000
T P R	10,200	1,230.000	12,546,000
ツバキ・ナカシマ	17,100	934.000	15,971,400
ホシザキ	22,400	8,390.000	187,936,000
大豊工業	8,200	668.000	5,477,600
日本精工	144,000	703.000	101,232,000
NTN	163,900	199.000	32,616,100
ジェイテクト	72,800	882.000	64,209,600
不二越	6,300	3,745.000	23,593,500
日本トムソン	22,700	521.000	11,826,700
THK	43,300	2,565.000	111,064,500
ユーシン精機	9,000	638.000	5,742,000
前澤給装工業	7,800	929.000	7,246,200
イーグル工業	10,500	917.000	9,628,500
日本ピラー工業	7,700	2,783.000	21,429,100
キッツ	26,500	665.000	17,622,500
マキタ	93,300	3,754.000	350,248,200
日立造船	64,800	692.000	44,841,600
三菱重工業	120,200	4,210.000	506,042,000
I H I	47,800	2,861.000	136,755,800
スター精密	11,800	1,434.000	16,921,200
日清紡ホールディングス	47,100	1,009.000	47,523,900
イビデン	40,200	5,430.000	218,286,000
コニカミノルタ	168,500	489.000	82,396,500
ブラザー工業	93,500	2,173.000	203,175,500
ミネベアミツミ	131,600	2,470.000	325,052,000
日立製作所	368,800	5,818.000	2,145,678,400
東芝	133,900	5,000.000	669,500,000
三菱電機	766,800	1,352.500	1,037,097,000
富士電機	46,100	5,500.000	253,550,000
安川電機	82,400	4,525.000	372,860,000
シンフォニアテクノロジー	10,400	1,266.000	13,166,400
明電舎	13,100	2,416.000	31,649,600
オリジン	4,700	1,391.000	6,537,700
山洋電気	3,500	4,605.000	16,117,500
デンヨー	7,600	1,588.000	12,068,800
PHCホールディングス	9,000	1,865.000	16,785,000
東芝テック	8,300	4,450.000	36,935,000
芝浦メカトロニクス	1,400	7,480.000	10,472,000
マブチモーター	17,800	3,585.000	63,813,000
日本電産	198,600	8,760.000	1,739,736,000
トレックス・セミコンダクター	4,200	2,304.000	9,676,800

東光高岳	5,200	1,429.000	7,430,800
ダイヘン	8,200	3,700.000	30,340,000
ヤーマン	13,500	1,274.000	17,199,000
JVCケンウッド	67,700	164.000	11,102,800
ミマキエンジニアリング	9,300	645.000	5,998,500
I - P E X	4,300	1,402.000	6,028,600
日新電機	17,800	1,376.000	24,492,800
大崎電気工業	19,000	488.000	9,272,000
オムロン	63,800	7,718.000	492,408,400
日東工業	10,100	1,502.000	15,170,200
I D E C	9,800	2,310.000	22,638,000
ジーエス・ユアサ コーポレーション	25,200	2,188.000	55,137,600
メルコホールディングス	2,000	3,780.000	7,560,000
日本電気	97,400	5,190.000	505,506,000
富士通	69,000	19,070.000	1,315,830,000
沖電気工業	31,300	828.000	25,916,400
電気興業	4,700	2,333.000	10,965,100
サンケン電気	7,300	4,415.000	32,229,500
アイホン	5,000	1,965.000	9,825,000
ルネサスエレクトロニクス	416,000	1,289.000	536,224,000
セイコーエプソン	95,100	1,763.000	167,661,300
ワコム	59,400	951.000	56,489,400
アルバック	15,300	5,410.000	82,773,000
アクセル	4,300	986.000	4,239,800
E I Z O	6,000	3,460.000	20,760,000
日本信号	20,100	884.000	17,768,400
京三製作所	20,100	421.000	8,462,100
能美防災	10,300	1,897.000	19,539,100
ホーチキ	6,900	1,180.000	8,142,000
エレコム	17,600	1,493.000	26,276,800
パナソニック ホールディングス	818,100	1,129.500	924,043,950
シャープ	87,300	1,089.000	95,069,700
アンリツ	49,800	1,611.000	80,227,800
富士通ゼネラル	21,300	2,274.000	48,436,200
ソニーグループ	480,200	11,500.000	5,522,300,000
T D K	110,900	4,075.000	451,917,500
帝国通信工業	5,000	1,420.000	7,100,000
タムラ製作所	30,100	591.000	17,789,100
アルプスアルパイン	68,600	1,170.000	80,262,000
日本電波工業	7,700	1,230.000	9,471,000
メイコー	6,200	3,825.000	23,715,000
日本トリム	2,200	2,503.000	5,506,600
ローランド ディー . ジー .	4,800	3,140.000	15,072,000
フォスター電機	10,300	676.000	6,962,800
S M K	2,600	2,145.000	5,577,000
ヨコオ	5,700	2,259.000	12,876,300
ホシデン	18,300	1,162.000	21,264,600
ヒロセ電機	11,800	16,440.000	193,992,000

日本航空電子工業	17,500	1,938.000	33,915,000
TOA	10,500	664.000	6,972,000
マクセル	15,400	1,167.000	17,971,800
古野電気	10,400	1,002.000	10,420,800
ユニデンホールディングス	2,200	3,480.000	7,656,000
スミダコーポレーション	8,100	826.000	6,690,600
アイコム	3,700	2,452.000	9,072,400
リオン	3,600	2,439.000	8,780,400
横河電機	76,700	2,110.000	161,837,000
新電元工業	3,200	2,871.000	9,187,200
アズビル	45,000	3,825.000	172,125,000
東亜ディーケーケー	6,100	916.000	5,587,600
日本光電工業	32,000	2,922.000	93,504,000
共和電業	17,600	355.000	6,248,000
日本電子材料	4,400	2,032.000	8,940,800
堀場製作所	14,200	5,900.000	83,780,000
アドバンテスト	56,900	8,520.000	484,788,000
エスベック	6,500	1,792.000	11,648,000
キーエンス	69,500	56,020.000	3,893,390,000
日置電機	3,700	7,330.000	27,121,000
シスメックス	64,800	9,093.000	589,226,400
日本マイクロニクス	13,500	1,557.000	21,019,500
メガチップス	7,200	3,520.000	25,344,000
OBARA GROUP	3,900	2,842.000	11,083,800
コーセル	11,000	762.000	8,382,000
イリソ電子工業	6,600	3,125.000	20,625,000
オプテックスグループ	12,900	1,670.000	21,543,000
千代田インテグレ	4,200	2,103.000	8,832,600
レーザーテック	33,700	18,710.000	630,527,000
スタンレー電気	53,400	2,093.000	111,766,200
岩崎電気	3,600	2,309.000	8,312,400
ウシオ電機	39,700	1,619.000	64,274,300
日本セラミック	7,400	2,349.000	17,382,600
遠藤照明	5,300	914.000	4,844,200
古河電池	6,000	1,213.000	7,278,000
山一電機	6,100	1,649.000	10,058,900
図研	5,200	3,035.000	15,782,000
日本電子	16,000	5,840.000	93,440,000
カシオ計算機	55,900	1,335.000	74,626,500
ファナック	67,300	20,620.000	1,387,726,000
日本シイエムケイ	17,100	552.000	9,439,200
エンプラス	2,400	2,768.000	6,643,200
大真空	11,000	1,115.000	12,265,000
ローム	34,300	8,720.000	299,096,000
浜松ホトニクス	54,900	5,890.000	323,361,000
三井ハイテック	7,500	11,800.000	88,500,000
新光電気工業	22,500	5,420.000	121,950,000
京セラ	107,900	6,670.000	719,693,000

太陽誘電	37,100	5,030.000	186,613,000
村田製作所	225,200	7,781.000	1,752,281,200
双葉電子工業	17,500	647.000	11,322,500
北陸電気工業	4,700	1,116.000	5,245,200
ニチコン	24,200	1,106.000	26,765,200
日本ケミコン	7,700	1,753.000	13,498,100
K O A	11,800	1,319.000	15,564,200
市光工業	11,300	359.000	4,056,700
小糸製作所	41,900	4,485.000	187,921,500
ミツバ	16,500	339.000	5,593,500
S C R E E Nホールディングス	13,300	10,770.000	143,241,000
キャノン電子	7,800	1,546.000	12,058,800
キャノン	380,800	2,989.000	1,138,211,200
リコー	213,200	961.000	204,885,200
象印マホービン	21,000	1,361.000	28,581,000
東京エレクトロン	48,600	55,690.000	2,706,534,000
トヨタ紡織	31,300	1,850.000	57,905,000
ユニプレス	13,800	708.000	9,770,400
豊田自動織機	61,800	7,620.000	470,916,000
モリタホールディングス	13,100	1,218.000	15,955,800
三櫻工業	11,300	687.000	7,763,100
デンソー	168,900	7,125.000	1,203,412,500
東海理化電機製作所	19,300	1,406.000	27,135,800
川崎重工業	55,900	2,184.000	122,085,600
日本車輛製造	3,700	2,094.000	7,747,800
三菱ロジスネクスト	10,900	794.000	8,654,600
日産自動車	905,100	504.000	456,170,400
いすゞ自動車	240,200	1,490.000	357,898,000
トヨタ自動車	3,883,000	2,119.500	8,230,018,500
日野自動車	96,000	674.000	64,704,000
三菱自動車工業	284,500	307.000	87,341,500
武蔵精密工業	17,100	1,282.000	21,922,200
日産車体	13,500	528.000	7,128,000
新明和工業	21,700	885.000	19,204,500
極東開発工業	14,300	1,280.000	18,304,000
トピー工業	8,300	1,015.000	8,424,500
ティラド	2,700	2,238.000	6,042,600
曙ブレーキ工業	50,300	147.000	7,394,100
タチエス	14,400	964.000	13,881,600
N O K	37,800	1,062.000	40,143,600
フタバ産業	21,800	329.000	7,172,200
K Y B	7,800	2,783.000	21,707,400
大同メタル工業	18,700	553.000	10,341,100
プレス工業	39,700	361.000	14,331,700
ミクニ	12,800	370.000	4,736,000
太平洋工業	16,300	896.000	14,604,800
アイシン	55,800	3,795.000	211,761,000
マツダ	240,500	880.000	211,640,000

本田技研工業	603,900	3,261.000	1,969,317,900
スズキ	175,500	3,853.000	676,201,500
S U B A R U	219,900	1,830.000	402,417,000
安永	5,900	751.000	4,430,900
ヤマハ発動機	99,600	2,599.000	258,860,400
T B K	17,300	348.000	6,020,400
エクセディ	11,400	1,476.000	16,826,400
豊田合成	24,900	1,790.000	44,571,000
愛三工業	13,700	663.000	9,083,100
ヨロズ	9,300	804.000	7,477,200
エフ・シー・シー	12,300	1,246.000	15,325,800
シマノ	30,700	25,310.000	777,017,000
テイ・エス テック	32,700	1,314.000	42,967,800
ジャムコ	5,500	778.000	4,279,000
テルモ	217,100	3,892.000	844,953,200
日機装	23,200	827.000	19,186,400
日本エム・ディ・エム	5,100	1,641.000	8,369,100
島津製作所	98,400	4,135.000	406,884,000
J M S	9,600	594.000	5,702,400
長野計器	6,200	1,128.000	6,993,600
ブイ・テクノロジ	3,500	3,065.000	10,727,500
東京計器	6,800	1,146.000	7,792,800
インターアクション	4,100	1,832.000	7,511,200
東京精密	12,800	4,385.000	56,128,000
マニー	31,300	1,616.000	50,580,800
ニコン	117,200	1,367.000	160,212,400
トプコン	36,500	1,493.000	54,494,500
オリンパス	402,400	2,456.000	988,294,400
理研計器	6,200	4,520.000	28,024,000
タムロン	5,900	2,273.000	13,410,700
H O Y A	149,600	12,955.000	1,938,068,000
ノーリツ鋼機	7,100	2,176.000	15,449,600
A & Dホロンホールディングス	7,600	875.000	6,650,000
朝日インテック	84,300	2,625.000	221,287,500
シチズン時計	88,800	476.000	42,268,800
リズム	3,800	1,451.000	5,513,800
メニコン	25,700	2,864.000	73,604,800
松風	4,100	1,605.000	6,580,500
セイコーホールディングス	10,700	2,096.000	22,427,200
ニプロ	58,200	1,015.000	59,073,000
スノーピーク	9,900	3,160.000	31,284,000
パラマウントベッドホールディングス	14,700	2,032.000	29,870,400
トランザクション	5,700	998.000	5,688,600
ニホンフラッシュ	7,600	975.000	7,410,000
前田工織	8,500	2,984.000	25,364,000
永大産業	20,600	286.000	5,891,600
アートネイチャー	9,300	703.000	6,537,900
バンダイナムコホールディングス	68,600	9,081.000	622,956,600

SHOEI	7,200	4,720.000	33,984,000
フランスベッドホールディングス	12,700	871.000	11,061,700
パイロットコーポレーション	13,100	5,040.000	66,024,000
萩原工業	6,600	1,072.000	7,075,200
フジシールインターナショナル	18,700	1,637.000	30,611,900
タカラトミー	31,800	1,187.000	37,746,600
広済堂ホールディングス	6,500	829.000	5,388,500
プロネクサス	7,800	1,042.000	8,127,600
大建工業	4,900	2,065.000	10,118,500
凸版印刷	116,100	2,139.000	248,337,900
大日本印刷	90,300	2,704.000	244,171,200
共同印刷	3,000	2,733.000	8,199,000
NISSHA	15,900	1,419.000	22,562,100
TAKARA & COMPANY	5,700	1,883.000	10,733,100
アシックス	67,900	2,092.000	142,046,800
ローランド	5,500	4,280.000	23,540,000
ヤマハ	44,400	5,100.000	226,440,000
河合楽器製作所	2,500	2,978.000	7,445,000
ピジョン	45,600	2,147.000	97,903,200
キングジム	9,600	929.000	8,918,400
リンテック	16,700	2,407.000	40,196,900
イトーキ	20,200	339.000	6,847,800
任天堂	43,300	64,540.000	2,794,582,000
三菱鉛筆	12,700	1,249.000	15,862,300
タカラスタANDARD	15,700	1,284.000	20,158,800
コクヨ	37,400	1,638.000	61,261,200
ナカバヤシ	11,400	485.000	5,529,000
グローブライド	6,900	2,668.000	18,409,200
オカムラ	26,300	1,164.000	30,613,200
美津濃	7,800	2,042.000	15,927,600
東京電力ホールディングス	573,900	435.000	249,646,500
中部電力	232,900	1,316.000	306,496,400
関西電力	289,200	1,177.000	340,388,400
中国電力	118,400	869.000	102,889,600
北陸電力	72,100	542.000	39,078,200
東北電力	178,000	725.000	129,050,000
四国電力	69,300	768.000	53,222,400
九州電力	156,300	828.000	129,416,400
北海道電力	67,700	488.000	33,037,600
沖縄電力	16,300	1,329.000	21,662,700
電源開発	65,400	1,749.000	114,384,600
エフオン	7,600	582.000	4,423,200
イーレックス	11,600	1,907.000	22,121,200
レノバ	15,200	1,640.000	24,928,000
東京瓦斯	146,500	2,249.000	329,478,500
大阪瓦斯	137,900	2,086.000	287,659,400
東邦瓦斯	34,900	2,651.000	92,519,900
北海道瓦斯	5,600	1,471.000	8,237,600

広島ガス	20,900	321.000	6,708,900
西部ガスホールディングス	8,900	1,949.000	17,346,100
静岡ガス	19,700	871.000	17,158,700
メタウォーター	8,500	1,986.000	16,881,000
S B Sホールディングス	5,500	3,165.000	17,407,500
東武鉄道	74,300	2,955.000	219,556,500
相鉄ホールディングス	25,000	2,222.000	55,550,000
東急	192,200	1,586.000	304,829,200
京浜急行電鉄	98,600	1,285.000	126,701,000
小田急電鉄	113,800	1,990.000	226,462,000
京王電鉄	39,700	4,760.000	188,972,000
京成電鉄	53,300	3,355.000	178,821,500
富士急行	9,200	3,930.000	36,156,000
新京成電鉄	3,800	2,132.000	8,101,600
東日本旅客鉄道	134,900	6,899.000	930,675,100
西日本旅客鉄道	92,900	4,896.000	454,838,400
東海旅客鉄道	63,800	15,885.000	1,013,463,000
西武ホールディングス	100,200	1,257.000	125,951,400
鴻池運輸	12,300	1,087.000	13,370,100
西日本鉄道	21,500	2,592.000	55,728,000
ハマキョウレックス	5,400	2,764.000	14,925,600
サカイ引越センター	3,400	4,030.000	13,702,000
近鉄グループホールディングス	72,100	3,525.000	254,152,500
阪急阪神ホールディングス	90,200	3,410.000	307,582,000
南海電気鉄道	32,600	2,303.000	75,077,800
京阪ホールディングス	32,400	2,673.000	86,605,200
神戸電鉄	2,800	3,190.000	8,932,000
名古屋鉄道	59,800	2,093.000	125,161,400
山陽電気鉄道	6,700	2,051.000	13,741,700
アルプス物流	5,700	1,020.000	5,814,000
ヤマトホールディングス	101,700	2,362.000	240,215,400
山九	19,000	3,690.000	70,110,000
丸全昭和運輸	6,000	3,060.000	18,360,000
センコーグループホールディングス	35,000	850.000	29,750,000
トナミホールディングス	2,000	3,540.000	7,080,000
ニッコンホールディングス	24,600	1,895.000	46,617,000
福山通運	11,700	3,400.000	39,780,000
セイノーホールディングス	49,200	1,018.000	50,085,600
神奈川中央交通	2,600	3,270.000	8,502,000
日立物流	14,000	6,520.000	91,280,000
丸和運輸機関	15,400	1,372.000	21,128,800
C & F ロジホールディングス	7,800	1,092.000	8,517,600
九州旅客鉄道	56,300	2,514.000	141,538,200
S Gホールディングス	137,000	2,187.000	299,619,000
NIPPON EXPRESSホール ディングス	24,900	7,310.000	182,019,000
日本郵船	60,600	9,120.000	552,672,000
商船三井	120,300	2,930.000	352,479,000

川崎汽船	22,300	6,890.000	153,647,000
N S ユナイテッド海運	4,100	3,770.000	15,457,000
明治海運	10,400	748.000	7,779,200
飯野海運	35,200	772.000	27,174,400
乾汽船	5,500	1,669.000	9,179,500
日本航空	166,300	2,168.000	360,538,400
A N A ホールディングス	185,300	2,420.000	448,426,000
トランコム	2,100	6,870.000	14,427,000
日新	6,400	1,509.000	9,657,600
三菱倉庫	22,900	2,971.000	68,035,900
三井倉庫ホールディングス	7,600	2,360.000	17,936,000
住友倉庫	24,900	2,163.000	53,858,700
澁澤倉庫	4,900	2,220.000	10,878,000
東陽倉庫	21,100	310.000	6,541,000
日本トランスシティ	17,000	560.000	9,520,000
川西倉庫	3,800	1,109.000	4,214,200
安田倉庫	8,500	965.000	8,202,500
東洋埠頭	5,400	1,479.000	7,986,600
上組	39,200	2,125.000	83,300,000
近鉄エクスプレス	13,500	3,030.000	40,905,000
エーアイテイー	5,500	1,474.000	8,107,000
内外トランスライン	3,500	1,792.000	6,272,000
日本コンセプト	3,600	1,390.000	5,004,000
N E C ネットスアイ	24,400	1,662.000	40,552,800
クロスキャット	5,400	1,017.000	5,491,800
システナ	105,700	415.000	43,865,500
デジタルアーツ	4,100	7,540.000	30,914,000
日鉄ソリューションズ	10,700	3,825.000	40,927,500
コア	4,100	1,569.000	6,432,900
手間いらず	1,300	4,600.000	5,980,000
ラクーンホールディングス	7,300	1,161.000	8,475,300
ソリトンシステムズ	4,900	1,564.000	7,663,600
ソフトクリエイティブホールディングス	3,500	4,595.000	16,082,500
T I S	71,600	2,827.000	202,413,200
グリー	34,900	1,223.000	42,682,700
コーエーテクモホールディングス	24,100	4,210.000	101,461,000
三菱総合研究所	3,100	3,890.000	12,059,000
ファインデックス	8,000	703.000	5,624,000
ブレインパッド	7,100	1,309.000	9,293,900
K L a b	16,500	465.000	7,672,500
ポルトゥウィン・ピットクルーホールディングス	11,800	1,041.000	12,283,800
ネクソン	169,900	3,040.000	516,496,000
エムアップホールディングス	9,400	1,051.000	9,879,400
エイチーム	7,100	773.000	5,488,300
エニグモ	9,500	587.000	5,576,500
コロプラ	25,300	660.000	16,698,000
ブロードリーフ	38,900	379.000	14,743,100

デジタルハーツホールディングス	4,200	1,711.000	7,186,200
システム情報	6,700	927.000	6,210,900
メディアドゥ	3,000	2,214.000	6,642,000
じげん	26,100	303.000	7,908,300
ブイキューブ	8,800	1,043.000	9,178,400
フィックスターズ	10,400	882.000	9,172,800
CARTA HOLDINGS	3,700	2,508.000	9,279,600
オプティム	6,700	1,055.000	7,068,500
セレス	3,300	1,531.000	5,052,300
SHIFT	3,800	26,150.000	99,370,000
ティーガイア	7,000	1,608.000	11,256,000
テクマトリックス	13,000	2,102.000	27,326,000
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	19,800	2,590.000	51,282,000
GMOペイメントゲートウェイ	14,600	11,400.000	166,440,000
システムリサーチ	3,100	1,876.000	5,815,600
インターネットイニシアティブ	20,200	4,360.000	88,072,000
さくらインターネット	11,000	553.000	6,083,000
GMOグローバルサイン・ホールディングス	1,900	6,380.000	12,122,000
SRAホールディングス	4,200	2,769.000	11,629,800
eBASE	11,200	512.000	5,734,400
アバント	8,700	1,251.000	10,883,700
アドソル日進	3,800	1,570.000	5,966,000
フリービット	5,700	866.000	4,936,200
コムチュア	8,400	2,946.000	24,746,400
アステリア	6,500	1,063.000	6,909,500
アイル	4,600	1,442.000	6,633,200
マークライnz	4,300	2,735.000	11,760,500
メディカル・データ・ビジョン	10,500	1,211.000	12,715,500
gumi	12,200	604.000	7,368,800
テラスカイ	3,500	1,584.000	5,544,000
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	4,400	1,240.000	5,456,000
PCIホールディングス	4,900	1,024.000	5,017,600
パイプドHD	1,900	2,319.000	4,406,100
PR TIMES	1,800	3,335.000	6,003,000
ラクス	26,200	1,847.000	48,391,400
ダブルスタンダード	2,700	1,993.000	5,381,100
オープンドア	5,100	2,010.000	10,251,000
アカツキ	3,600	3,170.000	11,412,000
UBICOMホールディングス	2,500	2,839.000	7,097,500
カナミックネットワーク	12,100	536.000	6,485,600
チェンジ	13,900	1,984.000	27,577,600
オークネット	5,000	1,636.000	8,180,000
マクロミル	17,200	1,147.000	19,728,400
オロ	2,800	2,115.000	5,922,000
ユーザーローカル	3,400	1,780.000	6,052,000

マネーフォワード	11,500	5,840.000	67,160,000
電算システムホールディングス	3,300	2,624.000	8,659,200
プロトコーポレーション	8,800	1,031.000	9,072,800
野村総合研究所	145,200	4,130.000	599,676,000
日本システム技術	2,000	2,614.000	5,228,000
インテージホールディングス	9,200	1,622.000	14,922,400
ソースネクスト	39,100	168.000	6,568,800
インフォコム	8,400	2,140.000	17,976,000
シンプレクス・ホールディングス	8,800	2,046.000	18,004,800
HEROZ	2,600	1,052.000	2,735,200
ラクスル	8,500	3,060.000	26,010,000
I P S	2,700	2,153.000	5,813,100
イーソル	6,700	626.000	4,194,200
アルテリア・ネットワークス	10,100	1,315.000	13,281,500
ウイングアーク1st	5,200	1,430.000	7,436,000
サーバーワークス	1,600	2,802.000	4,483,200
Sansan	27,200	1,505.000	40,936,000
ギフティ	7,900	1,287.000	10,167,300
ベース	1,600	6,100.000	9,760,000
JMDC	7,100	6,930.000	49,203,000
フォーカスシステムズ	6,800	901.000	6,126,800
クレスコ	6,100	1,929.000	11,766,900
フジ・メディア・ホールディングス	71,700	1,123.000	80,519,100
オービック	23,700	18,390.000	435,843,000
ジャストシステム	10,700	5,490.000	58,743,000
TDCソフト	7,800	1,135.000	8,853,000
Zホールディングス	1,082,700	513.800	556,291,260
トレンドマイクロ	40,200	7,160.000	287,832,000
日本オラクル	12,200	8,400.000	102,480,000
アルファシステムズ	2,300	3,640.000	8,372,000
フューチャー	15,700	1,690.000	26,533,000
CAC HOLDINGS	5,400	1,364.000	7,365,600
S Bテクノロジー	3,700	2,508.000	9,279,600
オービックビジネスコンサルタント	7,100	4,085.000	29,003,500
伊藤忠テクノソリューションズ	34,200	3,085.000	105,507,000
アイティフォー	10,900	783.000	8,534,700
東計電算	1,200	5,340.000	6,408,000
大塚商会	40,700	4,175.000	169,922,500
サイボウズ	10,700	1,349.000	14,434,300
電通国際情報サービス	10,700	3,860.000	41,302,000
ACCESS	11,400	574.000	6,543,600
デジタルガレージ	12,400	4,410.000	54,684,000
イーエムシステムズ	14,800	849.000	12,565,200
ウェザーニューズ	2,600	7,970.000	20,722,000
C I J	8,760	766.000	6,710,160
WOWOW	4,200	1,583.000	6,648,600
スカラ	9,600	750.000	7,200,000
IMAGICA GROUP	8,000	749.000	5,992,000

ネットワークシステムズ	28,800	3,130.000	90,144,000
アルゴグラフィックス	6,000	3,000.000	18,000,000
マーベラス	14,300	777.000	11,111,100
エイベックス	13,500	1,385.000	18,697,500
B I P R O G Y	23,600	3,195.000	75,402,000
兼松エレクトロニクス	4,100	3,770.000	15,457,000
都築電気	4,500	1,477.000	6,646,500
T B Sホールディングス	45,900	1,715.000	78,718,500
日本テレビホールディングス	63,100	1,237.000	78,054,700
朝日放送グループホールディングス	9,800	726.000	7,114,800
テレビ朝日ホールディングス	18,200	1,471.000	26,772,200
スカパーJ S A Tホールディングス	63,100	414.000	26,123,400
テレビ東京ホールディングス	5,900	1,992.000	11,752,800
ビジョン	13,600	1,179.000	16,034,400
U S E N - N E X T H O L D I N G S	7,300	2,309.000	16,855,700
コネクシオ	6,000	1,378.000	8,268,000
日本通信	68,900	192.000	13,228,800
日本電信電話	786,800	3,740.000	2,942,632,000
K D D I	548,400	4,175.000	2,289,570,000
ソフトバンク	1,138,800	1,465.000	1,668,342,000
光通信	8,700	14,740.000	128,238,000
エムティーアイ	10,700	491.000	5,253,700
G M Oインターネット	26,800	2,538.000	68,018,400
ファイバーゲート	4,600	1,270.000	5,842,000
K A D O K A W A	41,000	3,160.000	129,560,000
学研ホールディングス	11,100	929.000	10,311,900
ゼンリン	13,600	962.000	13,083,200
アイネット	5,700	1,235.000	7,039,500
松竹	5,100	11,990.000	61,149,000
東宝	44,400	4,770.000	211,788,000
東映	2,500	17,380.000	43,450,000
エヌ・ティ・ティ・データ	199,500	2,407.000	480,196,500
ピー・シー・エー	5,100	1,526.000	7,782,600
ビジネスブレイン太田昭和	3,400	1,362.000	4,630,800
D T S	13,600	2,696.000	36,665,600
スクウェア・エニックス・ホールディングス	35,100	5,390.000	189,189,000
シーイーシー	9,000	1,208.000	10,872,000
カプコン	71,000	3,090.000	219,390,000
アイ・エス・ビー	4,700	1,102.000	5,179,400
ジャステック	5,900	1,073.000	6,330,700
S C S K	51,800	2,095.000	108,521,000
日本システムウエア	3,300	2,186.000	7,213,800
アイネス	7,800	1,516.000	11,824,800
T K C	12,400	3,225.000	39,990,000
富士ソフト	7,900	6,850.000	54,115,000
N S D	23,500	2,263.000	53,180,500
コナミホールディングス	27,300	8,260.000	225,498,000

福井コンピュータホールディングス	3,900	3,150.000	12,285,000
J B C Cホールディングス	5,900	1,489.000	8,785,100
ミロク情報サービス	7,900	1,326.000	10,475,400
ソフトバンクグループ	451,000	5,592.000	2,521,992,000
高千穂交易	3,900	1,488.000	5,803,200
伊藤忠食品	2,100	4,945.000	10,384,500
エレマテック	7,200	1,031.000	7,423,200
あらた	6,000	3,330.000	19,980,000
トーマンデバイス	1,200	6,010.000	7,212,000
東京エレクトロン デバイス	2,300	4,885.000	11,235,500
フィールズ	8,000	825.000	6,600,000
双日	83,100	1,945.000	161,629,500
アルフレッサ ホールディングス	84,100	1,714.000	144,147,400
横浜冷凍	22,900	859.000	19,671,100
アルコニックス	10,000	1,387.000	13,870,000
神戸物産	58,700	3,785.000	222,179,500
あい ホールディングス	11,000	1,664.000	18,304,000
ダイワボウホールディングス	36,900	1,598.000	58,966,200
マクニカ・富士エレホールディングス	17,700	2,627.000	46,497,900
ラクト・ジャパン	3,200	2,041.000	6,531,200
グリムス	3,700	1,862.000	6,889,400
バイタルケーエスケー・ホールディングス	15,500	733.000	11,361,500
八洲電機	8,400	919.000	7,719,600
レスターホールディングス	7,100	1,960.000	13,916,000
ジュテックホールディングス	3,000	1,166.000	3,498,000
T O K A Iホールディングス	35,900	863.000	30,981,700
三洋貿易	8,900	966.000	8,597,400
ビューティガレージ	1,600	2,811.000	4,497,600
ウイン・パートナーズ	6,000	984.000	5,904,000
シップヘルスケアホールディングス	24,700	2,080.000	51,376,000
コメダホールディングス	17,200	2,018.000	34,709,600
フルサト・マルカホールディングス	7,500	3,100.000	23,250,000
ヤマエグループホールディングス	6,200	1,012.000	6,274,400
小野建	7,700	1,522.000	11,719,400
佐島電機	6,400	952.000	6,092,800
伯東	4,800	2,304.000	11,059,200
コンドーテック	7,600	1,060.000	8,056,000
ナガイレーベン	10,500	1,959.000	20,569,500
三菱食品	7,000	3,025.000	21,175,000
松田産業	5,800	2,360.000	13,688,000
第一興商	14,800	3,335.000	49,358,000
メディパルホールディングス	81,300	2,065.000	167,884,500
S P K	5,300	1,313.000	6,958,900
萩原電気ホールディングス	3,700	1,941.000	7,181,700
アズワン	11,000	6,970.000	76,670,000
尾家産業	5,000	931.000	4,655,000
シモジマ	6,500	899.000	5,843,500

ドウシシャ	7,600	1,478.000	11,232,800
高速	5,500	1,494.000	8,217,000
丸文	8,900	666.000	5,927,400
ハピネット	7,100	1,485.000	10,543,500
日本ライフライン	22,900	1,098.000	25,144,200
タカショー	8,400	677.000	5,686,800
I D O M	23,800	742.000	17,659,600
進和	5,200	1,964.000	10,212,800
ダイトロン	3,800	1,834.000	6,969,200
シークス	11,400	990.000	11,286,000
オーハシテクニカ	5,600	1,269.000	7,106,400
白銅	2,900	2,419.000	7,015,100
伊藤忠商事	527,800	3,987.000	2,104,338,600
丸紅	743,800	1,407.500	1,046,898,500
長瀬産業	41,300	1,803.000	74,463,900
蝶理	4,800	1,773.000	8,510,400
豊田通商	75,500	4,665.000	352,207,500
三共生興	14,300	499.000	7,135,700
兼松	26,900	1,307.000	35,158,300
三井物産	586,000	3,166.000	1,855,276,000
日本紙パルプ商事	4,000	3,765.000	15,060,000
カメイ	9,500	1,008.000	9,576,000
スターゼン	6,000	1,919.000	11,514,000
山善	30,800	928.000	28,582,400
椿本興業	1,900	3,585.000	6,811,500
住友商事	475,900	2,046.000	973,691,400
内田洋行	3,400	4,605.000	15,657,000
三菱商事	565,500	4,292.000	2,427,126,000
第一実業	3,600	3,805.000	13,698,000
キャノンマーケティングジャパン	19,100	2,535.000	48,418,500
西華産業	5,200	1,597.000	8,304,400
佐藤商事	7,100	1,109.000	7,873,900
菱洋エレクトロ	5,200	1,967.000	10,228,400
東京産業	8,500	705.000	5,992,500
ユアサ商事	6,900	2,839.000	19,589,100
神鋼商事	2,000	3,345.000	6,690,000
阪和興業	14,800	3,100.000	45,880,000
正栄食品工業	4,900	3,885.000	19,036,500
カナデン	8,100	997.000	8,075,700
菱電商事	6,800	1,636.000	11,124,800
岩谷産業	18,200	5,050.000	91,910,000
ナイス	3,100	1,829.000	5,669,900
極東貿易	2,700	2,119.000	5,721,300
アステナホールディングス	13,500	418.000	5,643,000
三愛オブリ	18,900	953.000	18,011,700
稲畑産業	16,300	2,058.000	33,545,400
G S Iクレオス	4,700	1,136.000	5,339,200
明和産業	7,500	885.000	6,637,500

ワキタ	17,000	1,035.000	17,595,000
東邦ホールディングス	25,100	2,000.000	50,200,000
サンゲツ	20,200	1,491.000	30,118,200
ミツウロコグループホールディングス	11,800	1,027.000	12,118,600
シナネンホールディングス	3,200	3,240.000	10,368,000
伊藤忠エネクス	15,800	1,043.000	16,479,400
サンリオ	23,100	2,653.000	61,284,300
サンワテクノス	5,400	1,248.000	6,739,200
リョーサン	8,600	2,158.000	18,558,800
新光商事	13,300	920.000	12,236,000
トーホー	5,400	1,092.000	5,896,800
三信電気	4,900	1,510.000	7,399,000
東陽テクニカ	9,100	1,022.000	9,300,200
モスフードサービス	9,900	2,874.000	28,452,600
加賀電子	6,800	3,005.000	20,434,000
ソーダニッカ	9,900	674.000	6,672,600
立花エレテック	6,500	1,595.000	10,367,500
PALTAC	10,700	4,365.000	46,705,500
太平洋興発	7,300	621.000	4,533,300
西本Wismettacホールディングス	2,200	2,755.000	6,061,000
国際紙パルプ商事	19,400	294.000	5,703,600
ヤマタネ	5,200	1,615.000	8,398,000
日鉄物産	5,100	5,270.000	26,877,000
泉州電業	2,200	5,010.000	11,022,000
トラスコ中山	15,500	2,189.000	33,929,500
オートバックスセブン	26,300	1,325.000	34,847,500
モリト	7,800	743.000	5,795,400
加藤産業	10,600	3,120.000	33,072,000
イノテック	5,500	1,320.000	7,260,000
イエローハット	12,900	1,581.000	20,394,900
J Kホールディングス	6,800	1,152.000	7,833,600
日伝	6,500	2,119.000	13,773,500
杉本商事	4,200	2,026.000	8,509,200
因幡電機産業	19,400	2,515.000	48,791,000
東テク	3,100	2,134.000	6,615,400
ミスミグループ本社	94,600	3,315.000	313,599,000
タキヒヨー	4,400	1,114.000	4,901,600
スズケン	29,700	3,795.000	112,711,500
ジェコス	7,500	784.000	5,880,000
ローソン	16,900	4,895.000	82,725,500
サンエー	5,500	4,160.000	22,880,000
カワチ薬品	5,900	2,170.000	12,803,000
エービーシー・マート	11,800	4,850.000	57,230,000
アスクル	17,200	1,581.000	27,193,200
ゲオホールディングス	10,300	1,272.000	13,101,600
アダストリア	8,200	1,987.000	16,293,400
くら寿司	8,000	3,345.000	26,760,000

キャンドウ	3,900	2,301.000	8,973,900
パルグループホールディングス	7,400	1,476.000	10,922,400
エディオン	33,300	1,103.000	36,729,900
サーラコーポレーション	17,100	625.000	10,687,500
ハローズ	3,700	3,025.000	11,192,500
フジオフードグループ本社	7,900	1,288.000	10,175,200
あみやき亭	2,800	2,880.000	8,064,000
大黒天物産	2,500	5,140.000	12,850,000
ハニーズホールディングス	7,700	1,081.000	8,323,700
アルペン	6,000	1,963.000	11,778,000
クオールホールディングス	10,000	1,118.000	11,180,000
ジンスホールディングス	5,300	4,685.000	24,830,500
ビックカメラ	43,800	1,108.000	48,530,400
D C Mホールディングス	45,900	1,027.000	47,139,300
Monotaro	95,500	2,522.000	240,851,000
アークランドサービスホールディングス	6,100	2,190.000	13,359,000
J.フロント リテイリング	90,700	943.000	85,530,100
ドトール・日レスホールディングス	12,700	1,422.000	18,059,400
マツキヨココカラ&カンパニー	46,400	4,335.000	201,144,000
ブロンコビリー	5,200	2,252.000	11,710,400
Z O Z O	52,200	3,120.000	162,864,000
物語コーポレーション	3,800	5,600.000	21,280,000
三越伊勢丹ホールディングス	132,100	957.000	126,419,700
Hamee	3,900	1,223.000	4,769,700
ウエルシアホールディングス	40,100	2,746.000	110,114,600
クリエイトSDホールディングス	10,800	3,070.000	33,156,000
チムニー	5,100	1,109.000	5,655,900
シュッピン	7,200	1,295.000	9,324,000
オイシックス・ラ・大地	10,900	2,950.000	32,155,000
ネクステージ	15,300	2,170.000	33,201,000
ジョイフル本田	22,400	1,579.000	35,369,600
鳥貴族ホールディングス	3,700	1,820.000	6,734,000
ホットランド	7,800	1,314.000	10,249,200
すかいらーくホールディングス	97,800	1,507.000	147,384,600
S F Pホールディングス	5,500	1,335.000	7,342,500
綿半ホールディングス	7,000	1,310.000	9,170,000
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	20,600	1,129.000	23,257,400
ゴルフダイジェスト・オンライン	5,300	1,108.000	5,872,400
B E E N O S	4,400	2,084.000	9,169,600
あさひ	6,400	1,360.000	8,704,000
日本調剤	5,500	1,266.000	6,963,000
コスモス薬品	7,600	13,020.000	98,952,000
セブン&アイ・ホールディングス	295,500	5,645.000	1,668,097,500
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	40,700	728.000	29,629,600
ツルハホールディングス	16,500	6,870.000	113,355,000
サンマルクホールディングス	8,000	1,473.000	11,784,000

トリドールホールディングス	18,800	2,422.000	45,533,600
TOKYO BASE	9,200	398.000	3,661,600
JMホールディングス	5,900	1,746.000	10,301,400
アレンザホールディングス	6,600	970.000	6,402,000
串カツ田中ホールディングス	2,600	1,809.000	4,703,400
パロックジャパンリミテッド	7,700	764.000	5,882,800
クスリのアオキホールディングス	7,600	6,450.000	49,020,000
FOOD & LIFE COMPANIES	44,200	3,120.000	137,904,000
メディカルシステムネットワーク	9,000	539.000	4,851,000
ノジマ	12,000	2,503.000	30,036,000
カップ・クリエイト	11,800	1,316.000	15,528,800
良品計画	86,800	1,212.000	105,201,600
アドヴァングループ	9,900	786.000	7,781,400
アルビス	3,400	2,253.000	7,660,200
G-7ホールディングス	8,900	1,690.000	15,041,000
イオン北海道	13,500	1,006.000	13,581,000
コジマ	14,000	606.000	8,484,000
コーナン商事	10,700	3,680.000	39,376,000
エコス	3,300	1,834.000	6,052,200
ワタミ	10,800	903.000	9,752,400
パン・パシフィック・インターナショナルホールディングス	151,100	1,934.000	292,227,400
西松屋チェーン	16,400	1,553.000	25,469,200
ゼンショーホールディングス	36,900	2,908.000	107,305,200
幸楽苑ホールディングス	6,800	1,221.000	8,302,800
サイゼリヤ	11,500	2,325.000	26,737,500
VTホールディングス	28,400	487.000	13,830,800
フジ・コーポレーション	5,600	1,179.000	6,602,400
ユナイテッドアローズ	8,300	1,817.000	15,081,100
ハイデイ日高	10,700	1,818.000	19,452,600
コロワイド	31,400	1,639.000	51,464,600
壱番屋	5,300	4,640.000	24,592,000
スギホールディングス	15,200	5,780.000	87,856,000
薬王堂ホールディングス	4,000	1,995.000	7,980,000
スクロール	12,300	798.000	9,815,400
ヨンドシーホールディングス	7,700	1,627.000	12,527,900
木曽路	10,700	2,009.000	21,496,300
SRSホールディングス	14,900	779.000	11,607,100
千趣会	17,900	381.000	6,819,900
リテールパートナーズ	9,800	1,390.000	13,622,000
ケーヨー	15,800	872.000	13,777,600
上新電機	8,200	1,912.000	15,678,400
日本瓦斯	36,900	1,590.000	58,671,000
ロイヤルホールディングス	13,300	2,033.000	27,038,900
いなげや	9,700	1,353.000	13,124,100
チヨダ	12,200	736.000	8,979,200
ライフコーポレーション	7,000	3,185.000	22,295,000

リンガーハット	10,000	2,248.000	22,480,000
MrMaxHD	12,200	557.000	6,795,400
AOKIホールディングス	16,300	577.000	9,405,100
オークワ	12,900	872.000	11,248,800
コメリ	11,400	2,613.000	29,788,200
青山商事	17,700	657.000	11,628,900
しまむら	8,800	11,570.000	101,816,000
高島屋	55,900	1,165.000	65,123,500
松屋	17,000	778.000	13,226,000
エイチ・ツー・オー リテイリング	34,800	859.000	29,893,200
近鉄百貨店	3,500	2,495.000	8,732,500
丸井グループ	59,600	2,195.000	130,822,000
アクシアル リテイリング	5,900	3,365.000	19,853,500
イオン	290,700	2,512.000	730,238,400
イズミ	13,900	2,709.000	37,655,100
平和堂	13,400	1,915.000	25,661,000
フジ	20,600	2,038.000	41,982,800
ヤオコー	8,700	7,010.000	60,987,000
ゼビオホールディングス	11,400	919.000	10,476,600
ケーズホールディングス	69,400	1,253.000	86,958,200
日産東京販売ホールディングス	22,300	220.000	4,906,000
Genky DrugStores	3,400	3,960.000	13,464,000
ブックオフグループホールディングス	5,600	981.000	5,493,600
ギフトホールディングス	1,800	2,440.000	4,392,000
アインホールディングス	10,200	5,930.000	60,486,000
元気寿司	2,900	2,445.000	7,090,500
ヤマダホールディングス	274,900	376.000	103,362,400
アークランドサカモト	12,000	1,585.000	19,020,000
ニトリホールディングス	29,900	14,375.000	429,812,500
グルメ杵屋	10,800	1,002.000	10,821,600
吉野家ホールディングス	26,500	2,270.000	60,155,000
松屋フーズホールディングス	3,800	3,685.000	14,003,000
サガミホールディングス	13,900	1,112.000	15,456,800
関西フードマーケット	6,300	1,304.000	8,215,200
王将フードサービス	4,900	5,930.000	29,057,000
プレナス	8,700	2,010.000	17,487,000
ミニストップ	7,000	1,368.000	9,576,000
アークス	13,900	2,175.000	30,232,500
バローホールディングス	16,200	2,114.000	34,246,800
ベルク	3,400	5,430.000	18,462,000
ファーストリテイリング	10,100	58,300.000	588,830,000
サンドラッグ	28,600	3,060.000	87,516,000
ベルーナ	17,100	717.000	12,260,700
めぶきフィナンシャルグループ	390,200	251.000	97,940,200
東京きらぼしフィナンシャルグループ	9,800	1,720.000	16,856,000
九州フィナンシャルグループ	150,200	390.000	58,578,000
ゆうちょ銀行	178,300	964.000	171,881,200
富山第一銀行	9,800	311.000	3,047,800

コンコルディア・フィナンシャルグループ	429,200	464.000	199,148,800
西日本フィナンシャルホールディングス	49,600	747.000	37,051,200
三十三フィナンシャルグループ	7,700	1,429.000	11,003,300
第四北越フィナンシャルグループ	12,400	2,503.000	31,037,200
ひろぎんホールディングス	111,700	638.000	71,264,600
おきなわフィナンシャルグループ	7,000	2,144.000	15,008,000
十六フィナンシャルグループ	10,500	2,151.000	22,585,500
北國フィナンシャルホールディングス	7,400	3,370.000	24,938,000
プロクレアホールディングス	7,670	1,776.000	13,621,920
新生銀行	49,400	2,329.000	115,052,600
あおぞら銀行	41,500	2,549.000	105,783,500
三菱UFJフィナンシャル・グループ	4,741,100	746.700	3,540,179,370
りそなホールディングス	857,600	543.300	465,934,080
三井住友トラスト・ホールディングス	142,800	3,878.000	553,778,400
三井住友フィナンシャルグループ	523,400	3,900.000	2,041,260,000
千葉銀行	251,700	760.000	191,292,000
群馬銀行	140,200	361.000	50,612,200
武蔵野銀行	11,600	1,767.000	20,497,200
筑波銀行	26,300	194.000	5,102,200
七十七銀行	23,700	1,514.000	35,881,800
秋田銀行	4,300	1,638.000	7,043,400
山形銀行	10,600	841.000	8,914,600
岩手銀行	6,000	1,895.000	11,370,000
東邦銀行	73,100	204.000	14,912,400
東北銀行	2,000	1,000.000	2,000,000
ふくおかフィナンシャルグループ	63,300	2,367.000	149,831,100
静岡銀行	183,800	848.000	155,862,400
スルガ銀行	67,500	421.000	28,417,500
八十二銀行	168,500	416.000	70,096,000
山梨中央銀行	10,800	947.000	10,227,600
大垣共立銀行	15,100	1,899.000	28,674,900
福井銀行	8,000	1,357.000	10,856,000
清水銀行	4,400	1,533.000	6,745,200
富山銀行	2,400	1,990.000	4,776,000
滋賀銀行	14,300	2,372.000	33,919,600
南都銀行	12,200	1,999.000	24,387,800
百五銀行	73,900	338.000	24,978,200
京都銀行	27,000	5,250.000	141,750,000
紀陽銀行	25,800	1,385.000	35,733,000
ほくほくフィナンシャルグループ	47,600	863.000	41,078,800
山陰合同銀行	45,900	630.000	28,917,000
中国銀行	59,800	917.000	54,836,600
伊予銀行	99,300	604.000	59,977,200
百十四銀行	9,200	1,627.000	14,968,400
四国銀行	13,400	727.000	9,741,800
阿波銀行	11,800	2,155.000	25,429,000
大分銀行	5,500	1,839.000	10,114,500

宮崎銀行	5,400	2,048.000	11,059,200
佐賀銀行	4,500	1,422.000	6,399,000
琉球銀行	18,200	800.000	14,560,000
セブン銀行	224,400	238.000	53,407,200
みずほフィナンシャルグループ	967,400	1,560.500	1,509,627,700
山口フィナンシャルグループ	88,700	700.000	62,090,000
名古屋銀行	5,800	2,841.000	16,477,800
北洋銀行	115,700	239.000	27,652,300
愛知銀行	2,900	4,590.000	13,311,000
中京銀行	4,000	1,578.000	6,312,000
愛媛銀行	13,100	879.000	11,514,900
京葉銀行	33,500	492.000	16,482,000
栃木銀行	43,200	228.000	9,849,600
東和銀行	17,400	525.000	9,135,000
トモニホールディングス	60,300	319.000	19,235,700
フィデアホールディングス	8,500	1,282.000	10,897,000
池田泉州ホールディングス	94,200	171.000	16,108,200
F P G	27,600	837.000	23,101,200
ジャパンインベストメントアドバイザー	6,900	1,181.000	8,148,900
S B Iホールディングス	92,700	2,901.000	268,922,700
ジャフコ グループ	29,300	1,796.000	52,622,800
大和証券グループ本社	566,100	641.000	362,870,100
野村ホールディングス	1,153,500	498.100	574,558,350
岡三証券グループ	62,200	363.000	22,578,600
丸三証券	22,100	487.000	10,762,700
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	85,100	397.000	33,784,700
水戸証券	26,100	267.000	6,968,700
いちよし証券	17,300	600.000	10,380,000
松井証券	37,500	836.000	31,350,000
マネックスグループ	62,000	634.000	39,308,000
極東証券	10,300	717.000	7,385,100
岩井コスモホールディングス	8,300	1,324.000	10,989,200
アイザワ証券グループ	14,200	692.000	9,826,400
スパークス・グループ	41,100	265.000	10,891,500
かんぽ生命保険	76,300	2,136.000	162,976,800
S O M P Oホールディングス	123,900	5,108.000	632,881,200
アニコム ホールディングス	26,500	620.000	16,430,000
M S & A Dインシュアランスグループ	169,100	3,771.000	637,676,100
ホールディングス			
第一生命ホールディングス	371,800	2,525.500	938,980,900
東京海上ホールディングス	249,000	6,736.000	1,677,264,000
T & Dホールディングス	195,800	1,630.000	319,154,000
アドバンスクリエイト	5,500	911.000	5,010,500
全国保証	18,200	4,685.000	85,267,000
ジェイリース	2,900	1,629.000	4,724,100
日本モーゲージサービス	4,100	954.000	3,911,400
アルヒ	12,400	1,020.000	12,648,000

プレミアグループ	4,200	3,990.000	16,758,000
ネットプロテクションズホールディングス	18,200	895.000	16,289,000
クレディセゾン	48,200	1,311.000	63,190,200
芙蓉総合リース	7,800	7,020.000	54,756,000
みずほリース	11,700	3,045.000	35,626,500
東京センチュリー	14,500	4,105.000	59,522,500
日本証券金融	31,600	949.000	29,988,400
アイフル	129,000	366.000	47,214,000
リコーリース	7,100	3,340.000	23,714,000
イオンフィナンシャルサービス	40,500	1,163.000	47,101,500
アコム	151,100	326.000	49,258,600
ジャックス	8,600	3,070.000	26,402,000
オリエントコーポレーション	208,600	124.000	25,866,400
オリックス	449,500	2,298.500	1,033,175,750
三菱HCキャピタル	277,000	572.000	158,444,000
日本取引所グループ	188,700	2,225.500	419,951,850
イー・ギャランティ	11,300	2,165.000	24,464,500
NECキャピタルソリューション	4,000	2,065.000	8,260,000
いちご	89,600	307.000	27,507,200
日本駐車場開発	101,600	149.000	15,138,400
スター・マイカ・ホールディングス	6,800	1,694.000	11,519,200
SREホールディングス	2,600	3,590.000	9,334,000
ヒューリック	180,900	1,090.000	197,181,000
三栄建築設計	4,300	1,629.000	7,004,700
野村不動産ホールディングス	39,000	2,964.000	115,596,000
三重交通グループホールディングス	20,700	446.000	9,232,200
サムティ	10,100	2,079.000	20,997,900
ディア・ライフ	13,800	519.000	7,162,200
地主	6,500	1,927.000	12,525,500
プレサンスコーポレーション	11,200	1,728.000	19,353,600
日本管理センター	6,700	998.000	6,686,600
フージャースホールディングス	13,300	648.000	8,618,400
オープンハウスグループ	24,000	5,390.000	129,360,000
東急不動産ホールディングス	223,200	673.000	150,213,600
飯田グループホールディングス	63,000	2,069.000	130,347,000
And Doホールディングス	5,700	941.000	5,363,700
シーアールイー	4,100	1,637.000	6,711,700
ケイアイスター不動産	3,900	5,630.000	21,957,000
グッドコムアセット	5,500	1,083.000	5,956,500
ジェイ・エス・ビー	2,100	3,450.000	7,245,000
パーク24	41,000	1,746.000	71,586,000
パラカ	4,400	1,727.000	7,598,800
宮越ホールディングス	4,500	877.000	3,946,500
三井不動産	344,400	2,708.000	932,635,200
三菱地所	497,700	1,840.000	915,768,000
平和不動産	13,500	4,130.000	55,755,000
東京建物	74,800	1,816.000	135,836,800

京阪神ビルディング	13,200	1,414.000	18,664,800
住友不動産	159,000	3,456.000	549,504,000
テーオーシー	16,900	651.000	11,001,900
東京楽天地	1,600	4,020.000	6,432,000
スターツコーポレーション	11,200	2,372.000	26,566,400
フジ住宅	12,900	603.000	7,778,700
空港施設	13,200	529.000	6,982,800
ゴールドクレスト	7,700	1,642.000	12,643,400
日神グループホールディングス	17,300	452.000	7,819,600
日本エスコン	16,100	820.000	13,202,000
タカラレーベン	41,800	297.000	12,414,600
A V A N T I A	7,900	844.000	6,667,600
イオンモール	38,400	1,528.000	58,675,200
カチタス	19,500	3,370.000	65,715,000
トーセイ	12,200	1,115.000	13,603,000
サンフロンティア不動産	12,800	1,048.000	13,414,400
F Jネクストホールディングス	9,500	985.000	9,357,500
日本空港ビルデング	29,000	5,440.000	157,760,000
日本工営	4,900	2,912.000	14,268,800
L I F U L L	30,100	239.000	7,193,900
ミクシィ	17,000	2,228.000	37,876,000
ジェイエイシーリクルートメント	6,600	1,888.000	12,460,800
日本M & Aセンターホールディングス	120,700	1,715.000	207,000,500
メンバーズ	2,600	3,260.000	8,476,000
UTグループ	10,600	2,973.000	31,513,800
アイティメディア	4,300	1,721.000	7,400,300
E・Jホールディングス	5,200	1,181.000	6,141,200
夢真ビーネックスグループ	23,900	1,684.000	40,247,600
コシダカホールディングス	20,500	680.000	13,940,000
パソナグループ	7,900	2,392.000	18,896,800
リンクアンドモチベーション	18,800	513.000	9,644,400
エス・エム・エス	25,200	3,420.000	86,184,000
パーソルホールディングス	73,200	2,695.000	197,274,000
リニカル	7,000	818.000	5,726,000
クックパッド	30,300	286.000	8,665,800
スタジオアリス	4,200	2,318.000	9,735,600
シミックホールディングス	5,400	1,546.000	8,348,400
総合警備保障	29,300	3,600.000	105,480,000
カカクコム	54,100	2,638.000	142,715,800
アイロムグループ	3,500	2,074.000	7,259,000
ルネサンス	6,700	924.000	6,190,800
ディップ	12,900	3,490.000	45,021,000
デジタルホールディングス	5,700	1,445.000	8,236,500
新日本科学	9,700	1,591.000	15,432,700
ベネフィット・ワン	26,900	2,451.000	65,931,900
エムスリー	129,300	4,764.000	615,985,200
アウトソーシング	42,300	1,245.000	52,663,500
ウェルネット	15,500	499.000	7,734,500

ワールドホールディングス	3,300	2,453.000	8,094,900
ディー・エヌ・エー	28,500	1,955.000	55,717,500
博報堂D Yホールディングス	102,000	1,484.000	151,368,000
ぐるなび	16,300	417.000	6,797,100
タカミヤ	15,600	361.000	5,631,600
ジャパンベストレスキューシステム	6,000	978.000	5,868,000
ファンコミュニケーションズ	24,200	440.000	10,648,000
ライク	3,200	1,880.000	6,016,000
エスプール	21,000	1,368.000	28,728,000
W D Bホールディングス	3,700	2,723.000	10,075,100
アドウェイズ	12,000	825.000	9,900,000
バリューコマース	5,700	3,740.000	21,318,000
インフォマート	81,600	715.000	58,344,000
J Pホールディングス	27,600	212.000	5,851,200
プレステージ・インターナショナル	28,400	664.000	18,857,600
アミューズ	4,800	1,967.000	9,441,600
ドリームインキュベータ	2,700	2,392.000	6,458,400
クイック	6,100	1,567.000	9,558,700
電通グループ	75,500	4,860.000	366,930,000
ぴあ	2,900	3,270.000	9,483,000
イオンファンタジー	3,800	2,098.000	7,972,400
シーティーエス	10,000	875.000	8,750,000
H . U . グループホールディングス	19,500	3,000.000	58,500,000
アルプス技研	7,300	1,949.000	14,227,700
日本空調サービス	10,600	793.000	8,405,800
オリエンタルランド	86,600	22,630.000	1,959,758,000
ダスキン	17,600	2,713.000	47,748,800
明光ネットワークジャパン	13,700	579.000	7,932,300
ファルコホールディングス	4,500	2,104.000	9,468,000
ラウンドワン	20,700	1,441.000	29,828,700
リゾートトラスト	34,000	2,110.000	71,740,000
ビー・エム・エル	9,400	3,215.000	30,221,000
りらいあコミュニケーションズ	11,900	1,066.000	12,685,400
リソー教育	36,500	379.000	13,833,500
ユー・エス・エス	82,300	2,033.000	167,315,900
東京個別指導学院	9,200	586.000	5,391,200
サイバーエージェント	180,900	1,494.000	270,264,600
楽天グループ	377,100	933.000	351,834,300
クリーク・アンド・リバー社	4,500	2,048.000	9,216,000
モーニングスター	16,200	594.000	9,622,800
山田コンサルティンググループ	5,000	1,254.000	6,270,000
セントラルスポーツ	3,900	2,329.000	9,083,100
フルキャストホールディングス	6,400	2,570.000	16,448,000
エン・ジャパン	11,800	3,085.000	36,403,000
テクノプロ・ホールディングス	44,000	3,210.000	141,240,000
アイ・アールジャパンホールディングス	3,600	4,660.000	16,776,000
Keep er 技研	5,100	2,752.000	14,035,200
Gunosy	5,200	1,068.000	5,553,600

イー・ガーディアン	3,400	3,235.000	10,999,000
ジャパンマテリアル	22,500	1,784.000	40,140,000
ベクトル	11,200	1,230.000	13,776,000
チャーム・ケア・コーポレーション	6,100	1,246.000	7,600,600
キャリアリンク	3,300	1,458.000	4,811,400
I B J	8,000	743.000	5,944,000
アサンテ	5,200	1,469.000	7,638,800
バリューHR	7,000	1,465.000	10,255,000
M&Aキャピタルパートナーズ	6,100	4,670.000	28,487,000
ライドオンエクスプレスホールディングス	3,900	1,210.000	4,719,000
E R Iホールディングス	2,900	1,227.000	3,558,300
シグマクシス・ホールディングス	9,600	1,188.000	11,404,800
ウィルグループ	6,100	1,136.000	6,929,600
メドピア	5,800	4,160.000	24,128,000
リクルートホールディングス	565,300	5,397.000	3,050,924,100
エラン	12,100	1,065.000	12,886,500
日本郵政	955,900	889.900	850,655,410
ベルシステム24ホールディングス	10,800	1,461.000	15,778,800
鎌倉新書	11,000	584.000	6,424,000
エアトリ	5,000	3,170.000	15,850,000
アトラエ	5,600	1,846.000	10,337,600
ストライク	3,300	4,390.000	14,487,000
ソラスト	18,400	960.000	17,664,000
インソース	7,400	2,132.000	15,776,800
ベイカレント・コンサルティング	5,200	42,600.000	221,520,000
Orchestra Holdings	1,800	2,849.000	5,128,200
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	23,300	1,676.000	39,050,800
ウェルビー	6,000	1,042.000	6,252,000
エル・ティー・エス	1,500	2,967.000	4,450,500
ミダックホールディングス	3,600	2,492.000	8,971,200
日総工産	7,300	715.000	5,219,500
キュービーネットホールディングス	4,500	1,411.000	6,349,500
RPAホールディングス	14,400	348.000	5,011,200
スプリックス	3,000	1,229.000	3,687,000
マネジメントソリューションズ	3,800	4,905.000	18,639,000
カーブスホールディングス	21,000	723.000	15,183,000
FAST FITNESS JAPAN	1,500	2,045.000	3,067,500
ダイレクトマーケティングミックス	9,400	1,701.000	15,989,400
ポピンズ	2,200	2,070.000	4,554,000
LITALICO	6,200	2,931.000	18,172,200
アドバンテッジリスクマネジメント	6,000	584.000	3,504,000
リログループ	40,600	1,831.000	74,338,600
東祥	6,400	1,680.000	10,752,000
TREホールディングス	10,300	2,360.000	24,308,000
人・夢・技術グループ	3,600	2,082.000	7,495,200
エイチ・アイ・エス	16,500	2,121.000	34,996,500

ラックランド	3,600	2,951.000	10,623,600
共立メンテナンス	13,000	4,455.000	57,915,000
イチネンホールディングス	8,500	1,243.000	10,565,500
建設技術研究所	4,900	2,176.000	10,662,400
燦ホールディングス	4,400	1,538.000	6,767,200
東京テアトル	6,100	1,227.000	7,484,700
ナガワ	2,300	9,090.000	20,907,000
東京都競馬	5,600	4,350.000	24,360,000
カナモト	12,700	1,957.000	24,853,900
西尾レントオール	6,700	2,689.000	18,016,300
トランス・コスモス	9,400	3,105.000	29,187,000
乃村工藝社	31,600	908.000	28,692,800
日本管財	7,600	2,817.000	21,409,200
トーカイ	6,900	1,706.000	11,771,400
セコム	72,200	8,851.000	639,042,200
セントラル警備保障	4,000	2,187.000	8,748,000
丹青社	16,300	777.000	12,665,100
メイテック	9,100	6,680.000	60,788,000
応用地質	8,300	1,975.000	16,392,500
船井総研ホールディングス	15,200	2,231.000	33,911,200
オオバ	8,100	732.000	5,929,200
ベネッセホールディングス	25,100	2,192.000	55,019,200
イオンディライト	9,000	2,802.000	25,218,000
ダイセキ	13,300	4,375.000	58,187,500
合 計	82,874,820		197,920,121,230

(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)

	(2021年4月13日現在)	(2022年4月13日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	271,148,043	78,454,043
コール・ローン	140,524,695	3,009,448,965
国債証券	105,477,475,540	109,049,192,830
地方債証券	8,542,550,820	9,573,035,400
特殊債券	11,582,718,565	9,360,292,837
社債券	4,045,168,000	5,074,875,400
未収利息	230,194,166	206,523,392
前払費用	3,090,887	3,702,938
流動資産合計	130,292,870,716	136,355,525,805

資産合計	130,292,870,716	136,355,525,805
負債の部		
流動負債		
未払金	52,732,500	2,783,309,300
未払解約金	3,455,246	28,069,291
未払利息	384	-
その他未払費用	5,597	1,645
流動負債合計	56,193,727	2,811,380,236
負債合計	56,193,727	2,811,380,236
純資産の部		
元本等		
元本	102,034,101,931	106,340,184,500
剰余金		
剰余金又は欠損金()	28,202,575,058	27,203,961,069
元本等合計	130,236,676,989	133,544,145,569
純資産合計	130,236,676,989	133,544,145,569
負債純資産合計	130,292,870,716	136,355,525,805

(2) 注記表

(重要な会計方針の注記)

項目	自 2021年4月14日 至 2022年4月13日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券は個別法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額(ただし、売気配相場は使用しない)、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適切ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>

(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	(2021年4月13日現在)	(2022年4月13日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	102,034,101,931口	106,340,184,500口

2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.2764円 (1万口当たりの純資産額12,764円)	1口当たり純資産額 1.2558円 (1万口当たりの純資産額12,558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 2021年4月14日 至 2022年4月13日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>

3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する会議をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用部署に是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用部署は、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。なお、投資信託協会の流動性リスク管理規制に抵触する場合には、流動性リスクを管理する会議で審議の上、流動性リスクの管理責任者が対処方針を決定します。その後、決定した対処方針やその実施等について、リスク管理会議に報告を行う体制となっております。</p> <p>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する会議にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。</p>
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。</p>

・金融商品の時価等に関する事項

項目	(2022年4月13日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	<p>金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p>
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券（国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

(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 2021年4月14日 至 2022年4月13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)

(2021年4月13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	102,757,947,265円
同期中における追加設定元本額	23,130,574,048円
同期中における一部解約元本額	23,854,419,382円
2021年4月13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)	6,094,869,774円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	10,799,784,589円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	2,409,904,423円
SMAM・グローバルバランスファンド(機動的資産配分型)	650,911,787円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2020(4資産タイプ)	43,319,205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)	200,477,835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)	430,298,494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)	542,880,234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)	237,927,219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)	394,951,809円
三井住友・DC年金バランスゼロ(債券型)	139,859,405円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	1,262,690,529円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	398,901,014円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	13,590,257円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050	32,881,227円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	1,220,630,022円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	398,613,032円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	568,525,120円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	118,550,076円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	33,192,378円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	90,202,755円
三井住友DS・年金バランス30(債券重点型)	79,038,998円
三井住友DS・年金バランス50(標準型)	126,731,002円
三井住友DS・年金バランス70(株式重点型)	35,039,983円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	4,679,578円
SMAM・年金グローバル債券ファンド<適格機関投資家限定>	1,615,752,867円
SMAM・バランスファンドVA25<適格機関投資家専用>	14,461,969,440円
SMAM・バランスファンドVA37.5<適格機関投資家専用>	6,723,802,531円

SMAM・バランスファンドVA50<適格機関投資家専用>	16,890,224,082円
SMAM・バランスファンドVL30<適格機関投資家限定>	330,039,962円
SMAM・バランスファンドVL50<適格機関投資家限定>	596,483,349円
SMAM・バランスファンドVA75<適格機関投資家専用>	264,477,800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>	120,304,219円
SMAM・インデックス・バランスVA25<適格機関投資家専用>	1,898,851,071円
SMAM・インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用>	2,189,946,035円
SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用>	2,559,318,640円
SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>	9,289,850,382円
SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定>	948,903円
三井住友・国内債券インデックスファンド・VAS(適格機関投資家専用)	1,263,341,710円
SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	469,017,209円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>	595,459,501円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>	180,178,556円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用>	43,116,807円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>	1,639,537,473円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	2,264,897,999円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A2<適格機関投資家専用>	808,518,064円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A2<適格機関投資家専用>	216,345,674円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A2<適格機関投資家専用>	18,836,644円
SMAM・アセットバランスファンドVA30L2<適格機関投資家専用>	299,035,679円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L2<適格機関投資家専用>	5,582,241,420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>	344,315,421円
SMAM・マルチアセットストラテジーファンド2016-04<適格機関投資家限定>	907,783,289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>	758,516,436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>	3,372,540,023円
合計	102,034,101,931円

(2022年4月13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	102,034,101,931円
同期中における追加設定元本額	21,659,250,973円
同期中における一部解約元本額	17,353,168,404円

2022年4月13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)	6,923,891,754円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	11,792,397,296円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	2,736,892,316円
SMAM・グローバルバランスファンド(機動的資産配分型)	839,744,278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)	44,108,804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)	187,516,541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)	486,968,806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)	750,745,280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)	365,715,230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)	518,385,905円
三井住友・DC年金バランスゼロ(債券型)	140,087,519円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	1,955,662,979円

アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	1,043,531,372円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	412,203,992円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2050	46,655,634円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	1,982,377,274円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	668,842,364円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	1,064,221,378円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	248,790,463円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	92,208,160円
三井住友・DCつみたてN I S A・世界分散ファンド	159,906,861円
三井住友D S・年金バランス30(債券重点型)	122,767,259円
三井住友D S・年金バランス50(標準型)	231,236,748円
三井住友D S・年金バランス70(株式重点型)	72,742,695円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2060	5,891,970円
S M A M・年金グローバル債券ファンド<適格機関投資家限定>	1,421,401,910円
S M A M・バランスファンドV A 2 5<適格機関投資家専用>	12,050,047,984円
S M A M・バランスファンドV A 3 7 . 5<適格機関投資家専用>	6,248,907,618円
S M A M・バランスファンドV A 5 0<適格機関投資家専用>	15,755,830,892円
S M A M・バランスファンドV L 3 0<適格機関投資家限定>	320,961,241円
S M A M・バランスファンドV L 5 0<適格機関投資家限定>	557,125,171円
S M A M・バランスファンドV A 7 5<適格機関投資家専用>	265,176,086円
S M A M・バランスファンドV L 国際分散型<適格機関投資家限定>	122,772,968円
S M A M・インデックス・バランスV A 2 5<適格機関投資家専用>	1,830,653,508円
S M A M・インデックス・バランスV A 5 0<適格機関投資家専用>	2,180,257,745円
S M A M・バランスファンドV A 4 0<適格機関投資家専用>	2,384,904,244円
S M A M・バランスファンドV A 3 5<適格機関投資家専用>	8,380,559,091円
S M A M・バランスV A 株40T<適格機関投資家限定>	972,339円
三井住友・国内債券インデックスファンド・V A S (適格機関投資家専用)	1,159,868,412円
S M A M・グローバルバランス40V A<適格機関投資家限定>	446,913,980円
S M A M・アセットバランスファンドV A 2 0 A<適格機関投資家専用>	535,210,250円
S M A M・アセットバランスファンドV A 3 5 A<適格機関投資家専用>	179,486,947円
S M A M・アセットバランスファンドV A 5 0 A<適格機関投資家専用>	44,152,419円
S M A M・アセットバランスファンドV A 2 0 L<適格機関投資家専用>	1,440,382,485円
S M A M・アセットバランスファンドV A 2 5 L<適格機関投資家専用>	2,107,627,635円
S M A M・アセットバランスファンドV A 2 0 A 2<適格機関投資家専用>	683,112,177円
S M A M・アセットバランスファンドV A 3 5 A 2<適格機関投資家専用>	205,571,184円
S M A M・アセットバランスファンドV A 5 0 A 2<適格機関投資家専用>	18,779,320円
S M A M・アセットバランスファンドV A 3 0 L 2<適格機関投資家専用>	272,432,388円
S M A M・アセットバランスファンドV A 2 5 L 2<適格機関投資家専用>	5,120,316,774円
S M A M・年金Wリスクコントロールファンド<適格機関投資家限定>	1,146,512,165円
S M A M・マルチアセットストラテジーファンド2016-04<適格機関投資家限定>	1,157,293,722円
S M A M・マルチアセットストラテジー・オープン<適格機関投資家限定>	1,481,392,104円
S M A M・マルチアセット・ダイナミックアロケーション・ストラテジー・ファンド <適格機関投資家限定>	5,928,068,863円
合 計	106,340,184,500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 3 1 2年国債	50,000,000	50,077,500	
	4 3 2 2年国債	750,000,000	751,155,000	
	4 3 3 2年国債	330,000,000	330,504,900	
	4 3 4 2年国債	1,130,000,000	1,131,796,700	
	4 3 5 2年国債	3,780,000,000	3,785,556,600	
	1 3 8 5年国債	600,000,000	601,872,000	
	1 3 9 5年国債	260,000,000	260,878,800	
	1 4 0 5年国債	600,000,000	602,160,000	
	1 4 1 5年国債	795,000,000	798,100,500	
	1 4 2 5年国債	760,000,000	763,161,600	
	1 4 3 5年国債	770,000,000	773,272,500	
	1 4 4 5年国債	980,000,000	984,214,000	
	1 4 5 5年国債	1,080,000,000	1,084,633,200	
	1 4 6 5年国債	1,550,000,000	1,556,851,000	
	1 4 7 5年国債	1,540,000,000	1,540,893,200	
	1 4 8 5年国債	1,070,000,000	1,070,214,000	
	1 4 9 5年国債	1,240,000,000	1,239,714,800	
	1 5 0 5年国債	2,510,000,000	2,508,217,900	
	1 4 0年国債	40,000,000	53,686,800	
	2 4 0年国債	242,000,000	314,282,980	
	3 4 0年国債	185,000,000	241,647,000	
	4 4 0年国債	247,000,000	323,303,240	
	5 4 0年国債	235,000,000	297,002,400	
	6 4 0年国債	240,000,000	298,430,400	
	7 4 0年国債	285,000,000	340,284,300	
	8 4 0年国債	300,000,000	334,281,000	
	9 4 0年国債	513,000,000	425,318,040	
	1 0 4 0年国債	450,000,000	437,215,500	
	1 1 4 0年国債	380,000,000	357,078,400	
	1 2 4 0年国債	380,000,000	320,963,200	
	1 3 4 0年国債	475,000,000	399,251,750	
	1 4 4 0年国債	475,000,000	426,697,250	
	3 3 2 1 0年国債	793,000,000	802,159,150	
	3 3 3 1 0年国債	815,000,000	825,635,750	
	3 3 4 1 0年国債	315,000,000	319,580,100	
3 3 5 1 0年国債	90,000,000	91,228,500		
3 3 6 1 0年国債	340,000,000	345,072,800		
3 3 7 1 0年国債	120,000,000	121,144,800		
3 3 8 1 0年国債	805,000,000	815,513,300		

339	10年国債	785,000,000	795,880,100	
340	10年国債	770,000,000	781,249,700	
341	10年国債	557,000,000	563,572,600	
342	10年国債	350,000,000	351,512,000	
343	10年国債	310,000,000	311,295,800	
344	10年国債	811,000,000	814,235,890	
345	10年国債	258,000,000	258,964,920	
346	10年国債	540,000,000	541,857,600	
347	10年国債	680,000,000	682,108,000	
348	10年国債	625,000,000	626,518,750	
349	10年国債	610,000,000	611,030,900	
350	10年国債	590,000,000	590,696,200	
351	10年国債	390,000,000	390,117,000	
352	10年国債	570,000,000	569,817,600	
353	10年国債	520,000,000	519,308,400	
354	10年国債	435,000,000	433,951,650	
355	10年国債	700,000,000	697,508,000	
356	10年国債	940,000,000	935,506,800	
357	10年国債	910,000,000	904,822,100	
358	10年国債	1,130,000,000	1,122,485,500	
359	10年国債	1,210,000,000	1,200,731,400	
360	10年国債	1,120,000,000	1,110,704,000	
361	10年国債	1,310,000,000	1,297,699,100	
362	10年国債	1,150,000,000	1,138,408,000	
363	10年国債	800,000,000	791,000,000	
364	10年国債	950,000,000	938,590,500	
365	10年国債	1,060,000,000	1,046,442,600	
366	10年国債	340,000,000	338,844,000	
2	30年国債	510,000,000	598,153,500	
4	30年国債	340,000,000	418,166,000	
5	30年国債	290,000,000	341,675,100	
7	30年国債	474,000,000	571,397,520	
9	30年国債	240,000,000	268,581,600	
10	30年国債	465,000,000	505,980,450	
11	30年国債	430,000,000	496,482,300	
12	30年国債	570,000,000	684,951,900	
14	30年国債	622,000,000	772,013,960	
16	30年国債	465,000,000	585,881,400	
18	30年国債	540,000,000	670,685,400	
19	30年国債	470,000,000	585,126,500	
21	30年国債	345,000,000	431,167,200	
22	30年国債	315,000,000	402,822,000	
23	30年国債	329,000,000	421,731,940	
24	30年国債	310,000,000	398,300,400	
25	30年国債	290,000,000	365,156,400	

26	30年国債	363,000,000	463,006,500	
27	30年国債	420,000,000	543,484,200	
28	30年国債	386,000,000	500,653,580	
29	30年国債	177,000,000	227,384,820	
30	30年国債	442,000,000	561,804,100	
31	30年国債	325,000,000	408,690,750	
32	30年国債	360,000,000	459,824,400	
33	30年国債	368,000,000	451,642,720	
34	30年国債	457,000,000	576,889,380	
35	30年国債	350,000,000	429,677,500	
36	30年国債	90,000,000	110,657,700	
37	30年国債	435,000,000	527,850,750	
38	30年国債	410,000,000	490,544,500	
39	30年国債	180,000,000	219,038,400	
40	30年国債	270,000,000	323,546,400	
41	30年国債	270,000,000	318,432,600	
42	30年国債	280,000,000	330,094,800	
43	30年国債	285,000,000	336,174,600	
44	30年国債	280,000,000	330,447,600	
45	30年国債	355,000,000	404,263,350	
46	30年国債	315,000,000	358,766,100	
47	30年国債	330,000,000	382,750,500	
48	30年国債	335,000,000	374,298,850	
49	30年国債	315,000,000	351,930,600	
50	30年国債	295,000,000	291,197,450	
51	30年国債	315,000,000	276,091,200	
52	30年国債	343,000,000	314,884,290	
53	30年国債	307,000,000	288,104,150	
54	30年国債	75,000,000	73,547,250	
55	30年国債	325,000,000	318,324,500	
56	30年国債	500,000,000	489,145,000	
57	30年国債	355,000,000	346,508,400	
58	30年国債	340,000,000	331,109,000	
59	30年国債	360,000,000	341,845,200	
60	30年国債	350,000,000	347,770,500	
61	30年国債	345,000,000	325,942,200	
62	30年国債	165,000,000	147,651,900	
63	30年国債	320,000,000	278,070,400	
64	30年国債	305,000,000	264,178,800	
65	30年国債	305,000,000	263,889,050	
66	30年国債	310,000,000	268,218,200	
67	30年国債	350,000,000	318,867,500	
68	30年国債	350,000,000	318,650,500	
69	30年国債	440,000,000	411,030,400	
70	30年国債	350,000,000	326,070,500	

7 1	3 0 年国債	320,000,000	297,974,400	
7 2	3 0 年国債	380,000,000	353,669,800	
7 3	3 0 年国債	410,000,000	380,972,000	
7 4	3 0 年国債	10,000,000	10,046,200	
6 5	2 0 年国債	1,020,000,000	1,054,159,800	
6 9	2 0 年国債	1,020,000,000	1,062,911,400	
7 0	2 0 年国債	780,000,000	822,042,000	
7 2	2 0 年国債	753,000,000	792,668,040	
7 4	2 0 年国債	664,000,000	702,472,160	
7 5	2 0 年国債	490,000,000	520,850,400	
7 8	2 0 年国債	590,000,000	626,385,300	
8 2	2 0 年国債	620,000,000	665,297,200	
8 4	2 0 年国債	500,000,000	537,245,000	
8 5	2 0 年国債	645,000,000	698,522,100	
8 8	2 0 年国債	742,000,000	813,395,240	
8 9	2 0 年国債	20,000,000	21,840,600	
9 0	2 0 年国債	580,000,000	636,312,200	
9 2	2 0 年国債	424,000,000	465,276,400	
9 3	2 0 年国債	632,000,000	693,304,000	
9 5	2 0 年国債	305,000,000	340,654,500	
9 7	2 0 年国債	677,000,000	755,694,480	
9 9	2 0 年国債	153,000,000	170,634,780	
1 0 0	2 0 年国債	207,000,000	232,974,360	
1 0 1	2 0 年国債	355,000,000	403,737,950	
1 0 2	2 0 年国債	457,000,000	521,912,280	
1 0 5	2 0 年国債	390,000,000	439,873,200	
1 0 6	2 0 年国債	370,000,000	419,683,600	
1 0 7	2 0 年国債	378,000,000	427,775,040	
1 0 8	2 0 年国債	390,000,000	436,179,900	
1 0 9	2 0 年国債	140,000,000	157,075,800	
1 1 1	2 0 年国債	386,000,000	442,549,000	
1 1 3	2 0 年国債	227,000,000	259,454,190	
1 1 4	2 0 年国債	263,000,000	301,618,920	
1 1 6	2 0 年国債	100,000,000	115,841,000	
1 1 8	2 0 年国債	200,000,000	229,262,000	
1 1 9	2 0 年国債	295,000,000	333,406,050	
1 2 0	2 0 年国債	200,000,000	222,814,000	
1 2 1	2 0 年国債	55,000,000	62,808,350	
1 2 2	2 0 年国債	330,000,000	374,111,100	
1 2 3	2 0 年国債	80,000,000	93,015,200	
1 2 4	2 0 年国債	190,000,000	219,288,500	
1 2 5	2 0 年国債	205,000,000	240,975,450	
1 2 6	2 0 年国債	180,000,000	208,429,200	
1 2 7	2 0 年国債	145,000,000	166,629,650	
1 2 8	2 0 年国債	65,000,000	74,896,900	

130	20年国債	155,000,000	177,719,900	
131	20年国債	380,000,000	432,185,400	
132	20年国債	450,000,000	513,153,000	
133	20年国債	190,000,000	218,465,800	
134	20年国債	200,000,000	230,712,000	
135	20年国債	155,000,000	177,295,200	
136	20年国債	120,000,000	136,094,400	
137	20年国債	185,000,000	212,059,950	
139	20年国債	60,000,000	68,179,200	
140	20年国債	340,000,000	390,534,200	
142	20年国債	190,000,000	220,647,000	
143	20年国債	120,000,000	137,018,400	
144	20年国債	170,000,000	192,304,000	
145	20年国債	110,000,000	127,007,100	
146	20年国債	95,000,000	109,886,500	
147	20年国債	210,000,000	240,817,500	
148	20年国債	219,000,000	248,840,940	
149	20年国債	575,000,000	654,177,500	
150	20年国債	391,000,000	440,449,770	
151	20年国債	580,000,000	639,484,800	
152	20年国債	585,000,000	645,319,350	
153	20年国債	437,000,000	487,779,400	
154	20年国債	380,000,000	419,292,000	
155	20年国債	410,000,000	441,627,400	
156	20年国債	480,000,000	477,792,000	
157	20年国債	335,000,000	323,616,700	
158	20年国債	410,000,000	412,218,100	
159	20年国債	388,000,000	394,925,800	
160	20年国債	355,000,000	365,880,750	
161	20年国債	380,000,000	385,361,800	
162	20年国債	370,000,000	374,495,500	
163	20年国債	430,000,000	434,355,900	
164	20年国債	385,000,000	382,177,950	
165	20年国債	390,000,000	386,240,400	
166	20年国債	335,000,000	341,287,950	
167	20年国債	400,000,000	393,932,000	
168	20年国債	480,000,000	463,814,400	
169	20年国債	400,000,000	378,944,000	
170	20年国債	385,000,000	363,609,400	
171	20年国債	345,000,000	325,072,800	
172	20年国債	480,000,000	458,884,800	
173	20年国債	505,000,000	481,335,700	
174	20年国債	510,000,000	484,617,300	
175	20年国債	515,000,000	496,748,400	
176	20年国債	610,000,000	586,661,400	

	177 20年国債	540,000,000	508,302,000	
	178 20年国債	500,000,000	478,390,000	
	179 20年国債	580,000,000	553,702,800	
	国債証券 小計		109,049,192,830	
地方債証券	727 東京都公債	500,000,000	505,708,500	
	792 東京都公債	300,000,000	295,569,300	
	1 東京都30年	100,000,000	120,100,100	
	8 東京都30年	400,000,000	499,078,800	
	13 東京都30年	500,000,000	604,714,500	
	1 東京都20年	100,000,000	101,799,100	
	6 東京都20年	100,000,000	105,615,000	
	24-14 北海道公債	100,000,000	100,688,500	
	26-15 北海道公債	100,000,000	100,994,800	
	30-18 北海道公債	200,000,000	198,058,800	
	1 神奈川県20年	100,000,000	105,422,900	
	3 神奈川県20年	100,000,000	106,424,600	
	7 神奈川県20年	100,000,000	110,230,300	
	13 神奈川県20年	100,000,000	114,447,000	
	373 大阪府公債	100,000,000	101,050,800	
	377 大阪府公債	100,000,000	101,067,200	
	388 大阪府公債	100,000,000	101,125,700	
	27-4 京都府公債	100,000,000	101,469,700	
	29-12 京都府5年	300,000,000	300,091,200	
	1-6 京都府5年	200,000,000	199,655,200	
	5 兵庫県公債15年	300,000,000	319,650,600	
	10 兵庫県公債20年	100,000,000	114,850,600	
	7 静岡県30年	100,000,000	122,243,000	
	1 静岡県20年	100,000,000	107,136,200	
	22-8 愛知県20年	200,000,000	226,178,000	
	27-16 愛知県公債	400,000,000	405,132,000	
	25-11 福岡県公債	100,000,000	101,200,000	
	26-3 福岡県公債	100,000,000	101,159,100	
	26-10 福岡県公債	100,000,000	101,062,500	
	1-1 福岡県公債	200,000,000	196,433,200	
	25-8 千葉県公債	100,000,000	101,025,000	
	118 共同発行地方	100,000,000	100,647,800	
	137 共同発行地方	200,000,000	202,341,600	
	138 共同発行地方	200,000,000	202,349,600	
	172 共同発行地方	500,000,000	501,760,500	
	183 共同発行地方	600,000,000	599,347,200	
	1 名古屋市20年	200,000,000	206,577,400	
	3 名古屋市20年	100,000,000	106,167,100	
	5 名古屋市20年	100,000,000	109,602,800	
	29-5 京都市5年	100,000,000	100,030,100	
	1 京都市30年	100,000,000	129,270,400	

	7 京都市20年	100,000,000	113,711,100	
	26-17 神戸市公債	100,000,000	100,555,100	
	26-3 横浜市公債	200,000,000	202,341,000	
	4 横浜市20年	100,000,000	105,705,800	
	9 横浜市20年	100,000,000	109,291,800	
	14 横浜市20年	100,000,000	112,488,400	
	47 横浜市5年	100,000,000	100,020,500	
	26-4 札幌市公債	100,000,000	101,039,200	
	24-2 北九州市債	100,000,000	100,498,400	
	1-2 北九州市5年	100,000,000	99,816,200	
	29-11 福岡市5年	300,000,000	300,091,200	
	地方債証券 小計		9,573,035,400	
特殊債券	3 政保政策投資CO	200,000,000	207,191,200	
	36 日本政策投資B	100,000,000	110,551,500	
	18 道路機構	100,000,000	141,049,900	
	22 道路機構	300,000,000	409,975,500	
	27 道路機構	100,000,000	111,707,500	
	37 道路機構	300,000,000	339,783,600	
	47 道路機構	200,000,000	229,019,400	
	104 道路機構	400,000,000	402,592,800	
	79 政保道路機構	200,000,000	226,626,000	
	81 政保道路機構	200,000,000	226,940,400	
	88 政保道路機構	100,000,000	126,661,100	
	90 政保道路機構	500,000,000	569,495,500	
	99 政保道路機構	100,000,000	115,229,300	
	176 政保道路機構	100,000,000	113,739,000	
	196 政保道路機構	100,000,000	115,761,900	
	210 政保道路機構	200,000,000	226,944,400	
	227 政保道路機構	200,000,000	202,722,600	
	231 政保道路機構	300,000,000	303,905,700	
	288 政保道路機構	189,000,000	188,562,276	
	9 道路債券	100,000,000	125,413,600	
	2 地方公営20年	100,000,000	113,826,500	
	45 地方公共団体	200,000,000	201,355,800	
	61 地方公共団体	100,000,000	101,386,200	
	62 地方公共団体	400,000,000	405,175,200	
	63 地方公共団体	100,000,000	101,219,700	
	67 政保地方公共団	100,000,000	101,240,800	
	101 地方公共団体	100,000,000	100,214,300	
	106 地方公共団体	200,000,000	199,924,600	
	3 公営企業20年	100,000,000	100,957,300	
	5 公営企業20年	100,000,000	102,997,800	
	17 公営企業20年	100,000,000	108,926,200	
	20 公営企業20年	100,000,000	110,331,700	
	22 公営企業20年	100,000,000	111,115,100	

2 4	公営企業2 0年	200,000,000	224,690,400	
5 2	住宅支援機構	100,000,000	113,599,600	
1 3 0	住宅支援機構	200,000,000	228,949,000	
2 2 6	住宅支援機構	100,000,000	100,134,800	
S 9	住宅金融R M B S	20,640,000	20,834,016	
S 1 0	住宅金融R M B S	31,836,000	32,109,789	
S 3	住宅機構R M B S	11,144,000	11,327,876	
S 5	住宅機構R M B S	23,666,000	24,189,018	
S 7	住宅機構R M B S	12,205,000	12,468,628	
S 9	住宅機構R M B S	12,367,000	12,699,672	
S 1 0	住宅機構R M B S	12,197,000	12,479,970	
S 1 1	住宅機構R M B S	13,073,000	13,503,101	
2 9	住宅金融R M B S	10,032,000	10,102,224	
3 2	住宅金融R M B S	11,073,000	11,209,197	
3 5	住宅金融R M B S	11,822,000	12,047,800	
3 9	住宅金融R M B S	10,766,000	10,915,647	
4 1	住宅金融R M B S	11,525,000	11,790,075	
4 3	住宅金融R M B S	22,070,000	22,473,881	
5 1	住宅金融R M B S	10,506,000	10,597,402	
5 3	住宅金融R M B S	11,419,000	11,672,501	
1	住宅機構R M B S	20,726,000	20,906,316	
2	住宅機構R M B S	23,390,000	23,979,428	
4	住宅機構R M B S	10,780,000	10,976,196	
6	住宅機構R M B S	10,721,000	10,900,040	
1 9	住宅機構R M B S	15,880,000	16,648,592	
2 4	住宅機構R M B S	32,450,000	34,241,240	
2 6	住宅機構R M B S	50,523,000	53,155,248	
2 7	住宅機構R M B S	18,258,000	19,260,364	
2 8	住宅機構R M B S	20,026,000	21,201,526	
2 9	住宅機構R M B S	22,104,000	23,481,079	
3 0	住宅機構R M B S	22,033,000	23,421,079	
3 2	住宅機構R M B S	43,162,000	45,535,910	
3 5	住宅機構R M B S	21,904,000	23,139,385	
3 6	住宅機構R M B S	21,275,000	22,402,575	
4 3	住宅機構R M B S	26,914,000	28,348,516	
4 6	住宅機構R M B S	21,342,000	22,485,931	
4 8	住宅機構R M B S	40,284,000	42,354,597	
4 9	住宅機構R M B S	20,570,000	21,547,075	
5 1	住宅機構R M B S	45,364,000	47,477,962	
5 5	住宅機構R M B S	60,218,000	62,867,592	
5 7	住宅機構R M B S	29,469,000	30,774,476	
5 8	住宅機構R M B S	33,387,000	34,889,415	
5 9	住宅機構R M B S	64,350,000	67,335,840	
6 0	住宅機構R M B S	101,619,000	106,222,340	
6 1	住宅機構R M B S	33,618,000	34,992,976	

	6 7 住宅機構 R M B S	39,831,000	41,105,592	
	6 9 住宅機構 R M B S	81,038,000	84,344,350	
	7 0 住宅機構 R M B S	70,776,000	73,465,488	
	7 3 住宅機構 R M B S	40,325,000	42,010,585	
	9 9 住宅機構 R M B S	60,688,000	61,950,310	
	1 2 3 住宅機構 R M B S	78,771,000	77,999,044	
	1 2 4 住宅機構 R M B S	78,620,000	77,621,526	
	1 2 5 住宅機構 R M B S	78,727,000	77,719,294	
	1 2 7 住宅機構 R M B S	80,432,000	79,225,520	
	1 2 8 住宅機構 R M B S	79,545,000	78,479,097	
	1 2 9 住宅機構 R M B S	81,229,000	80,335,481	
	1 3 7 住宅機構 R M B S	84,072,000	83,021,100	
	1 6 7 住宅機構 R M B S	96,274,000	94,685,479	
	8 5 中日本高速道	300,000,000	299,445,300	
	特殊債券 小計		9,360,292,837	
社債券	2 BPCE S.A.	200,000,000	200,466,800	
	2 0 西日本高速道	100,000,000	101,051,000	
	2 3 西日本高速道	100,000,000	101,167,900	
	1 3 大和ハウス	100,000,000	100,167,200	
	3 0 東レ	100,000,000	100,526,500	
	5 6 住友化学	200,000,000	200,280,600	
	2 4 三菱ケミカルホールデイ	100,000,000	100,011,400	
	1 6 日立製作所	100,000,000	101,272,600	
	2 2 パナソニック	100,000,000	99,470,200	
	9 T D K	100,000,000	98,350,500	
	6 3 三井物産	100,000,000	110,497,800	
	8 みずほコーポレート	100,000,000	111,254,000	
	1 三井住友 F G 劣後	100,000,000	100,906,700	
	8 住友信託 劣後	100,000,000	109,348,400	
	1 みずほ F G 劣後	100,000,000	100,936,000	
	9 みずほ銀行劣後	100,000,000	109,443,800	
	1 7 N T Tファイナンス	200,000,000	199,208,000	
	7 3 ホンダファイナンス	200,000,000	198,657,400	
	2 三菱 H C キヤピタル	200,000,000	199,075,400	
	1 野村ホールディングス	100,000,000	99,923,500	
	5 8 三菱地所	100,000,000	123,872,100	
	1 3 5 三菱地所	200,000,000	196,284,000	
	1 0 東急	100,000,000	98,139,900	
	3 8 京王電鉄	100,000,000	100,115,800	
	1 1 0 東日本旅客鉄	100,000,000	115,097,500	
	1 6 9 東日本旅客鉄	200,000,000	194,508,800	
	4 1 東海旅客鉄道	100,000,000	111,876,400	
	4 2 東海旅客鉄道	100,000,000	113,142,800	
	4 5 東京地下鉄	100,000,000	98,049,300	
	6 4 阪急阪神 H L D G	100,000,000	99,360,100	

5 4 6	中部電力	200,000,000	194,672,200	
5 5 3	中部電力	200,000,000	199,280,600	
5 0 8	東北電力	200,000,000	199,455,200	
4 9 6	九州電力	300,000,000	292,755,000	
3 8	東京電力パワー	100,000,000	100,381,900	
4 1	大阪瓦斯	200,000,000	195,580,600	
7	ファーストリテイリング	100,000,000	100,287,500	
	社債券 小計		5,074,875,400	
合 計			133,057,396,467	

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)

	(2021年4月13日現在)	(2022年4月13日現在)
資産の部		
流動資産		
預金	1,980,401,795	1,936,532,460
金銭信託	1,160,138,477	75,671,589
コール・ローン	601,251,271	2,902,715,751
株式	283,975,881,503	372,473,853,310
投資証券	6,632,679,127	9,939,902,140
派生商品評価勘定	67,211,947	71,064,623
未収入金	383,008	24,703,555
未収配当金	312,896,444	456,665,778
差入委託証拠金	1,307,692,251	1,059,785,844
流動資産合計	296,038,535,823	388,940,895,050
資産合計	296,038,535,823	388,940,895,050
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	3,068,399	45,750,848
前受金	65,838,580	-
未払解約金	390,760,813	582,876,494
未払利息	1,647	-
その他未払費用	3,865	2,331
流動負債合計	459,673,304	628,629,673
負債合計	459,673,304	628,629,673
純資産の部		
元本等		
元本	58,211,745,190	63,653,360,828
剰余金		
剰余金又は欠損金 ()	237,367,117,329	324,658,904,549
元本等合計	295,578,862,519	388,312,265,377

純資産合計	295,578,862,519	388,312,265,377
負債純資産合計	296,038,535,823	388,940,895,050

(2) 注記表

(重要な会計方針の注記)

項目	自 2021年4月14日 至 2022年4月13日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式、投資証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1) 先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算期間末日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場によっております。</p> <p>(2) 為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金の計上基準 受取配当金は原則として、配当落ち日において、確定配当金額または予想配当金額を計上しております。なお、配当金額が未確定の場合は、入金日基準で計上しております。</p>
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建資産等の会計処理 「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。</p>

(重要な会計上の見積りに関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

項目	(2021年4月13日現在)	(2022年4月13日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	58,211,745,190口	63,653,360,828口

2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 5.0776円 (1万口当たりの純資産額50,776円)	1口当たり純資産額 6.1004円 (1万口当たりの純資産額61,004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 2021年4月14日 至 2022年4月13日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、株式、投資証券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。当計算期間については、先物取引、為替予約取引を行っております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>

3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する会議をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用部署に是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用部署は、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。なお、投資信託協会の流動性リスク管理規制に抵触する場合には、流動性リスクを管理する会議で審議の上、流動性リスクの管理責任者が対処方針を決定します。その後、決定した対処方針やその実施等について、リスク管理会議に報告を行う体制となっております。</p> <p>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する会議にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。</p>
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。</p>

・金融商品の時価等に関する事項

項目	(2022年4月13日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	<p>金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p>
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券（株式、投資証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

(デリバティブ取引に関する注記)

(2021年4月13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				
	SPMINI 2106	4,592,481,363	-	4,650,475,482	57,994,119
	SPI200 2106	186,653,370	-	188,352,645	1,699,275
	FTSE 2106	287,848,728	-	288,833,521	984,793
	DJ EUR 2106	980,286,606	-	985,446,999	5,160,393
	小計	6,047,270,067	-	6,113,108,647	65,838,580
合 計		6,047,270,067	-	6,113,108,647	65,838,580

(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	1,819,250,400	-	1,817,899,629	1,350,771	
	イギリス・ポンド	67,749,720	-	67,760,180	10,460	
	イスラエル・シ ケル	8,338,970	-	8,307,350	31,620	
	オーストラリア・ ドル	50,940,280	-	50,873,685	66,595	
	カナダ・ドル	52,331,760	-	52,277,628	54,132	
	シンガポール・ド ル	4,086,300	-	4,086,865	565	
	スイス・フラン	55,755,930	-	55,771,231	15,301	
	スウェーデン・ク ローナ	14,174,700	-	14,174,700	-	
	デンマーク・ク ローネ	11,576,750	-	11,576,400	350	
	ニュージーラン ド・ドル	768,530	-	768,580	50	
	ノルウェー・ク ローネ	3,742,570	-	3,741,000	1,570	
	ユーロ	294,957,980	-	294,752,440	205,540	
	香港・ドル	29,055,840	-	29,045,010	10,830	
	小計	2,412,729,730	-	2,411,034,698	1,695,032	
	合 計		2,412,729,730	-	2,411,034,698	1,695,032

(2022年4月13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 JUN22	4,452,038,122	-	4,469,974,146	17,936,024
	SPI 200 FUTURES JUN22	227,121,578	-	225,741,568	1,380,010
	FTSE 100 IDX FUT JUN22	253,714,065	-	258,682,481	4,968,416
	EURO STOXX 50 JUN22	827,655,257	-	831,268,867	3,613,610
	小計	5,760,529,022	-	5,785,667,062	25,138,040
	合 計	5,760,529,022	-	5,785,667,062	25,138,040

(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	1,614,573,000	-	1,615,438,478	865,478
	カナダ・ドル	77,408,760	-	77,506,260	97,500
	オーストラリア・ ドル	29,774,720	-	29,938,976	164,256
	香港・ドル	17,783,310	-	17,792,967	9,657
	シンガポール・ド ル	10,108,780	-	10,128,470	19,690
	イスラエル・シュ ケル	4,695,600	-	4,693,992	1,608
	スイス・フラン	70,057,000	-	69,961,684	95,316
	スウェーデン・ク ローナ	6,207,760	-	6,189,900	17,860
	ユーロ	167,955,270	-	167,097,099	858,171
	小計	1,998,564,200	-	1,998,747,826	183,626
	売建				

	ニュージーランド・ドル	3,421,480	-	3,439,880	18,400
	イギリス・ポンド	6,539,120	-	6,528,612	10,508
	小計	9,960,600	-	9,968,492	7,892
	合計	2,008,524,800	-	2,008,716,318	175,734

(注) 1. 時価の算定方法

為替予約取引の時価の算定方法については以下のように評価しております。

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

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

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

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

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

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 2021年4月14日 至 2022年4月13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)

(2021年4月13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	58,474,870,859円
同期中における追加設定元本額	16,974,480,468円
同期中における一部解約元本額	17,237,606,137円
2021年4月13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	28,675,405,235円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	283,051,086円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	1,207,524,235円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	838,459,709円
S M A M・グローバルバランスファンド(機動的資産配分型)	70,282,809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)	1,307,216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)	6,549,259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)	20,430,761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)	51,182,329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)	48,571,646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)	96,727,490円
外国株式指数ファンド	587,742,940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	9,008,165,638円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	264,170,743円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	278,944,246円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	174,748,649円
イオン・バランス戦略ファンド	62,925,621円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050	13,540,485円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	93,387,800円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	79,483,815円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	251,680,503円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	124,835,202円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	142,461,893円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	31,309,522円
三井住友DS・外国株式インデックス年金ファンド	182,400,691円
三井住友DS・年金バランス30(債券重点型)	3,651,079円
三井住友DS・年金バランス50(標準型)	13,766,131円
三井住友DS・年金バランス70(株式重点型)	11,796,950円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	1,957,599円
SMBC・DCインデックスファンド(MSCIコクサイ)	28,095,372円
SMAM・外国株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	784,383,935円
バランスファンドVA(安定運用型)<適格機関投資家限定>	7,116,828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>	42,227,299円
SMAM・バランスファンドVA25<適格機関投資家専用>	931,142,266円
SMAM・バランスファンドVA37.5<適格機関投資家専用>	1,030,755,411円
SMAM・バランスファンドVA50<適格機関投資家専用>	4,447,927,100円
SMAM・バランスファンドVL30<適格機関投資家限定>	13,987,860円
SMAM・バランスファンドVL50<適格機関投資家限定>	76,827,086円
SMAM・バランスファンドVA75<適格機関投資家専用>	602,644,828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>	48,753,013円
SMAM・インデックス・バランスVA25<適格機関投資家専用>	123,376,353円
SMAM・インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用>	587,698,333円
SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用>	443,142,590円
SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>	1,029,197,056円
SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定>	241,876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)	252,196,472円
SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	91,962,063円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>	11,959,916円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>	9,927,876円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用>	4,880,615円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>	29,806,757円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	77,183,276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>	196,801,861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>	82,054,599円
SMAM・世界バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	2,543,269,267円
SMAM・世界バランスファンドVA2<適格機関投資家限定>	160,265,042円
SMAM・外国株式インデックスファンドSA<適格機関投資家限定>	1,441,122,783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>	12,940,494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>	34,488,574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>	28,712,764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>	410,194,343円
合計	58,211,745,190円

(2022年4月13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	58,211,745,190円
同期中における追加設定元本額	16,194,701,899円
同期中における一部解約元本額	10,753,086,261円

2022年4月13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	32,822,168,470円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	261,268,707円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	1,053,868,131円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	751,708,601円
SMAM・グローバルバランスファンド(機動的資産配分型)	48,029,718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)	1,125,866円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2025(4資産タイプ)	5,678,753円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2030(4資産タイプ)	16,717,392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)	44,979,799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)	47,841,761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)	94,776,574円
外国株式指数ファンド	852,708,104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	14,465,738,967円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	96,142,646円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	103,195,277円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	68,329,125円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050	15,569,633円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	122,523,866円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	105,362,465円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	367,489,080円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	192,799,695円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	222,706,458円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	43,921,433円
三井住友DS・外国株式インデックス年金ファンド	745,787,382円
三井住友DS・年金バランス30(債券重点型)	4,562,841円
三井住友DS・年金バランス50(標準型)	20,366,246円
三井住友DS・年金バランス70(株式重点型)	19,837,949円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	1,976,165円
SMBC・DCインデックスファンド(MSCIコクサイ)	170,769,804円
日興FWS・先進国株インデックス(為替ヘッジあり)	162,944,584円
日興FWS・先進国株インデックス(為替ヘッジなし)	544,987,952円
三井住友DS・先進国株式インデックス・ファンド	21,467,988円
SMAM・外国株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	509,401,113円
バランスファンドVA(安定運用型)<適格機関投資家限定>	3,309,072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>	25,733,245円

SMAM・バランスファンドVA25<適格機関投資家専用>	627,813,023円
SMAM・バランスファンドVA37.5<適格機関投資家専用>	773,029,117円
SMAM・バランスファンドVA50<適格機関投資家専用>	3,346,842,453円
SMAM・バランスファンドVL30<適格機関投資家限定>	10,889,499円
SMAM・バランスファンドVL50<適格機関投資家限定>	56,580,424円
SMAM・バランスファンドVA75<適格機関投資家専用>	451,874,051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>	37,545,497円
SMAM・インデックス・バランスVA25<適格機関投資家専用>	93,355,655円
SMAM・インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用>	461,868,419円
SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用>	326,103,369円
SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>	757,423,890円
SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定>	200,225円
三井住友・外国株式インデックスファンド・VAS(適格機関投資家専用)	208,564,505円
SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	69,160,413円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>	8,668,847円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>	7,431,222円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用>	3,930,927円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>	20,416,659円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	55,967,394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>	121,991,477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>	54,169,208円
SMAM・世界バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	509,774,724円
SMAM・世界バランスファンドVA2<適格機関投資家限定>	93,680,381円
SMAM・外国株式インデックスファンドSA<適格機関投資家限定>	1,402,985,029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>	22,195,395円
SMAM・マルチアセットストラテジーファンド2016-04<適格機関投資家限定>	14,310,453円
SMAM・マルチアセットストラテジー・オープン<適格機関投資家限定>	18,636,428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>	62,157,282円
合 計	63,653,360,828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	BAKER HUGHES CO	48,147	36.320	1,748,699.04	
	CHENIERE ENERGY INC	13,763	137.960	1,898,743.48	
	CHEVRON CORP	109,842	169.010	18,564,396.42	
	CONOCOPHILLIPS	75,728	100.000	7,572,800.00	
	COTERRA ENERGY INC	40,261	28.370	1,142,204.57	
	DEVON ENERGY CORP	36,196	62.260	2,253,562.96	
	DIAMONDBACK ENERGY INC	9,236	139.180	1,285,466.48	
	EOG RESOURCES INC	33,177	124.570	4,132,858.89	

EXXON MOBIL CORP	240,058	85.600	20,548,964.80	
HALLIBURTON CO	48,780	39.530	1,928,273.40	
HESS CORP	15,806	112.600	1,779,755.60	
KINDER MORGAN INC	115,515	19.140	2,210,957.10	
MARATHON PETROLEUM CORP	33,933	85.800	2,911,451.40	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	54,615	59.140	3,229,931.10	
ONEOK INC	24,725	70.810	1,750,777.25	
PHILLIPS 66	28,293	81.970	2,319,177.21	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	13,151	252.530	3,321,022.03	
SCHLUMBERGER LTD	77,056	41.530	3,200,135.68	
VALERO ENERGY CORP	23,182	100.790	2,336,513.78	
WILLIAMS COS INC	71,708	34.790	2,494,721.32	
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	12,372	247.780	3,065,534.16	
ALBEMARLE CORP	6,560	205.020	1,344,931.20	
AMCOR PLC	82,302	11.660	959,641.32	
AVERY DENNISON CORP	4,232	173.490	734,209.68	
BALL CORP	19,410	86.310	1,675,277.10	
CELANESE CORP	6,643	143.970	956,392.71	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	12,002	109.820	1,318,059.64	
CORTEVA INC	41,332	60.630	2,505,959.16	
CROWN HOLDINGS INC	6,863	118.620	814,089.06	
DOW INC	41,516	63.260	2,626,302.16	
DUPONT DE NEMOURS INC	27,944	68.460	1,913,046.24	
EASTMAN CHEMICAL CO	7,027	107.490	755,332.23	
ECOLAB INC	14,157	179.330	2,538,774.81	
FMC CORP	6,676	137.160	915,680.16	
FREEMPORT-MCMORAN INC	85,156	48.000	4,087,488.00	
INTERNATIONAL PAPER CO	19,140	46.640	892,689.60	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	13,922	124.430	1,732,314.46	
LINDE PLC	29,358	314.000	9,218,412.00	
LYONDELLBASELL INDU-CL A	16,010	103.530	1,657,515.30	
MARTIN MARIETTA MATERIALS	3,559	366.650	1,304,907.35	
MOSAIC CO/THE	22,416	75.480	1,691,959.68	
NEWMONT CORP	46,400	82.500	3,828,000.00	
NUCOR CORP	16,292	157.240	2,561,754.08	
PACKAGING CORP OF AMERICA	5,988	156.970	939,936.36	
PPG INDUSTRIES INC	13,502	128.710	1,737,842.42	
RPM INTERNATIONAL INC	7,696	85.750	659,932.00	
SEALED AIR CORP	7,895	67.000	528,965.00	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	14,500	256.950	3,725,775.00	
STEEL DYNAMICS INC	10,191	84.640	862,566.24	

VULCAN MATERIALS CO	7,555	175.500	1,325,902.50	
WESTROCK CO	13,034	47.880	624,067.92	
3M CO	32,676	148.580	4,855,000.08	
AERCAP HOLDINGS NV	8,330	48.760	406,170.80	
ALLEGION PLC	4,764	105.800	504,031.20	
AMETEK INC	13,117	128.690	1,688,026.73	
BOEING CO/THE	32,149	176.280	5,667,225.72	
CARRIER GLOBAL CORP	46,600	41.780	1,946,948.00	
CATERPILLAR INC	31,095	216.700	6,738,286.50	
CUMMINS INC	8,207	192.580	1,580,504.06	
DEERE & CO	16,702	419.730	7,010,330.46	
DOVER CORP	8,225	147.870	1,216,230.75	
EATON CORP PLC	23,221	140.820	3,269,981.22	
EMERSON ELECTRIC CO	34,129	92.820	3,167,853.78	
FASTENAL CO	32,763	57.690	1,890,097.47	
FORTIVE CORP	18,373	58.610	1,076,841.53	
FORTUNE BRANDS HOME & SECURI	7,166	70.330	503,984.78	
GENERAC HOLDINGS INC	3,300	264.900	874,170.00	
GENERAL DYNAMICS CORP	13,847	243.820	3,376,175.54	
GENERAL ELECTRIC CO	63,295	90.000	5,696,550.00	
HEICO CORP	1,888	148.730	280,802.24	
HEICO CORP-CLASS A	4,570	122.840	561,378.80	
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	39,519	190.990	7,547,733.81	
HOWMET AEROSPACE INC	19,024	34.680	659,752.32	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	2,107	209.970	442,406.79	
IDEX CORP	3,839	193.760	743,844.64	
ILLINOIS TOOL WORKS	18,247	199.810	3,645,933.07	
INGERSOLL-RAND INC	21,013	46.250	971,851.25	
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	11,500	56.020	644,230.00	
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	38,803	62.150	2,411,606.45	
KORNIT DIGITAL LTD	3,043	71.500	217,574.50	
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	11,079	257.200	2,849,518.80	
LENNOX INTERNATIONAL INC	2,104	242.620	510,472.48	
LOCKHEED MARTIN CORP	14,287	467.550	6,679,886.85	
MASCO CORP	14,885	49.670	739,337.95	
NORDSON CORP	2,884	217.650	627,702.60	
NORTHROP GRUMMAN CORP	8,540	463.280	3,956,411.20	
OTIS WORLDWIDE CORP	22,881	75.890	1,736,439.09	
OWENS CORNING	5,205	84.630	440,499.15	

PACCAR INC	20,753	82.410	1,710,254.73	
PARKER HANNIFIN CORP	7,329	270.260	1,980,735.54	
PENTAIR PLC	8,220	52.620	432,536.40	
PLUG POWER INC	28,584	25.920	740,897.28	
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	85,821	102.600	8,805,234.60	
ROCKWELL AUTOMATION INC	6,219	262.910	1,635,037.29	
ROPER TECHNOLOGIES INC	6,180	470.500	2,907,690.00	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	7,600	47.900	364,040.00	
SMITH (A.O.) CORP	7,157	64.490	461,554.93	
SNAP-ON INC	3,106	210.560	653,999.36	
STANLEY BLACK & DECKER INC	9,129	140.280	1,280,616.12	
SUNRUN INC	10,669	25.620	273,339.78	
TEXTRON INC	11,803	67.680	798,827.04	
TRANE TECHNOLOGIES PLC	12,759	146.910	1,874,424.69	
TRANSDIGM GROUP INC	3,010	636.510	1,915,895.10	
UNITED RENTALS INC	4,113	318.800	1,311,224.40	
WABTEC CORP	9,231	88.560	817,497.36	
WW GRAINGER INC	2,390	523.500	1,251,165.00	
XYLEM INC	10,225	84.850	867,591.25	
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	8,029	87.570	703,099.53	
CINTAS CORP	5,169	415.770	2,149,115.13	
CLARIVATE PLC	19,939	16.200	323,011.80	
COPART INC	12,238	121.000	1,480,798.00	
COSTAR GROUP INC	23,804	62.290	1,482,751.16	
EQUIFAX INC	6,841	217.190	1,485,796.79	
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	6,927	140.290	971,788.83	
LEIDOS HOLDINGS INC	6,947	108.300	752,360.10	
REPUBLIC SERVICES INC	12,824	133.910	1,717,261.84	
ROBERT HALF INTL INC	5,555	111.010	616,660.55	
ROLLINS INC	11,493	35.430	407,196.99	
TRANSUNION	11,233	93.110	1,045,904.63	
VERISK ANALYTICS INC	8,757	214.640	1,879,602.48	
WASTE CONNECTIONS INC	15,445	141.590	2,186,857.55	
WASTE MANAGEMENT INC	23,720	161.850	3,839,082.00	
AMERCO	650	547.570	355,920.50	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	6,925	101.410	702,264.25	
CSX CORP	128,276	34.410	4,413,977.16	
DELTA AIR LINES INC	8,299	38.620	320,507.38	
EXPEDITORS INTL WASH INC	8,689	96.740	840,573.86	

FEDEX CORP	14,310	204.380	2,924,677.80	
GRAB HOLDINGS LTD - CL A	65,402	3.400	222,366.80	
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	4,411	168.230	742,062.53	
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	7,940	45.610	362,143.40	
LYFT INC-A	13,145	33.450	439,700.25	
NORFOLK SOUTHERN CORP	13,579	258.720	3,513,158.88	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	5,539	260.000	1,440,140.00	
SOUTHWEST AIRLINES CO	7,076	42.820	302,994.32	
UBER TECHNOLOGIES INC	85,141	31.990	2,723,660.59	
UNION PACIFIC CORP	36,797	245.060	9,017,472.82	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	41,784	187.890	7,850,795.76	
APTIV PLC	15,307	110.860	1,696,934.02	
BORGWARNER INC	12,075	37.060	447,499.50	
FORD MOTOR CO	218,306	15.360	3,353,180.16	
GENERAL MOTORS CO	72,747	40.040	2,912,789.88	
LEAR CORP	3,736	129.980	485,605.28	
LUCID GROUP INC	21,730	21.290	462,631.70	
RIVIAN AUTOMOTIVE INC-A	9,269	38.150	353,612.35	
TESLA INC	48,490	986.950	47,857,205.50	
DR HORTON INC	18,162	71.660	1,301,488.92	
GARMIN LTD	8,444	111.820	944,208.08	
HASBRO INC	7,491	82.760	619,955.16	
LENNAR CORP-A	14,494	76.510	1,108,935.94	
LULULEMON ATHLETICA INC	6,481	376.160	2,437,892.96	
MOHAWK INDUSTRIES INC	2,863	123.880	354,668.44	
NEWELL BRANDS INC	17,587	22.250	391,310.75	
NIKE INC -CL B	73,154	125.040	9,147,176.16	
NVR INC	173	4,352.020	752,899.46	
PELOTON INTERACTIVE INC-A	15,071	23.710	357,333.41	
PULTEGROUP INC	13,075	41.810	546,665.75	
VF CORP	20,583	55.410	1,140,504.03	
WHIRLPOOL CORP	3,212	174.600	560,815.20	
AIRBNB INC-CLASS A	17,263	160.110	2,763,978.93	
ARAMARK	13,242	35.850	474,725.70	
BOOKING HOLDINGS INC	2,368	2,181.380	5,165,507.84	
CAESARS ENTERTAINMENT INC	13,336	67.020	893,778.72	
CARNIVAL CORP	48,156	18.510	891,367.56	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	1,586	1,532.610	2,430,719.46	
DARDEN RESTAURANTS INC	7,606	130.540	992,887.24	
DOMINO'S PIZZA INC	2,121	388.570	824,156.97	

DRAFTKINGS INC - CL A	16,742	16.410	274,736.22	
EXPEDIA GROUP INC	8,061	178.610	1,439,775.21	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	15,836	144.880	2,294,319.68	
LAS VEGAS SANDS CORP	17,634	35.030	617,719.02	
MARRIOTT INTERNATIONAL - CL A	15,697	163.240	2,562,378.28	
MCDONALD'S CORP	42,751	249.170	10,652,266.67	
MELCO RESORTS & ENTERT- ADR	9,746	6.540	63,738.84	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	22,198	39.550	877,930.90	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	11,890	78.780	936,694.20	
STARBUCKS CORP	67,557	79.790	5,390,373.03	
VAIL RESORTS INC	2,038	246.880	503,141.44	
WYNN RESORTS LTD	4,913	71.500	351,279.50	
YUM! BRANDS INC	17,414	119.890	2,087,764.46	
ADVANCE AUTO PARTS INC	3,426	221.880	760,160.88	
AMAZON.COM INC	25,910	3,015.750	78,138,082.50	
AUTOZONE INC	1,235	2,168.440	2,678,023.40	
BATH & BODY WORKS INC	15,400	48.890	752,906.00	
BEST BUY CO INC	12,132	93.230	1,131,066.36	
BURLINGTON STORES INC	3,391	207.710	704,344.61	
CARMAX INC	8,427	93.330	786,491.91	
CARVANA CO	4,496	100.780	453,106.88	
CHEWY INC - CLASS A	3,969	43.300	171,857.70	
DOLLAR GENERAL CORP	13,651	243.830	3,328,523.33	
DOLLAR TREE INC	12,839	167.180	2,146,424.02	
DOORDASH INC - A	5,953	104.420	621,612.26	
EBAY INC	35,551	54.240	1,928,286.24	
ETSY INC	7,168	112.950	809,625.60	
FIVERR INTERNATIONAL LTD	1,931	66.580	128,565.98	
GENUINE PARTS CO	7,406	131.690	975,296.14	
HOME DEPOT INC	59,526	306.290	18,232,218.54	
LKQ CORP	15,922	45.960	731,775.12	
LOWE'S COS INC	38,668	204.140	7,893,685.52	
MERCADOLIBRE INC	2,654	1,115.980	2,961,810.92	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	3,958	717.550	2,840,062.90	
POOL CORP	2,107	410.970	865,913.79	
ROSS STORES INC	21,189	102.190	2,165,303.91	
TARGET CORP	27,611	231.340	6,387,528.74	
TJX COMPANIES INC	66,779	62.830	4,195,724.57	
TRACTOR SUPPLY COMPANY	6,117	236.690	1,447,832.73	
ULTA BEAUTY INC	2,765	405.900	1,122,313.50	

WAYFAIR INC- CLASS A	3,756	107.550	403,957.80	
COSTCO WHOLESALE CORP	25,216	581.360	14,659,573.76	
KROGER CO	38,955	58.750	2,288,606.25	
SYSCO CORP	30,220	84.570	2,555,705.40	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	40,703	44.230	1,800,293.69	
WALMART INC	87,595	153.230	13,422,181.85	
ALTRIA GROUP INC	105,961	54.910	5,818,318.51	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	32,763	95.070	3,114,778.41	
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	16,130	68.240	1,100,711.20	
BUNGE LTD	7,174	119.300	855,858.20	
CAMPBELL SOUP CO	10,638	45.710	486,262.98	
COCA-COLA CO/THE	234,195	64.560	15,119,629.20	
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	13,567	47.940	650,401.98	
CONAGRA BRANDS INC	24,639	35.090	864,582.51	
CONSTELLATION BRANDS INC- A	8,881	248.830	2,209,859.23	
GENERAL MILLS INC	34,440	70.430	2,425,609.20	
HERSHEY CO/THE	8,265	226.020	1,868,055.30	
HORMEL FOODS CORP	14,939	53.330	796,696.87	
JM SMUCKER CO/THE	5,768	139.410	804,116.88	
KELLOGG CO	12,949	67.950	879,884.55	
KEURIG DR PEPPER INC	38,244	37.630	1,439,121.72	
KRAFT HEINZ CO/THE	38,438	41.120	1,580,570.56	
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	13,084	102.040	1,335,091.36	
MOLSON COORS BEVERAGE CO - B	9,629	53.670	516,788.43	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	80,596	63.670	5,131,547.32	
MONSTER BEVERAGE CORP	22,202	82.690	1,835,883.38	
PEPSICO INC	78,962	173.300	13,684,114.60	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	89,277	100.490	8,971,445.73	
TYSON FOODS INC-CL A	16,951	93.440	1,583,901.44	
CHURCH & DWIGHT CO INC	14,330	103.910	1,489,030.30	
CLOROX COMPANY	6,542	146.450	958,075.90	
COLGATE-PALMOLIVE CO	46,642	81.000	3,778,002.00	
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	12,953	262.700	3,402,753.10	
KIMBERLY-CLARK CORP	19,856	125.940	2,500,664.64	
PROCTER & GAMBLE CO/THE	137,834	159.010	21,916,984.34	
ABBOTT LABORATORIES	101,062	118.390	11,964,730.18	
ABIOMED INC	2,288	299.640	685,576.32	

ALIGN TECHNOLOGY INC	4,154	406.230	1,687,479.42	
AMERISOURCEBERGEN CORP	9,459	162.620	1,538,222.58	
ANTHEM INC	13,954	509.610	7,111,097.94	
BAXTER INTERNATIONAL INC	29,602	78.070	2,311,028.14	
BECTON DICKINSON AND CO	15,743	269.180	4,237,700.74	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	79,811	43.760	3,492,529.36	
CARDINAL HEALTH INC	15,114	63.300	956,716.20	
CENTENE CORP	31,798	85.810	2,728,586.38	
CERNER CORP	15,537	93.350	1,450,378.95	
CIGNA CORP	19,185	254.820	4,888,721.70	
COOPER COS INC/THE	2,771	402.850	1,116,297.35	
CVS HEALTH CORP	75,780	104.640	7,929,619.20	
DAVITA INC	4,138	119.220	493,332.36	
DENTSPLY SIRONA INC	11,864	48.450	574,810.80	
DEXCOM INC	5,440	490.430	2,667,939.20	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	36,200	120.840	4,374,408.00	
HCA HEALTHCARE INC	13,853	260.890	3,614,109.17	
HENRY SCHEIN INC	7,559	91.040	688,171.36	
HOLOGIC INC	13,592	76.500	1,039,788.00	
HUMANA INC	7,201	449.040	3,233,537.04	
IDEXX LABORATORIES INC	4,980	497.240	2,476,255.20	
INMODE LTD	4,416	31.790	140,384.64	
INSULET CORP	4,263	253.600	1,081,096.80	
INTUITIVE SURGICAL INC	20,553	277.850	5,710,651.05	
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	5,783	268.660	1,553,660.78	
MASIMO CORP	2,941	137.450	404,240.45	
MCKESSON CORP	8,411	322.580	2,713,220.38	
MEDTRONIC PLC	77,105	110.580	8,526,270.90	
MOLINA HEALTHCARE INC	3,428	331.880	1,137,684.64	
NOVOCURE LTD	4,517	82.600	373,104.20	
QUEST DIAGNOSTICS INC	6,814	137.270	935,357.78	
RESMED INC	8,650	237.370	2,053,250.50	
STERIS PLC	5,282	246.520	1,302,118.64	
STRYKER CORP	18,845	262.420	4,945,304.90	
TELADOC HEALTH INC	7,496	66.770	500,507.92	
TELEFLEX INC	2,340	339.690	794,874.60	
UNITEDHEALTH GROUP INC	53,590	533.710	28,601,518.90	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	4,203	149.270	627,381.81	
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	7,675	191.720	1,471,451.00	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	12,580	126.640	1,593,131.20	
10X GENOMICS INC-CLASS A	3,814	71.480	272,624.72	

ABBVIE INC	100,824	167.310	16,868,863.44	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	16,873	125.390	2,115,705.47	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	6,810	159.580	1,086,739.80	
AMGEN INC	32,328	250.040	8,083,293.12	
AVANTOR INC	30,428	30.360	923,794.08	
BIOGEN INC	7,987	208.060	1,661,775.22	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	9,080	82.590	749,917.20	
BIO-RAD LABORATORIES-A	1,220	558.240	681,052.80	
BIO-TECHNE CORP	1,991	412.750	821,785.25	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	127,148	76.550	9,733,179.40	
CATALENT INC	8,935	100.060	894,036.10	
CHARLES RIVER LABORATORIES	2,577	286.650	738,697.05	
DANAHER CORP	36,787	280.740	10,327,582.38	
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	20,811	25.830	537,548.13	
ELI LILLY & CO	46,434	308.080	14,305,386.72	
EXACT SCIENCES CORP	9,771	67.400	658,565.40	
GILEAD SCIENCES INC	72,708	61.630	4,480,994.04	
HORIZON THERAPEUTICS PLC	11,582	112.420	1,302,048.44	
ILLUMINA INC	8,237	344.590	2,838,387.83	
INCYTE CORP	9,243	80.070	740,087.01	
IQVIA HOLDINGS INC	10,637	237.670	2,528,095.79	
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	4,089	160.940	658,083.66	
JOHNSON & JOHNSON	149,808	179.900	26,950,459.20	
MERCK & CO. INC.	144,374	85.630	12,362,745.62	
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	1,258	1,313.770	1,652,722.66	
MODERNA INC	20,087	159.500	3,203,876.50	
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	4,186	98.010	410,269.86	
NOVAVAX INC	3,601	58.100	209,218.10	
PERKINELMER INC	6,979	161.260	1,125,433.54	
PFIZER INC	320,083	53.110	16,999,608.13	
REGENERON PHARMACEUTICALS	5,867	715.790	4,199,539.93	
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	18,344	41.810	766,962.64	
SEAGEN INC	7,790	142.230	1,107,971.70	
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	60,344	10.150	612,491.60	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	22,503	570.940	12,847,862.82	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	14,163	281.150	3,981,927.45	
VIATRIS INC	63,072	10.670	672,978.24	

WATERS CORP	3,425	293.930	1,006,710.25	
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	4,241	384.550	1,630,876.55	
ZOETIS INC	27,326	187.910	5,134,828.66	
BANK OF AMERICA CORP	419,938	39.170	16,448,971.46	
CITIGROUP INC	114,274	50.340	5,752,553.16	
CITIZENS FINANCIAL GROUP	25,225	40.900	1,031,702.50	
FIFTH THIRD BANCORP	37,150	39.630	1,472,254.50	
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	670	632.430	423,728.10	
FIRST REPUBLIC BANK/CA	9,688	155.050	1,502,124.40	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	75,817	13.470	1,021,254.99	
JPMORGAN CHASE & CO	168,263	131.540	22,133,315.02	
KEYCORP	51,128	20.500	1,048,124.00	
M & T BANK CORP	10,715	160.480	1,719,543.20	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	24,474	179.750	4,399,201.50	
REGIONS FINANCIAL CORP	58,274	20.820	1,213,264.68	
SIGNATURE BANK	3,256	268.690	874,854.64	
SVB FINANCIAL GROUP	3,496	506.840	1,771,912.64	
TRUIST FINANCIAL CORP	74,318	52.690	3,915,815.42	
US BANCORP	78,364	50.820	3,982,458.48	
WEBSTER FINANCIAL CORP	9,600	49.550	475,680.00	
WELLS FARGO & CO	228,028	48.420	11,041,115.76	
ALLY FINANCIAL INC	20,139	42.970	865,372.83	
AMERICAN EXPRESS CO	37,834	175.540	6,641,380.36	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	6,380	287.940	1,837,057.20	
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	19,982	55.510	1,109,200.82	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	44,547	47.650	2,122,664.55	
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	74,178	349.740	25,943,013.72	
BLACKROCK INC	8,737	716.830	6,262,943.71	
BLACKSTONE INC	38,948	113.430	4,417,871.64	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	23,654	132.230	3,127,768.42	
CARLYLE GROUP INC/THE	10,094	42.680	430,811.92	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	5,661	117.760	666,639.36	
CME GROUP INC	20,739	236.030	4,895,026.17	
COINBASE GLOBAL INC - CLASS A	2,027	149.850	303,745.95	
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	16,425	111.830	1,836,807.75	
EQUITABLE HOLDINGS INC	22,820	30.400	693,728.00	

FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	1,939	425.600	825,238.40	
FRANKLIN RESOURCES INC	14,298	25.770	368,459.46	
FUTU HOLDINGS LTD-ADR	3,159	34.210	108,069.39	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	19,406	319.780	6,205,650.68	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	32,658	124.830	4,076,698.14	
INVESCO LTD	18,328	21.110	386,904.08	
KKR & CO INC	28,569	55.500	1,585,579.50	
MARKETAXESS HOLDINGS INC	1,912	273.950	523,792.40	
MOODY'S CORP	9,247	332.140	3,071,298.58	
MORGAN STANLEY	77,387	83.930	6,495,090.91	
MSCI INC	4,862	480.310	2,335,267.22	
NASDAQ INC	6,509	180.060	1,172,010.54	
NORTHERN TRUST CORP	11,023	113.500	1,251,110.50	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	9,639	108.180	1,042,747.02	
ROBINHOOD MARKETS INC - A	9,737	11.430	111,293.91	
S&P GLOBAL INC	20,313	397.310	8,070,558.03	
SCHWAB (CHARLES) CORP	83,280	80.070	6,668,229.60	
SEI INVESTMENTS COMPANY	5,481	57.930	317,514.33	
SOFI TECHNOLOGIES INC	27,739	7.480	207,487.72	
STATE STREET CORP	20,939	82.250	1,722,232.75	
SYNCHRONY FINANCIAL	32,112	36.870	1,183,969.44	
T ROWE PRICE GROUP INC	12,314	143.870	1,771,615.18	
TRADEWEB MARKETS INC- CLASS A	5,220	86.020	449,024.40	
UPSTART HOLDINGS INC	1,590	83.960	133,496.40	
AFLAC INC	34,185	64.890	2,218,264.65	
ALLEGHANY CORP	689	848.020	584,285.78	
ALLSTATE CORP	16,419	142.120	2,333,468.28	
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	3,539	145.720	515,703.08	
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	48,577	62.450	3,033,633.65	
AON PLC-CLASS A	12,782	329.290	4,208,984.78	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	20,476	47.690	976,500.44	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	12,291	180.250	2,215,452.75	
ASSURANT INC	3,114	185.980	579,141.72	
BROWN & BROWN INC	14,273	71.940	1,026,799.62	
CHUBB LTD	24,864	214.420	5,331,338.88	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	9,371	136.840	1,282,327.64	
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	1,288	184.940	238,202.72	
EVEREST RE GROUP LTD	2,065	289.920	598,684.80	

FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	13,937	42.560	593,158.72	
GLOBE LIFE INC	6,373	101.440	646,477.12	
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	18,331	74.410	1,364,009.71	
LINCOLN NATIONAL CORP	8,677	63.130	547,779.01	
LOEWS CORP	12,727	64.510	821,018.77	
MARKEL CORP	702	1,480.590	1,039,374.18	
MARSH & MCLENNAN COS	28,143	168.640	4,746,035.52	
METLIFE INC	39,703	70.160	2,785,562.48	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	14,124	72.980	1,030,769.52	
PROGRESSIVE CORP	32,839	115.300	3,786,336.70	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	20,728	115.550	2,395,120.40	
TRAVELERS COS INC/THE	14,464	184.940	2,674,972.16	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	6,823	232.460	1,586,074.58	
WR BERKLEY CORP	11,142	68.520	763,449.84	
CBRE GROUP INC - A	18,244	85.930	1,567,706.92	
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	79,100	4.880	386,008.00	
ZILLOW GROUP INC - A	3,154	45.750	144,295.50	
ZILLOW GROUP INC - C	10,672	47.350	505,319.20	
ACCENTURE PLC-CL A	36,095	326.730	11,793,319.35	
ADOBE INC	27,186	426.770	11,602,169.22	
AFFIRM HOLDINGS INC	9,077	37.480	340,205.96	
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	8,321	117.930	981,295.53	
ANSYS INC	4,983	291.160	1,450,850.28	
ASANA INC - CL A	4,435	34.350	152,342.25	
AUTODESK INC	12,331	196.140	2,418,602.34	
AUTOMATIC DATA PROCESSING	23,443	231.060	5,416,739.58	
AVALARA INC	4,319	94.240	407,022.56	
BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	8,808	42.220	371,873.76	
BILL.COM HOLDINGS INC	4,158	200.540	833,845.32	
BLACK KNIGHT INC	7,623	66.270	505,176.21	
BLOCK INC	29,496	122.890	3,624,763.44	
BROADRIDGE FINANCIAL Solutio	5,889	154.070	907,318.23	
CADENCE DESIGN SYS INC	15,400	153.370	2,361,898.00	
CERIDIAN HCM HOLDING INC	6,979	61.390	428,440.81	
CHECK POINT SOFTWARE TECH	5,880	140.860	828,256.80	
CITRIX SYSTEMS INC	6,490	100.930	655,035.70	
CLOUDFLARE INC - CLASS A	14,179	113.920	1,615,271.68	
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	29,348	86.090	2,526,569.32	
COUPA SOFTWARE INC	3,490	102.780	358,702.20	

CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	10,656	223.510	2,381,722.56	
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	2,795	169.640	474,143.80	
DATADOG INC - CLASS A	11,914	135.500	1,614,347.00	
DOCUSIGN INC	12,031	98.760	1,188,181.56	
DROPBOX INC-CLASS A	16,584	22.470	372,642.48	
DYNATRACE INC	9,587	43.320	415,308.84	
EPAM SYSTEMS INC	3,095	298.130	922,712.35	
FAIR ISAAC CORP	1,494	407.400	608,655.60	
FIDELITY NATIONAL INFO SERV	33,940	101.940	3,459,843.60	
FISERV INC	33,818	98.970	3,346,967.46	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	4,371	250.740	1,095,984.54	
FORTINET INC	8,155	330.100	2,691,965.50	
GARTNER INC	4,568	289.470	1,322,298.96	
GLOBAL PAYMENTS INC	17,139	135.070	2,314,964.73	
GODADDY INC - CLASS A	8,905	82.490	734,573.45	
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	4,731	90.870	429,905.97	
HUBSPOT INC	2,561	443.910	1,136,853.51	
INTL BUSINESS MACHINES CORP	51,574	125.980	6,497,292.52	
INTUIT INC	15,449	461.620	7,131,567.38	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	3,915	200.730	785,857.95	
MASTERCARD INC - A	50,005	345.800	17,291,729.00	
MICROSOFT CORP	404,747	282.060	114,162,938.82	
MONGODB INC	3,155	414.070	1,306,390.85	
NORTONLIFELOCK INC	31,347	26.430	828,501.21	
OKTA INC	8,044	143.360	1,153,187.84	
ORACLE CORP	94,141	79.330	7,468,205.53	
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	98,735	12.460	1,230,238.10	
PALO ALTO NETWORKS INC	5,746	611.890	3,515,919.94	
PAYCHEX INC	17,729	136.590	2,421,604.11	
PAYCOM SOFTWARE INC	3,007	317.450	954,572.15	
PAYPAL HOLDINGS INC	64,104	108.250	6,939,258.00	
PTC INC	5,462	100.560	549,258.72	
RINGCENTRAL INC-CLASS A	3,992	108.060	431,375.52	
SALESFORCE INC	55,955	194.810	10,900,593.55	
SERVICENOW INC	11,453	510.210	5,843,435.13	
SNOWFLAKE INC-CLASS A	11,562	210.940	2,438,888.28	
SPLUNK INC	9,792	130.510	1,277,953.92	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	11,546	70.990	819,650.54	

SYNOPSYS INC	8,565	310.830	2,662,258.95	
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	24,100	65.840	1,586,744.00	
TWILIO INC - A	8,993	144.840	1,302,546.12	
TYLER TECHNOLOGIES INC	2,406	412.230	991,825.38	
UNITY SOFTWARE INC	2,853	90.080	256,998.24	
VERISIGN INC	5,227	213.340	1,115,128.18	
VISA INC-CLASS A SHARES	95,103	211.400	20,104,774.20	
VMWARE INC-CLASS A	12,723	111.790	1,422,304.17	
WESTERN UNION CO	21,840	18.630	406,879.20	
WIX.COM LTD	3,194	93.940	300,044.36	
WORKDAY INC-CLASS A	10,736	225.970	2,426,013.92	
ZENDESK INC	6,067	123.380	748,546.46	
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	12,049	106.580	1,284,182.42	
ZSCALER INC	4,551	223.000	1,014,873.00	
AMPHENOL CORP-CL A	35,157	71.800	2,524,272.60	
APPLE INC	930,837	167.660	156,064,131.42	
ARISTA NETWORKS INC	12,952	127.420	1,650,343.84	
ARROW ELECTRONICS INC	4,130	107.940	445,792.20	
CDW CORP/DE	7,404	171.650	1,270,896.60	
CISCO SYSTEMS INC	240,838	51.820	12,480,225.16	
COGNEX CORP	8,698	70.830	616,079.34	
CORNING INC	45,688	33.550	1,532,832.40	
DELL TECHNOLOGIES -C	14,550	47.100	685,305.00	
F5 INC	3,921	206.080	808,039.68	
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	71,283	15.410	1,098,471.03	
HP INC	65,388	37.890	2,477,551.32	
IPG PHOTONICS CORP	1,776	99.270	176,303.52	
JUNIPER NETWORKS INC	17,460	34.220	597,481.20	
KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	11,039	146.660	1,618,979.74	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	9,212	232.370	2,140,592.44	
NETAPP INC	13,273	76.390	1,013,924.47	
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	11,800	83.150	981,170.00	
TE CONNECTIVITY LTD	19,220	123.400	2,371,748.00	
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	2,844	477.650	1,358,436.60	
TRIMBLE INC	12,759	69.590	887,898.81	
WESTERN DIGITAL CORP	18,492	47.500	878,370.00	
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP- CL A	3,257	402.210	1,309,997.97	
ADVANCED MICRO DEVICES	93,559	95.100	8,897,460.90	
ANALOG DEVICES INC	30,985	155.500	4,818,167.50	

APPLIED MATERIALS INC	51,912	114.560	5,947,038.72	
BROADCOM INC	23,489	585.070	13,742,709.23	
ENPHASE ENERGY INC	7,293	185.950	1,356,133.35	
ENTEGRIS INC	7,892	110.310	870,566.52	
INTEL CORP	232,509	46.500	10,811,668.50	
KLA CORP	8,854	330.250	2,924,033.50	
LAM RESEARCH CORP	7,779	467.000	3,632,793.00	
MARVELL TECHNOLOGY INC	45,111	60.130	2,712,524.43	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	30,238	65.470	1,979,681.86	
MICRON TECHNOLOGY INC	64,636	71.960	4,651,206.56	
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	2,676	401.040	1,073,183.04	
NVIDIA CORP	142,103	215.040	30,557,829.12	
NXP SEMICONDUCTORS NV	14,457	166.230	2,403,187.11	
ON SEMICONDUCTOR	24,630	53.140	1,308,838.20	
QORVO INC	6,042	114.100	689,392.20	
QUALCOMM INC	64,123	136.090	8,726,499.07	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	8,757	120.340	1,053,817.38	
SOLAREEDGE TECHNOLOGIES INC	2,634	301.450	794,019.30	
TERADYNE INC	8,542	108.180	924,073.56	
TEXAS INSTRUMENTS INC	52,879	173.000	9,148,067.00	
AT&T INC	408,894	19.560	7,997,966.64	
LIBERTY GLOBAL PLC- C	21,079	25.520	537,936.08	
LIBERTY GLOBAL PLC-A	8,432	24.970	210,547.04	
LUMEN TECHNOLOGIES INC	49,758	11.400	567,241.20	
T-MOBILE US INC	36,145	131.440	4,750,898.80	
VERIZON COMMUNICATIONS INC	236,606	53.670	12,698,644.02	
AES CORP	33,656	24.450	822,889.20	
ALLIANT ENERGY CORP	13,644	64.630	881,811.72	
AMEREN CORPORATION	14,760	96.750	1,428,030.00	
AMERICAN ELECTRIC POWER	27,967	102.310	2,861,303.77	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	10,241	168.550	1,726,120.55	
ATMOS ENERGY CORP	6,965	120.200	837,193.00	
CENTERPOINT ENERGY INC	37,091	32.250	1,196,184.75	
CMS ENERGY CORP	16,996	72.830	1,237,818.68	
CONSOLIDATED EDISON INC	21,051	97.800	2,058,787.80	
CONSTELLATION ENERGY	18,329	61.870	1,134,015.23	
DOMINION ENERGY INC	47,030	87.390	4,109,951.70	
DTE ENERGY COMPANY	10,536	137.850	1,452,387.60	
DUKE ENERGY CORP	44,466	115.420	5,132,265.72	
EDISON INTERNATIONAL	21,701	71.880	1,559,867.88	

ENERGY CORP	10,866	123.310	1,339,886.46	
ESSENTIAL UTILITIES INC	13,909	51.070	710,332.63	
EVERGY INC	14,377	71.350	1,025,798.95	
EVERSOURCE ENERGY	19,764	92.840	1,834,889.76	
EXELON CORP	54,987	48.050	2,642,125.35	
FIRSTENERGY CORP	31,966	47.140	1,506,877.24	
NEXTERA ENERGY INC	112,369	83.890	9,426,635.41	
NISOURCE INC	18,919	32.110	607,489.09	
NRG ENERGY INC	13,547	38.870	526,571.89	
P G & E CORP	76,538	12.530	959,021.14	
PPL CORP	39,561	28.830	1,140,543.63	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	27,231	71.920	1,958,453.52	
SEMPRA ENERGY	18,666	169.630	3,166,313.58	
SOUTHERN CO/THE	61,390	75.540	4,637,400.60	
UGI CORP	10,588	35.970	380,850.36	
VISTRA CORP	25,777	24.050	619,936.85	
WEC ENERGY GROUP INC	18,827	104.410	1,965,727.07	
XCEL ENERGY INC	29,237	74.730	2,184,881.01	
ACTIVISION BLIZZARD INC	43,065	79.540	3,425,390.10	
ALPHABET INC-CL A	17,091	2,554.290	43,655,370.39	
ALPHABET INC-CL C	16,249	2,567.490	41,719,145.01	
AMC ENTERTAINMENT HLDS-CL A	27,658	17.420	481,802.36	
CABLE ONE INC	246	1,440.620	354,392.52	
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	7,002	549.120	3,844,938.24	
COMCAST CORP-CLASS A	260,545	47.250	12,310,751.25	
DISH NETWORK CORP-A	12,937	31.780	411,137.86	
ELECTRONIC ARTS INC	15,352	123.570	1,897,046.64	
FOX CORP - CLASS A	16,962	38.840	658,804.08	
FOX CORP - CLASS B	8,773	35.610	312,406.53	
IAC/INTERACTIVECORP	3,974	99.720	396,287.28	
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	19,626	33.870	664,732.62	
LIBERTY BROADBAND-A	1,312	132.500	173,840.00	
LIBERTY BROADBAND-C	8,196	137.330	1,125,556.68	
LIBERTY MEDIA CORP- LIBERTY-C	10,288	67.530	694,748.64	
LIBERTY MEDIA COR- SIRIUSXM A	4,141	45.000	186,345.00	
LIBERTY MEDIA COR- SIRIUSXM C	7,648	45.010	344,236.48	
LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	8,770	108.340	950,141.80	

	MATCH GROUP INC	15,249	94.130	1,435,388.37	
	META PLATFORMS INC-CLASS A	134,599	214.140	28,823,029.86	
	NETFLIX INC	25,368	344.100	8,729,128.80	
	NEWS CORP - CLASS A	23,102	20.960	484,217.92	
	OMNICOM GROUP	12,545	77.920	977,506.40	
	PARAMOUNT GLOBAL-CLASS B	32,381	36.060	1,167,658.86	
	PINTEREST INC- CLASS A	28,563	22.680	647,808.84	
	ROKU INC	6,012	113.580	682,842.96	
	SEA LTD-ADR	18,531	108.800	2,016,172.80	
	SIRIUS XM HOLDINGS INC	67,656	6.520	441,117.12	
	SNAP INC - A	64,099	33.570	2,151,803.43	
	TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	7,149	138.360	989,135.64	
	TWITTER INC	45,558	44.480	2,026,419.84	
	WALT DISNEY CO/THE	103,753	130.840	13,575,042.52	
	WARNER BROS DISCOVERY INC	123,410	24.680	3,045,758.80	
	ZOOMINFO TECHNOLOGIES INC	15,382	54.360	836,165.52	
	アメリカ・ドル小計	18,020,800		2,173,644,264.68 (273,053,192,529)	
カナダ・ ドル	CAMECO CORP	18,890	39.110	738,787.90	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	68,240	81.500	5,561,560.00	
	CENOVUS ENERGY INC	75,060	21.590	1,620,545.40	
	ENBRIDGE INC	116,715	58.320	6,806,818.80	
	IMPERIAL OIL LTD	12,999	64.700	841,035.30	
	KEYERA CORP	11,374	33.980	386,488.52	
	PARKLAND CORP	7,666	36.750	281,725.50	
	PEMBINA PIPELINE CORP	32,172	49.330	1,587,044.76	
	SUNCOR ENERGY INC	85,505	41.360	3,536,486.80	
	TC ENERGY CORP	53,918	72.180	3,891,801.24	
	TOURMALINE OIL CORP	16,638	60.790	1,011,424.02	
	AGNICO EAGLE MINES LTD	27,243	82.020	2,234,470.86	
	BARRICK GOLD CORP	102,105	32.170	3,284,717.85	
	CCL INDUSTRIES INC - CL B	8,705	57.000	496,185.00	
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	31,672	39.860	1,262,445.92	
	FRANCO-NEVADA CORP	11,432	208.310	2,381,399.92	
	IVANHOE MINES LTD-CL A	32,698	11.520	376,680.96	
	KINROSS GOLD CORP	63,501	7.750	492,132.75	
	LUNDIN MINING CORP	46,446	12.840	596,366.64	
	NUTRIEN LTD	33,270	137.570	4,576,953.90	
	PAN AMERICAN SILVER CORP	11,763	36.810	432,996.03	
	TECK RESOURCES LTD-CLS B	24,814	50.730	1,258,814.22	

WEST FRASER TIMBER CO LTD	4,438	95.680	424,627.84	
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	24,335	63.320	1,540,892.20	
BALLARD POWER SYSTEMS INC	17,008	13.110	222,974.88	
CAE INC	17,963	32.160	577,690.08	
TOROMONT INDUSTRIES LTD	3,843	119.070	457,586.01	
WSP GLOBAL INC	6,141	158.180	971,383.38	
GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	9,913	41.000	406,433.00	
RITCHIE BROS AUCTIONEERS	5,667	72.100	408,590.70	
THOMSON REUTERS CORP	9,710	134.080	1,301,916.80	
AIR CANADA	12,083	22.220	268,484.26	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	40,807	155.210	6,333,654.47	
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	53,134	94.530	5,022,757.02	
TFI INTERNATIONAL INC	5,097	103.840	529,272.48	
MAGNA INTERNATIONAL INC	16,331	76.740	1,253,240.94	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	9,066	44.200	400,717.20	
RESTAURANT BRANDS INTERN	17,686	74.630	1,319,906.18	
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	3,001	191.130	573,581.13	
DOLLARAMA INC	17,025	72.650	1,236,866.25	
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	48,248	56.670	2,734,214.16	
EMPIRE CO LTD 'A'	9,148	45.090	412,483.32	
LOBLAW COMPANIES LTD	8,683	118.110	1,025,549.13	
METRO INC/CN	13,109	72.950	956,301.55	
WESTON (GEORGE) LTD	4,984	160.930	802,075.12	
SAPUTO INC	13,425	30.310	406,911.75	
BAUSCH HEALTH COS INC	16,447	28.370	466,601.39	
CANOPY GROWTH CORP	11,251	8.560	96,308.56	
BANK OF MONTREAL	36,684	143.110	5,249,847.24	
BANK OF NOVA SCOTIA	68,902	85.750	5,908,346.50	
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	26,066	145.080	3,781,655.28	
NATIONAL BANK OF CANADA	19,626	93.730	1,839,544.98	
ROYAL BANK OF CANADA	80,808	136.450	11,026,251.60	
TORONTO-DOMINION BANK	104,525	94.590	9,887,019.75	
BROOKFIELD ASSET MANAGE- CL A	80,030	68.050	5,446,041.50	
IGM FINANCIAL INC	4,949	42.400	209,837.60	
ONEX CORPORATION	4,217	81.030	341,703.51	
TMX GROUP LTD	3,142	129.400	406,574.80	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	1,393	685.390	954,748.27	

	GREAT-WEST LIFECO INC	14,200	36.910	524,122.00	
	IA FINANCIAL CORP INC	4,851	74.190	359,895.69	
	INTACT FINANCIAL CORP	10,095	182.900	1,846,375.50	
	MANULIFE FINANCIAL CORP	110,844	26.760	2,966,185.44	
	POWER CORP OF CANADA	31,768	38.720	1,230,056.96	
	SUN LIFE FINANCIAL INC	33,220	69.980	2,324,735.60	
	FIRSTSERVICE CORP	2,516	171.620	431,795.92	
	BLACKBERRY LTD	25,993	8.460	219,900.78	
	CGI INC	11,493	101.890	1,171,021.77	
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	1,098	2,177.000	2,390,346.00	
	LIGHTSPEED COMMERCE INC	6,363	31.030	197,443.89	
	NUVEI CORP-SUBORDINATE VTG	5,042	82.540	416,166.68	
	OPEN TEXT CORP	15,337	53.420	819,302.54	
	SHOPIFY INC - CLASS A	6,582	747.230	4,918,267.86	
	BCE INC	5,509	72.850	401,330.65	
	ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	20,818	73.800	1,536,368.40	
	TELUS CORP	15,222	33.430	508,871.46	
	ALGONQUIN POWER & UTILITIES	44,154	19.830	875,573.82	
	ALTAGAS LTD	17,347	30.470	528,563.09	
	BROOKFIELD RENEWABLE COR- A	6,336	50.350	319,017.60	
	CANADIAN UTILITIES LTD-A	7,344	39.640	291,116.16	
	EMERA INC	14,279	64.660	923,280.14	
	FORTIS INC	25,895	64.510	1,670,486.45	
	HYDRO ONE LTD	18,821	35.370	665,698.77	
	NORTHLAND POWER INC	10,870	39.890	433,604.30	
	QUEBECOR INC -CL B	9,953	31.610	314,614.33	
	SHAW COMMUNICATIONS INC-B	27,232	39.060	1,063,681.92	
	カナダ・ドル小計	2,224,893		148,207,296.84 (14,727,359,087)	
オースト ラリア・ ドル	AMPOL LTD	10,927	31.680	346,167.36	
	SANTOS LTD	182,883	8.000	1,463,064.00	
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	14,025	28.100	394,102.50	
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	54,981	32.060	1,762,690.86	
	BHP GROUP LTD	287,051	51.720	14,846,277.72	
	BLUESCOPE STEEL LTD	25,462	21.260	541,322.12	
	EVOLUTION MINING LTD	84,420	4.500	379,890.00	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	88,448	21.170	1,872,444.16	

JAMES HARDIE INDUSTRIES- CDI	26,108	40.670	1,061,812.36	
MINERAL RESOURCES LTD	11,662	59.160	689,923.92	
NEWCREST MINING LTD	54,082	27.860	1,506,724.52	
NORTHERN STAR RESOURCES LTD	65,844	10.820	712,432.08	
ORICA LTD	17,981	15.990	287,516.19	
RIO TINTO LTD	21,049	118.090	2,485,676.41	
SOUTH32 LTD	276,348	5.050	1,395,557.40	
REECE LTD	19,309	17.020	328,639.18	
BRAMBLES LTD	74,638	9.850	735,184.30	
AURIZON HOLDINGS LTD	94,440	3.790	357,927.60	
QANTAS AIRWAYS LTD	45,831	5.080	232,821.48	
ARISTOCRAT LEISURE LTD	30,749	32.810	1,008,874.69	
CROWN RESORTS LTD	21,863	12.810	280,065.03	
DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L	3,794	79.800	302,761.20	
IDP EDUCATION LTD	10,940	27.320	298,880.80	
TABCORP HOLDINGS LTD	139,785	5.360	749,247.60	
WESFARMERS LTD	65,345	47.960	3,133,946.20	
COLES GROUP LTD	79,056	18.340	1,449,887.04	
ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALI	65,607	7.670	503,205.69	
WOOLWORTHS GROUP LTD	69,646	38.120	2,654,905.52	
TREASURY WINE ESTATES LTD	36,464	11.150	406,573.60	
COCHLEAR LTD	4,095	222.420	910,809.90	
RAMSAY HEALTH CARE LTD	9,446	64.310	607,472.26	
SONIC HEALTHCARE LTD	24,258	35.020	849,515.16	
CSL LTD	27,463	261.970	7,194,482.11	
AUST AND NZ BANKING GROUP	156,874	27.420	4,301,485.08	
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	97,957	106.710	10,452,991.47	
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	187,025	32.940	6,160,603.50	
WESTPAC BANKING CORP	213,258	24.140	5,148,048.12	
ASX LTD	11,180	82.500	922,350.00	
MACQUARIE GROUP LTD	18,953	203.130	3,849,922.89	
INSURANCE AUSTRALIA GROUP	117,187	4.290	502,732.23	
MEDIBANK PRIVATE LTD	128,724	3.110	400,331.64	
QBE INSURANCE GROUP LTD	80,863	11.760	950,948.88	
SUNCORP GROUP LTD	63,933	11.000	703,263.00	
COMPUTERSHARE LTD	33,563	25.210	846,123.23	
WISETECH GLOBAL LTD	7,909	47.340	374,412.06	
XERO LTD	7,459	101.170	754,627.03	

	TELSTRA CORP LTD	254,603	4.020	1,023,504.06	
	ORIGIN ENERGY LTD	117,278	6.440	755,270.32	
	REA GROUP LTD	2,833	129.700	367,440.10	
	SEEK LTD	17,266	28.190	486,728.54	
	オーストラリア・ドル小計	3,560,865		89,751,583.11 (8,397,158,116)	
香港・ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	153,924	56.400	8,681,313.60	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	83,000	109.700	9,105,100.00	
	XINYI GLASS HOLDINGS LTD	94,000	17.740	1,667,560.00	
	MTR CORP	84,500	41.700	3,523,650.00	
	SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	70,000	26.700	1,869,000.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	118,000	45.300	5,345,400.00	
	SANDS CHINA LTD	142,400	17.880	2,546,112.00	
	CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROU	117,000	13.180	1,542,060.00	
	BUDWEISER BREWING CO APAC LT	89,600	19.980	1,790,208.00	
	WH GROUP LTD	581,500	5.160	3,000,540.00	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	187,500	30.250	5,671,875.00	
	HANG SENG BANK LTD	48,200	151.200	7,287,840.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	67,100	343.400	23,042,140.00	
	AIA GROUP LTD	694,800	80.850	56,174,580.00	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	126,924	54.000	6,853,896.00	
	ESR CAYMAN LTD	102,000	23.250	2,371,500.00	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	98,000	16.140	1,581,720.00	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	83,384	32.950	2,747,502.80	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	84,833	31.500	2,672,239.50	
	SINO LAND CO	248,200	10.620	2,635,884.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	68,000	93.450	6,354,600.00	
	SWIRE PACIFIC LTD - CL A	27,000	45.100	1,217,700.00	
	SWIRE PROPERTIES LTD	53,000	20.000	1,060,000.00	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	91,000	38.150	3,471,650.00	
CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	41,000	53.350	2,187,350.00		
CLP HOLDINGS LTD	94,100	77.050	7,250,405.00		
HONG KONG & CHINA GAS	606,389	9.120	5,530,267.68		
POWER ASSETS HOLDINGS LTD	71,500	52.050	3,721,575.00		

香港・ドル小計		4,326,854		180,903,668.58 (2,899,885,807)	
シンガ ポール・ ドル	KEPPEL CORP LTD	70,500	6.550	461,775.00	
	SINGAPORE TECH ENGINEERING	108,600	4.060	440,916.00	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	77,966	5.350	417,118.10	
	GENTING SINGAPORE LTD	327,500	0.800	262,000.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	103,200	4.610	475,752.00	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	102,000	33.240	3,390,480.00	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	202,300	12.010	2,429,623.00	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	64,700	31.100	2,012,170.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	42,800	9.900	423,720.00	
	CAPITALAND INVESTMENT LTD/SI	136,600	4.020	549,132.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	25,800	8.200	211,560.00	
	UOL GROUP LTD	30,900	7.080	218,772.00	
	VENTURE CORP LTD	15,700	17.050	267,685.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	439,815	2.610	1,147,917.15	
シンガポール・ドル小計		1,748,381		12,708,620.25 (1,170,209,753)	
ニュー ジーラン ド・ドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	70,711	7.505	530,686.05	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	31,250	23.000	718,750.00	
	RYMAN HEALTHCARE LTD	24,028	9.100	218,654.80	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	113,841	4.780	544,159.98	
	MERCURY NZ LTD	26,913	5.970	160,670.61	
	MERIDIAN ENERGY LTD	66,454	4.900	325,624.60	
ニュージーランド・ドル 小計		333,197		2,498,546.04 (214,874,958)	
イギリ ス・ボン ド	BP PLC	1,097,928	3.959	4,346,696.95	
	SHELL PLC	439,968	21.655	9,527,507.04	
	ANGLO AMERICAN PLC	70,253	41.005	2,880,724.26	
	ANTOFAGASTA PLC	19,439	16.785	326,283.61	
	CRODA INTERNATIONAL PLC	7,838	77.280	605,720.64	
	GLENCORE PLC	576,604	5.248	3,026,017.79	
	JOHNSON MATTHEY PLC	10,074	19.050	191,909.70	
	MONDI PLC	25,128	14.270	358,576.56	
	RIO TINTO PLC	64,866	61.540	3,991,853.64	
	ASHTAD GROUP PLC	23,686	45.820	1,085,292.52	
	BAE SYSTEMS PLC	189,839	7.716	1,464,797.72	
	BUNZL PLC	17,064	30.900	527,277.60	
	DCC PLC	5,954	57.860	344,498.44	

FERGUSON PLC	12,017	97.700	1,174,060.90	
MELROSE INDUSTRIES PLC	221,714	1.189	263,617.94	
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	494,144	0.897	443,247.16	
SMITHS GROUP PLC	24,369	14.070	342,871.83	
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	4,459	124.100	553,361.90	
EXPERIAN PLC	54,749	27.530	1,507,239.97	
INTERTEK GROUP PLC	8,184	50.820	415,910.88	
RELX PLC	106,284	24.070	2,558,255.88	
RENTOKIL INITIAL PLC	112,603	5.298	596,570.69	
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	64,766	5.128	332,120.04	
BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE	6,637	40.010	265,546.37	
BURBERRY GROUP PLC	26,233	15.945	418,285.18	
PERSIMMON PLC	16,916	21.830	369,276.28	
TAYLOR WIMPEY PLC	225,588	1.324	298,678.51	
COMPASS GROUP PLC	97,177	16.440	1,597,589.88	
ENTAIN PLC	37,600	15.370	577,912.00	
INTERCONTINENTAL HOTELS GROU	9,587	48.950	469,283.65	
WHITBREAD PLC	11,282	28.080	316,798.56	
JD SPORTS FASHION PLC	144,300	1.474	212,698.20	
KINGFISHER PLC	109,678	2.607	285,930.54	
NEXT PLC	6,860	61.400	421,204.00	
OCADO GROUP PLC	27,379	11.845	324,304.25	
SAINSBURY (J) PLC	113,480	2.446	277,572.08	
TESCO PLC	439,670	2.706	1,189,747.02	
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	16,771	16.330	273,870.43	
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	125,847	32.700	4,115,196.90	
COCA-COLA HBC AG-DI	8,704	15.620	135,956.48	
DIAGEO PLC	134,031	39.655	5,314,999.30	
IMPERIAL BRANDS PLC	50,003	16.780	839,050.34	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	40,047	58.460	2,341,147.62	
UNILEVER PLC	147,693	34.320	5,068,823.76	
NMC HEALTH PLC	3,940	0.010	39.40	
SMITH & NEPHEW PLC	44,355	12.115	537,360.82	
ASTRAZENECA PLC	88,548	105.040	9,301,081.92	
GLAXOSMITHKLINE PLC	289,657	17.838	5,166,901.56	
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	7,581	20.660	156,623.46	
BARCLAYS PLC	904,741	1.432	1,295,589.11	
HSBC HOLDINGS PLC	1,167,394	5.193	6,062,277.04	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	4,178,120	0.441	1,842,550.92	

	NATWEST GROUP PLC	316,287	2.160	683,179.92	
	STANDARD CHARTERED PLC	146,561	5.014	734,856.85	
	3I GROUP PLC	49,338	13.200	651,261.60	
	ABRDN PLC	123,263	2.026	249,730.83	
	HARGREAVES LANSDOWN PLC	19,572	10.015	196,013.58	
	LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	17,716	81.700	1,447,397.20	
	M&G PLC	133,064	2.136	284,224.70	
	SCHRODERS PLC	6,213	31.780	197,449.14	
	ST JAMES'S PLACE PLC	33,823	13.910	470,477.93	
	ADMIRAL GROUP PLC	11,535	25.120	289,759.20	
	AVIVA PLC	229,027	4.289	982,296.80	
	LEGAL & GENERAL GROUP PLC	313,637	2.714	851,210.81	
	PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	36,851	6.208	228,771.00	
	PRUDENTIAL PLC	161,840	10.655	1,724,405.20	
	AVEVA GROUP PLC	6,037	24.400	147,302.80	
	SAGE GROUP PLC/THE	55,987	7.182	402,098.63	
	HALMA PLC	24,375	24.450	595,968.75	
	BT GROUP PLC	545,432	1.937	1,056,501.78	
	VODAFONE GROUP PLC	1,546,057	1.306	2,019,150.44	
	NATIONAL GRID PLC	199,260	11.940	2,379,164.40	
	SEVERN TRENT PLC	12,418	30.610	380,114.98	
	SSE PLC	64,516	17.835	1,150,642.86	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	42,035	11.400	479,199.00	
	AUTO TRADER GROUP PLC	51,319	6.382	327,517.85	
	INFORMA PLC	78,152	6.074	474,695.24	
	PEARSON PLC	39,623	7.794	308,821.66	
	WPP PLC	63,987	9.718	621,825.66	
	イギリス・ポンド小計	16,459,674		105,674,748.05 (17,248,232,377)	
イスラエル・シュケル	ICL GROUP LTD	41,773	38.080	1,590,715.84	
	ELBIT SYSTEMS LTD	1,389	696.000	966,744.00	
	BANK HAPOLIM BM	66,403	31.600	2,098,334.80	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	77,079	34.670	2,672,328.93	
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	54,674	19.990	1,092,933.26	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	9,249	124.900	1,155,200.10	
	AZRIELI GROUP LTD	2,140	278.500	595,990.00	
	NICE LTD	3,251	695.100	2,259,770.10	
	イスラエル・シュケル小計	255,958		12,432,017.03 (486,295,751)	
スイス・フラン	CLARIANT AG-REG	10,101	15.560	157,171.56	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	356	865.000	307,940.00	

GIVAUDAN-REG	521	3,852.000	2,006,892.00	
HOLCIM LTD	31,603	42.880	1,355,136.64	
SIKA AG-REG	7,800	306.900	2,393,820.00	
ABB LTD-REG	96,015	29.050	2,789,235.75	
GEBERIT AG-REG	1,986	550.800	1,093,888.80	
SCHINDLER HOLDING AG-REG	941	188.600	177,472.60	
SCHINDLER HOLDING-PART CERT	2,132	190.400	405,932.80	
VAT GROUP AG	1,436	319.400	458,658.40	
ADECCO GROUP AG-REG	9,118	38.980	355,419.64	
SGS SA-REG	374	2,525.000	944,350.00	
KUEHNE + NAGEL INTL AG- REG	2,981	256.200	763,732.20	
CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG	30,335	116.500	3,534,027.50	
SWATCH GROUP AG/THE-BR	1,716	249.500	428,142.00	
SWATCH GROUP AG/THE-REG	2,516	47.740	120,113.84	
BARRY CALLEBAUT AG-REG	216	2,256.000	487,296.00	
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT- PC	59	11,140.000	657,260.00	
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT- REG	6	114,300.000	685,800.00	
NESTLE SA-REG	160,218	122.840	19,681,179.12	
ALCON INC	29,513	75.060	2,215,245.78	
SONOVA HOLDING AG-REG	3,269	377.000	1,232,413.00	
STRAUMANN HOLDING AG-REG	531	1,304.500	692,689.50	
BACHEM HOLDING AG-REG B	322	502.000	161,644.00	
LONZA GROUP AG-REG	4,343	666.400	2,894,175.20	
NOVARTIS AG-REG	125,305	86.670	10,860,184.35	
ROCHE HOLDING AG-BR	1,921	419.600	806,051.60	
ROCHE HOLDING AG- GENUSSCHEIN	40,075	389.300	15,601,197.50	
VIFOR PHARMA AG	2,638	169.150	446,217.70	
CREDIT SUISSE GROUP AG- REG	145,488	7.154	1,040,821.15	
JULIUS BAER GROUP LTD	12,550	51.240	643,062.00	
PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,203	1,131.500	1,361,194.50	
UBS GROUP AG-REG	204,228	16.810	3,433,072.68	
BALOISE HOLDING AG - REG	2,475	173.500	429,412.50	
SWISS LIFE HOLDING AG-REG	1,834	616.600	1,130,844.40	
SWISS RE AG	16,690	88.360	1,474,728.40	
ZURICH INSURANCE GROUP AG	8,712	455.300	3,966,573.60	
SWISS PRIME SITE-REG	3,906	94.950	370,874.70	
TEMENOS AG - REG	3,743	86.900	325,266.70	

	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	10,426	66.600	694,371.60	
	SWISSCOM AG-REG	1,399	567.400	793,792.60	
	スイス・フラン小計	981,001		89,377,302.31 (12,024,822,253)	
デンマーク・クローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	5,509	542.400	2,988,081.60	
	NOVOZYMES A/S-B SHARES	11,512	465.700	5,361,138.40	
	ROCKWOOL A/S-B SHS	513	2,002.000	1,027,026.00	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	60,424	202.400	12,229,817.60	
	AP MOLLER-MAERSK A/S-A	168	17,230.000	2,894,640.00	
	AP MOLLER-MAERSK A/S-B	311	17,645.000	5,487,595.00	
	DSV A/S	11,866	1,128.000	13,384,848.00	
	PANDORA A/S	5,888	628.400	3,700,019.20	
	CARLSBERG AS-B	5,585	833.200	4,653,422.00	
	AMBU A/S-B	8,356	105.250	879,469.00	
	COLOPLAST-B	6,399	1,073.000	6,866,127.00	
	DEMANT A/S	8,178	298.200	2,438,679.60	
	GN STORE NORD A/S	6,484	280.000	1,815,520.00	
	GENMAB A/S	3,688	2,528.000	9,323,264.00	
	NOVO NORDISK A/S-B	96,328	794.000	76,484,432.00	
	DANSKE BANK A/S	39,103	114.500	4,477,293.50	
TRYG A/S	16,989	167.750	2,849,904.75		
ORSTED A/S	10,423	816.100	8,506,210.30		
	デンマーク・クローネ小計	297,724		165,367,487.95 (3,019,610,330)	
ノルウェー・クローネ	AKER BP ASA	6,316	349.100	2,204,915.60	
	EQUINOR ASA	55,409	332.350	18,415,181.15	
	NORSK HYDRO ASA	83,294	87.100	7,254,907.40	
	YARA INTERNATIONAL ASA	9,005	486.300	4,379,131.50	
	MOWI ASA	23,318	248.800	5,801,518.40	
	ORKLA ASA	46,955	78.660	3,693,480.30	
	DNB BANK ASA	52,746	195.950	10,335,578.70	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	11,412	216.600	2,471,839.20	
	TELENOR ASA	40,694	130.850	5,324,809.90	
	ADEVINTA ASA	15,540	82.150	1,276,611.00	
	SCHIBSTED ASA-B SHS	5,480	189.700	1,039,556.00	
	SCHIBSTED ASA-CL A	3,338	210.600	702,982.80	
	ノルウェー・クローネ小計	353,507		62,900,511.95 (900,106,326)	
スウェーデン・クローナ	LUNDIN ENERGY AB	13,316	423.900	5,644,652.40	
	BOLIDEN AB	15,297	490.400	7,501,648.80	
	SVENSKA CELLULOSA AB SCA-B	34,370	193.100	6,636,847.00	

ALFA LAVAL AB	18,697	312.000	5,833,464.00	
ASSA ABLOY AB-B	60,292	248.100	14,958,445.20	
ATLAS COPCO AB-A SHS	37,342	467.200	17,446,182.40	
ATLAS COPCO AB-B SHS	22,320	409.000	9,128,880.00	
EPIROC AB-A	34,230	194.300	6,650,889.00	
EPIROC AB-B	19,836	163.100	3,235,251.60	
HUSQVARNA AB-B SHS	18,593	91.780	1,706,465.54	
INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	8,223	291.300	2,395,359.90	
LIFCO AB-B SHS	15,149	220.400	3,338,839.60	
NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	89,271	103.450	9,235,084.95	
SANDVIK AB	61,070	191.400	11,688,798.00	
SKANSKA AB-B SHS	17,183	205.000	3,522,515.00	
SKF AB-B SHARES	20,607	152.950	3,151,840.65	
VOLVO AB-A SHS	13,283	160.100	2,126,608.30	
VOLVO AB-B SHS	80,338	155.700	12,508,626.60	
SECURITAS AB-B SHS	16,123	112.400	1,812,225.20	
ELECTROLUX AB-B	11,555	148.960	1,721,232.80	
EVOLUTION AB	10,669	991.100	10,574,045.90	
HENNES & MAURITZ AB-B SHS	40,148	131.360	5,273,841.28	
SWEDISH MATCH AB	84,640	77.240	6,537,593.60	
ESSITY AKTIEBOLAG-B	36,076	227.700	8,214,505.20	
GETINGE AB-B SHS	13,151	361.900	4,759,346.90	
NORDEA BANK ABP	184,357	97.760	18,022,740.32	
SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	100,891	107.850	10,881,094.35	
SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	77,668	93.540	7,265,064.72	
SWEDBANK AB - A SHARES	57,603	156.950	9,040,790.85	
EQT AB	15,443	361.000	5,574,923.00	
INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	7,211	262.300	1,891,445.30	
INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	10,642	257.300	2,738,186.60	
INVESTOR AB-A SHS	27,415	222.200	6,091,613.00	
INVESTOR AB-B SHS	101,275	206.400	20,903,160.00	
KINNEVIK AB - B	12,465	236.400	2,946,726.00	
LUNDBERGS AB-B SHS	3,368	486.000	1,636,848.00	
FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	5,323	579.200	3,083,081.60	
SAGAX AB-B	9,651	265.000	2,557,515.00	
SINCH AB	27,690	61.750	1,709,857.50	
ERICSSON LM-B SHS	159,685	89.420	14,279,032.70	
HEXAGON AB-B SHS	117,010	132.700	15,527,227.00	
TELE2 AB-B SHS	25,537	148.800	3,799,905.60	
TELIA CO AB	143,404	39.240	5,627,172.96	

	EMBRACER GROUP AB	30,012	81.750	2,453,481.00	
	スウェーデン・クローナ 小計	1,908,429		301,633,055.32 (3,972,507,339)	
ユーロ	ENI SPA	146,752	13.866	2,034,863.23	
	GALP ENERGIA SGPS SA	25,920	11.975	310,392.00	
	NESTE OYJ	23,055	44.360	1,022,719.80	
	OMV AG	8,389	43.890	368,193.21	
	REPSOL SA	79,358	13.235	1,050,303.13	
	TENARIS SA	25,963	14.855	385,680.36	
	TOTALENERGIES SE	142,236	46.425	6,603,306.30	
	AIR LIQUIDE SA	26,340	162.100	4,269,714.00	
	AKZO NOBEL N.V.	9,886	77.060	761,815.16	
	ARCELORMITTAL	37,054	29.280	1,084,941.12	
	ARKEMA	3,250	107.250	348,562.50	
	BASF SE	53,726	51.960	2,791,602.96	
	COVESTRO AG	11,797	43.620	514,585.14	
	CRH PLC	43,426	35.905	1,559,210.53	
	EVONIK INDUSTRIES AG	10,952	24.440	267,666.88	
	FUCHS PETROLUB SE-PREF	3,370	30.380	102,380.60	
	HEIDELBERGCEMENT AG	8,677	50.920	441,832.84	
	KONINKLIJKE DSM NV	10,433	159.250	1,661,455.25	
	LANXESS AG	4,409	36.190	159,561.71	
	SMURFIT KAPPA GROUP PLC	12,921	37.040	478,593.84	
	SOLVAY SA	4,802	88.300	424,016.60	
	STORA ENSO OYJ-R SHS	30,234	18.805	568,550.37	
	SYMRISE AG	6,785	110.350	748,724.75	
	UMICORE	10,288	38.220	393,207.36	
	UPM-KYMMENE OYJ	33,126	31.000	1,026,906.00	
	VOESTALPINE AG	7,382	24.960	184,254.72	
	ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	13,189	24.580	324,185.62	
	AIRBUS SE	34,199	104.660	3,579,267.34	
	ALSTOM	17,665	20.720	366,018.80	
	BOUYGUES SA	11,049	31.020	342,739.98	
	BRENTAG SE	9,920	71.840	712,652.80	
	CNH INDUSTRIAL NV	54,775	14.225	779,174.37	
	COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN	29,471	52.080	1,534,849.68	
	DAIMLER TRUCK HOLDING AG	23,340	23.750	554,325.00	
	DASSAULT AVIATION SA	1,720	156.000	268,320.00	
	EIFFAGE	4,989	91.800	457,990.20	
	FERROVIAL SA	24,693	25.200	622,263.60	
	GEA GROUP AG	8,178	36.720	300,296.16	
	IMCD NV	3,214	148.750	478,082.50	

KINGSPAN GROUP PLC	8,978	84.980	762,950.44	
KION GROUP AG	3,179	54.340	172,746.86	
KNORR-BREMSE AG	3,881	68.300	265,072.30	
KONE OYJ-B	20,623	46.620	961,444.26	
LEGRAND SA	15,079	81.760	1,232,859.04	
MTU AERO ENGINES AG	2,957	188.550	557,542.35	
PRYSMIAN SPA	17,186	30.870	530,531.82	
RATIONAL AG	350	612.500	214,375.00	
SAFRAN SA	20,172	101.540	2,048,264.88	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	31,211	141.860	4,427,592.46	
SIEMENS AG-REG	44,055	116.640	5,138,575.20	
SIEMENS ENERGY AG	19,855	19.375	384,690.62	
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENE	11,482	15.465	177,569.13	
THALES SA	5,403	125.050	675,645.15	
VINCI SA	29,309	90.910	2,664,481.19	
WARTSILA OYJ ABP	26,753	8.390	224,457.67	
BUREAU VERITAS SA	17,817	24.970	444,890.49	
RANDSTAD NV	6,241	50.820	317,167.62	
TELEPERFORMANCE	3,420	334.300	1,143,306.00	
WOLTERS KLUWER	14,578	98.120	1,430,393.36	
ADP	1,346	138.350	186,219.10	
AENA SME SA	4,377	148.500	649,984.50	
ATLANTIA SPA	26,501	21.720	575,601.72	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	33,148	6.897	228,621.75	
DEUTSCHE POST AG-REG	54,453	40.425	2,201,262.52	
GETLINK SE	22,311	16.670	371,924.37	
INPOST SA	10,902	5.342	58,238.48	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	17,873	76.090	1,359,956.57	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE- PRF	2,564	68.400	175,377.60	
CONTINENTAL AG	5,578	64.520	359,892.56	
FAURECIA	6,090	22.700	138,243.00	
FERRARI NV	6,949	206.600	1,435,663.40	
MERCEDES-BENZ GROUP AG	49,868	62.500	3,116,750.00	
MICHELIN (CGDE)	9,617	117.900	1,133,844.30	
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG- PRF	7,765	81.120	629,896.80	
RENAULT SA	8,830	22.170	195,761.10	
STELLANTIS NV	118,658	13.906	1,650,058.14	
VALEO	14,444	16.535	238,831.54	
VOLKSWAGEN AG	1,960	210.800	413,168.00	
VOLKSWAGEN AG-PREF	10,563	151.100	1,596,069.30	
ADIDAS AG	11,195	202.400	2,265,868.00	

ESSILORLUXOTTICA	16,375	161.350	2,642,106.25	
HERMES INTERNATIONAL	1,777	1,263.000	2,244,351.00	
KERING	4,123	531.800	2,192,611.40	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	15,873	630.900	10,014,275.70	
MONCLER SPA	12,209	49.480	604,101.32	
PUMA SE	6,459	73.760	476,415.84	
SEB SA	1,127	124.100	139,860.70	
ACCOR SA	10,451	27.580	288,238.58	
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC-DI	8,869	100.900	894,882.10	
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	5,785	34.990	202,417.15	
SODEXO SA	4,760	69.260	329,677.60	
DELIVERY HERO SE	8,530	38.560	328,916.80	
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL	58,328	20.100	1,172,392.80	
JUST EAT TAKEAWAY	9,307	30.055	279,721.88	
PROSUS NV	54,174	48.005	2,600,622.87	
ZALANDO SE	12,367	44.560	551,073.52	
CARREFOUR SA	35,990	20.080	722,679.20	
COLRUYT SA	2,164	39.550	85,586.20	
HELLOFRESH SE	9,790	38.210	374,075.90	
JERONIMO MARTINS	12,978	21.480	278,767.44	
KESKO OYJ-B SHS	13,402	23.690	317,493.38	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	55,657	29.735	1,654,960.89	
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	49,732	53.970	2,684,036.04	
DANONE	37,154	51.930	1,929,407.22	
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	28,021	10.635	298,003.33	
HEINEKEN HOLDING NV	6,168	71.250	439,470.00	
HEINEKEN NV	14,659	88.600	1,298,787.40	
JDE PEET'S NV	6,660	26.820	178,621.20	
KERRY GROUP PLC-A	8,193	102.050	836,095.65	
PERNOD RICARD SA	11,879	197.150	2,341,944.85	
REMY COINTREAU	1,273	191.100	243,270.30	
BEIERSDORF AG	5,138	94.000	482,972.00	
HENKEL AG & CO KGAA	5,974	58.700	350,673.80	
HENKEL AG & CO KGAA VOR- PREF	11,499	59.460	683,730.54	
L'OREAL	14,230	361.650	5,146,279.50	
AMPLIFON SPA	7,567	40.210	304,269.07	
BIOMERIEUX	2,791	93.200	260,121.20	

CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	2,161	131.450	284,063.45	
DIASORIN SPA	1,313	134.800	176,992.40	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	11,118	62.200	691,539.60	
FRESENIUS SE & CO KGAA	26,317	33.920	892,672.64	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	52,727	27.260	1,437,338.02	
ORPEA	2,695	37.200	100,254.00	
SARTORIUS AG-VORZUG	1,308	383.500	501,618.00	
SIEMENS HEALTHINEERS AG	16,426	55.000	903,430.00	
ARGENX SE	2,644	300.000	793,200.00	
BAYER AG-REG	55,293	67.420	3,727,854.06	
EUROFINS SCIENTIFIC	7,010	96.180	674,221.80	
GRIFOLS SA	15,169	15.400	233,602.60	
IPSEN	1,498	115.000	172,270.00	
MERCK KGAA	7,777	184.200	1,432,523.40	
ORION OYJ-CLASS B	6,261	42.230	264,402.03	
QIAGEN N.V.	12,543	43.800	549,383.40	
RECORDATI INDUSTRIA CHIMICA	4,578	47.680	218,279.04	
SANOFI	65,399	103.220	6,750,484.78	
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	1,555	354.600	551,403.00	
UCB SA	6,623	113.850	754,028.55	
ABN AMRO BANK NV-CVA	28,787	11.715	337,239.70	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	378,832	4.970	1,882,795.04	
BANCO ESPIRITO SANTO-REG	187,906	0.010	1,879.06	
BANCO SANTANDER SA	983,269	3.133	3,080,581.77	
BNP PARIBAS	65,416	48.710	3,186,413.36	
CAIXABANK SA	277,723	3.117	865,662.59	
COMMERZBANK AG	46,644	6.418	299,361.19	
CREDIT AGRICOLE SA	73,102	9.917	724,952.53	
ERSTE GROUP BANK AG	19,383	31.050	601,842.15	
FINECOBANK SPA	32,034	13.955	447,034.47	
ING GROEP NV	230,297	9.340	2,150,973.98	
INTESA SANPAOLO	977,250	1.941	1,896,842.25	
KBC GROUP NV	13,092	62.740	821,392.08	
MEDIOBANCA SPA	31,303	8.934	279,661.00	
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONA	7,066	11.480	81,117.68	
SOCIETE GENERALE SA	41,025	22.525	924,088.12	
UNICREDIT SPA	112,845	9.339	1,053,859.45	
AMUNDI SA	3,955	59.450	235,124.75	
DEUTSCHE BANK AG- REGISTERED	113,478	10.808	1,226,470.22	

DEUTSCHE BOERSE AG	10,701	166.450	1,781,181.45	
EURAZEO SE	1,792	75.750	135,744.00	
EURONEXT NV	5,502	82.200	452,264.40	
EXOR NV	6,204	67.660	419,762.64	
GRUPE BRUXELLES LAMBERT SA	5,914	92.500	547,045.00	
SOFINA	804	318.000	255,672.00	
WENDEL	1,082	90.900	98,353.80	
AEGON NV	91,609	5.092	466,473.02	
AGEAS	11,247	45.880	516,012.36	
ALLIANZ SE-REG	23,552	219.200	5,162,598.40	
ASSICURAZIONI GENERALI	64,729	19.275	1,247,651.47	
AXA SA	113,586	26.775	3,041,265.15	
CNP ASSURANCES	8,978	21.860	196,259.08	
HANNOVER RUECK SE	3,598	149.900	539,340.20	
MUENCHENER RUECKVER AG- REG	8,295	242.800	2,014,026.00	
NN GROUP NV	14,069	47.700	671,091.30	
POSTE ITALIANE SPA	26,562	9.834	261,210.70	
SAMPO OYJ-A SHS	28,454	46.630	1,326,810.02	
AROUNDTOWN SA	52,560	4.976	261,538.56	
LEG IMMOBILIEN SE	3,680	103.300	380,144.00	
VONOVIA SE	43,654	39.970	1,744,850.38	
ADYEN NV	1,069	1,688.800	1,805,327.20	
AMADEUS IT GROUP SA	24,570	55.960	1,374,937.20	
BECHTLE AG	4,305	44.970	193,595.85	
CAPGEMINI SE	8,961	189.950	1,702,141.95	
DASSAULT SYSTEMES SE	39,595	40.820	1,616,267.90	
EDENRED	16,042	48.680	780,924.56	
NEMETSCHEK SE	3,011	82.000	246,902.00	
NEXI SPA	30,853	9.336	288,043.60	
SAP SE	60,055	98.320	5,904,607.60	
WORLDFLINE SA	12,774	35.260	450,411.24	
NOKIA OYJ	296,676	4.867	1,443,922.09	
ASM INTERNATIONAL NV	2,455	297.950	731,467.25	
ASML HOLDING NV	23,576	560.400	13,211,990.40	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	71,533	26.895	1,923,880.03	
STMICROELECTRONICS NV	37,804	34.750	1,313,689.00	
CELLNEX TELECOM SA	29,081	44.060	1,281,308.86	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	188,344	17.056	3,212,395.26	
ELISA OYJ	8,681	55.640	483,010.84	
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	15,804	10.385	164,124.54	
KONINKLIJKE KPN NV	173,603	3.359	583,132.47	

ORANGE	116,269	11.106	1,291,283.51	
PROXIMUS	10,895	17.245	187,884.27	
TELECOM ITALIA SPA	696,355	0.307	213,780.98	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	46,895	2.714	127,273.03	
TELEFONICA SA	316,236	4.822	1,524,889.99	
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	5,269	31.390	165,393.91	
E.ON SE	126,998	10.195	1,294,744.61	
EDF	32,658	8.332	272,106.45	
EDP RENOVAVEIS SA	14,791	22.900	338,713.90	
EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	170,355	4.665	794,706.07	
ELIA GROUP SA/NV	2,106	153.000	322,218.00	
ENAGAS SA	14,471	20.660	298,970.86	
ENDESA SA	14,104	19.425	273,970.20	
ENEL SPA	475,178	6.248	2,968,912.14	
ENGIE	110,679	11.448	1,267,053.19	
FORTUM OYJ	24,312	15.565	378,416.28	
IBERDROLA SA	337,074	10.480	3,532,535.52	
NATURGY ENERGY GROUP SA	12,930	29.330	379,236.90	
RED ELECTRICA CORPORACION SA	23,632	19.240	454,679.68	
RWE AG	34,673	40.480	1,403,563.04	
SNAM SPA	106,707	5.344	570,242.20	
TERNA-RETE ELETTRICA NAZIONA	75,662	8.070	610,592.34	
UNIPER SE	4,697	23.220	109,064.34	
VEOLIA ENVIRONNEMENT	36,122	27.600	996,967.20	
VERBUND AG	3,190	95.300	304,007.00	
BOLLORE SE	39,433	4.512	177,921.69	
PUBLICIS GROUPE	13,301	54.240	721,446.24	
SCOUT24 SE	4,671	60.820	284,090.22	
UBISOFT ENTERTAINMENT	4,745	39.320	186,573.40	
UNIVERSAL MUSIC GROUP NV	44,422	23.995	1,065,905.89	
VIVENDI SE	38,496	11.840	455,792.64	
ユーロ小計	10,772,399		252,923,067.24 (34,359,598,685)	
合計	61,243,682		372,473,853,310 (372,473,853,310)	

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

通貨	銘柄数		組入株式時価比率	合計金額に対する比率
アメリカ・ドル	株式	605銘柄	70.3%	73.3%

カナダ・ドル	株式	86銘柄	3.8%	4.0%
オーストラリア・ドル	株式	50銘柄	2.2%	2.3%
香港・ドル	株式	28銘柄	0.7%	0.8%
シンガポール・ドル	株式	14銘柄	0.3%	0.3%
ニュージーランド・ドル	株式	6銘柄	0.1%	0.1%
イギリス・ポンド	株式	79銘柄	4.4%	4.6%
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	41銘柄	3.1%	3.2%
デンマーク・クローネ	株式	18銘柄	0.8%	0.8%
ノルウェー・クローネ	株式	12銘柄	0.2%	0.2%
スウェーデン・クローナ	株式	44銘柄	1.0%	1.1%
ユーロ	株式	228銘柄	8.8%	9.2%

(b)株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	アメリカ・ドル	AGNC INVESTMENT CORP	25,432.00	318,662.96	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	8,490.00	1,676,265.60	
		AMERICAN TOWER CORP	26,197.00	6,737,344.46	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	90,010.00	608,467.60	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	8,302.00	2,046,276.96	
		BOSTON PROPERTIES INC	7,835.00	967,152.40	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	6,009.00	992,806.98	
		CROWN CASTLE INTL CORP	25,016.00	4,855,355.44	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	16,754.00	2,438,042.08	
		DUKE REALTY CORP	21,667.00	1,275,969.63	
		EQUINIX INC	5,232.00	3,880,312.80	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	8,664.00	680,643.84	
		EQUITY RESIDENTIAL	21,246.00	1,917,663.96	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	3,691.00	1,280,001.89	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	7,376.00	1,569,981.60	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	28,756.00	1,008,760.48	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	37,569.00	684,507.18	
		INVITATION HOMES INC	32,632.00	1,351,617.44	
		IRON MOUNTAIN INC	15,785.00	883,170.75	
		KIMCO REALTY CORP	35,169.00	858,475.29	
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	31,858.00	647,673.14			
MID-AMERICA APARTMENT COMM	6,678.00	1,386,820.26			
PROLOGIS INC	42,504.00	7,027,186.32			

	PUBLIC STORAGE	8,778.00	3,570,627.06	
	REALTY INCOME CORP	31,385.00	2,245,910.60	
	REGENCY CENTERS CORP	8,289.00	575,919.72	
	SBA COMMUNICATIONS CORP	5,916.00	2,097,103.68	
	SIMON PROPERTY GROUP INC	18,517.00	2,336,475.06	
	SUN COMMUNITIES INC	6,088.00	1,113,190.80	
	UDR INC	16,633.00	959,058.78	
	VENTAS INC	23,363.00	1,424,909.37	
	VICI PROPERTIES INC	36,025.00	1,018,066.50	
	VORNADO REALTY TRUST	8,706.00	362,953.14	
	WELLTOWER INC	24,682.00	2,383,293.92	
	WEYERHAEUSER CO	44,952.00	1,779,200.16	
	WP CAREY INC	11,067.00	908,379.36	
	アメリカ・ドル小計	757,273.00	65,868,247.21 (8,274,369,216)	
カナ ダ・ド ル	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	3,971.00	204,943.31	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	7,441.00	182,825.37	
	カナダ・ドル小計	11,412.00	387,768.68 (38,532,574)	
オース トラリ ア・ド ル	APA GROUP	68,281.00	737,434.80	
	DEXUS/AU	72,475.00	782,730.00	
	GOODMAN GROUP	95,350.00	2,181,608.00	
	GPT GROUP	121,221.00	619,439.31	
	LENDLEASE GROUP	36,263.00	400,706.15	
	MIRVAC GROUP	200,053.00	486,128.79	
	SCENTRE GROUP	275,200.00	811,840.00	
	STOCKLAND	127,393.00	532,502.74	
	TRANSURBAN GROUP	176,197.00	2,408,612.99	
	VICINITY CENTRES	241,241.00	441,471.03	
	オーストラリア・ドル小計	1,413,674.00	9,402,473.81 (879,695,450)	
香港・ ドル	HK ELECTRIC INVESTMENTS - SS	193,500.00	1,489,950.00	
	HKT TRUST AND HKT LTD-SS	197,000.00	2,135,480.00	
	LINK REIT	110,100.00	7,426,245.00	
	香港・ドル小計	500,600.00	11,051,675.00 (177,158,350)	
シンガ ポー ル・ド ル	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	170,500.00	491,040.00	
	CAPITALAND INTEGRATED COMMER	259,616.00	586,732.16	
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	112,400.00	210,188.00	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	208,100.00	380,823.00	

シンガポール・ドル小計		750,616.00	1,668,783.16 (153,661,553)	
イギリス・ポンド	BRITISH LAND CO PLC	62,406.00	319,643.53	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	39,861.00	298,957.50	
	SEGRO PLC	68,623.00	920,920.66	
イギリス・ポンド小計		170,890.00	1,539,521.69 (251,280,730)	
ユーロ	COVIVIO	2,388.00	175,637.40	
	GECINA SA	2,189.00	241,665.60	
	KLEPIERRE	13,600.00	308,992.00	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	7,024.00	489,783.52	
ユーロ小計		25,201.00	1,216,078.52 (165,204,267)	
投資証券合計			9,939,902,140 (9,939,902,140)	
合計			9,939,902,140 (9,939,902,140)	

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

通貨	銘柄数		組入 投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカ・ドル	投資証券	36銘柄	2.1%	83.2%
カナダ・ドル	投資証券	2銘柄	0.0%	0.4%
オーストラリア・ドル	投資証券	10銘柄	0.2%	8.9%
香港・ドル	投資証券	3銘柄	0.0%	1.8%
シンガポール・ドル	投資証券	4銘柄	0.0%	1.5%
イギリス・ポンド	投資証券	3銘柄	0.1%	2.5%
ユーロ	投資証券	4銘柄	0.0%	1.7%

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)

	(2021年4月13日現在)	(2022年4月13日現在)
資産の部		
流動資産		
預金	45,981,282	-
金銭信託	228,213,133	14,004,575
コール・ローン	118,273,326	537,206,904
国債証券	162,158,985,055	155,013,648,989
未収入金	-	87,233,725
未収利息	1,125,045,179	1,052,104,210

前払費用	21,150,614	55,878,885
流動資産合計	163,697,648,589	156,760,077,288
資産合計	163,697,648,589	156,760,077,288
負債の部		
流動負債		
未払解約金	9,011,993	202,299,339
未払利息	324	-
その他未払費用	3,950	1,344
流動負債合計	9,016,267	202,300,683
負債合計	9,016,267	202,300,683
純資産の部		
元本等		
元本	84,438,755,498	78,998,924,437
剰余金		
剰余金又は欠損金()	79,249,876,824	77,558,852,168
元本等合計	163,688,632,322	156,557,776,605
純資産合計	163,688,632,322	156,557,776,605
負債純資産合計	163,697,648,589	156,760,077,288

(2) 注記表

(重要な会計方針の注記)

項目	自 2021年4月14日 至 2022年4月13日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券は個別法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額(ただし、売気配相場は使用しない)、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。</p>
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建資産等の会計処理</p> <p>「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。</p>

（重要な会計上の見積りに関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

項目	（2021年4月13日現在）	（2022年4月13日現在）
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	84,438,755,498口	78,998,924,437口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.9385円 （1万口当たりの純資産額19,385円）	1口当たり純資産額 1.9818円 （1万口当たりの純資産額19,818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 2021年4月14日 至 2022年4月13日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、国債証券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。当計算期間については、為替予約取引を行っております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>

3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する会議をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用部署に是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用部署は、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。なお、投資信託協会の流動性リスク管理規制に抵触する場合には、流動性リスクを管理する会議で審議の上、流動性リスクの管理責任者が対処方針を決定します。その後、決定した対処方針やその実施等について、リスク管理会議に報告を行う体制となっております。</p> <p>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する会議にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。</p>
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。</p>

・金融商品の時価等に関する事項

項目	(2022年4月13日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	<p>金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p>
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券（国債証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

(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 2021年4月14日 至 2022年4月13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)

(2021年4月13日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	84,556,952,355円
同期中における追加設定元本額	11,304,078,309円
同期中における一部解約元本額	11,422,275,166円
2021年4月13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	23,568,244,950円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	727,323,151円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	2,025,052,215円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	1,054,240,718円
S M A M・グローバルバランスファンド(機動的資産配分型)	147,217,912円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2020(4資産タイプ)	6,940,706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)	31,877,472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)	102,070,891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)	178,438,989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)	114,686,398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)	213,016,075円
三井住友・DC年金バランスゼロ(債券型)	24,554,885円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	87,727,566円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	124,954,775円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	43,978,309円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2050	12,865,502円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	68,983,578円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	45,540,068円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	104,193,059円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	33,020,764円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	21,739,889円
三井住友・DCつみたてN I S A・世界分散ファンド	79,084,232円
三井住友D S・外国債券インデックス年金ファンド	124,065,397円
三井住友D S・年金バランス30(債券重点型)	9,459,055円
三井住友D S・年金バランス50(標準型)	23,768,100円
三井住友D S・年金バランス70(株式重点型)	15,321,018円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2060	1,832,778円
S M A M・年金外国債券パッシブ・ファンド<適格機関投資家限定>	2,341,294,117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>	53,057,364円
SMAM・バランスファンドVA25<適格機関投資家専用>	8,328,869,926円
SMAM・バランスファンドVA37.5<適格機関投資家専用>	4,860,208,256円
SMAM・バランスファンドVA50<適格機関投資家専用>	11,174,840,543円
SMAM・バランスファンドVL30<適格機関投資家限定>	35,901,694円
SMAM・バランスファンドVL50<適格機関投資家限定>	97,373,210円
SMAM・バランスファンドVA75<適格機関投資家専用>	737,710,826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>	120,185,798円
SMAM・インデックス・バランスVA25<適格機関投資家専用>	1,100,173,191円
SMAM・インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用>	1,455,394,432円
SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用>	1,679,976,562円
SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>	5,272,263,603円
SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定>	619,895円
SMAM・外国債券パッシブファンドVA<適格機関投資家限定>	8,795,241,360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)	345,889,060円
SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	154,703,653円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>	90,561,097円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>	35,408,120円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用>	11,874,819円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>	110,155,429円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	454,726,492円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A2<適格機関投資家専用>	120,646,991円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A2<適格機関投資家専用>	42,530,817円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A2<適格機関投資家専用>	5,288,637円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L2<適格機関投資家専用>	1,117,480,487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>	793,807,908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>	1,093,960,390円
SMAM・世界バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	3,262,823,790円
SMAM・世界バランスファンドVA2<適格機関投資家限定>	474,627,289円
SMAM・年金マルチ・インカム・ダイナミック・アロケーション・ファンド<適格機関投資家限定>	52,198,733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>	64,301,287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>	177,723,755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>	149,075,586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>	837,661,929円
合計	84,438,755,498円

(2022年4月13日現在)

開示対象ファンドの

期首における当該親投資信託の元本額	84,438,755,498円
同期中における追加設定元本額	11,076,997,643円
同期中における一部解約元本額	16,516,828,704円

2022年4月13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	24,393,880,841円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	797,136,312円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	2,119,967,555円

三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	1,147,542,270円
S M A M・グローバルバランスファンド(機動的資産配分型)	158,413,037円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2020(4資産タイプ)	6,893,764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)	29,273,421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)	94,401,071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)	225,146,317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)	156,890,144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)	262,638,809円
三井住友・DC年金バランスゼロ(債券型)	23,814,887円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	53,018,449円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	75,940,895円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	53,017,014円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2050	17,667,980円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	72,121,077円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	51,857,305円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	133,397,804円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	38,493,469円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	18,531,301円
三井住友・DCつみたてN I S A・世界分散ファンド	136,355,816円
三井住友D S・外国債券インデックス年金ファンド	294,281,824円
三井住友D S・年金バランス30(債券重点型)	14,238,080円
三井住友D S・年金バランス50(標準型)	42,018,400円
三井住友D S・年金バランス70(株式重点型)	30,944,093円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2060	2,203,842円
日興F W S・先進国債インデックス(為替ヘッジなし)	223,960,014円
三井住友D S・先進国債インデックス・ファンド	4,196,884円
S M A M・年金外国債券パッシブ・ファンド<適格機関投資家限定>	3,864,757,153円
S M A M・バランスファンドV A安定成長型<適格機関投資家限定>	40,032,740円
S M A M・バランスファンドV A 2 5<適格機関投資家専用>	6,840,867,224円
S M A M・バランスファンドV A 3 7 . 5<適格機関投資家専用>	4,426,406,787円
S M A M・バランスファンドV A 5 0<適格機関投資家専用>	10,181,017,794円
S M A M・バランスファンドV L 3 0<適格機関投資家限定>	34,375,893円
S M A M・バランスファンドV L 5 0<適格機関投資家限定>	87,983,369円
S M A M・バランスファンドV A 7 5<適格機関投資家専用>	690,283,030円
S M A M・バランスファンドV L国際分散型<適格機関投資家限定>	117,223,907円
S M A M・インデックス・バランスV A 2 5<適格機関投資家専用>	1,014,133,750円
S M A M・インデックス・バランスV A 5 0<適格機関投資家専用>	1,391,887,471円
S M A M・バランスファンドV A 4 0<適格機関投資家専用>	1,524,271,237円
S M A M・バランスファンドV A 3 5<適格機関投資家専用>	4,687,829,375円
S M A M・バランスV A株40T<適格機関投資家限定>	627,347円
S M A M・外国債券パッシブファンドV A<適格機関投資家限定>	7,892,173,791円
三井住友・外国債券インデックスファンド・V A S(適格機関投資家専用)	320,769,429円
S M A M・グローバルバランス40V A<適格機関投資家限定>	143,270,463円
S M A M・アセットバランスファンドV A 2 0 A<適格機関投資家専用>	78,444,198円
S M A M・アセットバランスファンドV A 3 5 A<適格機関投資家専用>	33,971,193円
S M A M・アセットバランスファンドV A 5 0 A<適格機関投資家専用>	11,926,289円
S M A M・アセットバランスファンドV A 2 0 L<適格機関投資家専用>	95,205,741円
S M A M・アセットバランスファンドV A 2 5 L<適格機関投資家専用>	404,375,583円

SMAM・アセットバランスファンドVA20A2<適格機関投資家専用>	99,457,001円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A2<適格機関投資家専用>	40,181,590円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A2<適格機関投資家専用>	5,252,180円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L2<適格機関投資家専用>	1,001,905,605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>	619,332,518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>	865,687,557円
SMAM・世界バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	779,208,964円
SMAM・世界バランスファンドVA2<適格機関投資家限定>	341,578,053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>	190,502,250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>	124,850,498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>	159,858,275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>	211,033,507円
合計	78,998,924,437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 0.125 02/15/24	7,700,000.00	7,392,539.00	
		T 0.125 07/15/23	4,300,000.00	4,198,520.00	
		T 0.125 08/15/23	8,000,000.00	7,790,560.00	
		T 0.125 10/15/23	5,700,000.00	5,523,186.00	
		T 0.25 04/15/23	5,000,000.00	4,921,650.00	
		T 0.25 06/15/23	7,700,000.00	7,548,387.00	
		T 0.25 06/30/25	2,400,000.00	2,222,424.00	
		T 0.25 07/31/25	3,300,000.00	3,048,375.00	
		T 0.25 09/30/25	2,000,000.00	1,841,000.00	
		T 0.25 11/15/23	3,000,000.00	2,906,460.00	
		T 0.375 04/30/25	200,000.00	186,858.00	
		T 0.375 07/31/27	4,700,000.00	4,162,414.00	
		T 0.375 09/15/24	3,000,000.00	2,849,040.00	
		T 0.375 09/30/27	4,800,000.00	4,230,720.00	
		T 0.375 11/30/25	2,000,000.00	1,841,480.00	
		T 0.375 12/31/25	3,000,000.00	2,757,750.00	
		T 0.5 03/31/25	600,000.00	563,526.00	
		T 0.5 04/30/27	200,000.00	179,592.00	
		T 0.5 05/31/27	3,000,000.00	2,684,640.00	
		T 0.5 06/30/27	4,400,000.00	3,929,200.00	
T 0.625 03/31/27	600,000.00	543,492.00			
T 0.625 05/15/30	7,500,000.00	6,362,100.00			

T 0.625 07/31/26	3,600,000.00	3,299,184.00	
T 0.625 08/15/30	8,800,000.00	7,415,320.00	
T 0.625 10/15/24	4,400,000.00	4,197,160.00	
T 0.625 11/30/27	2,100,000.00	1,869,231.00	
T 0.625 12/31/27	7,200,000.00	6,398,712.00	
T 0.75 01/31/28	6,700,000.00	5,990,470.00	
T 0.75 11/15/24	5,200,000.00	4,967,612.00	
T 0.875 11/15/30	7,000,000.00	6,013,420.00	
T 1 07/31/28	5,900,000.00	5,306,755.00	
T 1 12/15/24	4,500,000.00	4,320,315.00	
T 1.125 02/15/31	8,500,000.00	7,432,145.00	
T 1.125 02/28/25	1,500,000.00	1,437,420.00	
T 1.125 02/28/27	2,000,000.00	1,858,660.00	
T 1.125 05/15/40	2,000,000.00	1,476,860.00	
T 1.125 08/15/40	700,000.00	514,115.00	
T 1.125 08/31/28	3,500,000.00	3,167,885.00	
T 1.25 05/15/50	5,100,000.00	3,508,239.00	
T 1.25 06/30/28	3,000,000.00	2,743,920.00	
T 1.25 07/31/23	3,000,000.00	2,969,760.00	
T 1.25 08/15/31	5,500,000.00	4,833,125.00	
T 1.25 09/30/28	4,500,000.00	4,104,450.00	
T 1.25 11/30/26	4,200,000.00	3,939,432.00	
T 1.25 12/31/26	2,300,000.00	2,154,272.00	
T 1.375 01/31/25	1,900,000.00	1,836,312.00	
T 1.375 06/30/23	500,000.00	496,425.00	
T 1.375 08/15/50	4,500,000.00	3,196,395.00	
T 1.375 08/31/23	2,500,000.00	2,475,000.00	
T 1.375 08/31/26	7,100,000.00	6,716,103.00	
T 1.375 09/30/23	3,000,000.00	2,966,340.00	
T 1.375 10/31/28	6,000,000.00	5,504,280.00	
T 1.375 11/15/31	5,400,000.00	4,786,560.00	
T 1.375 11/15/40	2,000,000.00	1,534,060.00	
T 1.375 12/31/28	2,500,000.00	2,291,100.00	
T 1.5 01/31/27	2,400,000.00	2,272,680.00	
T 1.5 02/15/30	4,500,000.00	4,112,190.00	
T 1.5 03/31/23	3,000,000.00	2,992,590.00	
T 1.5 10/31/24	5,500,000.00	5,351,720.00	
T 1.5 11/30/24	800,000.00	777,872.00	
T 1.5 11/30/28	2,300,000.00	2,125,683.00	
T 1.625 02/15/26	2,900,000.00	2,788,176.00	
T 1.625 04/30/23	3,000,000.00	2,992,590.00	
T 1.625 05/15/26	14,950,000.00	14,338,545.00	
T 1.625 05/15/31	4,300,000.00	3,921,385.00	
T 1.625 05/31/23	3,000,000.00	2,991,090.00	

T 1.625 08/15/29	2,450,000.00	2,273,796.00	
T 1.625 09/30/26	3,900,000.00	3,728,127.00	
T 1.625 10/31/23	3,000,000.00	2,973,270.00	
T 1.625 11/15/50	3,200,000.00	2,425,472.00	
T 1.625 11/30/26	200,000.00	190,858.00	
T 1.75 01/31/29	4,300,000.00	4,036,754.00	
T 1.75 03/15/25	1,500,000.00	1,464,375.00	
T 1.75 05/15/23	2,700,000.00	2,694,384.00	
T 1.75 06/30/24	6,200,000.00	6,101,420.00	
T 1.75 07/31/24	850,000.00	835,983.50	
T 1.75 08/15/41	3,500,000.00	2,845,360.00	
T 1.75 11/15/29	4,000,000.00	3,734,680.00	
T 1.75 12/31/26	3,500,000.00	3,353,000.00	
T 1.875 02/15/32	4,200,000.00	3,893,526.00	
T 1.875 02/15/51	5,800,000.00	4,679,846.00	
T 1.875 02/28/27	1,200,000.00	1,156,404.00	
T 1.875 02/28/29	2,800,000.00	2,649,584.00	
T 1.875 08/31/24	3,800,000.00	3,742,392.00	
T 1.875 11/15/51	1,300,000.00	1,051,063.00	
T 2 02/15/25	3,500,000.00	3,440,115.00	
T 2 02/15/50	2,800,000.00	2,333,604.00	
T 2 04/30/24	2,000,000.00	1,982,800.00	
T 2 05/31/24	3,300,000.00	3,268,287.00	
T 2 06/30/24	4,100,000.00	4,057,073.00	
T 2 08/15/25	4,300,000.00	4,206,905.00	
T 2 08/15/51	4,700,000.00	3,911,998.00	
T 2 11/15/26	5,000,000.00	4,849,800.00	
T 2.125 02/29/24	2,000,000.00	1,991,160.00	
T 2.125 03/31/24	6,500,000.00	6,464,900.00	
T 2.125 05/15/25	1,900,000.00	1,870,303.00	
T 2.125 07/31/24	3,500,000.00	3,468,255.00	
T 2.125 09/30/24	4,000,000.00	3,957,160.00	
T 2.125 11/30/23	3,100,000.00	3,093,335.00	
T 2.125 11/30/24	2,600,000.00	2,566,460.00	
T 2.25 01/31/24	2,200,000.00	2,196,128.00	
T 2.25 02/15/27	4,400,000.00	4,312,660.00	
T 2.25 02/15/52	700,000.00	619,003.00	
T 2.25 03/31/26	13,300,000.00	13,094,249.00	
T 2.25 04/30/24	3,800,000.00	3,785,864.00	
T 2.25 05/15/41	3,000,000.00	2,663,430.00	
T 2.25 08/15/27	4,200,000.00	4,108,776.00	
T 2.25 08/15/46	2,450,000.00	2,133,411.00	
T 2.25 08/15/49	3,500,000.00	3,086,265.00	
T 2.25 10/31/24	800,000.00	793,560.00	

T 2.25 11/15/24	5,100,000.00	5,059,353.00	
T 2.25 11/15/25	4,000,000.00	3,942,000.00	
T 2.25 11/15/27	4,400,000.00	4,294,092.00	
T 2.25 12/31/23	3,000,000.00	2,998,110.00	
T 2.25 12/31/24	3,900,000.00	3,864,042.00	
T 2.375 02/15/42	3,600,000.00	3,260,808.00	
T 2.375 02/29/24	3,700,000.00	3,700,703.00	
T 2.375 05/15/27	1,000,000.00	985,420.00	
T 2.375 05/15/29	400,000.00	390,796.00	
T 2.375 05/15/51	1,400,000.00	1,269,184.00	
T 2.375 08/15/24	5,600,000.00	5,580,288.00	
T 2.375 11/15/49	1,900,000.00	1,723,490.00	
T 2.5 01/31/25	3,400,000.00	3,388,032.00	
T 2.5 02/15/45	4,100,000.00	3,734,198.00	
T 2.5 02/15/46	2,900,000.00	2,650,078.00	
T 2.5 02/28/26	8,500,000.00	8,438,885.00	
T 2.5 05/15/24	5,700,000.00	5,706,213.00	
T 2.5 05/15/46	3,600,000.00	3,289,500.00	
T 2.5 08/15/23	5,000,000.00	5,028,500.00	
T 2.625 01/31/26	2,700,000.00	2,695,653.00	
T 2.625 02/15/29	1,800,000.00	1,787,400.00	
T 2.625 03/31/25	1,000,000.00	999,920.00	
T 2.625 12/31/23	1,900,000.00	1,909,937.00	
T 2.625 12/31/25	4,400,000.00	4,393,268.00	
T 2.75 02/15/24	5,100,000.00	5,135,241.00	
T 2.75 02/15/28	4,800,000.00	4,806,336.00	
T 2.75 02/28/25	2,000,000.00	2,006,080.00	
T 2.75 04/30/23	2,900,000.00	2,927,057.00	
T 2.75 05/31/23	1,000,000.00	1,009,060.00	
T 2.75 06/30/25	4,600,000.00	4,618,308.00	
T 2.75 07/31/23	2,000,000.00	2,017,340.00	
T 2.75 08/15/42	2,000,000.00	1,912,960.00	
T 2.75 08/15/47	3,600,000.00	3,469,500.00	
T 2.75 08/31/23	3,800,000.00	3,827,892.00	
T 2.75 08/31/25	2,100,000.00	2,105,565.00	
T 2.75 11/15/23	4,200,000.00	4,232,466.00	
T 2.75 11/15/42	300,000.00	286,569.00	
T 2.75 11/15/47	1,500,000.00	1,446,675.00	
T 2.875 04/30/25	2,200,000.00	2,216,148.00	
T 2.875 05/15/28	9,000,000.00	9,064,260.00	
T 2.875 05/15/43	2,400,000.00	2,333,040.00	
T 2.875 05/15/49	1,400,000.00	1,399,776.00	
T 2.875 05/31/25	1,100,000.00	1,107,898.00	
T 2.875 08/15/28	4,500,000.00	4,532,670.00	

T 2.875 08/15/45	3,300,000.00	3,217,731.00	
T 2.875 10/31/23	1,000,000.00	1,009,600.00	
T 2.875 11/15/46	300,000.00	294,513.00	
T 2.875 11/30/23	2,000,000.00	2,019,200.00	
T 2.875 11/30/25	2,500,000.00	2,517,850.00	
T 3 02/15/47	2,500,000.00	2,510,725.00	
T 3 02/15/48	2,400,000.00	2,432,040.00	
T 3 02/15/49	3,300,000.00	3,373,194.00	
T 3 05/15/42	800,000.00	797,496.00	
T 3 05/15/45	3,000,000.00	2,985,000.00	
T 3 05/15/47	1,800,000.00	1,810,404.00	
T 3 08/15/48	900,000.00	913,005.00	
T 3 09/30/25	4,000,000.00	4,047,160.00	
T 3 10/31/25	3,100,000.00	3,136,797.00	
T 3 11/15/44	3,500,000.00	3,475,640.00	
T 3 11/15/45	2,700,000.00	2,694,087.00	
T 3.125 02/15/42	1,000,000.00	1,017,100.00	
T 3.125 02/15/43	2,300,000.00	2,326,588.00	
T 3.125 05/15/48	2,400,000.00	2,494,296.00	
T 3.125 08/15/44	3,300,000.00	3,343,560.00	
T 3.125 11/15/28	2,900,000.00	2,965,018.00	
T 3.375 05/15/44	3,000,000.00	3,158,670.00	
T 3.375 11/15/48	3,100,000.00	3,379,000.00	
T 3.5 02/15/39	200,000.00	216,796.00	
T 3.625 02/15/44	3,600,000.00	3,934,944.00	
T 3.625 08/15/43	2,400,000.00	2,619,360.00	
T 3.75 08/15/41	1,500,000.00	1,665,225.00	
T 3.75 11/15/43	700,000.00	778,750.00	
T 3.875 08/15/40	500,000.00	565,310.00	
T 4.25 05/15/39	100,000.00	118,656.00	
T 4.25 11/15/40	600,000.00	709,734.00	
T 4.375 05/15/40	900,000.00	1,085,202.00	
T 4.375 05/15/41	300,000.00	360,750.00	
T 4.375 11/15/39	700,000.00	841,750.00	
T 4.5 08/15/39	300,000.00	366,654.00	
T 4.625 02/15/40	1,100,000.00	1,366,310.00	
T 4.75 02/15/41	900,000.00	1,134,207.00	
T 5.25 11/15/28	500,000.00	576,050.00	
T 5.375 02/15/31	320,000.00	386,998.40	
T 6 02/15/26	1,000,000.00	1,123,120.00	
T 6.25 08/15/23	800,000.00	845,056.00	
T-BOND 15/11/2027	1,000,000.00	1,176,250.00	
アメリカ・ドル小計	632,420,000.00	603,489,773.90 (75,810,385,397)	

カナダ・ドル	CAN 0.5 09/01/25	2,700,000.00	2,528,415.00	
	CAN 1 06/01/27	600,000.00	556,488.00	
	CAN 1.25 06/01/30	6,200,000.00	5,588,122.00	
	CAN 1.5 06/01/23	1,200,000.00	1,192,164.00	
	CAN 1.5 06/01/26	3,200,000.00	3,078,400.00	
	CAN 1.5 09/01/24	2,000,000.00	1,960,220.00	
	CAN 1.5 12/01/31	400,000.00	361,588.00	
	CAN 1.75 12/01/53	500,000.00	407,280.00	
	CAN 2 06/01/28	700,000.00	679,392.00	
	CAN 2 09/01/23	1,200,000.00	1,197,252.00	
	CAN 2.25 03/01/24	1,000,000.00	998,510.00	
	CAN 2.25 06/01/25	1,000,000.00	994,420.00	
	CAN 2.25 06/01/29	1,900,000.00	1,861,696.00	
	CAN 2.5 06/01/24	2,100,000.00	2,106,090.00	
	CAN 2.75 12/01/48	1,300,000.00	1,331,759.00	
	CAN 3.5 12/01/45	1,200,000.00	1,377,612.00	
	CAN 4 06/01/41	1,800,000.00	2,151,630.00	
	CAN 5 06/01/37	1,450,000.00	1,863,076.00	
	CAN 5.75 06/01/29	250,000.00	301,562.50	
	CAN 5.75 06/01/33	400,000.00	517,364.00	
CANADA 2.75 12/01/64	700,000.00	714,875.00		
カナダ・ドル小計		31,800,000.00	31,767,915.50 (3,156,777,763)	
オーストラリア・ドル	ACGB 0.25 11/21/25	800,000.00	733,576.00	
	ACGB 1.5 06/21/31	2,800,000.00	2,452,716.00	
	ACGB 1.75 06/21/51	500,000.00	345,660.00	
	ACGB 2.25 05/21/28	2,400,000.00	2,312,976.00	
	ACGB 2.5 05/21/30	2,250,000.00	2,167,245.00	
	ACGB 2.75 04/21/24	2,500,000.00	2,528,200.00	
	ACGB 2.75 06/21/35	800,000.00	762,152.00	
	ACGB 2.75 11/21/27	900,000.00	894,834.00	
	ACGB 2.75 11/21/28	200,000.00	197,854.00	
	ACGB 2.75 11/21/29	2,600,000.00	2,558,426.00	
	ACGB 3 03/21/47	1,200,000.00	1,112,784.00	
	ACGB 3.25 04/21/25	1,300,000.00	1,326,078.00	
	ACGB 3.25 04/21/29	800,000.00	814,880.00	
	ACGB 3.25 06/21/39	2,550,000.00	2,526,234.00	
	ACGB 3.75 04/21/37	1,200,000.00	1,272,180.00	
	ACGB 4.25 04/21/26	2,650,000.00	2,804,124.00	
	ACGB 4.5 04/21/33	1,100,000.00	1,243,770.00	
	ACGB 5.5 04/21/23	900,000.00	937,674.00	
オーストラリア・ドル小計		27,450,000.00	26,991,363.00 (2,525,311,922)	
シンガ	SIGB 1.25 11/01/26	100,000.00	95,070.00	

ポール・ドル	SIGB 1.625 07/01/31	200,000.00	183,636.00	
	SIGB 2.25 08/01/36	1,200,000.00	1,128,732.00	
	SIGB 2.625 05/01/28	800,000.00	802,800.00	
	SIGB 2.75 03/01/46	700,000.00	693,000.00	
	SIGB 2.75 04/01/42	400,000.00	399,848.00	
	SIGB 2.75 07/01/23	1,200,000.00	1,216,320.00	
	SIGB 2.875 09/01/30	200,000.00	203,400.00	
	SIGB 3 09/01/24	100,000.00	102,290.00	
	SIGB 3.375 09/01/33	750,000.00	796,125.00	
	SIGB 3.5 03/01/27	1,500,000.00	1,568,175.00	
シンガポール・ドル小計		7,150,000.00	7,189,396.00 (661,999,584)	
イギリス・ポンド	UK TSY GILT	400,000.00	349,776.00	
	UKT 0.125 01/30/26	1,500,000.00	1,422,990.00	
	UKT 0.25 01/31/25	300,000.00	288,945.00	
	UKT 0.25 07/31/31	1,600,000.00	1,391,200.00	
	UKT 0.375 10/22/30	1,800,000.00	1,612,044.00	
	UKT 0.5 01/31/29	700,000.00	647,878.00	
	UKT 0.5 10/22/61	100,000.00	63,686.00	
	UKT 0.625 06/07/25	800,000.00	778,112.00	
	UKT 0.625 07/31/35	600,000.00	505,500.00	
	UKT 0.75 07/22/23	1,700,000.00	1,686,281.00	
	UKT 0.875 10/22/29	500,000.00	472,340.00	
	UKT 1 04/22/24	800,000.00	792,104.00	
	UKT 1.125 10/22/73	300,000.00	242,670.00	
	UKT 1.25 07/22/27	200,000.00	196,920.00	
	UKT 1.5 07/22/26	1,100,000.00	1,097,965.00	
	UKT 1.5 07/22/47	2,000,000.00	1,813,300.00	
	UKT 1.625 10/22/28	900,000.00	902,268.00	
	UKT 1.625 10/22/54	500,000.00	467,440.00	
	UKT 1.75 01/22/49	850,000.00	813,960.00	
	UKT 1.75 09/07/37	100,000.00	96,737.00	
	UKT 2 09/07/25	1,100,000.00	1,117,479.00	
	UKT 2.25 09/07/23	2,700,000.00	2,729,295.00	
	UKT 2.5 07/22/65	1,600,000.00	1,947,680.00	
	UKT 2.75 09/07/24	900,000.00	925,551.00	
	UKT 3.25 01/22/44	1,600,000.00	1,951,520.00	
	UKT 3.5 01/22/45	1,250,000.00	1,594,812.50	
	UKT 3.5 07/22/68	1,450,000.00	2,232,391.00	
UKT 3.75 07/22/52	1,200,000.00	1,698,372.00		
UKT 4 01/22/60	1,600,000.00	2,550,096.00		
UKT 4.25 03/07/36	1,050,000.00	1,342,236.00		
UKT 4.25 06/07/32	300,000.00	368,115.00		
UKT 4.25 09/07/39	750,000.00	999,225.00		

	UKT 4.25 12/07/27	900,000.00	1,027,566.00	
	UKT 4.25 12/07/40	600,000.00	810,756.00	
	UKT 4.25 12/07/46	1,500,000.00	2,157,660.00	
	UKT 4.25 12/07/49	900,000.00	1,337,913.00	
	UKT 4.25 12/07/55	1,700,000.00	2,703,272.00	
	UKT 4.5 09/07/34	1,100,000.00	1,412,928.00	
	UKT 4.5 12/07/42	1,250,000.00	1,778,462.50	
	UKT 4.75 12/07/30	1,150,000.00	1,433,486.50	
	UKT 4.75 12/07/38	1,000,000.00	1,395,300.00	
	UKT 5 03/07/25	1,300,000.00	1,424,085.00	
	UKT 6 12/07/28	650,000.00	829,055.50	
	イギリス・ボンド小計	44,300,000.00	51,409,373.00 (8,391,037,861)	
イスラエル・シュケル	ILGOV 0.15 07/31/23	5,800,000.00	5,724,716.00	
	ILGOV 1.5 11/30/23	2,200,000.00	2,204,048.00	
	ILGOV 2.25 09/28/28	1,500,000.00	1,499,520.00	
	ILGOV 3.75 03/31/47	4,100,000.00	4,565,186.00	
	ILGOV 6.25 10/30/26	3,300,000.00	3,899,313.00	
	イスラエル・シュケル小計	16,900,000.00	17,892,783.00 (699,901,257)	
デンマーク・クローネ	DGB 0.25 11/15/52	1,800,000.00	1,377,864.00	
	DGB 0.5 11/15/27	8,500,000.00	8,341,390.00	
	DGB 0.5 11/15/29	4,300,000.00	4,162,314.00	
	DGB 1.5 11/15/23	3,000,000.00	3,074,610.00	
	DGB 1.75 11/15/25	3,100,000.00	3,224,589.00	
	DGB 4.5 11/15/39	9,800,000.00	14,971,460.00	
	デンマーク・クローネ小計	30,500,000.00	35,152,227.00 (641,879,665)	
ノルウェー・クローネ	NGB 1.375 08/19/30	3,200,000.00	2,862,912.00	
	NGB 1.5 02/19/26	3,500,000.00	3,352,860.00	
	NGB 1.75 03/13/25	3,000,000.00	2,932,920.00	
	NGB 1.75 09/06/29	4,200,000.00	3,909,990.00	
	NGB 2 04/26/28	9,000,000.00	8,623,170.00	
	NGB 2 05/24/23	3,300,000.00	3,310,593.00	
	NGB 3 03/14/24	4,300,000.00	4,358,824.00	
	ノルウェー・クローネ小計	30,500,000.00	29,351,269.00 (420,016,659)	
スウェーデン・クローナ	SGB 0.75 05/12/28	3,700,000.00	3,555,293.00	
	SGB 0.75 11/12/29	6,400,000.00	6,073,152.00	
	SGB 1 11/12/26	5,800,000.00	5,707,490.00	
	SGB 1.5 11/13/23	6,900,000.00	6,972,588.00	
	SGB 2.5 05/12/25	5,000,000.00	5,196,600.00	
	SGB 3.5 03/30/39	4,600,000.00	5,850,924.00	
	スウェーデン・クローナ小計	32,400,000.00	33,356,047.00 (439,299,139)	

メキシコ・ペソ	MBONO 10 12/05/24	32,000,000.00	32,888,000.00	
	MBONO 5.75 03/05/26	19,000,000.00	17,124,130.00	
	MBONO 7.5 06/03/27	25,000,000.00	23,693,000.00	
	MBONO 7.75 05/29/31	5,000,000.00	4,667,050.00	
	MBONO 7.75 11/23/34	18,000,000.00	16,526,880.00	
	MBONO 8 11/07/47	5,000,000.00	4,552,050.00	
	MBONO 8 12/07/23	21,000,000.00	20,805,540.00	
	MBONO 8.5 05/31/29	23,000,000.00	22,597,730.00	
	MBONO 8.5 11/18/38	40,000,000.00	38,829,600.00	
メキシコ・ペソ小計		188,000,000.00	181,683,980.00	(1,153,093,716)
オフショア・人民元	CGB 2.26 02/24/25	5,000,000.00	4,982,350.00	
	CGB 2.47 09/02/24	26,000,000.00	26,059,280.00	
	CGB 2.56 10/21/23	11,000,000.00	11,050,490.00	
	CGB 2.69 08/12/26	32,000,000.00	32,178,880.00	
	CGB 2.8 03/24/29	3,000,000.00	3,002,280.00	
	CGB 2.91 10/14/28	14,000,000.00	14,117,880.00	
	CGB 3.02 05/27/31	17,000,000.00	17,221,850.00	
	CGB 3.72 04/12/51	11,000,000.00	11,704,110.00	
オフショア・人民元小計		119,000,000.00	120,317,120.00	(2,369,104,251)
マレーシア・リングgit	MALAYSIA GOVT	700,000.00	708,862.00	
	MALAYSIA GOVT	700,000.00	709,751.00	
	MGS 3.502 05/31/27	7,900,000.00	7,821,632.00	
	MGS 3.955 09/15/25	4,700,000.00	4,783,378.00	
	MGS 4.498 04/15/30	6,000,000.00	6,163,980.00	
	MGS 4.736 03/15/46	6,700,000.00	6,714,070.00	
マレーシア・リングgit小計		26,700,000.00	26,901,673.00	(798,815,588)
ポーランド・ズロチ	POLGB 0 04/25/23	300,000.00	283,320.00	
	POLGB 0.25 10/25/26	7,000,000.00	5,292,700.00	
	POLGB 0.75 04/25/25	1,800,000.00	1,516,680.00	
	POLGB 1.25 10/25/30	6,500,000.00	4,479,150.00	
	POLGB 2.25 10/25/24	12,500,000.00	11,276,250.00	
ポーランド・ズロチ小計		28,100,000.00	22,848,100.00	(668,763,887)
ユーロ	BGB 0 10/22/31	1,300,000.00	1,157,416.00	
	BGB 0.1 06/22/30	700,000.00	647,171.00	
	BGB 0.4 06/22/40	300,000.00	242,952.00	
	BGB 0.5 10/22/24	1,300,000.00	1,308,177.00	
	BGB 0.65 06/22/71	400,000.00	244,424.00	
	BGB 0.8 06/22/25	300,000.00	303,378.00	
	BGB 0.8 06/22/27	1,000,000.00	1,001,700.00	
	BGB 0.8 06/22/28	1,600,000.00	1,594,640.00	

BGB 0.9 06/22/29	900,000.00	895,131.00	
BGB 1 06/22/26	1,800,000.00	1,828,782.00	
BGB 1 06/22/31	1,300,000.00	1,282,632.00	
BGB 1.25 04/22/33	1,200,000.00	1,204,812.00	
BGB 1.45 06/22/37	400,000.00	396,868.00	
BGB 1.6 06/22/47	650,000.00	636,324.00	
BGB 1.7 06/22/50	500,000.00	497,155.00	
BGB 1.9 06/22/38	1,000,000.00	1,058,410.00	
BGB 2.15 06/22/66	500,000.00	550,155.00	
BGB 2.25 06/22/23	1,300,000.00	1,339,585.00	
BGB 2.25 06/22/57	500,000.00	561,035.00	
BGB 2.6 06/22/24	800,000.00	842,696.00	
BGB 3 06/22/34	200,000.00	236,952.00	
BGB 3.75 06/22/45	800,000.00	1,117,744.00	
BGB 4 03/28/32	500,000.00	630,945.00	
BGB 4.25 03/28/41	1,000,000.00	1,425,330.00	
BGB 4.5 03/28/26	700,000.00	809,158.00	
BGB 5 03/28/35	1,000,000.00	1,424,590.00	
BGB 5.5 03/28/28	1,100,000.00	1,403,666.00	
BTPS 0 12/15/24	1,300,000.00	1,264,913.00	
BTPS 0.35 02/01/25	2,400,000.00	2,356,896.00	
BTPS 0.5 02/01/26	1,000,000.00	970,630.00	
BTPS 0.65 10/15/23	2,000,000.00	2,013,140.00	
BTPS 0.85 01/15/27	1,700,000.00	1,646,688.00	
BTPS 0.9 04/01/31	2,000,000.00	1,775,340.00	
BTPS 0.95 08/01/30	1,800,000.00	1,631,160.00	
BTPS 0.95 09/15/27	800,000.00	769,904.00	
BTPS 0.95 12/01/31	1,100,000.00	967,890.00	
BTPS 1.25 12/01/26	800,000.00	791,880.00	
BTPS 1.45 03/01/36	1,100,000.00	967,164.00	
BTPS 1.45 05/15/25	700,000.00	706,748.00	
BTPS 1.45 11/15/24	1,800,000.00	1,821,078.00	
BTPS 1.5 06/01/25	2,700,000.00	2,733,183.00	
BTPS 1.6 06/01/26	1,200,000.00	1,210,404.00	
BTPS 1.65 12/01/30	2,200,000.00	2,099,284.00	
BTPS 1.7 09/01/51	1,500,000.00	1,182,495.00	
BTPS 1.85 05/15/24	3,000,000.00	3,071,400.00	
BTPS 1.85 07/01/25	1,000,000.00	1,021,000.00	
BTPS 2 02/01/28	3,900,000.00	3,955,068.00	
BTPS 2 12/01/25	1,300,000.00	1,335,529.00	
BTPS 2.05 08/01/27	1,500,000.00	1,528,485.00	
BTPS 2.1 07/15/26	1,000,000.00	1,028,320.00	
BTPS 2.2 06/01/27	1,300,000.00	1,337,479.00	
BTPS 2.25 09/01/36	500,000.00	485,125.00	

BTPS 2.45 09/01/33	1,100,000.00	1,106,017.00	
BTPS 2.45 09/01/50	900,000.00	835,353.00	
BTPS 2.5 11/15/25	2,100,000.00	2,194,500.00	
BTPS 2.5 12/01/24	1,300,000.00	1,353,391.00	
BTPS 2.7 03/01/47	1,550,000.00	1,546,652.00	
BTPS 2.8 03/01/67	600,000.00	568,746.00	
BTPS 2.8 12/01/28	1,000,000.00	1,057,140.00	
BTPS 2.95 09/01/38	800,000.00	839,480.00	
BTPS 3 08/01/29	2,700,000.00	2,884,032.00	
BTPS 3.1 03/01/40	500,000.00	531,845.00	
BTPS 3.25 09/01/46	1,500,000.00	1,640,955.00	
BTPS 3.35 03/01/35	850,000.00	931,387.50	
BTPS 3.45 03/01/48	1,000,000.00	1,127,930.00	
BTPS 3.5 03/01/30	4,400,000.00	4,870,096.00	
BTPS 3.75 09/01/24	2,300,000.00	2,460,517.00	
BTPS 3.85 09/01/49	1,100,000.00	1,319,032.00	
BTPS 4 02/01/37	2,600,000.00	3,074,188.00	
BTPS 4.5 03/01/24	1,000,000.00	1,074,710.00	
BTPS 4.5 03/01/26	1,800,000.00	2,020,968.00	
BTPS 4.5 05/01/23	2,300,000.00	2,410,584.00	
BTPS 4.75 08/01/23	2,500,000.00	2,653,325.00	
BTPS 4.75 09/01/28	2,000,000.00	2,348,460.00	
BTPS 4.75 09/01/44	1,400,000.00	1,880,858.00	
BTPS 5 03/01/25	1,000,000.00	1,113,440.00	
BTPS 5 08/01/34	2,070,000.00	2,653,346.70	
BTPS 5 08/01/39	1,800,000.00	2,398,716.00	
BTPS 5 09/01/40	1,700,000.00	2,286,432.00	
BTPS 5.75 02/01/33	1,700,000.00	2,258,246.00	
BTPS 6 05/01/31	2,200,000.00	2,893,814.00	
BTPS 6.5 11/01/27	1,700,000.00	2,138,311.00	
BTPS 7.25 11/01/26	400,000.00	503,136.00	
BTPS 9 11/01/23	300,000.00	340,371.00	
DBR 0 02/15/30	1,300,000.00	1,232,933.00	
DBR 0 02/15/32	400,000.00	370,236.00	
DBR 0 05/15/35	4,100,000.00	3,654,904.00	
DBR 0 08/15/29	2,600,000.00	2,477,540.00	
DBR 0 08/15/30	5,800,000.00	5,472,996.00	
DBR 0 08/15/31	1,500,000.00	1,401,030.00	
DBR 0 08/15/50	2,800,000.00	2,175,908.00	
DBR 0.25 02/15/27	2,300,000.00	2,270,468.00	
DBR 0.25 02/15/29	1,800,000.00	1,753,344.00	
DBR 0.25 08/15/28	1,500,000.00	1,464,900.00	
DBR 0.5 02/15/25	2,500,000.00	2,517,475.00	
DBR 0.5 02/15/26	3,100,000.00	3,108,804.00	

DBR 0.5 02/15/28	2,100,000.00	2,086,980.00	
DBR 0.5 08/15/27	3,400,000.00	3,385,856.00	
DBR 1 08/15/24	1,300,000.00	1,325,831.00	
DBR 1 08/15/25	2,050,000.00	2,093,993.00	
DBR 1.25 08/15/48	1,450,000.00	1,580,108.50	
DBR 1.5 05/15/23	1,300,000.00	1,326,273.00	
DBR 1.5 05/15/24	3,600,000.00	3,705,048.00	
DBR 1.75 02/15/24	2,200,000.00	2,270,510.00	
DBR 2 08/15/23	2,000,000.00	2,062,100.00	
DBR 2.5 07/04/44	2,200,000.00	2,936,450.00	
DBR 2.5 08/15/46	2,500,000.00	3,411,375.00	
DBR 3.25 07/04/42	700,000.00	1,010,590.00	
DBR 4 01/04/37	1,800,000.00	2,588,616.00	
DBR 4.25 07/04/39	950,000.00	1,462,867.00	
DBR 4.75 07/04/28	1,600,000.00	2,008,400.00	
DBR 4.75 07/04/34	600,000.00	877,314.00	
DBR 4.75 07/04/40	1,450,000.00	2,394,588.00	
DBR 5.5 01/04/31	900,000.00	1,266,318.00	
DBR 5.625 01/04/28	1,000,000.00	1,284,500.00	
DBR 6.25 01/04/24	1,200,000.00	1,331,604.00	
DBR 6.25 01/04/30	500,000.00	711,870.00	
DBR 6.5 07/04/27	1,000,000.00	1,304,240.00	
FRTR 0 02/25/24	1,900,000.00	1,895,288.00	
FRTR 0 02/25/26	4,300,000.00	4,191,296.00	
FRTR 0 03/25/24	4,800,000.00	4,780,512.00	
FRTR 0 03/25/25	1,900,000.00	1,872,963.00	
FRTR 0 11/25/29	4,500,000.00	4,154,310.00	
FRTR 0 11/25/30	3,900,000.00	3,529,266.00	
FRTR 0 11/25/31	3,400,000.00	3,016,990.00	
FRTR 0.25 11/25/26	3,200,000.00	3,127,584.00	
FRTR 0.5 05/25/25	1,300,000.00	1,299,233.00	
FRTR 0.5 05/25/26	3,500,000.00	3,471,895.00	
FRTR 0.5 05/25/29	200,000.00	193,120.00	
FRTR 0.5 05/25/72	100,000.00	56,365.00	
FRTR 0.75 05/25/28	3,300,000.00	3,271,554.00	
FRTR 0.75 05/25/52	3,000,000.00	2,330,640.00	
FRTR 0.75 11/25/28	3,500,000.00	3,457,475.00	
FRTR 1 05/25/27	2,100,000.00	2,119,236.00	
FRTR 1 11/25/25	2,050,000.00	2,076,465.50	
FRTR 1.25 05/25/34	4,100,000.00	4,034,236.00	
FRTR 1.25 05/25/36	3,700,000.00	3,605,650.00	
FRTR 1.5 05/25/31	2,550,000.00	2,624,562.00	
FRTR 1.5 05/25/50	2,400,000.00	2,308,200.00	
FRTR 1.75 05/25/23	4,200,000.00	4,296,096.00	

FRTR 1.75 05/25/66	800,000.00	790,816.00	
FRTR 1.75 06/25/39	2,500,000.00	2,608,100.00	
FRTR 1.75 11/25/24	2,600,000.00	2,691,416.00	
FRTR 2 05/25/48	2,000,000.00	2,148,260.00	
FRTR 2.25 05/25/24	1,700,000.00	1,771,111.00	
FRTR 2.5 05/25/30	3,500,000.00	3,896,445.00	
FRTR 2.75 10/25/27	3,850,000.00	4,250,284.50	
FRTR 3.25 05/25/45	1,400,000.00	1,841,182.00	
FRTR 3.5 04/25/26	2,500,000.00	2,782,175.00	
FRTR 4 04/25/55	1,370,000.00	2,159,928.30	
FRTR 4 04/25/60	1,400,000.00	2,275,504.00	
FRTR 4 10/25/38	2,000,000.00	2,745,220.00	
FRTR 4.25 10/25/23	1,000,000.00	1,065,540.00	
FRTR 4.5 04/25/41	2,000,000.00	2,960,260.00	
FRTR 4.75 04/25/35	2,200,000.00	3,087,304.00	
FRTR 5.5 04/25/29	2,350,000.00	3,079,886.50	
FRTR 5.75 10/25/32	400,000.00	576,956.00	
FRTR 6 10/25/25	3,000,000.00	3,569,880.00	
FRTR 8.5 04/25/23	600,000.00	655,032.00	
IRISH 0.9 05/15/28	700,000.00	697,942.00	
IRISH 1 05/15/26	600,000.00	607,716.00	
IRISH 1.1 05/15/29	1,600,000.00	1,606,720.00	
IRISH 1.3 05/15/33	1,000,000.00	990,180.00	
IRISH 1.35 03/18/31	500,000.00	508,925.00	
IRISH 1.5 05/15/50	500,000.00	479,115.00	
IRISH 1.7 05/15/37	300,000.00	308,805.00	
IRISH 2 02/18/45	900,000.00	968,886.00	
IRISH 2.4 05/15/30	600,000.00	661,236.00	
IRISH 3.4 03/18/24	500,000.00	530,970.00	
IRISH 5.4 03/13/25	800,000.00	913,272.00	
NETHER 0 01/15/24	1,000,000.00	1,000,320.00	
NETHER 0 01/15/27	800,000.00	775,216.00	
NETHER 0 07/15/30	2,600,000.00	2,411,474.00	
NETHER 0.25 07/15/25	1,700,000.00	1,690,650.00	
NETHER 0.25 07/15/29	500,000.00	478,685.00	
NETHER 0.5 01/15/40	1,700,000.00	1,537,701.00	
NETHER 0.5 07/15/26	1,700,000.00	1,695,920.00	
NETHER 0.75 07/15/27	400,000.00	400,880.00	
NETHER 0.75 07/15/28	1,500,000.00	1,497,585.00	
NETHER 1.75 07/15/23	800,000.00	821,064.00	
NETHER 2 07/15/24	1,000,000.00	1,041,410.00	
NETHER 2.5 01/15/33	600,000.00	688,434.00	
NETHER 2.75 01/15/47	1,500,000.00	2,057,655.00	
NETHER 3.75 01/15/42	1,300,000.00	1,914,159.00	

NETHER 4 01/15/37	1,400,000.00	1,950,060.00	
NETHER 5.5 01/15/28	700,000.00	887,838.00	
OBL 0 04/05/24	1,300,000.00	1,298,661.00	
OBL 0 04/11/25	2,800,000.00	2,774,716.00	
OBL 0 04/14/23	200,000.00	200,834.00	
OBL 0 10/09/26	1,100,000.00	1,074,689.00	
OBL 0 10/10/25	1,800,000.00	1,776,456.00	
OBL 0 10/13/23	1,600,000.00	1,605,184.00	
OBL 0 10/18/24	600,000.00	596,844.00	
RAGB 0 02/20/30	900,000.00	826,137.00	
RAGB 0 02/20/31	800,000.00	721,392.00	
RAGB 0 07/15/23	600,000.00	601,716.00	
RAGB 0.5 02/20/29	550,000.00	531,921.50	
RAGB 0.5 04/20/27	500,000.00	494,045.00	
RAGB 0.75 02/20/28	700,000.00	696,080.00	
RAGB 0.75 03/20/51	900,000.00	751,077.00	
RAGB 0.75 10/20/26	900,000.00	902,997.00	
RAGB 0.85 06/30/20	150,000.00	84,864.00	
RAGB 1.2 10/20/25	1,000,000.00	1,023,800.00	
RAGB 1.5 02/20/47	700,000.00	716,205.00	
RAGB 1.5 11/02/86	200,000.00	182,634.00	
RAGB 1.65 10/21/24	1,200,000.00	1,243,200.00	
RAGB 1.75 10/20/23	1,000,000.00	1,028,370.00	
RAGB 2.4 05/23/34	600,000.00	675,066.00	
RAGB 3.15 06/20/44	500,000.00	674,300.00	
RAGB 3.8 01/26/62	700,000.00	1,167,852.00	
RAGB 4.15 03/15/37	600,000.00	829,734.00	
RAGB 4.85 03/15/26	500,000.00	584,615.00	
RAGB 6.25 07/15/27	1,000,000.00	1,289,020.00	
RFGB 0.25 09/15/40	300,000.00	245,988.00	
RFGB 0.5 04/15/26	800,000.00	797,088.00	
RFGB 0.5 09/15/28	400,000.00	389,588.00	
RFGB 0.5 09/15/29	800,000.00	771,576.00	
RFGB 0.75 04/15/31	500,000.00	485,450.00	
RFGB 1.375 04/15/47	300,000.00	307,266.00	
RFGB 1.5 04/15/23	200,000.00	203,738.00	
RFGB 2 04/15/24	1,000,000.00	1,037,860.00	
RFGB 2.625 07/04/42	1,000,000.00	1,230,310.00	
RFGB 2.75 07/04/28	400,000.00	446,384.00	
RFGB 4 07/04/25	600,000.00	669,504.00	
SPGB 0 01/31/25	500,000.00	491,540.00	
SPGB 0.25 07/30/24	1,400,000.00	1,393,910.00	
SPGB 0.5 04/30/30	1,000,000.00	932,860.00	
SPGB 0.5 10/31/31	1,400,000.00	1,261,204.00	

SPGB 0.8 07/30/27	400,000.00	393,536.00	
SPGB 1 10/31/50	300,000.00	226,425.00	
SPGB 1.2 10/31/40	700,000.00	608,601.00	
SPGB 1.25 10/31/30	3,000,000.00	2,950,380.00	
SPGB 1.3 10/31/26	3,100,000.00	3,146,376.00	
SPGB 1.4 04/30/28	2,200,000.00	2,228,424.00	
SPGB 1.4 07/30/28	1,600,000.00	1,618,848.00	
SPGB 1.45 04/30/29	2,000,000.00	2,022,760.00	
SPGB 1.45 10/31/27	2,600,000.00	2,643,160.00	
SPGB 1.45 10/31/71	400,000.00	274,568.00	
SPGB 1.5 04/30/27	700,000.00	714,063.00	
SPGB 1.6 04/30/25	1,400,000.00	1,439,508.00	
SPGB 1.85 07/30/35	2,700,000.00	2,702,160.00	
SPGB 1.95 04/30/26	2,000,000.00	2,079,820.00	
SPGB 1.95 07/30/30	1,700,000.00	1,770,125.00	
SPGB 2.15 10/31/25	2,400,000.00	2,508,888.00	
SPGB 2.35 07/30/33	1,500,000.00	1,596,165.00	
SPGB 2.7 10/31/48	1,050,000.00	1,174,498.50	
SPGB 2.75 10/31/24	2,100,000.00	2,221,170.00	
SPGB 2.9 10/31/46	1,700,000.00	1,970,079.00	
SPGB 3.45 07/30/66	1,300,000.00	1,611,428.00	
SPGB 3.8 04/30/24	1,400,000.00	1,496,754.00	
SPGB 4.2 01/31/37	1,650,000.00	2,150,758.50	
SPGB 4.4 10/31/23	2,000,000.00	2,131,840.00	
SPGB 4.65 07/30/25	1,800,000.00	2,023,470.00	
SPGB 4.7 07/30/41	1,500,000.00	2,154,930.00	
SPGB 4.8 01/31/24	3,000,000.00	3,239,340.00	
SPGB 4.9 07/30/40	1,200,000.00	1,745,796.00	
SPGB 5.15 10/31/28	1,500,000.00	1,866,600.00	
SPGB 5.15 10/31/44	1,000,000.00	1,566,760.00	
SPGB 5.75 07/30/32	1,500,000.00	2,088,195.00	
SPGB 5.9 07/30/26	500,000.00	604,100.00	
SPGB 6 01/31/29	2,200,000.00	2,889,128.00	
一口小計	394,690,000.00	421,621,364.00 (57,277,262,299)	
国債証券合計		155,013,648,989 (155,013,648,989)	
合計		155,013,648,989 (155,013,648,989)	

(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 196銘柄	48.4%	48.9%

カナダ・ドル	国債証券	21銘柄	2.0%	2.0%
オーストラリア・ドル	国債証券	18銘柄	1.6%	1.6%
シンガポール・ドル	国債証券	11銘柄	0.4%	0.4%
イギリス・ポンド	国債証券	43銘柄	5.4%	5.4%
イスラエル・シケル	国債証券	5銘柄	0.4%	0.5%
デンマーク・クローネ	国債証券	6銘柄	0.4%	0.4%
ノルウェー・クローネ	国債証券	7銘柄	0.3%	0.3%
スウェーデン・クローナ	国債証券	6銘柄	0.3%	0.3%
メキシコ・ペソ	国債証券	9銘柄	0.7%	0.7%
オフショア・人民元	国債証券	8銘柄	1.5%	1.5%
マレーシア・リングギット	国債証券	6銘柄	0.5%	0.5%
ポーランド・ズロチ	国債証券	5銘柄	0.4%	0.4%
ユーロ	国債証券	261銘柄	36.6%	36.9%

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

マネーインカム・マザーファンド

(1) 貸借対照表

(単位：円)

	(2021年4月13日現在)	(2022年4月13日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	353,667,650	11,627,715
コール・ローン	183,291,158	446,032,013
国債証券	220,025,960	300,054,000
特殊債券	1,517,370,344	1,196,252,766
未収利息	3,234,062	1,138,662
前払費用	-	237,925
流動資産合計	2,277,589,174	1,955,343,081
資産合計	2,277,589,174	1,955,343,081
負債の部		
流動負債		
未払解約金	1,200,000	4,684,078
未払利息	502	-
その他未払費用	4,950	1,766
流動負債合計	1,205,452	4,685,844
負債合計	1,205,452	4,685,844
純資産の部		
元本等		
元本	2,257,314,469	1,935,317,393
剰余金		
剰余金又は欠損金()	19,069,253	15,339,844
元本等合計	2,276,383,722	1,950,657,237
純資産合計	2,276,383,722	1,950,657,237
負債純資産合計	2,277,589,174	1,955,343,081

(2) 注記表

(重要な会計方針の注記)

項目	自 2021年4月14日 至 2022年4月13日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券、特殊債券は個別法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額(ただし、売気配相場は使用しない)、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>

(重要な会計上の見積りに関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

項目	(2021年4月13日現在)	(2022年4月13日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	2,257,314,469口	1,935,317,393口
2. 1単位あたり純資産の額	1口あたり純資産額 1.0084円 (1万口当たりの純資産額10,084円)	1口あたり純資産額 1.0079円 (1万口当たりの純資産額10,079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 2021年4月14日 至 2022年4月13日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、国債証券、特殊債券を組み入れております。</p>

	<p>2) デリバティブ取引</p> <p>当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク</p> <p>有価証券およびデリバティブ取引等</p> <p>当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>
<p>3. 金融商品に係るリスク管理体制</p>	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する会議をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用部署に是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用部署は、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。なお、投資信託協会の流動性リスク管理規制に抵触する場合には、流動性リスクを管理する会議で審議の上、流動性リスクの管理責任者が対処方針を決定します。その後、決定した対処方針やその実施等について、リスク管理会議に報告を行う体制となっております。</p> <p>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する会議にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。</p>
<p>4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明</p>	<p>金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。</p>

・金融商品の時価等に関する事項

<p>項 目</p>	<p>(2022年4月13日現在)</p>
------------	-----------------------

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

(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 2021年4月14日 至 2022年4月13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)

(2021年4月13日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	2,617,198,028円
同期中における追加設定元本額	1,166,758,748円
同期中における一部解約元本額	1,526,642,307円
2021年4月13日現在の元本の内訳	
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2020(4資産タイプ)	100,839,042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)	116,052,823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)	47,825,996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)	32,545,911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)	20,369,659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)	38,075,492円
米国小型ハイクオリティファンド(毎月決算型)	99,128円
米国小型ハイクオリティファンド(資産成長型)	297,384円
SMAM・マネーインカムファンド<適格機関投資家限定>	890,895,719円
SMAM・バランス先物ファンドVA20<適格機関投資家限定>	164,438,276円
SMAM・FGマネーファンドVA<適格機関投資家限定>	845,875,039円
合計	2,257,314,469円

(2022年4月13日現在)

開示対象ファンドの

期首における当該親投資信託の元本額	2,257,314,469円
同期中における追加設定元本額	955,084,096円
同期中における一部解約元本額	1,277,081,172円
2022年4月13日現在の元本の内訳	
S M A M ・ グローバルバランスファンド(機動的資産配分型)	21,805,906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)	102,779,034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)	162,087,175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)	89,556,632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)	42,692,099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)	29,057,907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)	49,084,616円
米国小型ハイクオリティファンド(毎月決算型)	99,128円
米国小型ハイクオリティファンド(資産成長型)	297,384円
S M A M ・ マネーインカムファンド<適格機関投資家限定>	858,040,993円
S M A M ・ F G マネーファンドV A <適格機関投資家限定>	579,816,519円
合 計	1,935,317,393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	1055 国庫短期証券	100,000,000	100,008,900	
	1062 国庫短期証券	100,000,000	100,018,800	
	1067 国庫短期証券	100,000,000	100,026,300	
	国債証券 小計		300,054,000	
特殊債券	19 政保政策投資C	100,000,000	100,667,700	
	163 政保道路機構	100,000,000	100,127,300	
	166 政保道路機構	100,000,000	100,197,100	
	170 政保道路機構	100,000,000	100,326,100	
	177 政保道路機構	100,000,000	100,546,300	
	180 政保道路機構	100,000,000	100,557,200	
	182 政保道路機構	123,000,000	123,870,102	
	189 政保道路機構	100,000,000	100,615,000	
	40 政保地方公共団	69,000,000	69,252,264	
	42 政保日本政策	200,000,000	200,054,800	
	229 政保預金保険	100,000,000	100,038,900	
	特殊債券 小計		1,196,252,766	
	合 計		1,496,306,766	

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。

【中間財務諸表】

1. 当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和52年大蔵省令第38号)ならびに同規則第38条の3、第57条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)に基づいて作成しております。
なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
2. 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第15期中間計算期間(2022年4月14日から2022年10月13日まで)の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。

【SMAM・グローバルバランスファンド(機動的資産配分型)】

(1)【中間貸借対照表】

(単位:円)

	第14期 (2022年4月13日現在)	第15期中間計算期間 (2022年10月13日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	321,669	657,672
コール・ローン	12,339,012	16,385,099
親投資信託受益証券	2,093,898,903	2,015,947,981
未収入金	5,000,000	700,000
流動資産合計	2,111,559,584	2,033,690,752
資産合計	2,111,559,584	2,033,690,752
負債の部		
流動負債		
未払解約金	2,849,560	785,079
未払受託者報酬	341,072	337,683
未払委託者報酬	6,367,451	6,304,123
その他未払費用	56,837	56,279
流動負債合計	9,614,920	7,483,164
負債合計	9,614,920	7,483,164
純資産の部		
元本等		
元本	1,390,422,023	1,384,128,339
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金()	711,522,641	642,079,249
(分配準備積立金)	229,117,187	205,255,459
元本等合計	2,101,944,664	2,026,207,588
純資産合計	2,101,944,664	2,026,207,588
負債純資産合計	2,111,559,584	2,033,690,752

(2) 【中間損益及び剰余金計算書】

(単位 : 円)

	第14期中間計算期間 自 2021年 4月14日 至 2021年10月13日	第15期中間計算期間 自 2022年 4月14日 至 2022年10月13日
営業収益		
受取利息	9	71
有価証券売買等損益	36,983,672	59,590,922
営業収益合計	36,983,681	59,590,851
営業費用		
支払利息	4,962	2,879
受託者報酬	327,092	337,683
委託者報酬	6,105,734	6,304,123
その他費用	55,476	56,384
営業費用合計	6,493,264	6,701,069
営業利益又は営業損失()	30,490,417	66,291,920
経常利益又は経常損失()	30,490,417	66,291,920
中間純利益又は中間純損失()	30,490,417	66,291,920
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額()	1,217,847	2,960,988
期首剰余金又は期首欠損金()	641,601,915	711,522,641
剰余金増加額又は欠損金減少額	62,239,148	70,533,330
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	62,239,148	70,533,330
剰余金減少額又は欠損金増加額	44,942,616	76,645,790
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	44,942,616	76,645,790
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金()	688,171,017	642,079,249

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針の注記)

項 目	第15期中間計算期間 自 2022年4月14日 至 2022年10月13日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>

(中間貸借対照表に関する注記)

項 目	第14期 (2022年4月13日現在)	第15期中間計算期間 (2022年10月13日現在)
1. 当中間計算期間の末日における受益権の総数	1,390,422,023口	1,384,128,339口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.5117円 (1万口当たりの純資産額15,117円)	1口当たり純資産額 1.4639円 (1万口当たりの純資産額14,639円)

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項 目	第15期中間計算期間 (2022年10月13日現在)
1. 中間貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券（親投資信託受益証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

項目	第14期 (2022年4月13日現在)	第15期中間計算期間 (2022年10月13日現在)
期首元本額	1,295,316,193円	1,390,422,023円
期中追加設定元本額	269,771,610円	143,653,994円
期中一部解約元本額	174,665,780円	149,947,678円

（参考）

S M A M・グローバルバランスファンド（機動的資産配分型）は、「国内株式インデックス・マザーファンド（B号）」、「国内債券パッシブ・マザーファンド」、「外国株式インデックス・マザーファンド」、「外国債券パッシブ・マザーファンド」および「マネーインカム・マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、中間貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同マザーファンドの受益証券です。

なお、以下に記載した状況は、監査の対象外です。

国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

（1）貸借対照表

（単位：円）

	(2022年4月13日現在)	(2022年10月13日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	35,806,941	104,385,566
コール・ローン	1,373,532,285	2,600,639,532
株式	197,920,121,230	202,907,138,612
派生商品評価勘定	19,744,700	1,660,100
未収配当金	2,365,057,715	2,180,666,339
前払金	139,360,000	22,025,000
差入委託証拠金	157,590,000	209,550,000
流動資産合計	202,011,212,871	208,026,065,149
資産合計	202,011,212,871	208,026,065,149
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	92,875,700	75,397,800
未払解約金	51,245,960	294,051,331
その他未払費用	9,440	14,357
流動負債合計	144,131,100	369,463,488
負債合計	144,131,100	369,463,488
純資産の部		
元本等		
元本	63,097,233,521	65,278,173,848
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	138,769,848,250	142,378,427,813

元本等合計	201,867,081,771	207,656,601,661
純資産合計	201,867,081,771	207,656,601,661
負債純資産合計	202,011,212,871	208,026,065,149

(2) 注記表

(重要な会計方針の注記)

項目	自 2022年4月14日 至 2022年10月13日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算期間末日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場によっております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金の計上基準 受取配当金は原則として、配当落ち日において、確定配当金額または予想配当金額を計上しております。なお、配当金額が未確定の場合は、入金日基準で計上しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

項目	(2022年4月13日現在)	(2022年10月13日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	63,097,233,521口	65,278,173,848口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 3.1993円 (1万口当たりの純資産額31,993円)	1口当たり純資産額 3.1811円 (1万口当たりの純資産額31,811円)

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項目	(2022年10月13日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券（株式） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。

	<p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>
--	--

（デリバティブ取引に関する注記）

（2022年4月13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 0406月	4,049,481,000	-	3,976,350,000	73,131,000
	小計	4,049,481,000	-	3,976,350,000	73,131,000
合 計		4,049,481,000	-	3,976,350,000	73,131,000

（2022年10月13日現在）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

（単位：円）

区 分	種 類	契 約 額 等		時 価	評 価 損 益
			う ち 1 年 超		
市場取引	株価指数先物取引 買建				
	TOPIX 先物 0412月	4,816,672,700	-	4,742,935,000	73,737,700
	小計	4,816,672,700	-	4,742,935,000	73,737,700
合 計		4,816,672,700	-	4,742,935,000	73,737,700

（注）1．時価の算定方法

株価指数先物取引の時価の算定方法については以下のように評価しております。

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

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

2)株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

2．ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

（その他の注記）

（2022年4月13日現在）

開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	60,307,285,983円
同期中における追加設定元本額	11,806,523,474円
同期中における一部解約元本額	9,016,575,936円

2022年4月13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	9,524,501,074円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	980,498,940円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	4,538,348,289円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	3,440,118,395円
SMAM・グローバルバランスファンド(機動的資産配分型)	128,286,319円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2020(4資産タイプ)	4,784,541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)	20,797,656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)	64,462,163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)	154,781,571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)	133,882,770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)	242,084,389円
国内株式指数ファンド(TOPIX)	1,489,236,000円
三井住友・DCつみたてNISA・日本株インデックスファンド	19,582,111,751円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	146,334,176円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	231,330,362円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	152,943,467円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050	31,895,783円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	182,885,633円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	165,851,866円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	584,008,251円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	318,357,546円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	360,155,415円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	41,466,339円
三井住友DS・国内株式インデックス年金ファンド	547,071,614円
三井住友DS・年金バランス30(債券重点型)	17,456,337円
三井住友DS・年金バランス50(標準型)	88,881,884円
三井住友DS・年金バランス70(株式重点型)	94,685,297円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	4,047,832円
日興FWS・日本株インデックス	582,504,321円
三井住友DS・TOPIXインデックス・ファンド	5,086,487円
SMAM・国内株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	2,743,586,165円
バランスファンドVA(安定運用型) <適格機関投資家限定>	12,823,736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>	97,797,524円
SMAM・バランスファンドVA25 <適格機関投資家専用>	1,769,964,821円
SMAM・バランスファンドVA37.5 <適格機関投資家専用>	1,640,393,274円
SMAM・バランスファンドVA50 <適格機関投資家専用>	6,218,766,294円
SMAM・バランスファンドVL30 <適格機関投資家限定>	40,740,210円
SMAM・バランスファンドVL50 <適格機関投資家限定>	159,471,500円
SMAM・バランスファンドVA75 <適格機関投資家専用>	735,491,821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>	46,826,720円
SMAM・インデックス・バランスVA25 <適格機関投資家専用>	257,810,451円
SMAM・インデックス・バランスVA50 <適格機関投資家専用>	839,187,037円
SMAM・バランスファンドVA40 <適格機関投資家専用>	607,019,790円
SMAM・バランスファンドVA35 <適格機関投資家専用>	1,876,743,832円
SMAM・バランスVA株40T <適格機関投資家限定>	374,931円
SMAM・グローバルバランス40VA <適格機関投資家限定>	42,725,221円

SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>	47,564,568円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>	34,436,924円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用>	16,874,370円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>	113,224,715円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	245,176,007円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A2<適格機関投資家専用>	60,459,399円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A2<適格機関投資家専用>	41,778,678円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A2<適格機関投資家専用>	7,630,596円
SMAM・アセットバランスファンドVA30L2<適格機関投資家専用>	44,249,093円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L2<適格機関投資家専用>	601,227,185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)	181,398,201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>	228,400,003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>	101,339,489円
SMAM・世界バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	181,801,332円
SMAM・世界バランスファンドVA2<適格機関投資家限定>	55,617,287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>	43,072,081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>	28,371,625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>	36,568,156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>	67,859,289円
SMDAM・日米3資産バランスオープン<適格機関投資家限定>	11,604,728円
合計	63,097,233,521円

(2022年10月13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	63,097,233,521円
同期中における追加設定元本額	5,582,031,584円
同期中における一部解約元本額	3,401,091,257円

2022年10月13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	9,599,611,966円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	1,050,007,924円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	4,674,125,018円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	3,593,259,903円
SMAM・グローバルバランスファンド(機動的資産配分型)	126,173,868円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2020(4資産タイプ)	4,359,754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)	20,004,779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)	66,062,612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)	168,369,176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)	152,307,266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)	268,485,068円
国内株式指数ファンド(TOPIX)	1,452,962,836円
三井住友・DCつみたてNISA・日本株インデックスファンド	21,524,419,965円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	131,058,857円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	212,157,060円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	139,804,903円
イオン・バランス戦略ファンド	17,477,169円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050	42,068,527円

三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	191,899,392円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	180,541,009円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	657,417,555円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	365,398,473円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	413,679,933円
三井住友・DCつみたてN I S A・世界分散ファンド	48,951,021円
三井住友D S・国内株式インデックス年金ファンド	781,990,168円
三井住友D S・年金バランス30(債券重点型)	40,400,902円
三井住友D S・年金バランス50(標準型)	196,455,374円
三井住友D S・年金バランス70(株式重点型)	187,337,426円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2060	5,557,988円
日興F W S・日本株インデックス	1,112,218,010円
三井住友D S・T O P I Xインデックス・ファンド	15,972,616円
S M A M・国内株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	2,636,850,032円
バランスファンドV A(安定運用型) <適格機関投資家限定>	11,474,292円
S M A M・バランスファンドV A安定成長型 <適格機関投資家限定>	79,456,538円
S M A M・バランスファンドV A 2 5 <適格機関投資家専用>	1,568,758,365円
S M A M・バランスファンドV A 3 7 . 5 <適格機関投資家専用>	1,539,747,417円
S M A M・バランスファンドV A 5 0 <適格機関投資家専用>	5,797,625,995円
S M A M・バランスファンドV L 3 0 <適格機関投資家限定>	38,205,939円
S M A M・バランスファンドV L 5 0 <適格機関投資家限定>	144,473,228円
S M A M・バランスファンドV A 7 5 <適格機関投資家専用>	694,789,862円
S M A M・バランスファンドV L国際分散型 <適格機関投資家限定>	46,213,392円
S M A M・インデックス・バランスV A 2 5 <適格機関投資家専用>	254,234,553円
S M A M・インデックス・バランスV A 5 0 <適格機関投資家専用>	801,202,128円
S M A M・バランスファンドV A 4 0 <適格機関投資家専用>	555,586,499円
S M A M・バランスファンドV A 3 5 <適格機関投資家専用>	1,729,215,024円
S M A M・バランスV A株40T <適格機関投資家限定>	372,784円
S M A M・グローバルバランス40V A <適格機関投資家限定>	37,699,412円
S M A M・アセットバランスファンドV A 2 0 A <適格機関投資家専用>	43,041,505円
S M A M・アセットバランスファンドV A 3 5 A <適格機関投資家専用>	32,479,210円
S M A M・アセットバランスファンドV A 5 0 A <適格機関投資家専用>	16,795,425円
S M A M・アセットバランスファンドV A 2 0 L <適格機関投資家専用>	101,803,881円
S M A M・アセットバランスファンドV A 2 5 L <適格機関投資家専用>	230,466,699円
S M A M・アセットバランスファンドV A 2 0 A 2 <適格機関投資家専用>	54,297,783円
S M A M・アセットバランスファンドV A 3 5 A 2 <適格機関投資家専用>	38,723,328円
S M A M・アセットバランスファンドV A 5 0 A 2 <適格機関投資家専用>	7,737,301円
S M A M・アセットバランスファンドV A 3 0 L 2 <適格機関投資家専用>	42,112,383円
S M A M・アセットバランスファンドV A 2 5 L 2 <適格機関投資家専用>	562,014,298円
S M A M・国内株式インデックスファンド・V A(適格機関投資家専用)	171,790,446円
S M A M・グローバルバランスファンド(標準型)V A <適格機関投資家限定>	211,396,741円
S M A M・グローバルバランスファンド(債券重視型)V A <適格機関投資家限定>	90,728,678円
S M A M・世界バランスファンドV A <適格機関投資家限定>	108,633,632円
S M A M・世界バランスファンドV A 2 <適格機関投資家限定>	47,780,927円
S M A M・年金Wリスクコントロールファンド <適格機関投資家限定>	45,934,025円
S M A M・マルチアセットストラテジーファンド2016-04 <適格機関投資家限定>	9,786,781円
S M A M・マルチアセットストラテジー・オープン <適格機関投資家限定>	12,298,327円

S M A M・マルチアセット・ダイナミックアロケーション・ストラテジー・ファンド < 適格機関投資家限定 >	55,774,152円
S M D A M・日米3資産バランスオープン<適格機関投資家限定>	18,136,348円
合 計	65,278,173,848円

国内債券パッシブ・マザーファンド

(1) 貸借対照表

(単位：円)

	(2022年4月13日現在)	(2022年10月13日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	78,454,043	17,182,435
コール・ローン	3,009,448,965	428,079,478
国債証券	109,049,192,830	103,322,142,370
地方債証券	9,573,035,400	10,053,059,300
特殊債券	9,360,292,837	9,371,776,847
社債券	5,074,875,400	6,613,751,300
未収入金	-	268,433,200
未収利息	206,523,392	194,181,010
前払費用	3,702,938	5,216,732
流動資産合計	136,355,525,805	130,273,822,672
資産合計	136,355,525,805	130,273,822,672
負債の部		
流動負債		
未払金	2,783,309,300	200,000,000
未払解約金	28,069,291	24,168,000
その他未払費用	1,645	2,618
流動負債合計	2,811,380,236	224,170,618
負債合計	2,811,380,236	224,170,618
純資産の部		
元本等		
元本	106,340,184,500	105,540,937,611
剰余金		
剰余金又は欠損金 ()	27,203,961,069	24,508,714,443
元本等合計	133,544,145,569	130,049,652,054
純資産合計	133,544,145,569	130,049,652,054
負債純資産合計	136,355,525,805	130,273,822,672

(2) 注記表

(重要な会計方針の注記)

項 目	自 2022年4月14日 至 2022年10月13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。

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

（貸借対照表に関する注記）

項目	（2022年4月13日現在）	（2022年10月13日現在）
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	106,340,184,500口	105,540,937,611口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.2558円 （1万口当たりの純資産額12,558円）	1口当たり純資産額 1.2322円 （1万口当たりの純資産額12,322円）

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

項目	（2022年10月13日現在）
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券（国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

（2022年4月13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	102,034,101,931円
同期中における追加設定元本額	21,659,250,973円
同期中における一部解約元本額	17,353,168,404円
2022年4月13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）	6,923,891,754円
三井住友・DC年金バランス50（標準型）	11,792,397,296円

三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	2,736,892,316円
S M A M・グローバルバランスファンド(機動的資産配分型)	839,744,278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)	44,108,804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)	187,516,541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)	486,968,806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)	750,745,280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)	365,715,230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)	518,385,905円
三井住友・DC年金バランスゼロ(債券型)	140,087,519円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	1,955,662,979円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	1,043,531,372円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	412,203,992円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2050	46,655,634円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	1,982,377,274円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	668,842,364円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	1,064,221,378円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	248,790,463円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	92,208,160円
三井住友・DCつみたてN I S A・世界分散ファンド	159,906,861円
三井住友D S・年金バランス30(債券重点型)	122,767,259円
三井住友D S・年金バランス50(標準型)	231,236,748円
三井住友D S・年金バランス70(株式重点型)	72,742,695円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2060	5,891,970円
S M A M・年金グローバル債券ファンド<適格機関投資家限定>	1,421,401,910円
S M A M・バランスファンドV A 2 5<適格機関投資家専用>	12,050,047,984円
S M A M・バランスファンドV A 3 7 . 5<適格機関投資家専用>	6,248,907,618円
S M A M・バランスファンドV A 5 0<適格機関投資家専用>	15,755,830,892円
S M A M・バランスファンドV L 3 0<適格機関投資家限定>	320,961,241円
S M A M・バランスファンドV L 5 0<適格機関投資家限定>	557,125,171円
S M A M・バランスファンドV A 7 5<適格機関投資家専用>	265,176,086円
S M A M・バランスファンドV L 国際分散型<適格機関投資家限定>	122,772,968円
S M A M・インデックス・バランスV A 2 5<適格機関投資家専用>	1,830,653,508円
S M A M・インデックス・バランスV A 5 0<適格機関投資家専用>	2,180,257,745円
S M A M・バランスファンドV A 4 0<適格機関投資家専用>	2,384,904,244円
S M A M・バランスファンドV A 3 5<適格機関投資家専用>	8,380,559,091円
S M A M・バランスV A 株4 0 T<適格機関投資家限定>	972,339円
三井住友・国内債券インデックスファンド・V A S (適格機関投資家専用)	1,159,868,412円
S M A M・グローバルバランス4 0 V A<適格機関投資家限定>	446,913,980円
S M A M・アセットバランスファンドV A 2 0 A<適格機関投資家専用>	535,210,250円
S M A M・アセットバランスファンドV A 3 5 A<適格機関投資家専用>	179,486,947円
S M A M・アセットバランスファンドV A 5 0 A<適格機関投資家専用>	44,152,419円
S M A M・アセットバランスファンドV A 2 0 L<適格機関投資家専用>	1,440,382,485円
S M A M・アセットバランスファンドV A 2 5 L<適格機関投資家専用>	2,107,627,635円
S M A M・アセットバランスファンドV A 2 0 A 2<適格機関投資家専用>	683,112,177円
S M A M・アセットバランスファンドV A 3 5 A 2<適格機関投資家専用>	205,571,184円
S M A M・アセットバランスファンドV A 5 0 A 2<適格機関投資家専用>	18,779,320円
S M A M・アセットバランスファンドV A 3 0 L 2<適格機関投資家専用>	272,432,388円
S M A M・アセットバランスファンドV A 2 5 L 2<適格機関投資家専用>	5,120,316,774円

S M A M ・ 年 金 W リ ス ク コ ン ト ロ ー ル フ ァ ン ド < 適 格 機 関 投 資 家 限 定 >	1,146,512,165円
S M A M ・ マ ル チ ア セ ッ ト ス ト ラ テ ジ ー フ ァ ン ド 2 0 1 6 - 0 4 < 適 格 機 関 投 資 家 限 定 >	1,157,293,722円
S M A M ・ マ ル チ ア セ ッ ト ス ト ラ テ ジ ー ・ オ ー プ ン < 適 格 機 関 投 資 家 限 定 >	1,481,392,104円
S M A M ・ マ ル チ ア セ ッ ト ・ ダ イ ナ ミ ッ ク ア ロ ケ ー シ ョ ン ・ ス ト ラ テ ジ ー ・ フ ァ ン ド < 適 格 機 関 投 資 家 限 定 >	5,928,068,863円
合 計	106,340,184,500円

(2022年10月13日現在)

開示対象ファンドの

期首における当該親投資信託の元本額	106,340,184,500円
同期中における追加設定元本額	13,271,067,381円
同期中における一部解約元本額	14,070,314,270円

2022年10月13日現在の元本の内訳

三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	7,479,422,364円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	12,264,523,127円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	2,847,369,109円
S M A M ・ グ ロ ー バ ル バ ラ ン ス フ ァ ン ド (機 動 的 資 産 配 分 型)	825,100,046円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2020(4資産タイプ)	41,200,565円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2025(4資産タイプ)	189,158,599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)	514,005,575円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2035(4資産タイプ)	879,925,767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)	455,593,098円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2045(4資産タイプ)	581,737,665円
三井住友・DC年金バランスゼロ(債券型)	141,753,971円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	1,924,964,674円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	1,056,053,003円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	422,825,277円
三井住友D S ・ D C タ ー ゲ ッ ト イ ー ヤ ー フ ァ ン ド 2 0 5 0	60,604,247円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	1,952,964,401円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	663,288,141円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	992,887,605円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	220,913,535円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	35,698,724円
三井住友・DCつみたてN I S A ・ 世 界 分 散 フ ァ ン ド	197,456,398円
三井住友D S ・ 年 金 バ ラ ン ス 3 0 (債 券 重 点 型)	285,784,296円
三井住友D S ・ 年 金 バ ラ ン ス 5 0 (標 準 型)	515,371,388円
三井住友D S ・ 年 金 バ ラ ン ス 7 0 (株 式 重 点 型)	149,169,841円
三井住友D S ・ D C タ ー ゲ ッ ト イ ー ヤ ー フ ァ ン ド 2 0 6 0	8,007,380円
S M A M ・ 年 金 グ ロ ー バ ル 債 券 フ ァ ン ド < 適 格 機 関 投 資 家 限 定 >	1,204,216,972円
S M A M ・ バ ラ ン ス フ ァ ン ド V A 2 5 < 適 格 機 関 投 資 家 専 用 >	11,092,168,623円
S M A M ・ バ ラ ン ス フ ァ ン ド V A 3 7 . 5 < 適 格 機 関 投 資 家 専 用 >	6,039,047,880円
S M A M ・ バ ラ ン ス フ ァ ン ド V A 5 0 < 適 格 機 関 投 資 家 専 用 >	15,252,310,056円
S M A M ・ バ ラ ン ス フ ァ ン ド V L 3 0 < 適 格 機 関 投 資 家 限 定 >	306,310,460円
S M A M ・ バ ラ ン ス フ ァ ン ド V L 5 0 < 適 格 機 関 投 資 家 限 定 >	515,791,535円
S M A M ・ バ ラ ン ス フ ァ ン ド V A 7 5 < 適 格 機 関 投 資 家 専 用 >	257,205,778円
S M A M ・ バ ラ ン ス フ ァ ン ド V L 国 際 分 散 型 < 適 格 機 関 投 資 家 限 定 >	123,612,741円
S M A M ・ イ ン デ ッ ク ス ・ バ ラ ン ス V A 2 5 < 適 格 機 関 投 資 家 専 用 >	1,782,048,124円

SMAM・インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用>	2,124,463,694円
SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用>	2,201,598,177円
SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>	8,002,726,253円
SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定>	961,967円
三井住友・国内債券インデックスファンド・VAS(適格機関投資家専用)	1,098,441,463円
SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	399,654,186円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>	494,312,874円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>	171,990,647円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用>	43,587,883円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>	1,308,081,293円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	2,006,821,425円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A2<適格機関投資家専用>	641,904,071円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A2<適格機関投資家専用>	210,001,663円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A2<適格機関投資家専用>	20,814,251円
SMAM・アセットバランスファンドVA30L2<適格機関投資家専用>	262,637,029円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L2<適格機関投資家専用>	4,948,345,332円
SMAM・年金Wリスクコントロールファンド<適格機関投資家限定>	1,212,855,473円
SMAM・マルチアセットストラテジーファンド2016-04<適格機関投資家限定>	1,399,189,185円
SMAM・マルチアセットストラテジー・オープン<適格機関投資家限定>	1,788,397,969円
SMAM・マルチアセット・ダイナミックアロケーション・ストラテジー・ファンド<適格機関投資家限定>	5,925,661,811円
合計	105,540,937,611円

外国株式インデックス・マザーファンド

(1) 貸借対照表

(単位：円)

	(2022年4月13日現在)	(2022年10月13日現在)
資産の部		
流動資産		
預金	1,936,532,460	5,814,331,451
金銭信託	75,671,589	114,442,227
コール・ローン	2,902,715,751	2,851,189,013
株式	372,473,853,310	380,308,233,187
投資証券	9,939,902,140	9,197,044,167
派生商品評価勘定	71,064,623	20,163,295
未収入金	24,703,555	11,535,960
未収配当金	456,665,778	359,558,311
差入委託証拠金	1,059,785,844	5,155,068,856
流動資産合計	388,940,895,050	403,831,566,467
資産合計	388,940,895,050	403,831,566,467
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	45,750,848	1,104,656,493
未払金	-	86,893,601
未払解約金	582,876,494	65,950,136
その他未払費用	2,331	4,251

流動負債合計	628,629,673	1,257,504,481
負債合計	628,629,673	1,257,504,481
純資産の部		
元本等		
元本	63,653,360,828	69,924,760,009
剰余金		
剰余金又は欠損金()	324,658,904,549	332,649,301,977
元本等合計	388,312,265,377	402,574,061,986
純資産合計	388,312,265,377	402,574,061,986
負債純資産合計	388,940,895,050	403,831,566,467

(2) 注記表

(重要な会計方針の注記)

項目	自 2022年4月14日 至 2022年10月13日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式、投資証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額(ただし、売気配相場は使用しない)、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1) 先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算期間末日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場によっております。</p> <p>(2) 為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金の計上基準 受取配当金は原則として、配当落ち日において、確定配当金額または予想配当金額を計上しております。なお、配当金額が未確定の場合は、入金日基準で計上しております。</p>
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建資産等の会計処理 「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

項目	(2022年4月13日現在)	(2022年10月13日現在)
----	----------------	-----------------

1. 当計算期間の末日における 受益権の総数	63,653,360,828口	69,924,760,009口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 6.1004円 (1万口当たりの純資産額61,004円)	1口当たり純資産額 5.7572円 (1万口当たりの純資産額57,572円)

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項目	(2022年10月13日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券(株式、投資証券) 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定(デリバティブ取引) デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(デリバティブ取引に関する注記)

(2022年4月13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 JUN22	4,452,038,122	-	4,469,974,146	17,936,024
	SPI 200 FUTURES JUN22	227,121,578	-	225,741,568	1,380,010
	FTSE 100 IDX FUT JUN22	253,714,065	-	258,682,481	4,968,416
	EURO STOXX 50 JUN22	827,655,257	-	831,268,867	3,613,610
	小計	5,760,529,022	-	5,785,667,062	25,138,040
	合計	5,760,529,022	-	5,785,667,062	25,138,040

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち 1年超		
為替予約取引 買建					
	アメリカ・ドル	1,614,573,000	-	1,615,438,478	865,478
	カナダ・ドル	77,408,760	-	77,506,260	97,500

市場取引以外の取引	オーストラリア・ドル	29,774,720	-	29,938,976	164,256
	香港・ドル	17,783,310	-	17,792,967	9,657
	シンガポール・ドル	10,108,780	-	10,128,470	19,690
	イスラエル・シケル	4,695,600	-	4,693,992	1,608
	スイス・フラン	70,057,000	-	69,961,684	95,316
	スウェーデン・クローナ	6,207,760	-	6,189,900	17,860
	ユーロ	167,955,270	-	167,097,099	858,171
	小計	1,998,564,200	-	1,998,747,826	183,626
	売建				
	ニュージーランド・ドル	3,421,480	-	3,439,880	18,400
	イギリス・ポンド	6,539,120	-	6,528,612	10,508
	小計	9,960,600	-	9,968,492	7,892
	合計	2,008,524,800	-	2,008,716,318	175,734

(2022年10月13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 DEC22	11,186,959,142	-	10,229,507,286	957,451,856
	SPI 200 FUTURES DEC22	502,591,320	-	491,198,400	11,392,920
	FTSE 100 IDX FUT DEC22	601,721,955	-	568,752,332	32,969,623
	EURO STOXX 50 DEC22	1,920,233,559	-	1,821,110,537	99,123,022
	小計	14,211,505,976	-	13,110,568,555	1,100,937,421
	合計	14,211,505,976	-	13,110,568,555	1,100,937,421

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価の算定方法については以下のように評価しております。

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

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

2) 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

(単位：円)

	契約額等	

区分	種類		うち 1年超	時価	評価損益
市場取引以外の取引	為替予約取引 買建				
	アメリカ・ドル	1,942,343,796	-	1,953,000,248	10,656,452
	カナダ・ドル	90,597,510	-	90,944,212	346,702
	オーストラリア・ドル	83,668,565	-	84,425,083	756,518
	香港・ドル	29,900,186	-	30,054,362	154,176
	イギリス・ポンド	132,299,640	-	134,614,260	2,314,620
	スイス・フラン	71,679,331	-	72,046,815	367,484
	デンマーク・クローネ	22,003,548	-	22,130,835	127,287
	スウェーデン・クローナ	25,203,906	-	25,383,742	179,836
	ユーロ	341,238,292	-	342,779,440	1,541,148
	小計	2,738,934,774	-	2,755,378,997	16,444,223
	合計	2,738,934,774	-	2,755,378,997	16,444,223

(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。

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

(その他の注記)

(2022年4月13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	58,211,745,190円
同期中における追加設定元本額	16,194,701,899円
同期中における一部解約元本額	10,753,086,261円
2022年4月13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	32,822,168,470円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	261,268,707円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	1,053,868,131円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	751,708,601円

SMAM・グローバルバランスファンド(機動的資産配分型)	48,029,718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)	1,125,866円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2025(4資産タイプ)	5,678,753円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2030(4資産タイプ)	16,717,392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)	44,979,799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)	47,841,761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)	94,776,574円
外国株式指数ファンド	852,708,104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	14,465,738,967円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	96,142,646円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	103,195,277円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	68,329,125円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050	15,569,633円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	122,523,866円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	105,362,465円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	367,489,080円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	192,799,695円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	222,706,458円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	43,921,433円
三井住友DS・外国株式インデックス年金ファンド	745,787,382円
三井住友DS・年金バランス30(債券重点型)	4,562,841円
三井住友DS・年金バランス50(標準型)	20,366,246円
三井住友DS・年金バランス70(株式重点型)	19,837,949円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	1,976,165円
SMBC・DCインデックスファンド(MSCIコクサイ)	170,769,804円
日興FWS・先進国株インデックス(為替ヘッジあり)	162,944,584円
日興FWS・先進国株インデックス(為替ヘッジなし)	544,987,952円
三井住友DS・先進国株式インデックス・ファンド	21,467,988円
SMAM・外国株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	509,401,113円
バランスファンドVA(安定運用型)＜適格機関投資家限定＞	3,309,072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＞	25,733,245円
SMAM・バランスファンドVA25＜適格機関投資家専用＞	627,813,023円
SMAM・バランスファンドVA37.5＜適格機関投資家専用＞	773,029,117円
SMAM・バランスファンドVA50＜適格機関投資家専用＞	3,346,842,453円
SMAM・バランスファンドVL30＜適格機関投資家限定＞	10,889,499円
SMAM・バランスファンドVL50＜適格機関投資家限定＞	56,580,424円
SMAM・バランスファンドVA75＜適格機関投資家専用＞	451,874,051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＞	37,545,497円
SMAM・インデックス・バランスVA25＜適格機関投資家専用＞	93,355,655円
SMAM・インデックス・バランスVA50＜適格機関投資家専用＞	461,868,419円
SMAM・バランスファンドVA40＜適格機関投資家専用＞	326,103,369円
SMAM・バランスファンドVA35＜適格機関投資家専用＞	757,423,890円
SMAM・バランスVA株40T＜適格機関投資家限定＞	200,225円
三井住友・外国株式インデックスファンド・VAS(適格機関投資家専用)	208,564,505円
SMAM・グローバルバランス40VA＜適格機関投資家限定＞	69,160,413円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A＜適格機関投資家専用＞	8,668,847円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A＜適格機関投資家専用＞	7,431,222円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A＜適格機関投資家専用＞	3,930,927円

SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>	20,416,659円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	55,967,394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>	121,991,477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>	54,169,208円
SMAM・世界バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	509,774,724円
SMAM・世界バランスファンドVA2<適格機関投資家限定>	93,680,381円
SMAM・外国株式インデックスファンドSA<適格機関投資家限定>	1,402,985,029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>	22,195,395円
SMAM・マルチアセットストラテジーファンド2016-04<適格機関投資家限定>	14,310,453円
SMAM・マルチアセットストラテジー・オープン<適格機関投資家限定>	18,636,428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>	62,157,282円
合計	63,653,360,828円

(2022年10月13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	63,653,360,828円
同期中における追加設定元本額	11,886,058,884円
同期中における一部解約元本額	5,614,659,703円

2022年10月13日現在の元本の内訳

三井住友・DC外国株式インデックスファンドS	35,778,546,247円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	286,380,185円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	1,089,654,124円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	788,827,504円
SMAM・グローバルバランスファンド(機動的資産配分型)	48,098,144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)	1,017,107円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2025(4資産タイプ)	5,342,658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)	17,370,416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)	50,367,711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)	56,316,201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)	105,589,648円
外国株式指数ファンド	928,352,818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	17,163,193,342円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	87,908,136円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	97,508,641円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	63,989,360円
イオン・バランス戦略ファンド	11,870,137円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050	20,894,936円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	132,091,669円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	117,575,335円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	429,076,959円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	231,069,044円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	264,982,635円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	54,384,063円
三井住友DS・外国株式インデックス年金ファンド	1,360,532,243円
三井住友DS・年金バランス30(債券重点型)	11,161,705円
三井住友DS・年金バランス50(標準型)	46,510,397円

三井住友DS・年金バランス70(株式重点型)	41,240,796円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	2,759,870円
SMBC・DCインデックスファンド(MSCIコクサイ)	349,877,638円
日興FWS・先進国株インデックス(為替ヘッジあり)	193,020,399円
日興FWS・先進国株インデックス(為替ヘッジなし)	1,296,054,817円
三井住友DS・先進国株式インデックス・ファンド	48,812,995円
SMAM・外国株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	471,570,996円
バランスファンドVA(安定運用型) < 適格機関投資家限定 >	3,079,251円
SMAM・バランスファンドVA安定成長型 < 適格機関投資家限定 >	21,307,587円
SMAM・バランスファンドVA25 < 適格機関投資家専用 >	564,847,930円
SMAM・バランスファンドVA37.5 < 適格機関投資家専用 >	727,721,617円
SMAM・バランスファンドVA50 < 適格機関投資家専用 >	3,129,347,782円
SMAM・バランスファンドVL30 < 適格機関投資家限定 >	10,511,330円
SMAM・バランスファンドVL50 < 適格機関投資家限定 >	51,791,476円
SMAM・バランスファンドVA75 < 適格機関投資家専用 >	427,084,701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 >	37,322,232円
SMAM・インデックス・バランスVA25 < 適格機関投資家専用 >	90,939,599円
SMAM・インデックス・バランスVA50 < 適格機関投資家専用 >	440,464,244円
SMAM・バランスファンドVA40 < 適格機関投資家専用 >	300,547,776円
SMAM・バランスファンドVA35 < 適格機関投資家専用 >	705,216,760円
SMAM・バランスVA株40T < 適格機関投資家限定 >	200,225円
三井住友・外国株式インデックスファンド・VAS(適格機関投資家専用)	197,574,233円
SMAM・グローバルバランス40VA < 適格機関投資家限定 >	60,711,309円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A < 適格機関投資家専用 >	7,588,533円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A < 適格機関投資家専用 >	6,951,628円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A < 適格機関投資家専用 >	3,833,026円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L < 適格機関投資家専用 >	18,297,757円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L < 適格機関投資家専用 >	52,743,776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 >	113,544,613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 >	49,498,800円
SMAM・世界バランスファンドVA < 適格機関投資家限定 >	319,025,746円
SMAM・世界バランスファンドVA2 < 適格機関投資家限定 >	82,003,389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 >	784,541,753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 >	15,751,862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 >	2,926,588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 >	3,364,789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 >	44,070,821円
合計	69,924,760,009円

外国債券パッシブ・マザーファンド

(1) 貸借対照表

(単位:円)

	(2022年4月13日現在)	(2022年10月13日現在)
資産の部		
流動資産		
預金	-	128,148,136

金銭信託	14,004,575	39,867,339
コール・ローン	537,206,904	993,246,311
国債証券	155,013,648,989	151,127,203,057
未収入金	87,233,725	-
未収利息	1,052,104,210	1,095,786,727
前払費用	55,878,885	60,970,253
流動資産合計	156,760,077,288	153,445,221,823
資産合計	156,760,077,288	153,445,221,823
負債の部		
流動負債		
未払解約金	202,299,339	4,645,305
その他未払費用	1,344	4,244
流動負債合計	202,300,683	4,649,549
負債合計	202,300,683	4,649,549
純資産の部		
元本等		
元本	78,998,924,437	76,842,259,180
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	77,558,852,168	76,598,313,094
元本等合計	156,557,776,605	153,440,572,274
純資産合計	156,557,776,605	153,440,572,274
負債純資産合計	156,760,077,288	153,445,221,823

(2) 注記表

(重要な会計方針の注記)

項目	自 2022年4月14日 至 2022年10月13日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券は個別法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。</p>

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

(貸借対照表に関する注記)

項目	(2022年4月13日現在)	(2022年10月13日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	78,998,924,437口	76,842,259,180口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.9818円 (1万口当たりの純資産額19,818円)	1口当たり純資産額 1.9968円 (1万口当たりの純資産額19,968円)

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項目	(2022年10月13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。

(デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

(2022年4月13日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	84,438,755,498円
同期中における追加設定元本額	11,076,997,643円
同期中における一部解約元本額	16,516,828,704円
2022年4月13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	24,393,880,841円
三井住友・DC年金バランス30（債券重点型）	797,136,312円
三井住友・DC年金バランス50（標準型）	2,119,967,555円
三井住友・DC年金バランス70（株式重点型）	1,147,542,270円
S M A M・グローバルバランスファンド（機動的資産配分型）	158,413,037円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2020（4資産タイプ）	6,893,764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）	29,273,421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）	94,401,071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）	225,146,317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）	156,890,144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）	262,638,809円

三井住友・DC年金バランスゼロ(債券型)	23,814,887円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	53,018,449円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	75,940,895円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	53,017,014円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2050	17,667,980円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	72,121,077円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	51,857,305円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	133,397,804円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	38,493,469円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	18,531,301円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	136,355,816円
三井住友D S・外国債券インデックス年金ファンド	294,281,824円
三井住友D S・年金バランス30(債券重点型)	14,238,080円
三井住友D S・年金バランス50(標準型)	42,018,400円
三井住友D S・年金バランス70(株式重点型)	30,944,093円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2060	2,203,842円
日興FWS・先進国債インデックス(為替ヘッジなし)	223,960,014円
三井住友D S・先進国債インデックス・ファンド	4,196,884円
SMAM・年金外国債券パッシブ・ファンド<適格機関投資家限定>	3,864,757,153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>	40,032,740円
SMAM・バランスファンドVA25<適格機関投資家専用>	6,840,867,224円
SMAM・バランスファンドVA37.5<適格機関投資家専用>	4,426,406,787円
SMAM・バランスファンドVA50<適格機関投資家専用>	10,181,017,794円
SMAM・バランスファンドVL30<適格機関投資家限定>	34,375,893円
SMAM・バランスファンドVL50<適格機関投資家限定>	87,983,369円
SMAM・バランスファンドVA75<適格機関投資家専用>	690,283,030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>	117,223,907円
SMAM・インデックス・バランスVA25<適格機関投資家専用>	1,014,133,750円
SMAM・インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用>	1,391,887,471円
SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用>	1,524,271,237円
SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>	4,687,829,375円
SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定>	627,347円
SMAM・外国債券パッシブファンドVA<適格機関投資家限定>	7,892,173,791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)	320,769,429円
SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	143,270,463円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>	78,444,198円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>	33,971,193円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用>	11,926,289円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>	95,205,741円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	404,375,583円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A2<適格機関投資家専用>	99,457,001円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A2<適格機関投資家専用>	40,181,590円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A2<適格機関投資家専用>	5,252,180円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L2<適格機関投資家専用>	1,001,905,605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>	619,332,518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>	865,687,557円
SMAM・世界バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	779,208,964円
SMAM・世界バランスファンドVA2<適格機関投資家限定>	341,578,053円

S M A M・年金Wリスクコントロールファンド<適格機関投資家限定>	190,502,250円
S M A M・マルチアセットストラテジーファンド2016-04<適格機関投資家限定>	124,850,498円
S M A M・マルチアセットストラテジー・オープン<適格機関投資家限定>	159,858,275円
S M A M・マルチアセット・ダイナミックアロケーション・ストラテジー・ファンド <適格機関投資家限定>	211,033,507円
合 計	78,998,924,437円

(2022年10月13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	78,998,924,437円
同期中における追加設定元本額	4,860,555,416円
同期中における一部解約元本額	7,017,220,673円
2022年10月13日現在の元本の内訳	
三井住友・DC外国債券インデックスファンドS	25,622,987,395円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	832,386,587円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	2,156,635,138円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	1,173,985,674円
S M A M・グローバルバランスファンド(機動的資産配分型)	150,760,960円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2020(4資産タイプ)	6,250,590円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2025(4資産タイプ)	28,036,019円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2030(4資産タイプ)	94,559,836円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2035(4資産タイプ)	248,153,073円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2040(4資産タイプ)	175,366,454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)	282,636,366円
三井住友・DC年金バランスゼロ(債券型)	23,444,683円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	48,841,238円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	71,389,406円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	49,801,190円
イオン・バランス戦略ファンド	165,408,654円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2050	22,453,694円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	77,033,842円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	57,841,285円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	150,738,817円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	45,415,312円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	22,253,366円
三井住友・DCつみたてN I S A・世界分散ファンド	159,295,969円
三井住友D S・外国債券インデックス年金ファンド	585,641,175円
三井住友D S・年金バランス30(債券重点型)	32,214,613円
三井住友D S・年金バランス50(標準型)	90,559,330円
三井住友D S・年金バランス70(株式重点型)	61,209,417円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2060	2,996,394円
日興F W S・先進国債インデックス(為替ヘッジなし)	687,645,372円
三井住友D S・先進国債インデックス・ファンド	18,587,552円
S M A M・年金外国債券パッシブ・ファンド<適格機関投資家限定>	3,748,217,629円
S M A M・バランスファンドV A安定成長型<適格機関投資家限定>	32,123,395円
S M A M・バランスファンドV A 2 5<適格機関投資家専用>	6,008,196,647円
S M A M・バランスファンドV A 3 7 . 5<適格機関投資家専用>	4,051,932,022円

SMAM・バランスファンドVA50<適格機関投資家専用>	9,394,889,670円
SMAM・バランスファンドVL30<適格機関投資家限定>	30,929,407円
SMAM・バランスファンドVL50<適格機関投資家限定>	78,245,722円
SMAM・バランスファンドVA75<適格機関投資家専用>	658,038,408円
SMAM・バランスファンドVL国際分散型<適格機関投資家限定>	111,843,878円
SMAM・インデックス・バランスVA25<適格機関投資家専用>	949,869,564円
SMAM・インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用>	1,298,450,320円
SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用>	1,359,831,216円
SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>	4,232,453,114円
SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定>	604,716円
SMAM・外国債券パッシブファンドVA<適格機関投資家限定>	7,205,618,482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)	304,740,365円
SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	122,044,909円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>	69,668,563円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>	31,256,873円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用>	11,592,229円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>	82,645,206円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	374,295,269円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A2<適格機関投資家専用>	87,815,936円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A2<適格機関投資家専用>	37,410,392円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A2<適格機関投資家専用>	5,501,058円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L2<適格機関投資家専用>	916,857,346円
SMAM・グローバルバランスファンド(標準型)VA<適格機関投資家限定>	568,480,944円
SMAM・グローバルバランスファンド(債券重視型)VA<適格機関投資家限定>	752,624,141円
SMAM・世界バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	453,960,450円
SMAM・世界バランスファンドVA2<適格機関投資家限定>	283,052,375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>	101,513,665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>	21,093,706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>	26,980,302円
SMAM・マルチアセット・ダイナミックアロケーション・ストラテジー・ファンド<適格機関投資家限定>	284,951,860円
合計	76,842,259,180円

マネーインカム・マザーファンド

(1) 貸借対照表

(単位:円)

	(2022年4月13日現在)	(2022年10月13日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	11,627,715	16,457,949
コール・ローン	446,032,013	410,029,804
国債証券	300,054,000	100,648,000
特殊債券	1,196,252,766	1,401,204,818
未収利息	1,138,662	1,896,197
前払費用	237,925	461,515
流動資産合計	1,955,343,081	1,930,698,283

資産合計	1,955,343,081	1,930,698,283
負債の部		
流動負債		
未払解約金	4,684,078	-
その他未払費用	1,766	2,303
流動負債合計	4,685,844	2,303
負債合計	4,685,844	2,303
純資産の部		
元本等		
元本	1,935,317,393	1,915,710,600
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	15,339,844	14,985,380
元本等合計	1,950,657,237	1,930,695,980
純資産合計	1,950,657,237	1,930,695,980
負債純資産合計	1,955,343,081	1,930,698,283

(2) 注記表

(重要な会計方針の注記)

項 目	自 2022年4月14日 至 2022年10月13日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券、特殊債券は個別法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

項 目	(2022年4月13日現在)	(2022年10月13日現在)
1. 当計算期間の末日における 受益権の総数	1,935,317,393口	1,915,710,600口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.0079円 (1万口当たりの純資産額10,079円)	1口当たり純資産額 1.0078円 (1万口当たりの純資産額10,078円)

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項 目	(2022年10月13日現在)

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

(デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

(2022年4月13日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	2,257,314,469円
同期中における追加設定元本額	955,084,096円
同期中における一部解約元本額	1,277,081,172円
2022年4月13日現在の元本の内訳	
S M A M・グローバルバランスファンド(機動的資産配分型)	21,805,906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)	102,779,034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)	162,087,175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)	89,556,632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)	42,692,099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)	29,057,907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)	49,084,616円
米国小型ハイクオリティファンド(毎月決算型)	99,128円
米国小型ハイクオリティファンド(資産成長型)	297,384円
S M A M・マネーインカムファンド<適格機関投資家限定>	858,040,993円
S M A M・F GマネーファンドV A<適格機関投資家限定>	579,816,519円
合計	1,935,317,393円

(2022年10月13日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	1,935,317,393円
同期中における追加設定元本額	629,503,080円
同期中における一部解約元本額	649,109,873円
2022年10月13日現在の元本の内訳	
S M A M・グローバルバランスファンド(機動的資産配分型)	19,783,585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)	94,116,172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)	203,018,727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)	130,904,927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)	46,332,809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)	32,906,999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)	52,556,558円
米国小型ハイクオリティファンド(毎月決算型)	99,128円
米国小型ハイクオリティファンド(資産成長型)	297,384円
S M A M・マネーインカムファンド<適格機関投資家限定>	837,300,546円
S M A M・F GマネーファンドV A<適格機関投資家限定>	498,393,765円
合 計	1,915,710,600円

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

S M A M ・ グローバルバランスファンド（機動的資産配分型）

2022年10月31日現在

資産総額	2,094,048,398円
負債総額	2,244,128円
純資産総額（ - ）	2,091,804,270円
発行済口数	1,395,305,331口
1口当たり純資産額（ / ）	1.4992円
（1万口当たり純資産額）	（14,992円）

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

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

イ 名義書換

該当事項はありません。

ロ 受益者名簿

作成しません。

ハ 受益者に対する特典

ありません。

ニ 受益権の譲渡および譲渡制限等

(イ) 受益権の譲渡

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

(ロ) 受益権の譲渡制限および譲渡の対抗要件

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

ホ 受益権の再分割

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

へ 償還金

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

ト 質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

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

第三部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

イ 資本金の額および株式数

	2022年10月31日現在
資本金の額	20億円
会社が発行する株式の総数	60,000,000株
発行済株式総数	33,870,060株

ロ 最近5年間における資本金の額の増減 該当ありません。

ハ 会社の機構

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

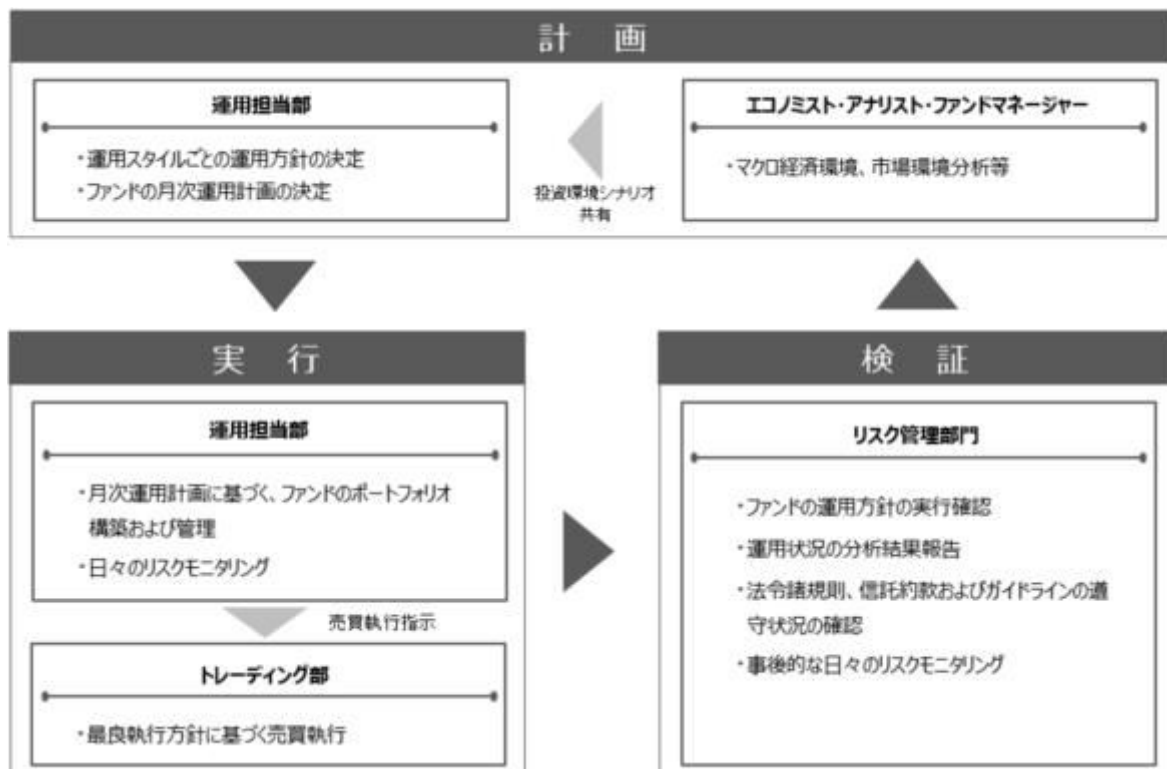
取締役の任期は、選任後1年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会の終結の時までとし、補欠または増員によって選任された取締役の任期は、他の現任取締役の任期の満了する時までとします。

委託会社の業務上重要な事項は、取締役会の決議により決定します。

取締役会は、取締役会の決議によって、代表取締役若干名を選定します。

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

ニ 投資信託の運用の流れ



2【事業の内容及び営業の概況】

「投資信託及び投資法人に関する法律」に定める投資信託委託会社である委託会社は、証券投資信託の設定を行うとともに「金融商品取引法」に定める金融商品取引業者として投資運用業および投資助言業務を行っています。また、「金融商品取引法」に定める第二種金融商品取引業にかかる業務を行っています。

2022年10月31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	714	9,374,172
単位型株式投資信託	97	447,350
追加型公社債投資信託	1	25,160
単位型公社債投資信託	183	307,173
合計	995	10,153,857

3【委託会社等の経理状況】

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

また、当社の中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和52年大蔵省令第38号)並びに同規則第38条及び第57条の規定により、「金融商品取引業等に関する内閣府令」(平成19年内閣府令第52号)に基づいて作成しております。

なお、当中間会計期間(2022年4月1日から2022年9月30日まで)は、改正府令附則第3条第1項ただし書きにより、改正後の中間財務諸表等規則に基づいて作成しております。

2 当社は、第37期(2021年4月1日から2022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38期中間会計期間(2022年4月1日から2022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 (2021年3月31日)	当事業年度 (2022年3月31日)
資産の部		
流動資産		
現金及び預金	33,048,142	49,008,279
顧客分別金信託	300,036	300,041
前払費用	449,748	475,266
未収入金	132,419	103,809
未収委託者報酬	9,936,096	12,125,117
未収運用受託報酬	2,247,156	2,437,063
未収投資助言報酬	398,108	388,639
未収収益	39,975	36,700

その他の流動資産		6,981	18,458
流動資産合計		46,558,665	64,893,375
固定資産			
有形固定資産	1		
建物		1,509,450	1,433,442
器具備品		870,855	653,985
土地		710	710
リース資産		13,483	7,357
建設仮勘定		-	5,500
有形固定資産合計		2,394,500	2,100,996
無形固定資産			
ソフトウェア		1,347,889	2,766,476
ソフトウェア仮勘定		1,029,033	100,616
のれん		3,654,491	3,349,950
顧客関連資産		15,671,890	13,558,615
電話加入権		12,727	12,716
商標権		48	42
無形固定資産合計		21,716,080	19,788,417
投資その他の資産			
投資有価証券		22,866,282	14,212,354
関係会社株式		11,246,398	11,246,398
長期差入保証金		1,409,091	1,414,646
長期前払費用		116,117	77,936
会員権		90,479	90,479
貸倒引当金		20,750	20,750
投資その他の資産合計		35,707,619	27,021,065
固定資産合計		59,818,200	48,910,479
資産合計		106,376,866	113,803,855

(単位：千円)

	前事業年度 (2021年3月31日)	当事業年度 (2022年3月31日)
負債の部		
流動負債		
リース債務	5,153	3,567
顧客からの預り金	20,077	6,045
その他の預り金	169,380	196,515
未払金		
未払収益分配金	1,646	1,969
未払償還金	43,523	152
未払手数料	4,480,697	5,545,582
その他未払金	270,290	48,893
未払費用	5,940,121	7,379,404
未払消費税等	235,647	1,133,332
未払法人税等	762,648	2,455,291
賞与引当金	1,516,622	2,100,323
資産除去債務	-	7,192
その他の流動負債	9,710	40,396
流動負債合計	13,455,519	18,918,667
固定負債		
リース債務	9,678	4,525
繰延税金負債	2,566,958	1,279,409
退職給付引当金	5,258,448	5,084,506
その他の固定負債	40,950	4,620
固定負債合計	7,876,035	6,373,062

負債合計	21,331,554	25,291,730
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	81,927,000	73,466,962
資本剰余金合計	90,555,984	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		
配当準備積立金	60,000	-
別途積立金	1,476,959	-
繰越利益剰余金	10,281,242	3,834,794
利益剰余金合計	8,460,037	4,119,040
株主資本計	84,095,946	88,214,986
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	949,365	297,138
評価・換算差額等合計	949,365	297,138
純資産合計	85,045,311	88,512,124
負債・純資産合計	106,376,866	113,803,855

(2) 【損益計算書】

(単位：千円)

	前事業年度		当事業年度	
	(自	2020年4月1日	(自	2021年4月1日
	至	2021年3月31日)	至	2022年3月31日)
営業収益				
委託者報酬		50,610,457		66,139,024
運用受託報酬		9,450,169		9,652,634
投資助言報酬		1,270,584		1,256,334
その他営業収益				
サービス支 hands 手数料		200,807		199,046
その他		32,820		32,936
営業収益計		61,564,839		77,279,976
営業費用				
支払手数料		22,784,919		30,522,133
広告宣伝費		365,317		330,161
調査費				
調査費		3,061,987		3,196,921
委託調査費		7,810,157		12,192,048
営業雑経費				
通信費		95,163		67,600
印刷費		554,920		494,834
協会費		40,044		34,433
諸会費		29,473		30,488
情報機器関連費		4,562,612		4,767,504
販売促進費		23,614		31,930
その他		163,332		181,301
営業費用合計		39,491,542		51,849,358
一般管理費				
給料				

役員報酬	277,027	263,893
給料・手当	9,280,730	8,664,828
賞与	950,630	991,916
賞与引当金繰入額	1,501,855	2,100,323
交際費	11,815	12,301
寄付金	949	29,273
事務委託費	844,255	1,422,189
旅費交通費	21,023	16,863
租税公課	389,819	476,729
不動産賃借料	1,639,529	1,289,256
退職給付費用	790,144	632,559
固定資産減価償却費	3,040,894	3,133,951
のれん償却費	2,645,986	304,540
諸経費	608,206	256,994
一般管理費合計	22,002,869	19,595,622
営業利益	70,426	5,834,995

(単位：千円)

	前事業年度 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)	当事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)
営業外収益		
受取配当金	13,164	7,666
受取利息	2,736	1,836
時効成立分配金・償還金	88,335	43,406
原稿・講演料	2,603	2,587
投資有価証券償還益	57,388	383,608
投資有価証券売却益	162,941	911,268
為替差益	-	4,673
雑収入	72,933	81,640
営業外収益合計	400,104	1,436,686
営業外費用		
投資有価証券償還損	11,762	146,219
投資有価証券売却損	34,473	81,384
為替差損	766	-
雑損失	1,240	2,866
営業外費用合計	48,243	230,470
経常利益	422,288	7,041,212
特別損失		
固定資産除却損	1 54,493	83,651
減損損失	2 28,097,346	-
システム統合関連費用	3 -	375,636
早期退職費用	4 216,200	260,075
本社移転費用	127,044	-
その他特別損失	5,460	67,000
特別損失合計	28,500,544	786,362
税引前当期純利益又は 税引前当期純損失()	28,078,256	6,254,849
法人税、住民税及び事業税	1,549,173	3,101,482
法人税等調整額	693,192	965,673

法人税等合計	855,980	2,135,809
当期純利益又は 当期純損失（ ）	28,934,237	4,119,040

（ 3 ）【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

（単位：千円）

	株主資本							
	資本金	資本剰余金			利益準備金	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		その他利益剰余金		
					配当準備 積立金	別途積立金	繰越利益 剰余金	
当期首残高	2,000,000	8,628,984	81,927,000	90,555,984	284,245	60,000	1,476,959	19,364,265
当期変動額								
剰余金の配当								711,271
当期純損失（ ）								28,934,237
株主資本以外の 項目の当期変動 額（純額）								
当期変動額合計	-	-	-	-	-	-	-	29,645,508
当期末残高	2,000,000	8,628,984	81,927,000	90,555,984	284,245	60,000	1,476,959	10,281,242

	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	21,185,470	113,741,454	377,855	377,855	114,119,309
当期変動額					
剰余金の配当	711,271	711,271			711,271
当期純損失（ ）	28,934,237	28,934,237			28,934,237
株主資本以外の 項目の当期変動 額（純額）			571,510	571,510	571,510
当期変動額合計	29,645,508	29,645,508	571,510	571,510	29,073,997
当期末残高	8,460,037	84,095,946	949,365	949,365	85,045,311

当事業年度（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

（単位：千円）

	株主資本							
	資本金	資本剰余金			利益準備金	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		その他利益剰余金		
					配当準備 積立金	別途積立金	繰越利益 剰余金	
当期首残高	2,000,000	8,628,984	81,927,000	90,555,984	284,245	60,000	1,476,959	10,281,242
当期変動額								
剰余金の配当								
欠損填補			8,460,037	8,460,037				8,460,037
当期純利益								4,119,040

任意積立金の取崩						60,000	1,476,959	1,536,959
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）								
当期変動額合計	-	-	8,460,037	8,460,037	-	60,000	1,476,959	14,116,037
当期末残高	2,000,000	8,628,984	73,466,962	82,095,946	284,245	-	-	3,834,794

	株主資本		評価・換算差額等		純資産合計
	利益剰余金	株主資本合計	その他有価証券 評価差額金	評価・換算 差額等合計	
	利益剰余金 合計				
当期首残高	8,460,037	84,095,946	949,365	949,365	85,045,311
当期変動額					
剰余金の配当					
欠損填補	8,460,037	-			-
当期純利益	4,119,040	4,119,040			4,119,040
任意積立金の取崩	-	-			-
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）			652,227	652,227	652,227
当期変動額合計	12,579,078	4,119,040	652,227	652,227	3,466,812
当期末残高	4,119,040	88,214,986	297,138	297,138	88,512,124

[注記事項]

(重要な会計方針)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法

(1) 子会社株式

移動平均法による原価法

(2) その他有価証券

市場価格のない株式等以外

決算日の市場価格等に基づく時価法

（評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定）

市場価格のない株式等

移動平均法による原価法

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 3～50年

器具備品 4～15年

(2) 無形固定資産（リース資産を除く）

定額法によっております。

なお、主な償却年数は次のとおりであります。

のれん 14年

顧客関連資産 6～19年

ソフトウェア（自社利用分） 5年（社内における利用可能期間）

(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

「収益認識に関する会計基準」（企業会計基準第29号 2020年3月31日。以下、「収益認識会計基準」という。）等を適用しており、約束したサービスの支配が顧客に移転した時点で、当該サービスと交換に受け取ると見込まれる金額で収益を認識することとしております。

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

(1) 委託者報酬

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

(2) 運用受託報酬

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

(3) 投資助言報酬

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

(会計方針の変更)

「収益認識会計基準」等を当事業年度の期首から適用し、約束したサービスの支配が顧客に移転した時点で、当該サービスと交換に受け取ると見込まれる金額で収益を認識することとしております。当該会計基準等の適用が当事業年度の財務諸表に与える影響はありません。なお、収益認識会計基準第89-3項に定める経過的な取扱いに従って、前事業年度に係る「収益認識関係」注記については記載していません。

(貸借対照表関係)

1 有形固定資産の減価償却累計額

	前事業年度 (2021年3月31日)	当事業年度 (2022年3月31日)
建物	102,329千円	210,548千円
器具備品	1,153,649千円	1,309,352千円
リース資産	2,830千円	6,073千円

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 (2021年3月31日)	当事業年度 (2022年3月31日)
当座借越極度額の総額	10,000,000千円	10,000,000千円
借入実行残高	- 千円	- 千円
差引額	10,000,000千円	10,000,000千円

3 保証債務

当社は、子会社であるSumitomo Mitsui DS Asset Management (USA) Inc.における賃貸借契約に係る賃借料に対し、2023年6月までの賃借料総額の支払保証を行っております。

	前事業年度 (2021年3月31日)	当事業年度 (2022年3月31日)
Sumitomo Mitsui DS Asset Management (USA) Inc.	93,374千円	57,356千円

(損益計算書関係)

1 固定資産除却損

	前事業年度 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)	当事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)
建物	18,278千円	- 千円
器具備品	28,604千円	0千円
リース資産	- 千円	- 千円
ソフトウェア	7,610千円	83,651千円
ソフトウェア仮勘定	- 千円	- 千円

2 減損損失

前事業年度において、次のとおり減損損失を計上しております。

(単位：千円)

場所	用途	種類	減損損失
-	その他	のれん	28,097,346

当社は、資産と対応して継続的に収支の把握ができる単位が全社のみであることから全社資産の単一グループとしております。

当社は、当社を存続会社とし、大和住銀投信投資顧問株式会社を消滅会社とする吸収合併に伴って発生したのれんを計上しております。当該のれんについて下期以降の業績は上向いているものの、通期では業績計画を下回る結果となったことを踏まえて将来キャッシュ・フローを見直した結果、のれんの帳簿価額の回収が見込まれなくなったため、帳簿価額を回収可能価額まで減損し、当該減少額を減損損失として計上しております。

なお、回収可能価額は使用価値としており、将来キャッシュ・フローを9.2%で割り引いて算出しております。当事業年度において計上した減損損失はありません。

3 システム統合関連費用

社内システム統合に伴うものであり、主にデータの移行費用などであります。

4 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。

(株主資本等変動計算書関係)

前事業年度(自 2020年4月1日 至 2021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
2020年6月29日 定時株主総会	普通株式	711,271	21.00	2020年 3月31日	2020年 6月30日

当事業年度(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

1. 発行済株式数に関する事項

	当期首株式数	当期増加株式数	当期減少株式数	当期末株式数

普通株式	33,870,060株	-	-	33,870,060株
------	-------------	---	---	-------------

2. 剰余金の配当に関する事項

基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生が翌事業年度になるもの

決議	株式の種類	配当金の総額 (千円)	一株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
2022年6月28日 定時株主総会	普通株式	2,540,254	75.00	2022年 3月31日	2022年 6月29日

(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 (2021年3月31日)	当事業年度 (2022年3月31日)
1年以内	1,194,699	1,166,952
1年超	3,497,258	2,323,090
合計	4,691,958	3,490,042

(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います。そのため、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、資金調達及びデリバティブ取引は行っていません。

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

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

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。

投資有価証券、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

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。

2. 金融商品の時価等に関する事項

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、次表には含まれていません（注2）参照）。

前事業年度（2021年3月31日）

(単位：千円)

区分	貸借対照表計上額	時価	差額
----	----------	----	----

(1)現金及び預金	33,048,142	33,048,142	-
(2)顧客分別金信託	300,036	300,036	-
(3)未収委託者報酬	9,936,096	9,936,096	-
(4)未収運用受託報酬	2,247,156	2,247,156	-
(5)未収投資助言報酬	398,108	398,108	-
(6)投資有価証券 その他有価証券	22,826,472	22,826,472	-
(7)長期差入保証金	1,409,091	1,409,091	-
資産計	70,165,105	70,165,105	-
(1)顧客からの預り金	20,077	20,077	-
(2)未払手数料	4,480,697	4,480,697	-
負債計	4,500,774	4,500,774	-

当事業年度（2022年3月31日）

（単位：千円）

区分	貸借対照表計上額	時価	差額
(1)現金及び預金	49,008,279	49,008,279	-
(2)顧客分別金信託	300,041	300,041	-
(3)未収委託者報酬	12,125,117	12,125,117	-
(4)未収運用受託報酬	2,437,063	2,437,063	-
(5)未収投資助言報酬	388,639	388,639	-
(6)投資有価証券 その他有価証券	14,172,545	14,172,545	-
資産計	78,431,686	78,431,686	-
(1)顧客からの預り金	6,045	6,045	-
(2)未払手数料	5,545,582	5,545,582	-
負債計	5,551,627	5,551,627	-

（注1）金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

資 産

(1)現金及び預金、(2)顧客分別金信託、(3)未収委託者報酬、(4)未収運用受託報酬及び(5)未収投資助言報酬
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、当該帳簿価額によっています。

(6)投資有価証券

これらの時価について、投資信託等については取引所の価格、取引金融機関から提示された価格及び公表されている基準価格によっております。

負 債

(1)顧客からの預り金及び(2)未払手数料

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、当該帳簿価額によっています。

（注2）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 (2021年3月31日)	当事業年度 (2022年3月31日)
その他有価証券 非上場株式	39,809	39,809
合計	39,809	39,809
子会社株式 非上場株式	11,246,398	11,246,398
合計	11,246,398	11,246,398

その他有価証券については、市場価格がないため、「(6) その他有価証券」には含めておりません。

子会社株式については、市場価格がないため、時価開示の対象とはしておりません。

また時価をもって貸借対照表計上額としている「(6) その他有価証券」は、全て投資信託で構成されております。そのため、「時価の算定に関する会計基準の適用指針」第26項の経過措置を適用し、金融商品の時価等及び時価のレベルごとの内訳等に関する事項は記載しておりません。

（注3）金銭債権及び満期がある有価証券の決算日後の償還予定額

前事業年度（2021年3月31日）

（単位：千円）

区分	1年以内	1年超5年以内	5年超10年以内	10年超
----	------	---------	----------	------

現金及び預金	33,048,142	-	-	-
顧客分別金信託	300,036	-	-	-
未収委託者報酬	9,936,096	-	-	-
未収運用受託報酬	2,247,156	-	-	-
未収投資助言報酬	398,108	-	-	-
長期差入保証金	42,007	1,367,084	-	-
合計	45,971,548	1,367,084	-	-

当事業年度（2022年3月31日）

（単位：千円）

区分	1年以内	1年超5年以内	5年超10年以内	10年超
現金及び預金	49,008,279	-	-	-
顧客分別金信託	300,041	-	-	-
未収委託者報酬	12,125,117	-	-	-
未収運用受託報酬	2,437,063	-	-	-
未収投資助言報酬	388,639	-	-	-
合計	64,259,140	-	-	-

(有価証券関係)

1. 子会社株式

前事業年度（2021年3月31日）

子会社株式（貸借対照表計上額 関係会社株式11,246,398千円）は、市場価格がないことから、記載しておりません。

当事業年度（2022年3月31日）

子会社株式（貸借対照表計上額 関係会社株式11,246,398千円）は、市場価格がないことから、記載しておりません。

2. その他有価証券

前事業年度（2021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			
小計	16,097,433	14,397,606	1,699,827
(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			
小計	6,729,039	6,994,762	265,723
合計	22,826,472	21,392,369	1,434,103

(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（2022年3月31日）

（単位：千円）

区分	貸借対照表計上額	取得原価	差額
(1) 貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの 投資信託等			
小計	9,299,062	8,672,725	626,337
(2) 貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの 投資信託等			
小計	4,873,482	5,039,817	166,335
合計	14,172,545	13,712,543	460,001

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

3. 事業年度中に売却したその他有価証券

前事業年度(自 2020年4月1日 至 2021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
1,978,622	162,941	34,473

（単位：千円）

償還額	償還益の合計額	償還損の合計額
1,630,219	57,388	11,762

当事業年度(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

(単位：千円)

売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
4,082,976	911,268	81,384

(単位：千円)

償還額	償還益の合計額	償還損の合計額
7,183,410	383,608	146,219

4. 減損処理を行った有価証券

前事業年度において、投資有価証券について1,560千円（その他有価証券1,560千円）減損処理を行っております。

なお、減損処理にあたっては、期末における時価が取得原価に比べ50%以上下落した場合、及び30%以上50%未満下落し、回復可能性等の合理的反証がない場合に行っております。

当事業年度において、減損処理を行った有価証券はありません。

(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 2020年4月1日 至 2021年3月31日)	当事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)
退職給付債務の期首残高	5,299,814	5,258,448
勤務費用	476,308	454,611
利息費用	-	1,013
数理計算上の差異の発生額	67,476	34,553
退職給付の支払額	585,151	595,013
過去勤務費用の発生額	-	-
合併による発生額	-	-
退職給付債務の期末残高	5,258,448	5,084,506

(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 (2021年3月31日)	当事業年度 (2022年3月31日)
非積立型制度の退職給付債務	5,258,448	5,084,506
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	5,258,448	5,084,506

(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 2020年4月1日 至 2021年3月31日)	当事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)
勤務費用	476,308	454,611
利息費用	-	1,013
数理計算上の差異の費用処理額	67,476	34,553
その他	246,359	211,487
確定給付制度に係る退職給付費用	790,144	632,559

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

(4)数理計算上の計算基礎に関する事項

主要な数理計算上の計算基礎（加重平均で表わしております。）

	前事業年度 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)	当事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)
割引率	0.020%	0.130%

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239,162千円、当事業年度237,296千円であります。

(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 (2021年3月31日)	当事業年度 (2022年3月31日)
繰延税金資産		
退職給付引当金	1,610,136	1,556,876
賞与引当金	464,389	643,119
調査費	247,208	279,809
未払金	206,090	284,070
未払事業税	66,891	139,522
ソフトウェア償却	90,431	107,998
子会社株式評価損	114,876	114,876
その他有価証券評価差額金	131,391	93,946
その他	35,930	28,056
繰延税金資産小計	2,967,346	3,248,274
評価性引当額(注)	218,966	189,102
繰延税金資産合計	2,748,380	3,059,171
繰延税金負債		
無形固定資産	4,798,732	4,151,648
資産除去債務	-	825
その他有価証券評価差額金	516,605	186,107
繰延税金負債合計	5,315,338	4,338,581
繰延税金資産(負債)の純額	2,566,958	1,279,409

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 (2021年3月31日)	当事業年度 (2022年3月31日)
法定実効税率	税引前当期純損失のため 記載を省略しております。	30.6%
(調整)		
交際費等永久に損金に算入されない項目		1.6
住民税均等割等		0.1
のれん償却費		1.4
その他		0.2
税効果会計適用後の法人税等の負担率		34.1

(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2020年4月1日至2021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	50,610,457	9,450,169	1,270,584	233,628	61,564,839

(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 2021年4月1日 至2022年3月31日)

1. セグメント情報

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

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

2. 関連情報

(1) 製品及びサービスごとの情報

(単位：千円)

	委託者報酬	運用受託報酬	投資助言報酬	その他	合計
外部顧客への 営業収益	66,139,024	9,652,634	1,256,334	231,982	77,279,976

(2) 地域ごとの情報

営業収益

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

有形固定資産

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

(3) 主要な顧客ごとの情報

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

3. 報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

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

4. 報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

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

5. 報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報
該当事項はありません。

(関連当事者情報)

前事業年度(自 2020年4月1日 至 2021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	3,728,851	未払 手数料	863,159
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	5,578,226	未払 手数料	1,070,559

(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 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

1. 関連当事者との取引

(1)兄弟会社等

(単位：千円)

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金、出資金又は基金	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額	科目	期末残高
親会社の子会社	(株)三井住友銀行	東京都千代田区	1,770,996,505	銀行業	%	投信の販売委託 役員の兼任	委託販売 手数料	4,727,024	未払 手数料	1,098,966
親会社の子会社	SMBC日興証券(株)	東京都千代田区	10,000,000	証券業	%	投信の販売委託 役員の兼任	委託販売 手数料	8,397,864	未払 手数料	1,661,614

(注) 取引条件及び取引条件の決定方針等

投信の販売委託については、一般取引条件を基に、協議の上決定しております。

2. 親会社に関する注記

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

(1株当たり情報)

	前事業年度 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)	当事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)
1株当たり純資産額	2,510.93円	2,613.28円
1株当たり当期純利益又は 1株当たり当期純損失()	854.27円	121.61円

(注) 1. 前事業年度の潜在株式調整後1株当たり当期純利益については、1株当たり当期純損失であり、また、潜在株式が存在しないため記載していません。

当事業年度の潜在株式調整後1株当たり当期純利益については、潜在株式が存在しないため記載していません。

2. 1株当たり当期純利益又は1株当たり当期純損失の算定上の基礎は、次のとおりであります。

	前事業年度 (自 2020年 4月 1日 至 2021年 3月 31日)	当事業年度 (自 2021年 4月 1日 至 2022年 3月 31日)
1株当たり当期純利益又は当期純損失		
当期純利益又は当期純損失() (千円)	28,934,237	4,119,040
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又は 当期純損失() (千円)	28,934,237	4,119,040
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38期中間会計期間 (2022年 9月 30日)	
資産の部	
流動資産	
現金及び預金	35,409,452
金銭の信託	9,386,865
顧客分別金信託	300,043
前払費用	601,040
未収委託者報酬	11,798,214
未収運用受託報酬	2,759,722
未収投資助言報酬	386,860
未収収益	40,783
その他	307,594
流動資産合計	60,990,577
固定資産	
有形固定資産	1 2,044,583
無形固定資産	
のれん	3,197,680
顧客関連資産	12,501,978
その他	2,865,181
無形固定資産合計	18,564,839
投資その他の資産	
投資有価証券	11,924,303
関係会社株式	11,850,598
その他	1,571,118
貸倒引当金	20,750
投資その他の資産合計	25,325,270
固定資産合計	45,934,694
資産合計	106,925,272
負債の部	
流動負債	
リース債務	2,564
顧客からの預り金	28,648
その他の預り金	93,717
未払金	5,378,614
未払費用	4,957,793
未払法人税等	910,281
前受収益	32,553
賞与引当金	1,973,312

その他	2	482,541
流動負債合計		13,860,025
固定負債		
リース債務		3,243
繰延税金負債		987,563
退職給付引当金		5,137,995
固定負債合計		6,128,802
負債合計		19,988,828
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		2,489,135
利益剰余金合計		2,773,380
株主資本合計		86,869,326
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金		67,117
評価・換算差額等合計		67,117
純資産合計		86,936,444
負債純資産合計		106,925,272

(2)中間損益計算書

(単位：千円)

		第38期中間会計期間 (自 2022年4月1日 至 2022年9月30日)
営業収益		
委託者報酬		31,446,166
運用受託報酬		4,428,746
投資助言報酬		607,317
その他の営業収益		126,597
営業収益計		36,608,828
営業費用		25,074,910
一般管理費	1	9,497,685
営業利益		2,036,233
営業外収益	2	87,533
営業外費用	3	309,096
経常利益		1,814,670
特別損失	4	6,885
税引前中間純利益		1,807,784
法人税、住民税及び事業税		784,532
法人税等調整額		171,342
法人税等合計		613,189
中間純利益		1,194,594

(3)中間株主資本等変動計算書

第38期中間会計期間（自 2022年4月1日 至 2022年9月30日）

（単位：千円）

	株主資本					
	資本金	資本剰余金			利益剰余金	
		資本準備金	その他資本 剰余金	資本剰余金 合計	利益 準備金	その他利益剰余金 繰越利益 剰余金
当期首残高	2,000,000	8,628,984	73,466,962	82,095,946	284,245	3,834,794
当中間期変動額						
剰余金の配当						2,540,254
中間純利益						1,194,594
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	-	-	-	-	-	1,345,660
当中間期末残高	2,000,000	8,628,984	73,466,962	82,095,946	284,245	2,489,135

	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
当中間期変動額					
剰余金の配当	2,540,254	2,540,254			2,540,254
中間純利益	1,194,594	1,194,594			1,194,594
株主資本以外の 項目の当中間期 変動額（純額）			230,020	230,020	230,020
当中間期変動額 合計	1,345,660	1,345,660	230,020	230,020	1,575,680
当中間期末残高	2,773,380	86,869,326	67,117	67,117	86,936,444

注記事項

(重要な会計方針)

1. 資産の評価基準及び評価方法

(1)有価証券

子会社株式

移動平均法による原価法

その他有価証券

市場価格のない株式等以外

中間会計期間末日の市場価格等に基づく時価法

（評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定）

市場価格のない株式等

移動平均法による原価法

(2)金銭の信託

運用目的の金銭の信託

時価法

2. 固定資産の減価償却の方法

(1)有形固定資産（リース資産を除く）

定率法によっております。但し、建物（建物附属設備を除く）並びに2016年4月1日以降に取得した建物附属設備については、定額法によっております。

なお、主な耐用年数は次のとおりであります。

建物	8～50年
器具備品	4～15年

(2)無形固定資産（リース資産を除く）

定額法によっております。

なお、主な償却年数は次のとおりであります。

のれん	14年
顧客関連資産	6～19年
ソフトウェア（自社利用分）	5年（社内における利用可能期間）

(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

「収益認識に関する会計基準」（企業会計基準第29号 2020年3月31日。以下、「収益認識会計基準」という。）等を適用しており、約束したサービスの支配が顧客に移転した時点で、当該サービスと交換に受け取ると見込まれる金額で収益を認識することとしております。

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

(1)委託者報酬

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

(2)運用受託報酬

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

(3)投資助言報酬

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

（会計方針の変更）

「時価の算定に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第31号 2021年6月17日。以下「時価算定会計基準適用指針」という。）等を当中間会計期間の期首から適用し、時価算定会計基準適用指針第27-2項に定める経過的な取扱いに従って、時価算定基準等が定める新たな会計方針を、将来にわたって適用しております。これによる当中間財務諸表に与える影響はありません。

（中間貸借対照表関係）

第38期中間会計期間 (2022年9月30日)	
1.有形固定資産の減価償却累計額	1,632,164千円
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
4.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40,711千円の支払保証を行っております。	

(中間損益計算書関係)

第38期中間会計期間 (自 2022年4月1日 至 2022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	173,639千円
無形固定資産	1,441,546千円
2.営業外収益のうち主要なもの	
為替差益	7,815千円
受取配当金	1,230千円
投資有価証券償還益	20,660千円
投資有価証券売却益	25,620千円
3.営業外費用のうち主要なもの	
投資有価証券償還損	43,419千円
投資有価証券売却損	152,586千円
金銭の信託運用損	113,089千円
4.特別損失のうち主要なもの	
固定資産除却損	6,885千円

(中間株主資本等変動計算書関係)

第38期中間会計期間(自 2022年4月1日 至 2022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
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

(リース取引関係)

第38期中間会計期間 (自 2022年4月1日 至 2022年9月30日)	
1.オペレーティング・リース取引 (借主側)	
未経過リース料(解約不能のもの)	
1年以内	1,161,545千円
1年超	1,742,317千円
合計	2,903,862千円

(金融商品関係)

1. 金融商品の時価等に関する事項

第38期中間会計期間（2022年9月30日）

2022年9月30日における中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。なお、市場価格のないものは、次表には含まれておりません（（注1）参照）。また、現金及び預金、顧客分別金信託、未収委託者報酬、未収運用受託報酬、未収投資助言報酬、顧客からの預り金、未払金は、短期間で決済されるため時価が帳簿価格に近似することから、注記を省略しております。

（単位：千円）

区分	中間貸借対照表計上額	時価	差額
(1) 金銭の信託	9,386,865	9,386,865	-
(2) 投資有価証券 その他有価証券	11,884,494	11,884,494	-
資産計	21,271,360	21,271,360	-

（注1）市場価格のない金融商品

（単位：千円）

区分	中間貸借対照表計上額
その他有価証券 非上場株式	39,809
合計	39,809
子会社株式 非上場株式	11,850,598
合計	11,850,598

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

2. 金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項

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

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

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

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

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

時価で中間貸借対照表に計上している金融商品

（単位：千円）

区分	時価			合計
	レベル1	レベル2	レベル3	
(1) 金銭の信託	-	9,386,865	-	9,386,865
(2) 投資有価証券 その他有価証券	-	11,884,494	-	11,884,494
資産計	-	21,271,360	-	21,271,360

（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38期中間会計期間（2022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 11,850,598千円）は、市場価格がないことから、記載しておりません。

2. その他有価証券

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	4,799,952	4,484,899	315,053
小計	4,799,952	4,484,899	315,053
(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	7,084,541	7,290,117	205,575
小計	7,084,541	7,290,117	205,575
合計	11,884,494	11,775,016	109,477

(注)非上場株式等(中間貸借対照表計上額 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。

(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38期中間会計期間(自 2022年4月1日 至 2022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38期中間会計期間(自 2022年4月1日 至 2022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	31,446,166	4,428,746	607,317	126,597	36,608,828

(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38期中間会計期間 (自 2022年4月1日 至 2022年9月30日)	
1株当たり純資産額	2,566円76銭
1株当たり中間純利益	35円26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いません。	

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(2022年3月末現在)

- (八) 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(2022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。

□ 販売会社

名称	資本金の額(百万円) 2022年3月末現在	事業の内容
auカブコム証券株式会社	7,196	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
株式会社SBI証券	48,323	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
岡三証券株式会社	5,000	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
楽天証券株式会社	17,495	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
マネックス証券株式会社	12,200	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
松井証券株式会社	11,945	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
住友生命保険相互会社	639,000	保険業法に基づき、生命保険業を営んでいます。

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

2【関係業務の概要】

イ 受託会社

信託契約の受託会社であり、信託財産の保管・管理・計算等を行います。

□ 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、収益分配金、償還金の支払事務等を行います。

3【資本関係】

(持株比率5%以上を記載しています。)

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

第3【その他】

1 目論見書の表紙から本文の前までおよび裏表紙の記載について

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

(2) 委託会社の金融商品取引業者登録番号を記載することがあります。

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

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

独立監査人の監査報告書

2022年6月15日

三井住友DSアセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 羽 太 典 明指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 菅 野 雅 子指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 佐 藤 栄 裕**監査意見**

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている三井住友DSアセットマネジメント株式会社の2021年4月1日から2022年3月31日までの第37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2022年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

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

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

財務諸表に対する経営者並びに監査役及び監査役会の責任

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

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

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

以 上

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

独立監査人の監査報告書

2022年6月28日

三井住友DSアセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士

菅野 雅子

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士

松井 貴志

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SMAM・グローバルバランスファンド（機動的資産配分型）の2021年4月14日から2022年4月13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、SMAM・グローバルバランスファンド（機動的資産配分型）の2022年4月13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 . X B R L データは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

2022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 菅野 雅子指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 佐藤 栄裕**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2022年4月1日から2023年3月31日までの第38期事業年度の中間会計期間（2022年4月1日から2022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2022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（2022年4月1日から2022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、継続企業的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な応じて追加の監査手続が選択及び適用される。
- ・ 中間財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。
- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、企業は継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 中間財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。

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

利害関係

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

以 上

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

独立監査人の中間監査報告書

2022年12月20日

三井住友DSアセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	菅野 雅子
--------------------	-------	-------

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	松井 貴志
--------------------	-------	-------

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているSMAM・グローバルバランスファンド（機動的資産配分型）の2022年4月14日から2022年10月13日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、SMAM・グローバルバランスファンド（機動的資産配分型）の2022年10月13日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2022年4月14日から2022年10月13日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

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

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

- ・不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要な応じて追加の監査手続が選択及び適用される。
- ・中間財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。
- ・経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・中間財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。

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

利害関係

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

以 上

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