

【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2024年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】

2024年1月11日から2024年7月11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す。なお、組み入れる資産そのものは投資信託証券ですが、投資信託証券の先の実質投資対象は株式、債券および円短期金融資産であり、ファンドの収益はそれぞれの市場の動向に左右されるものであるため、商品分類上の投資対象資産（収益の源泉）は「資産複合」となります。
決算頻度	年1回	目論見書または信託約款において、年1回決算する旨の記載があるものをいいます。
投資対象地域	グローバル（日本を含む）	目論見書または信託約款において、組入資産による投資収益が日本を含む世界の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
投資形態	ファミリーファンド	目論見書または信託約款において、親投資信託（ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除く。）を投資対象として投資するものをいいます。

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

商品分類表

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

属性区分表

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

(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。

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。

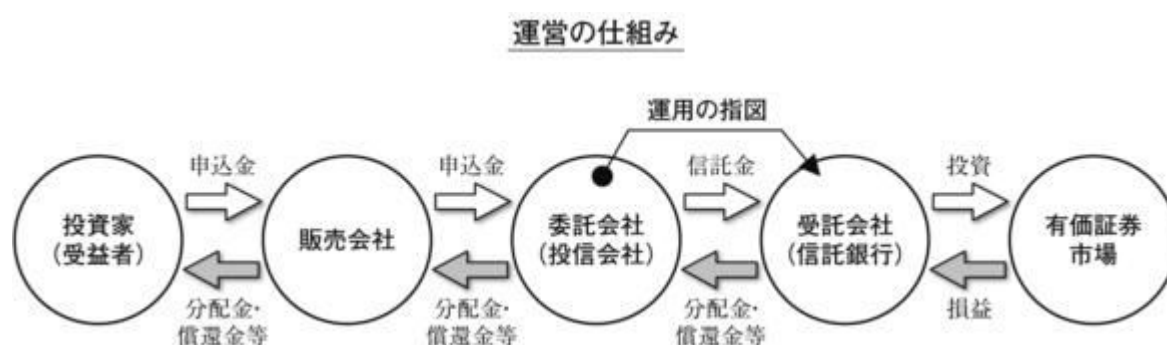
(ロ) 受託会社 「三井住友信託銀行株式会社」

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、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。



ロ 委託会社の概況

(イ) 資本金の額

20億円(2023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

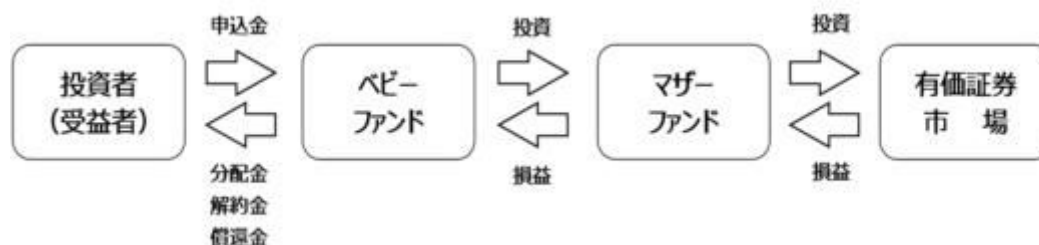
(八) 大株主の状況

(2023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。

ロ 投資態度

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

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

短期金融資産	マネーインカム・マザーファンド
--------	-----------------

- (ロ) 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 (配当込み、 円換算ベース)	FTSE世界国債 インデックス (除く日本、 円換算ベース)	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）。

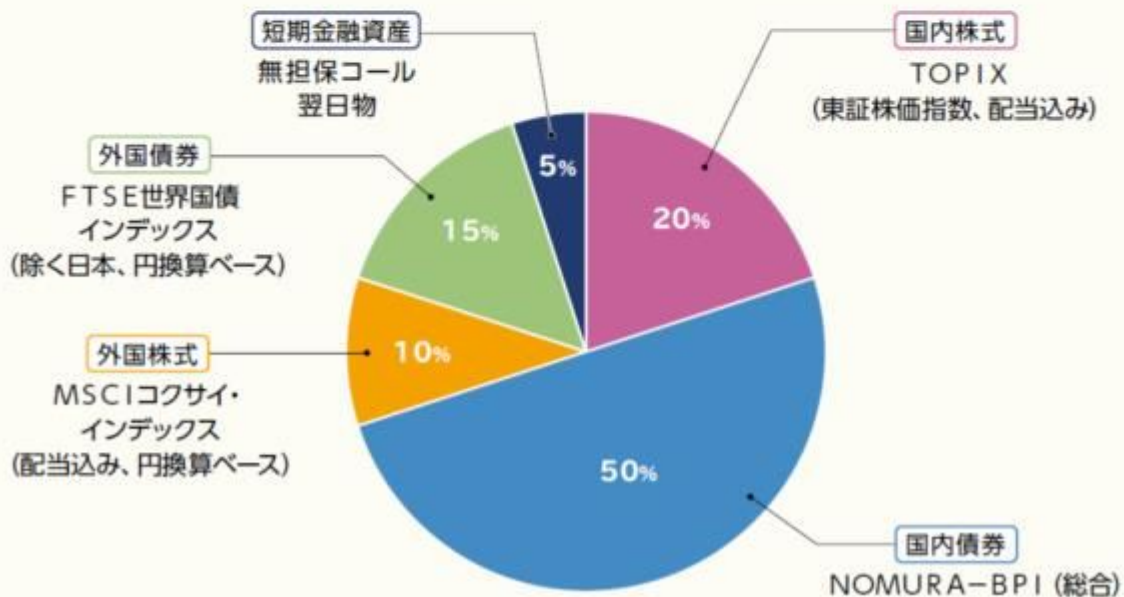
2 委託会社が独自に作成する基本資産配分に対し、一定の許容変動幅内で機動的に資産配分を変更します。

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

ファンドのしくみ

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



※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。

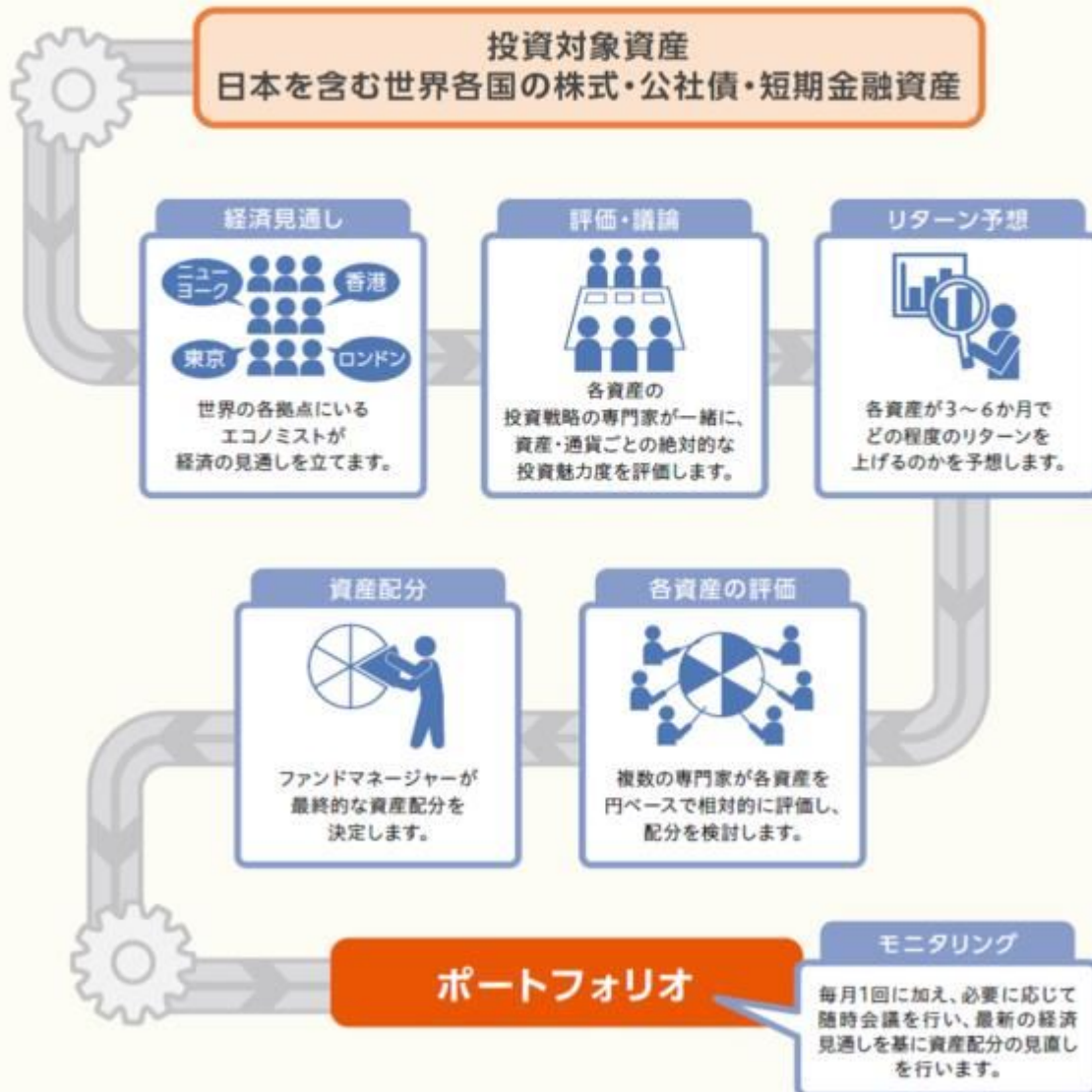
運用(資産配分)プロセス

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2023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（配当込み、円換算ベース）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。
- MSCIコクサイ・インデックス構成銘柄の中から、原則として投資不適格銘柄および低流動性銘柄を除外した上で、最適化法によりポートフォリオを構築します。

▶ 外国債券パッシブ・マザーファンド

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

▶ 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

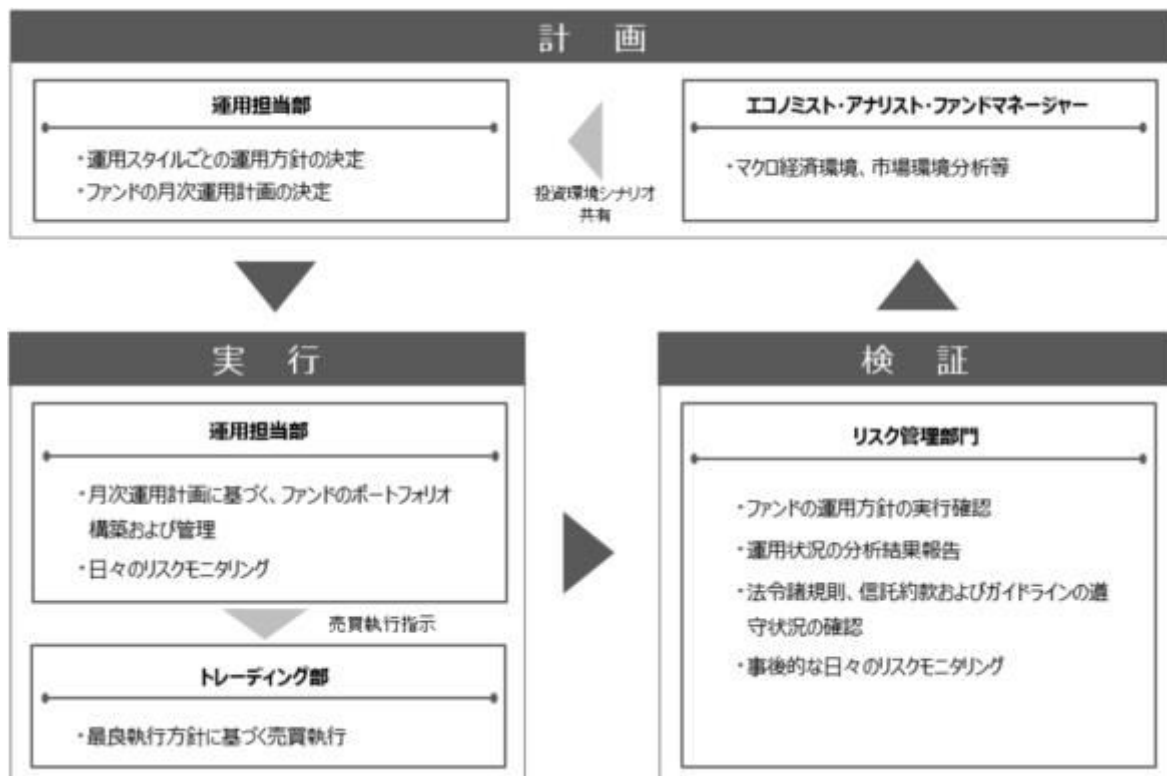
委託会社は、信託金を、上記口に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法

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40名です。

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

ロ 委託会社によるファンドの関係法人（販売会社を除く）に対する管理体制

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

(4) 【分配方針】

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

- イ 分配対象額は、経費控除後の配当等収益と有価証券売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。
- ロ 収益分配金額は、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象収益が少額の場合等には、委託会社の判断により収益分配を行わない場合もあるため、将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

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、円換算ベース）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。

ロ 投資態度

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

(2) 投資対象

イ 投資対象とする資産の種類

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

ロ 投資対象とする有価証券

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

ハ 投資対象とする金融商品

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

(3) 投資制限

イ ファンドの信託約款に基づく主要な投資制限

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

(外国債券パッシブ・マザーファンド)

(1) 投資方針等

イ 基本方針

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

ロ 投資態度

- (イ) FTSE世界国債インデックス(除く日本、円換算ベース)をベンチマークとし、ベンチマークの動きに連動する投資成果を目指します。
- (ロ) ポートフォリオ構築にあたっては、取引コストを極力抑えながら、推定トラッキングエラーを最小化します。
- (ハ) ベンチマークの月次の変化状況とポートフォリオのリスク量の状況を勘案しながらリバランスを行います。
- (ニ) 保有する外貨建資産については、原則として対円で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ンドが投資対象とする金融商品に同じです。

（3）投資制限

イ ファンドの信託約款に基づく主要な投資制限

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

（ロ）投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

（ハ）外貨建資産への投資は行いません。

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

3【投資リスク】

イ ファンドのもつリスクの特性

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

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

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

当ファンドの主要なリスクは以下の通りです。

（イ）株式市場リスク

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

（ロ）債券市場リスク

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

（ハ）信用リスク

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

（ニ）為替変動リスク

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

（ホ）カントリーリスク

海外に投資を行う場合には、投資先の国の政治・経済・社会状況の不安定化、取引規制や税制

の変更等によって投資した資金の回収が困難になることや、その影響により投資する有価証券等の価格が大きく変動することがあり、基準価額が下落する要因となります。

（ヘ）流動性リスク

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

ロ その他の留意点

（イ）投資信託に関する留意点

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

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

（ロ）分配金に関する留意事項

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



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

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

ハ 投資リスクの管理体制

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

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

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

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

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

議に報告します。

（参考情報）投資リスクの定量的比較**〔 ファンドの年間騰落率および
分配金再投資基準価額の推移 〕**

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



※年間騰落率、分配金再投資基準価額は、分配金（税引前）を分配時に再投資したものと仮定して計算したものです。
※分配実績がない場合は、分配金再投資基準価額は基準価額と同じです。

**〔 ファンドと他の代表的な
資産クラスとの騰落率の比較 〕**

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



※ファンドの騰落率は、分配金（税引前）を分配時に再投資したものと仮定して計算しており、実際の基準価額をもとに計算したものと異なります。
※すべての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。

各資産クラスの指数

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

※海外の指数は、為替ヘッジなしによる投資を想定して、円ベースとしています。
※上記各指数に関する知的所有権その他の一切の権利は、その発行者および許諾者に帰属します。また、上記各指数の発行者および許諾者は、当ファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。

4 【手数料等及び税金】**(1) 【申込手数料】**

ありません。

(2) 【換金（解約）手数料】

解約手数料はありません。

(3) 【信託報酬等】

純資産総額に年0.649%（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（消費税等相当額を含みます。）は、原則として、計算期間を通じて毎日、信託財産の費用として計上され、毎計算期間の最初の6ヵ月終了日と各計算期末または信託終了のときに、信託財産中から支弁するものとします。
- ロ 信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用および受託会社の立て替えた立替金の利息は、信託財産中から支弁します。
- ハ 有価証券の売買時の手数料、デリバティブ取引等に要する費用、および外国における資産の保管等に要する費用等（それらにかかる消費税等相当額を含みます。）は、信託財産中から支弁するものとします。

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

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

(5) 【課税上の取扱い】

イ 個別元本について

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

ります。

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

ロ 一部解約時および償還時の課税について

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

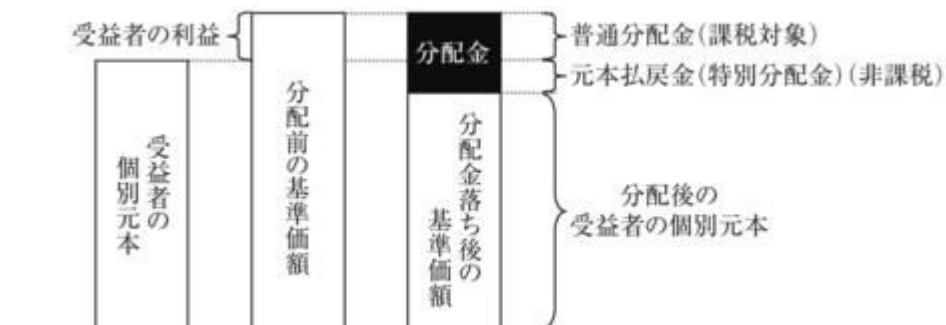
ハ 収益分配金の課税について

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

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



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



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

二 個人、法人別の課税の取扱いについて

(イ) 個人の受益者に対する課税

・収益分配時

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

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

・一部解約時および償還時

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

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

(ロ)法人の受益者に対する課税

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

当ファンドは、課税上は株式投資信託として取り扱われます。

なお、当ファンドは、配当控除および益金不算入制度の適用はありません。

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

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

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

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

当ファンドは、NISAの対象ではありません。

上記「(5)課税上の取扱い」ほか税制に関する本書の記載は、2024年1月現在の情報をもとに作成しています。税法の改正等により、変更されることがあります。

(参考情報) 総経費率

直近の運用報告書の対象期間(2022年4月14日~2023年4月13日)における当ファンドの総経費率(年率換算)は以下の通りです。

総経費率(①+②)	①運用管理費用の比率	②その他費用の比率
0.66%	0.65%	0.02%

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

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

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

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

5【運用状況】

(1)【投資状況】

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)

2023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	2,288,130,484	99.70
現金・預金・その他の資産（負債控除後）	-	6,826,442	0.30
合計（純資産総額）		2,294,956,926	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

2023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	808,118,620	1.2353	998,252,402	1.1895	961,257,098	41.89
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)	139,329,728	3.6446	507,800,978	3.9655	552,512,036	24.08
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	165,530,061	1.9885	329,161,353	2.0931	346,470,970	15.10
日本	親投資 信託受 益証券	外国株式イン デックス・マ ザーファンド	32,391,694	6.2544	202,589,467	6.9481	225,060,729	9.81
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	201,359,726	1.0075	202,873,018	1.0073	202,829,651	8.84

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

2023年10月31日現在

種類	投資比率 (%)
親投資信託受益証券	99.70
合計	99.70

【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
第15期 (2023年 4月13日)	2,152,780,394	2,152,780,394	15,046	15,046
2022年10月末日	2,091,804,270	-	14,992	-
11月末日	2,091,928,942	-	14,941	-
12月末日	2,032,012,067	-	14,475	-
2023年 1月末日	2,076,293,598	-	14,694	-
2月末日	2,099,856,450	-	14,868	-
3月末日	2,153,190,032	-	15,030	-
4月末日	2,182,284,357	-	15,197	-
5月末日	2,225,135,595	-	15,444	-
6月末日	2,314,667,552	-	15,945	-
7月末日	2,325,859,477	-	15,860	-
8月末日	2,334,013,974	-	15,914	-
9月末日	2,338,271,563	-	15,805	-
10月末日	2,294,956,926	-	15,500	-

【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
第15期	2022年 4月14日～2023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	0.5
第16期（中間期）	4.9

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

（４）【設定及び解約の実績】

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	264,851,982	224,517,986
第16期（中間期）	125,900,230	80,444,368

（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）

2023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	264,056,034,550	97.83
現金・預金・その他の資産（負債控除後）	-	5,867,041,389	2.17
合計（純資産総額）		269,923,075,939	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	5,837,860,000	2.16
合計	買建	-	5,837,860,000	2.16

国内債券パッシブ・マザーファンド

2023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	99,711,452,070	79.14
地方債証券	日本	9,847,817,900	7.82
特殊債券	日本	9,477,635,852	7.52
社債券	日本	6,291,889,700	4.99
現金・預金・その他の資産（負債控除後）	-	658,778,000	0.53
合計（純資産総額）		125,987,573,522	100.00

外国株式インデックス・マザーファンド

2023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	388,271,466,902	68.94
	イギリス	22,838,302,537	4.05
	カナダ	18,782,511,110	3.33
	スイス	17,603,068,435	3.13
	フランス	17,520,610,530	3.11
	ドイツ	13,018,365,214	2.31
	オーストラリア	10,224,077,152	1.82
	オランダ	10,076,508,868	1.79
	アイルランド	10,023,306,785	1.78
	デンマーク	5,399,344,910	0.96
	スウェーデン	4,451,344,663	0.79
	スペイン	4,080,277,419	0.72
	イタリア	3,048,936,055	0.54
	香港	2,824,204,986	0.50
	シンガポール	1,857,982,408	0.33
	ジャージー	1,833,131,908	0.33
フィンランド	1,737,357,768	0.31	

	ベルギー	1,204,422,359	0.21
	ノルウェー	1,127,529,976	0.20
	バミューダ	1,027,992,561	0.18
	イスラエル	997,181,287	0.18
	ケイマン諸島	890,359,464	0.16
	オランダ領キュラソー	887,059,395	0.16
	ニュージーランド	413,332,405	0.07
	オーストリア	307,632,832	0.05
	ポルトガル	287,038,166	0.05
	ルクセンブルグ	274,395,733	0.05
	リベリア	206,636,039	0.04
	パナマ	118,874,354	0.02
	マン島	70,013,481	0.01
	小計	541,403,265,702	96.13
投資証券	アメリカ	9,233,269,395	1.64
	オーストラリア	964,169,934	0.17
	シンガポール	206,764,755	0.04
	フランス	187,581,058	0.03
	イギリス	173,656,748	0.03
	香港	131,816,339	0.02
	カナダ	49,593,337	0.01
	ベルギー	48,624,073	0.01
	ケイマン諸島	42,797,443	0.01
	小計	11,038,273,082	1.96
現金・預金・その他の資産（負債控除後）	-	10,783,213,519	1.91
合計（純資産総額）		563,224,752,303	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	480,295,202	0.09
株価指数先物取引	買建	ドイツ	1,570,027,963	0.28
株価指数先物取引	買建	アメリカ	8,479,745,587	1.51
株価指数先物取引	買建	オーストラリア	338,878,779	0.06
合計	買建	-	10,868,947,531	1.93

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	-	2,132,883,523	0.38

外国債券パッシブ・マザーファンド

2023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	79,123,080,945	47.55
	フランス	13,772,358,560	8.28

	イタリア	12,214,688,275	7.34
	中国	11,537,420,810	6.93
	ドイツ	10,739,833,592	6.45
	スペイン	8,095,937,076	4.87
	イギリス	7,982,313,674	4.80
	カナダ	3,272,472,945	1.97
	ベルギー	3,012,267,988	1.81
	オランダ	2,447,823,456	1.47
	オーストラリア	2,359,809,360	1.42
	オーストリア	1,940,874,531	1.17
	メキシコ	1,464,568,583	0.88
	アイルランド	901,838,988	0.54
	マレーシア	880,517,196	0.53
	ポーランド	877,532,674	0.53
	フィンランド	813,953,724	0.49
	シンガポール	718,418,966	0.43
	デンマーク	516,590,128	0.31
	イスラエル	460,905,262	0.28
	ニュージーランド	364,375,676	0.22
	スウェーデン	319,113,559	0.19
	ノルウェー	265,557,670	0.16
	小計	164,082,253,638	98.60
現金・預金・その他の資産（負債控除後）	-	2,324,507,499	1.40
合計（純資産総額）		166,406,761,137	100.00

マネーインカム・マザーファンド

2023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	293,730,080	13.67
特殊債券	日本	1,202,824,500	55.97
現金・預金・その他の資産（負債控除後）	-	652,430,427	30.36
合計（純資産総額）		2,148,985,007	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）

2023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	4,527,000	2,017.59	9,133,652,048	2,590.00	11,724,930,000	4.34
日本	株式	ソニーグループ	電気機器	582,300	11,308.79	6,585,109,300	12,425.00	7,235,077,500	2.68

日本	株式	三菱UFJ フィナンシャル・グループ	銀行業	5,084,900	774.41	3,937,777,423	1,257.00	6,391,719,300	2.37
日本	株式	キーエンス	電気機器	82,400	57,360.44	4,726,500,435	58,150.00	4,791,560,000	1.78
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	24,649,100	153.36	3,780,085,509	176.80	4,357,960,880	1.61
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	577,000	4,754.97	2,743,617,001	7,220.00	4,165,940,000	1.54
日本	株式	三菱商事	卸売業	574,000	4,830.99	2,772,986,626	6,955.00	3,992,170,000	1.48
日本	株式	日立製作所	電気機器	404,900	7,362.46	2,981,058,786	9,477.00	3,837,237,300	1.42
日本	株式	三井物産	卸売業	654,400	4,131.38	2,703,576,688	5,417.00	3,544,884,800	1.31
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	174,300	15,233.92	2,655,272,589	19,755.00	3,443,296,500	1.28
日本	株式	信越化学工業	化学	743,100	3,636.97	2,702,633,982	4,468.00	3,320,170,800	1.23
日本	株式	任天堂	その他製品	519,900	5,897.74	3,066,236,198	6,221.00	3,234,297,900	1.20
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	582,800	4,416.11	2,573,709,752	5,373.00	3,131,384,400	1.16
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	2,010,000	1,132.53	2,276,391,047	1,506.50	3,028,065,000	1.12
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	731,800	4,073.44	2,980,939,857	4,063.00	2,973,303,400	1.10
日本	株式	KDDI	情報・通信業	639,000	4,115.14	2,629,571,397	4,487.00	2,867,193,000	1.06
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	1,105,300	1,752.79	1,937,353,995	2,545.50	2,813,541,150	1.04
日本	株式	第一三共	医薬品	720,400	4,495.84	3,238,805,809	3,858.00	2,779,303,200	1.03
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	626,600	4,341.12	2,720,147,515	4,333.00	2,715,057,800	1.01
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	802,400	2,842.69	2,280,973,700	3,343.00	2,682,423,200	0.99
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	407,900	5,984.40	2,441,035,916	6,124.00	2,497,979,600	0.93
日本	株式	HOYA	精密機器	164,000	14,125.20	2,316,533,503	14,335.00	2,350,940,000	0.87
日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	1,329,400	1,501.66	1,996,311,960	1,705.00	2,266,627,000	0.84
日本	株式	オリエンタルランド	サービス業	447,500	4,013.56	1,796,066,075	4,857.00	2,173,507,500	0.81
日本	株式	ダイキン工業	機械	99,200	22,608.03	2,242,716,944	21,630.00	2,145,696,000	0.79
日本	株式	村田製作所	電気機器	749,700	2,491.25	1,867,691,639	2,477.50	1,857,381,750	0.69
日本	株式	日本たばこ産業	食料品	493,400	2,819.77	1,391,276,900	3,521.00	1,737,261,400	0.64
日本	株式	S M C	機械	25,200	62,196.83	1,567,360,117	68,680.00	1,730,736,000	0.64
日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	300,400	5,604.67	1,683,641,585	5,493.00	1,650,097,200	0.61
日本	株式	丸紅	卸売業	721,900	1,624.96	1,173,055,687	2,178.00	1,572,298,200	0.58

□ 種類別・業種別投資比率

2023年10月31日現在

種類	業種	投資比率(%)
----	----	---------

株式（国内）	水産・農林業	0.09
	鉱業	0.39
	建設業	2.15
	食料品	3.47
	繊維製品	0.40
	パルプ・紙	0.19
	化学	5.82
	医薬品	4.73
	石油・石炭製品	0.46
	ゴム製品	0.69
	ガラス・土石製品	0.68
	鉄鋼	0.96
	非鉄金属	0.65
	金属製品	0.51
	機械	4.99
	電気機器	16.00
	輸送用機器	8.40
	精密機器	2.13
	その他製品	2.23
	電気・ガス業	1.40
	陸運業	2.82
	海運業	0.73
	空運業	0.45
	倉庫・運輸関連業	0.14
	情報・通信業	7.70
	卸売業	7.05
	小売業	4.27
	銀行業	7.45
	証券、商品先物取引業	0.78
	保険業	2.47
その他金融業	1.18	
不動産業	1.93	
サービス業	4.53	
合 計	97.83	

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）

2023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	4 5 1 2年国債	4,520,000,000	99.97	4,518,596,300	99.89	4,514,847,200	0.005	2025/08/01	3.58
日本	国債 証券	1 4 7 5年国債	1,310,000,000	100.16	1,312,030,500	99.63	1,305,179,200	0.005	2026/03/20	1.04
日本	国債 証券	1 4 9 5年国債	1,240,000,000	100.10	1,241,227,600	99.41	1,232,708,800	0.005	2026/09/20	0.98

日本	国債 証券	145 5年国債	1,180,000,000	100.37	1,184,377,800	99.99	1,179,882,000	0.100	2025/09/20	0.94
日本	国債 証券	160 5年国債	1,190,000,000	99.89	1,188,711,300	98.98	1,177,826,300	0.200	2028/06/20	0.93
日本	国債 証券	148 5年国債	1,180,000,000	100.12	1,181,409,400	99.53	1,174,430,400	0.005	2026/06/20	0.93
日本	国債 証券	371 10年国債	1,190,000,000	97.60	1,161,468,300	95.15	1,132,237,400	0.400	2033/06/20	0.90
日本	国債 証券	361 10年国債	1,170,000,000	98.33	1,150,452,400	95.92	1,122,299,100	0.100	2030/12/20	0.89
日本	国債 証券	150 5年国債	1,130,000,000	100.05	1,130,565,000	99.28	1,121,909,200	0.005	2026/12/20	0.89
日本	国債 証券	362 10年国債	1,150,000,000	98.43	1,131,991,000	95.55	1,098,871,000	0.100	2031/03/20	0.87
日本	国債 証券	357 10年国債	1,120,000,000	99.20	1,111,078,700	97.24	1,089,121,600	0.100	2029/12/20	0.86
日本	国債 証券	370 10年国債	1,120,000,000	100.72	1,128,064,000	96.29	1,078,436,800	0.500	2033/03/20	0.86
日本	国債 証券	369 10年国債	1,110,000,000	100.92	1,120,223,100	96.54	1,071,616,200	0.500	2032/12/20	0.85
日本	国債 証券	153 5年国債	1,080,000,000	99.92	1,079,136,000	98.96	1,068,735,600	0.005	2027/06/20	0.85
日本	国債 証券	364 10年国債	1,120,000,000	98.09	1,098,663,600	94.81	1,061,849,600	0.100	2031/09/20	0.84
日本	国債 証券	154 5年国債	1,060,000,000	100.21	1,062,221,600	99.14	1,050,841,600	0.100	2027/09/20	0.83
日本	国債 証券	360 10年国債	1,050,000,000	98.65	1,035,825,000	96.28	1,010,940,000	0.100	2030/09/20	0.80
日本	国債 証券	359 10年国債	1,040,000,000	98.85	1,028,022,900	96.63	1,004,900,000	0.100	2030/06/20	0.80
日本	国債 証券	146 5年国債	1,000,000,000	100.40	1,003,980,000	99.93	999,250,000	0.100	2025/12/20	0.79
日本	国債 証券	358 10年国債	1,030,000,000	99.03	1,019,997,400	96.96	998,657,100	0.100	2030/03/20	0.79
日本	国債 証券	367 10年国債	1,050,000,000	98.66	1,035,941,900	94.54	992,712,000	0.200	2032/06/20	0.79
日本	国債 証券	365 10年国債	1,040,000,000	97.98	1,018,940,600	94.44	982,144,800	0.100	2031/12/20	0.78
日本	国債 証券	368 10年国債	980,000,000	97.13	951,849,900	94.24	923,561,800	0.200	2032/09/20	0.73

日本	国債証券	158 5年国債	930,000,000	100.14	931,311,200	98.75	918,375,000	0.100	2028/03/20	0.73
日本	国債証券	156 5年国債	880,000,000	100.52	884,576,000	99.37	874,438,400	0.200	2027/12/20	0.69
日本	国債証券	363 10年国債	910,000,000	98.16	893,224,400	95.17	866,037,900	0.100	2031/06/20	0.69
日本	国債証券	151 20年国債	840,000,000	107.13	899,875,200	101.39	851,709,600	1.200	2034/12/20	0.68
日本	国債証券	344 10年国債	811,000,000	100.42	814,365,650	99.68	808,437,240	0.100	2026/09/20	0.64
日本	国債証券	453 2年国債	800,000,000	99.93	799,464,000	99.76	798,088,000	0.005	2025/10/01	0.63
日本	国債証券	882 0年国債	742,000,000	107.19	795,342,380	105.56	783,218,100	2.300	2026/06/20	0.62

□ 種類別投資比率

2023年10月31日現在

種類	投資比率（％）
国債証券	79.14
地方債証券	7.82
特殊債券	7.52
社債券	4.99
合計	99.48

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）

2023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	1,178,730	21,644.20	25,512,667,374	25,460.06	30,010,534,048	5.33
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	529,731	37,199.53	19,705,744,903	50,431.22	26,714,979,595	4.74
アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	一般消費財・サービス流通・小売り	692,035	14,375.01	9,948,011,841	19,841.47	13,730,993,144	2.44

アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導体・半導体製造装置	185,105	27,005.70	4,998,890,553	61,539.81	11,391,326,733	2.02
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	445,227	14,646.42	6,520,982,526	18,608.01	8,284,790,516	1.47
アメリカ	株式	META PLATFORMS INC-CLASS A	メディア・娯楽	165,862	18,669.41	3,096,545,257	45,250.70	7,505,371,039	1.33
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	396,590	14,602.07	5,791,033,959	18,800.88	7,456,241,990	1.32
アメリカ	株式	TESLA INC	自動車・自動車部品	214,241	28,154.99	6,031,952,200	29,507.29	6,321,672,088	1.12
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	70,017	78,254.37	5,479,136,057	79,238.80	5,548,063,402	0.99
アメリカ	株式	ELI LILLY & CO	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	60,686	55,252.25	3,353,037,896	84,579.30	5,132,779,527	0.91
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	金融サービス	97,122	47,390.58	4,602,668,275	50,446.17	4,899,432,835	0.87
アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORP	エネルギー	304,036	16,481.26	5,010,897,598	15,830.12	4,812,925,999	0.85
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	219,809	20,567.93	4,521,016,512	20,545.66	4,516,121,902	0.80
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	金融サービス	121,762	31,705.39	3,860,512,285	34,847.79	4,243,136,703	0.75
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	180,442	26,087.42	4,707,266,023	21,982.46	3,966,558,199	0.70
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO/THE	家庭用品・パーソナル用品	177,416	21,819.47	3,871,123,062	22,315.86	3,959,191,079	0.70

アメリカ	株式	BROADCOM INC	半導体・半導体製造装置	30,906	82,070.93	2,536,484,114	125,775.29	3,887,211,035	0.69
デンマーク	株式	NOVO NORDISK A/S-B	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	245,570	9,533.85	2,341,228,684	14,407.90	3,538,148,494	0.63
アメリカ	株式	MASTERCARD INC - A	金融サービス	63,063	51,963.22	3,276,956,750	55,680.51	3,511,380,266	0.62
スイス	株式	NESTLE SA-REG	食品・飲料・タバコ	200,093	18,401.00	3,681,910,582	16,195.73	3,240,652,002	0.58
アメリカ	株式	HOME DEPOT INC	一般消費財・サービス流通・小売り	75,103	47,323.35	3,554,125,664	42,084.07	3,160,640,269	0.56
アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギー	136,457	26,731.80	3,647,740,997	21,841.92	2,980,482,317	0.53
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	191,252	16,242.24	3,106,360,462	15,351.69	2,936,040,803	0.52
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	133,033	23,428.71	3,116,791,438	21,213.97	2,822,158,589	0.50
アメリカ	株式	COSTCO WHOLESALE CORP	生活必需品流通・小売り	33,432	79,085.45	2,643,984,658	82,960.11	2,773,522,357	0.49
アメリカ	株式	WALMART INC	生活必需品流通・小売り	111,744	22,856.50	2,554,076,650	24,373.12	2,723,549,943	0.48

アメリカ	株式	ADOBE INC	ソフトウェア・サービス	34,076	50,513.38	1,721,293,816	78,782.80	2,684,602,672	0.48
オランダ	株式	ASML HOLDING NV	半導体・半導体製造装置	30,212	90,191.81	2,724,875,075	87,580.32	2,645,976,627	0.47
アメリカ	株式	COCA-COLA CO/THE	食品・飲料・タバコ	309,873	9,308.48	2,884,448,063	8,394.99	2,601,379,651	0.46
アメリカ	株式	PEPSICO INC	食品・飲料・タバコ	103,827	27,281.68	2,832,574,973	24,262.48	2,519,100,801	0.45

□ 種類別・業種別投資比率

2023年10月31日現在

種類	業種	投資比率（％）
株式（外国）	エネルギー	5.35
	素材	3.99
	資本財	6.47
	商業・専門サービス	1.56
	運輸	1.69
	自動車・自動車部品	1.88
	耐久消費財・アパレル	1.51
	消費者サービス	2.04
	一般消費財・サービス流通・小売り	4.48
	生活必需品流通・小売り	1.75
	食品・飲料・タバコ	3.76
	家庭用品・パーソナル用品	1.75
	ヘルスケア機器・サービス	4.43
	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	8.23
	銀行	5.13
	金融サービス	6.34
	保険	3.22
	ソフトウェア・サービス	9.81
	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	6.77
	半導体・半導体製造装置	5.76
電気通信サービス	1.20	
公益事業	2.75	
メディア・娯楽	5.92	
不動産管理・開発	0.32	
投資証券	-	1.96
合計		98.09

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）

2023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	11,450,000	13,897.40	1,591,252,646	13,779.89	1,577,797,195	1.625	2026/05/15	0.95
アメリカ	国債 証券	US TREASURY N/B	8,200,000	14,229.61	1,166,828,368	14,041.53	1,151,405,514	2.250	2026/03/31	0.69
中国	国債 証券	CHINA GOVERNMENT BOND	50,000,000	2,040.48	1,020,238,479	2,054.81	1,027,405,810	2.690	2026/08/12	0.62
アメリカ	国債 証券	US TREASURY N/B	7,200,000	12,894.64	928,414,041	12,596.67	906,959,954	0.625	2027/12/31	0.55
中国	国債 証券	CHINA GOVERNMENT BOND	43,000,000	2,062.42	886,839,461	2,090.68	898,991,910	3.020	2031/05/27	0.54
中国	国債 証券	CHINA GOVERNMENT BOND	38,700,000	2,203.46	852,740,703	2,274.44	880,208,221	3.720	2051/04/12	0.53
中国	国債 証券	CHINA GOVERNMENT BOND	41,000,000	2,036.24	834,859,957	2,027.65	831,336,995	2.400	2028/07/15	0.50
アメリカ	国債 証券	US TREASURY N/B	6,100,000	14,835.40	904,959,659	13,418.52	818,529,872	3.500	2033/02/15	0.49
アメリカ	国債 証券	US TREASURY N/B	7,000,000	12,308.86	861,620,149	11,451.42	801,599,360	0.875	2030/11/15	0.48
中国	国債 証券	CHINA GOVERNMENT BOND	39,000,000	2,023.84	789,299,201	2,033.69	793,137,873	2.180	2025/08/25	0.48
アメリカ	国債 証券	US TREASURY N/B	5,600,000	15,667.60	877,385,381	14,118.68	790,645,958	4.125	2032/11/15	0.48
アメリカ	国債 証券	US TREASURY N/B	5,300,000	14,902.49	789,831,927	14,601.74	773,892,465	3.875	2026/01/15	0.47
アメリカ	国債 証券	US TREASURY N/B	5,900,000	12,957.58	764,497,407	12,624.77	744,861,660	0.750	2028/01/31	0.45
アメリカ	国債 証券	US TREASURY N/B	5,200,000	14,007.74	728,402,553	14,253.09	741,160,540	0.750	2024/11/15	0.45
アメリカ	国債 証券	US TREASURY N/B	5,100,000	14,420.69	735,455,089	14,477.50	738,352,593	2.250	2024/11/15	0.44
アメリカ	国債 証券	US TREASURY N/B	5,700,000	14,224.38	810,789,739	12,860.10	733,025,851	2.875	2032/05/15	0.44
アメリカ	国債 証券	US TREASURY N/B	5,300,000	14,320.51	758,986,767	13,755.37	729,034,532	2.750	2028/02/15	0.44
アメリカ	国債 証券	US TREASURY N/B	5,500,000	14,433.76	793,856,610	13,253.76	728,956,936	3.375	2033/05/15	0.44
アメリカ	国債 証券	US TREASURY N/B	5,000,000	15,288.00	764,399,777	14,474.96	723,748,008	4.000	2028/02/29	0.43
アメリカ	国債 証券	US TREASURY N/B	5,000,000	14,232.60	711,630,222	14,384.51	719,225,330	1.500	2024/10/31	0.43

アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,800,000	14,307.96	686,781,959	13,865.26	665,532,402	2.625	2027/05/31	0.40
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,700,000	12,551.81	715,453,342	11,602.72	661,355,242	1.125	2031/02/15	0.40
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,000,000	13,909.06	695,453,240	13,185.44	659,271,820	2.375	2029/03/31	0.40
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,500,000	12,959.38	712,765,750	11,930.30	656,166,497	1.625	2031/05/15	0.39
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,500,000	14,480.19	651,608,685	14,412.76	648,574,380	2.625	2025/04/15	0.39
中国	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	31,500,000	2,046.30	644,585,557	2,050.39	645,871,854	2.640	2028/01/15	0.39
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,500,000	14,053.94	632,427,300	14,247.11	641,119,811	1.000	2024/12/15	0.39
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,400,000	14,982.10	659,212,315	14,414.86	634,253,714	3.875	2027/12/31	0.38
中国	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	31,000,000	2,023.45	627,269,724	2,036.58	631,340,523	2.240	2025/05/25	0.38
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,300,000	13,078.54	693,162,448	11,909.97	631,228,229	1.875	2032/02/15	0.38

□ 種類別投資比率

2023年10月31日現在

種類	投資比率(%)
国債証券	98.60
合計	98.60

マネーインカム・マザーファンド

イ 主要投資銘柄

2023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	2 9 政保 日本政策	300,000,000	100.24	300,715,000	100.22	300,647,400	0.660	2024/02/20	13.99
日本	特殊 債券	2 1 5 政 保道路機構	200,000,000	100.64	201,286,000	100.35	200,707,800	0.669	2024/04/30	9.34
日本	特殊 債券	2 3 政保 政策投資C	200,000,000	100.64	201,274,200	100.27	200,531,600	0.645	2024/03/18	9.33
日本	特殊 債券	5 6 政保地 方公共団	200,000,000	100.55	201,108,000	100.17	200,332,000	0.747	2024/01/19	9.32
日本	国債 証券	3 3 2 1 0年国債	173,000,000	100.49	173,852,890	100.10	173,166,080	0.600	2023/12/20	8.06
日本	国債 証券	3 3 5 1 0年国債	120,000,000	100.54	120,645,600	100.47	120,564,000	0.500	2024/09/20	5.61
日本	特殊 債券	2 1 8 政 保道路機構	100,000,000	100.47	100,466,000	100.39	100,392,800	0.660	2024/05/31	4.67
日本	特殊 債券	2 0 7 政 保道路機構	100,000,000	100.33	100,325,000	100.12	100,116,400	0.693	2023/12/28	4.66

日本	特殊 債券	2 2 政保 政策投資 C	100,000,000	100.38	100,379,000	100.10	100,096,500	0.693	2023/12/18	4.66
----	----------	------------------	-------------	--------	-------------	--------	-------------	-------	------------	------

以上が、当ファンドが保有する有価証券のすべてです。

□ 種類別投資比率

2023年10月31日現在

種類	投資比率(%)
国債証券	13.67
特殊債券	55.97
合計	69.64

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)

2023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	TOPI X 先 物 0512 月 2023年 12月	買建	259	日本・円	6,000,029,900	5,837,860,000	2.16

(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

2023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 100 INDEX DEC 23 2023年12 月	買建	36	イギリス・ポンド	2,734,547.00	496,976,571	2,642,760.00	480,295,202	0.09
	ドイツ	EU REX	EURO STOX 50 DEC 23 2023年12 月	買建	245	ユーロ	10,220,550.00	1,621,592,463	9,895,550.00	1,570,027,963	0.28
	アメリカ	シカゴ 商品 取引所	S&P 500 EMIN I FUT DEC 23 2023年12 月	買建	271	アメリカ・ドル	58,757,548.00	8,784,841,001	56,716,912.50	8,479,745,587	1.51
	オーストラリア	シドニー 先物 取引所	SPI 200 FUTU RES DEC 23 2023年12 月	買建	21	オーストラリア・ドル	3,696,444.50	351,864,551	3,560,025.00	338,878,779	0.06

(注) 主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。

2023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	11,412,000.00	1,711,526,415	1,705,682,952	0.30
	ユーロ	買建	1,143,000.00	181,067,719	181,315,852	0.03
	イギリス・ポンド	買建	548,000.00	99,649,826	99,571,467	0.02
	スイス・フラン	買建	378,000.00	62,974,446	62,655,741	0.01
	オーストラリア・ドル	買建	492,000.00	46,768,978	46,821,327	0.01
	カナダ・ドル	買建	341,000.00	37,059,777	36,836,184	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:2023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



分配の推移

決算期	分配金
2023年4月	0円
2022年4月	0円
2021年4月	0円
2020年4月	0円
2019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	99.70
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		0.30
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	41.89
日本	親投資信託受益証券	国内株式インデックス・マザーファンド(B号)	24.08
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	15.10
日本	親投資信託受益証券	外国株式インデックス・マザーファンド	9.81
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	8.84

■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	97.83
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		2.17
合計(純資産総額)		100.00

※株価指数先物取引の買建て 2.16%

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	4.34
日本	株式	ソニーグループ	電気機器	2.68
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	2.37
日本	株式	キーエンス	電気機器	1.78
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	1.61
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	1.54
日本	株式	三菱商事	卸売業	1.48
日本	株式	日立製作所	電気機器	1.42
日本	株式	三井物産	卸売業	1.31
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	1.28

※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)」は組入価値証券が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	79.14
地方債証券	日本	7.82
特殊債証券	日本	7.52
社債証券	日本	4.99
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		0.53
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	451 2年国債	0.005	2025/08/01	3.58
日本	国債証券	147 5年国債	0.005	2026/03/20	1.04
日本	国債証券	149 5年国債	0.005	2026/09/20	0.98
日本	国債証券	145 5年国債	0.100	2025/09/20	0.94
日本	国債証券	160 5年国債	0.200	2028/06/20	0.93
日本	国債証券	148 5年国債	0.005	2026/06/20	0.93
日本	国債証券	371 10年国債	0.400	2033/06/20	0.90
日本	国債証券	361 10年国債	0.100	2030/12/20	0.89
日本	国債証券	150 5年国債	0.005	2026/12/20	0.89
日本	国債証券	362 10年国債	0.100	2031/03/20	0.87

■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	68.94
	イギリス	4.05
	カナダ	3.33
	スイス	3.13
	フランス	3.11
	ドイツ	2.31
	その他	11.25
投資証券	アメリカ・その他	1.96
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1.91
合計(純資産総額)		100.00

※株価指数先物取引の興建で 1.93%

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	5.33
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	4.74
アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	一般消費財・ サービス流通・小売り	2.44
アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導体・半導体製造装置	2.02
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	1.47
アメリカ	株式	META PLATFORMS INC-CLASS A	メディア・娯楽	1.33
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	1.32
アメリカ	株式	TESLA INC	自動車・自動車部品	1.12
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	0.99
アメリカ	株式	ELI LILLY & CO	医薬品・バイオテクノロジー ライフサイエンス	0.91

■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	47.55
	フランス	8.28
	イタリア	7.34
	中国	6.93
	ドイツ	6.45
	スペイン	4.87
	イギリス	4.80
	その他	12.39
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1.40
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(%)
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1.625	2026/05/15	0.95
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.250	2026/03/31	0.69
中国	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	2.690	2026/08/12	0.62
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	0.625	2027/12/31	0.55
中国	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	3.020	2031/05/27	0.54
中国	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	3.720	2051/04/12	0.53
中国	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	2.400	2028/07/15	0.50
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3.500	2033/02/15	0.49
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	0.875	2030/11/15	0.48
中国	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	2.180	2025/08/25	0.48

※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	55.97
国債証券	日本	13.67
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		30.36
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	29 政保日本政策	0.660	2024/02/20	13.99
日本	特殊債券	215 政保道路機構	0.669	2024/04/30	9.34
日本	特殊債券	23 政保政策投資C	0.645	2024/03/18	9.33
日本	特殊債券	56政保地方公共団	0.747	2024/01/19	9.32
日本	国債証券	332 10年国債	0.600	2023/12/20	8.06
日本	国債証券	335 10年国債	0.500	2024/09/20	5.61
日本	特殊債券	218 政保道路機構	0.660	2024/05/31	4.67
日本	特殊債券	207 政保道路機構	0.693	2023/12/28	4.66
日本	特殊債券	22 政保政策投資C	0.693	2023/12/18	4.66

※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。

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

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。

※2023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。

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。

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

(ロ) 信託契約に関する監督官庁の命令

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

(ハ) 委託会社の登録取消等に伴う取扱い

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

(ニ) 受託会社の辞任および解任に伴う取扱い

- a. 受託会社は、委託会社の承諾を受けてその任務を辞任することができます。また、受託会社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發します。

(ハ) 上記(ロ)の書面決議において、受益者(委託会社等を除きます。)は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、知っている受益者が議決権を行使しないときは、当該知っている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。

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

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

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

二 反対受益者の受益権買取請求の不適用

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

ホ 販売会社との契約の更改等

委託会社と販売会社との間で締結される販売契約(名称の如何を問わず、ファンドの募集・販売の取扱い、受益者からの一部解約実行請求の受付け、受益者への収益分配金、一部解約金および

償還金の支払事務等を規定するもの)は、期間満了の3ヵ月前に当事者のいずれからも、何らの意思表示もない場合は、自動的に1年間更新されます。販売契約の内容は、必要に応じて、委託会社と販売会社との合意により変更されることがあります。

へ 委託会社の事業の譲渡および承継に伴う取扱い

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

ト 公告

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

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

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

チ 運用にかかる報告書の開示方法

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

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

4【受益者の権利等】

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

受益者の有する主な権利は次の通りです。

イ 分配金請求権

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

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

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。

二 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15期(2022年4月14日から2023年4月13日まで)の財務諸表について、PwCあらた有限責任監査法人により監査を受けております。

1【財務諸表】

【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)】

(1)【貸借対照表】

(単位:円)

	第14期 (2022年 4月13日現在)	第15期 (2023年 4月13日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	321,669	654,615
コール・ローン	12,339,012	14,665,005
親投資信託受益証券	2,093,898,903	2,142,326,971
未収入金	5,000,000	2,000,000
流動資産合計	2,111,559,584	2,159,646,591
資産合計	2,111,559,584	2,159,646,591
負債の部		
流動負債		
未払解約金	2,849,560	77,251
未払受託者報酬	341,072	342,259
未払委託者報酬	6,367,451	6,389,670
その他未払費用	56,837	57,017
流動負債合計	9,614,920	6,866,197
負債合計	9,614,920	6,866,197
純資産の部		
元本等		
元本	1,390,422,023	1,430,756,019
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	711,522,641	722,024,375
(分配準備積立金)	229,117,187	213,242,407
元本等合計	2,101,944,664	2,152,780,394
純資産合計	2,101,944,664	2,152,780,394
負債純資産合計	2,111,559,584	2,159,646,591

（ 2 ） 【 損益及び剰余金計算書 】

（ 単位：円 ）

	第14期		第15期	
	自	2021年 4月14日	自	2022年 4月14日
	至	2022年 4月13日	至	2023年 4月13日
営業収益				
受取利息		138		130
有価証券売買等損益		33,615,712		4,938,068
営業収益合計		33,615,850		4,938,198
営業費用				
支払利息		8,398		5,898
受託者報酬		668,164		679,942
委託者報酬		12,473,185		12,693,793
その他費用		112,477		113,578
営業費用合計		13,262,224		13,493,211
営業利益又は営業損失（ ）		20,353,626		8,555,013
経常利益又は経常損失（ ）		20,353,626		8,555,013
当期純利益又は当期純損失（ ）		20,353,626		8,555,013
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（ ）		2,947,910		4,951,633
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		139,342,167		128,669,989
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		139,342,167		128,669,989
剰余金減少額又は欠損金増加額		86,827,157		114,564,875
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		86,827,157		114,564,875
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（ ）		711,522,641		722,024,375

(3)【注記表】

(重要な会計方針の注記)

項目	第15期	
	自 2022年4月14日 至 2023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14期	第15期
	(2022年4月13日現在)	(2023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	1,390,422,023口	1,430,756,019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 1.5046円 (1万口当たりの純資産額15,046円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第14期	第15期
	自 2021年4月14日 至 2022年4月13日	自 2022年4月14日 至 2023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（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>	<p>計算期間末における費用控除後の配当等収益（18,607,811円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（0円）、収益調整金（724,853,195円）、および分配準備積立金（194,634,596円）より、分配対象収益は938,095,602円（1万口当たり6,556.64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15期 自 2022年4月14日 至 2023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>

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

・金融商品の時価等に関する事項

項目	第15期 (2023年4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（親投資信託受益証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等による場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

第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

第15期（自 2022年4月14日 至 2023年4月13日）

種 類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	37,350,885円
合計	37,350,885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15期 自 2022年4月14日 至 2023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14期 (2022年4月13日現在)	第15期 (2023年4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	264,851,982円
期中一部解約元本額	174,665,780円	224,517,986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）	149,688,598	522,937,117	
	外国株式インデックス・マザーファンド	35,335,134	219,961,209	
	外国債券パッシブ・マザーファンド	164,754,130	326,905,144	
	国内債券パッシブ・マザーファンド	728,176,754	899,589,561	
	マネーインカム・マザーファンド	171,629,556	172,933,940	
	親投資信託受益証券 小計			2,142,326,971
合計			2,142,326,971	

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)

	(2022年4月13日現在)	(2023年4月13日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	35,806,941	155,442,581
コール・ローン	1,373,532,285	3,482,300,514
株式	197,920,121,230	226,980,178,810
派生商品評価勘定	19,744,700	101,813,200
未収入金	-	1,487,700
未収配当金	2,365,057,715	2,733,543,848
前払金	139,360,000	-
差入委託証拠金	157,590,000	253,500,000
流動資産合計	202,011,212,871	233,708,266,653
資産合計	202,011,212,871	233,708,266,653
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	92,875,700	6,668,900
前受金	-	92,256,000
未払解約金	51,245,960	125,377,224
その他未払費用	9,440	8,232
流動負債合計	144,131,100	224,310,356
負債合計	144,131,100	224,310,356
純資産の部		
元本等		
元本	63,097,233,521	66,834,421,601
剰余金		
剰余金又は欠損金()	138,769,848,250	166,649,534,696
元本等合計	201,867,081,771	233,483,956,297
純資産合計	201,867,081,771	233,483,956,297
負債純資産合計	202,011,212,871	233,708,266,653

(2) 注記表

(重要な会計方針の注記)

項 目	自 2022年4月14日 至 2023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</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算期間末日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場によっております。</p>

(重要な会計上の見積りに関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

項目	(2022年4月13日現在)	(2023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	63,097,233,521口	66,834,421,601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 3.4935円 (1万口当たりの純資産額34,935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 2022年4月14日 至 2023年4月13日
1. 金融商品に対する取組方針	<p>当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。</p>
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、株式を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。</p> <p>当計算期間については、先物取引を行っております。</p>

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

・金融商品の時価等に関する事項

項目	(2023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)</p> <p>「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定(デリバティブ取引)</p> <p>デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

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

(デリバティブ取引に関する注記)

(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

(2023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 0506月	6,372,225,700	-	6,467,370,000	95,144,300
	小計	6,372,225,700	-	6,467,370,000	95,144,300
合計		6,372,225,700	-	6,467,370,000	95,144,300

(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)

<p style="text-align: center;">自 2022年4月14日 至 2023年4月13日</p>
<p>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。</p>

(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
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)	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(T O P I X)	1,489,236,000円
三井住友・DCつみたてN I S A・日本株インデックスファンド	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D S・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N I S A・世界分散ファンド	41,466,339円
三井住友D S・国内株式インデックス年金ファンド	547,071,614円
三井住友D S・年金バランス30(債券重点型)	17,456,337円
三井住友D S・年金バランス50(標準型)	88,881,884円
三井住友D S・年金バランス70(株式重点型)	94,685,297円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2060	4,047,832円
日興F W S・日本株インデックス	582,504,321円
三井住友D S・T O P I Xインデックス・ファンド	5,086,487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)	2,743,586,165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 >	12,823,736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 >	97,797,524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 >	1,769,964,821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 >	1,640,393,274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 >	6,218,766,294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 >	40,740,210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 >	159,471,500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 >	735,491,821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 >	46,826,720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 >	257,810,451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 >	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

(2023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	63,097,233,521円
同期中における追加設定元本額	11,385,515,013円
同期中における一部解約元本額	7,648,326,933円
2023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	9,570,680,227円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	1,059,937,184円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	4,638,997,735円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	3,648,030,008円
SMAM・グローバルバランスファンド(機動的資産配分型)	149,688,598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)	4,175,044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)	20,105,492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)	65,174,904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)	171,116,447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)	156,280,073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)	274,275,931円
国内株式指数ファンド(TOPIX)	1,340,401,706円
三井住友・DCつみたてNISA・日本株インデックスファンド	23,642,030,750円

アセットアロケーション・ファンド(安定型)	224,604,200円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	287,321,128円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	179,357,049円
イオン・バランス戦略ファンド	48,802,794円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2050	47,275,620円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	211,812,693円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	195,201,725円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	724,047,688円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	403,895,409円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	461,567,788円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	54,207,734円
三井住友D S・国内株式インデックス年金ファンド	912,956,383円
三井住友D S・年金バランス30(債券重点型)	42,315,625円
三井住友D S・年金バランス50(標準型)	230,367,140円
三井住友D S・年金バランス70(株式重点型)	220,965,270円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2060	5,943,129円
日興FWS・日本株インデックス	1,539,161,603円
三井住友D S・TOPIXインデックス・ファンド	31,182,740円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2035	48,532円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2040	55,404円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2045	65,862円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2055	75,722円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2065	75,722円
三井住友D S・FW専用ポートフォリオ・レベル1(保守型)	36,977円
三井住友D S・FW専用ポートフォリオ・レベル2(安定型)	53,380円
三井住友D S・FW専用ポートフォリオ・レベル3(安定成長型)	64,358円
三井住友D S・FW専用ポートフォリオ・レベル4(成長型)	74,521円
三井住友D S・FW専用ポートフォリオ・レベル5(積極成長型)	84,740円
SMAM・国内株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	2,338,416,776円
バランスファンドVA(安定運用型) <適格機関投資家限定>	11,374,364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>	65,084,989円
SMAM・バランスファンドVA25 <適格機関投資家専用>	1,278,636,021円
SMAM・バランスファンドVA37.5 <適格機関投資家専用>	1,365,230,760円
SMAM・バランスファンドVA50 <適格機関投資家専用>	5,221,333,717円
SMAM・バランスファンドVL30 <適格機関投資家限定>	35,485,948円
SMAM・バランスファンドVL50 <適格機関投資家限定>	128,454,719円
SMAM・バランスファンドVA75 <適格機関投資家専用>	627,326,286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>	42,743,164円
SMAM・インデックス・バランスVA25 <適格機関投資家専用>	227,367,598円
SMAM・インデックス・バランスVA50 <適格機関投資家専用>	724,446,785円
SMAM・バランスファンドVA40 <適格機関投資家専用>	505,694,664円
SMAM・バランスファンドVA35 <適格機関投資家専用>	1,525,907,370円
SMAM・バランスVA株40T <適格機関投資家限定>	352,709円
SMAM・グローバルバランス40VA <適格機関投資家限定>	33,786,896円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A <適格機関投資家専用>	37,753,776円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A <適格機関投資家専用>	29,039,696円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A <適格機関投資家専用>	15,809,789円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L <適格機関投資家専用>	88,713,894円

SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	217,333,061円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A2<適格機関投資家専用>	47,877,088円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A2<適格機関投資家専用>	35,298,082円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A2<適格機関投資家専用>	7,431,986円
SMAM・アセットバランスファンドVA30L2<適格機関投資家専用>	38,679,568円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L2<適格機関投資家専用>	489,268,886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)	158,733,909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>	182,201,631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>	78,463,864円
SMAM・世界バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	79,070,264円
SMAM・世界バランスファンドVA2<適格機関投資家限定>	38,854,455円
SMAM・年金Wリスクコントロールファンド<適格機関投資家限定>	51,538,394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>	37,247,656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>	48,176,456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>	442,012,325円
SMDAM・日米3資産バランスオープン<適格機関投資家限定>	16,759,020円
合計	66,834,421,601円

(3) 附属明細表

有価証券明細表

(a) 株式

(単位:円)

銘柄	株数	評価額		備考
		単価	金額	
極洋	4,100	3,465.000	14,206,500	
ニッスイ	109,600	564.000	61,814,400	
マルハニチロ	16,400	2,389.000	39,179,600	
雪国まいたけ	10,700	1,006.000	10,764,200	
カネコ種苗	4,700	1,608.000	7,557,600	
サカタのタネ	12,700	3,825.000	48,577,500	
ホクト	10,000	1,810.000	18,100,000	
住石ホールディングス	18,600	338.000	6,286,800	
日鉄鉱業	4,500	3,475.000	15,637,500	
三井松島ホールディングス	5,200	3,115.000	16,198,000	
INPEX	407,400	1,497.000	609,877,800	
石油資源開発	12,700	4,545.000	57,721,500	
K&Oエナジーグループ	5,400	2,218.000	11,977,200	
ショーボンドホールディングス	15,100	5,340.000	80,634,000	
ミライト・ワン	36,600	1,664.000	60,902,400	
タマホーム	7,100	3,525.000	25,027,500	
日本アクア	5,200	885.000	4,602,000	
Robot Home	21,600	250.000	5,400,000	
安藤・間	63,200	840.000	53,088,000	
東急建設	32,900	676.000	22,240,400	
コムシスホールディングス	37,000	2,457.000	90,909,000	

ピーアールホールディングス	21,600	348.000	7,516,800
高松コンストラクショングループ	7,300	2,076.000	15,154,800
東建コーポレーション	3,100	8,000.000	24,800,000
ヤマウラ	6,800	1,144.000	7,779,200
オリエンタル白石	42,800	324.000	13,867,200
大成建設	76,900	4,200.000	322,980,000
大林組	274,800	1,013.000	278,372,400
清水建設	231,000	773.000	178,563,000
飛島建設	9,600	1,075.000	10,320,000
長谷工コーポレーション	79,100	1,572.000	124,345,200
松井建設	7,000	668.000	4,676,000
銭高組	1,900	3,025.000	5,747,500
鹿島建設	170,700	1,621.000	276,704,700
不動テトラ	5,300	1,676.000	8,882,800
鉄建建設	6,700	1,843.000	12,348,100
西松建設	13,400	3,505.000	46,967,000
三井住友建設	65,200	388.000	25,297,600
大豊建設	3,500	3,765.000	13,177,500
奥村組	12,500	3,185.000	39,812,500
東鉄工業	10,500	2,647.000	27,793,500
浅沼組	6,400	3,100.000	19,840,000
戸田建設	95,600	682.000	65,199,200
熊谷組	13,100	2,731.000	35,776,100
北野建設	2,300	3,260.000	7,498,000
矢作建設工業	11,000	823.000	9,053,000
ピーエス三菱	10,900	660.000	7,194,000
日本ハウスホールディングス	18,200	394.000	7,170,800
新日本建設	10,900	947.000	10,322,300
東亜道路工業	3,400	4,010.000	13,634,000
日本道路	1,700	7,490.000	12,733,000
東亜建設工業	7,000	2,807.000	19,649,000
日本国土開発	24,500	621.000	15,214,500
若築建設	3,600	3,905.000	14,058,000
東洋建設	25,800	950.000	24,510,000
五洋建設	110,700	623.000	68,966,100
世紀東急工業	11,100	890.000	9,879,000
福田組	3,100	4,685.000	14,523,500
住友林業	59,000	2,748.000	162,132,000
日本基礎技術	8,700	517.000	4,497,900
巴コーポレーション	13,000	434.000	5,642,000
大和ハウス工業	215,600	3,144.000	677,846,400
ライト工業	13,900	1,934.000	26,882,600
積水ハウス	241,600	2,696.500	651,474,400
日特建設	8,200	965.000	7,913,000
ユアテック	17,300	822.000	14,220,600
日本リーテック	6,300	1,064.000	6,703,200
四電工	3,600	1,919.000	6,908,400
中電工	10,900	2,124.000	23,151,600

関電工	40,500	935.000	37,867,500
きんでん	53,500	1,629.000	87,151,500
東京エネシス	8,900	887.000	7,894,300
トーエネック	2,800	3,355.000	9,394,000
住友電設	7,300	2,613.000	19,074,900
日本電設工業	12,500	1,630.000	20,375,000
エクシオグループ	35,100	2,420.000	84,942,000
新日本空調	4,400	1,901.000	8,364,400
九電工	19,000	3,300.000	62,700,000
三機工業	16,700	1,447.000	24,164,900
日揮ホールディングス	76,400	1,689.000	129,039,600
中外炉工業	3,300	1,805.000	5,956,500
ヤマト	8,200	864.000	7,084,800
太平電業	4,900	3,950.000	19,355,000
高砂熱学工業	18,500	2,173.000	40,200,500
三晃金属工業	1,300	3,910.000	5,083,000
朝日工業社	3,600	2,242.000	8,071,200
明星工業	14,400	816.000	11,750,400
大気社	8,800	3,600.000	31,680,000
ダイダン	5,200	2,391.000	12,433,200
日比谷総合設備	6,900	2,146.000	14,807,400
テスホールディングス	8,900	1,077.000	9,585,300
インフロニア・ホールディングス	80,800	1,014.000	81,931,200
東洋エンジニアリング	11,100	566.000	6,282,600
レイズネクスト	11,000	1,364.000	15,004,000
ニッポン	20,400	1,684.000	34,353,600
日清製粉グループ本社	71,500	1,588.000	113,542,000
日東富士製粉	1,900	4,505.000	8,559,500
昭和産業	6,500	2,543.000	16,529,500
鳥越製粉	11,200	605.000	6,776,000
中部飼料	10,900	1,052.000	11,466,800
フィード・ワン	12,600	691.000	8,706,600
日本甜菜製糖	5,400	1,687.000	9,109,800
DM三井製糖ホールディングス	7,600	2,115.000	16,074,000
ウェルネオシュガー	4,700	1,679.000	7,891,300
森永製菓	14,500	3,785.000	54,882,500
中村屋	2,800	3,115.000	8,722,000
江崎グリコ	22,200	3,355.000	74,481,000
井村屋グループ	4,600	2,241.000	10,308,600
不二家	5,300	2,465.000	13,064,500
山崎製パン	52,400	1,575.000	82,530,000
モロゾフ	2,700	3,470.000	9,369,000
亀田製菓	5,100	4,355.000	22,210,500
寿スピリッツ	8,300	9,620.000	79,846,000
カルビー	35,700	2,813.000	100,424,100
森永乳業	14,200	4,665.000	66,243,000
六甲バター	6,000	1,350.000	8,100,000
ヤクルト本社	55,400	9,840.000	545,136,000

明治ホールディングス	95,800	3,165.000	303,207,000
雪印メグミルク	18,600	1,773.000	32,977,800
プリマハム	10,300	2,231.000	22,979,300
日本ハム	30,200	3,885.000	117,327,000
丸大食品	8,700	1,480.000	12,876,000
S Foods	8,700	2,838.000	24,690,600
柿安本店	3,200	2,330.000	7,456,000
伊藤ハム米久ホールディングス	58,100	705.000	40,960,500
サッポロホールディングス	25,600	3,480.000	89,088,000
アサヒグループホールディングス	179,000	4,870.000	871,730,000
キリンホールディングス	349,700	2,108.500	737,342,450
宝ホールディングス	52,100	1,036.000	53,975,600
オエノンホールディングス	25,900	274.000	7,096,600
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	60,600	1,416.000	85,809,600
サントリー食品インターナショナル	54,500	4,980.000	271,410,000
ダイドーグループホールディングス	4,400	4,880.000	21,472,000
伊藤園	26,300	4,290.000	112,827,000
キーコーヒー	8,500	2,056.000	17,476,000
日清オイリオグループ	10,900	3,175.000	34,607,500
不二製油グループ本社	18,300	1,994.000	36,490,200
かどや製油	1,900	3,515.000	6,678,500
J - オイルミルズ	8,300	1,545.000	12,823,500
キッコーマン	51,200	7,140.000	365,568,000
味の素	189,800	4,719.000	895,666,200
ブルドックソース	3,600	1,898.000	6,832,800
キューピー	41,700	2,213.000	92,282,100
ハウス食品グループ本社	23,500	2,792.000	65,612,000
カゴメ	36,100	3,100.000	111,910,000
焼津水産化学工業	6,800	862.000	5,861,600
アリアケジャパン	6,800	5,150.000	35,020,000
エバラ食品工業	1,800	3,065.000	5,517,000
ニチレイ	35,700	2,651.000	94,640,700
東洋水産	39,300	5,690.000	223,617,000
イトアンドホールディングス	3,900	2,205.000	8,599,500
ヨシムラ・フード・ホールディングス	5,600	978.000	5,476,800
日清食品ホールディングス	27,200	12,100.000	329,120,000
永谷園ホールディングス	4,200	2,124.000	8,920,800
フジッコ	7,900	1,859.000	14,686,100
ロック・フィールド	8,700	1,538.000	13,380,600
日本たばこ産業	510,200	2,793.500	1,425,243,700
ケンコーマヨネーズ	6,000	1,210.000	7,260,000
わらべや日洋ホールディングス	6,200	2,122.000	13,156,400
なとり	5,300	1,952.000	10,345,600
ファーマフーズ	12,200	1,549.000	18,897,800
ユーグレナ	50,900	905.000	46,064,500
紀文食品	6,900	1,018.000	7,024,200
ピククルスホールディングス	5,200	1,150.000	5,980,000

ミヨシ油脂	3,800	976.000	3,708,800
理研ビタミン	7,200	1,937.000	13,946,400
片倉工業	8,800	1,801.000	15,848,800
グンゼ	6,100	4,560.000	27,816,000
東洋紡	34,900	1,018.000	35,528,200
ユニチカ	30,500	213.000	6,496,500
富士紡ホールディングス	3,400	3,175.000	10,795,000
倉敷紡績	6,300	2,435.000	15,340,500
シキボウ	6,400	995.000	6,368,000
日本毛織	21,400	1,011.000	21,635,400
帝国繊維	9,300	1,709.000	15,893,700
帝人	76,500	1,448.000	110,772,000
東レ	529,500	746.800	395,430,600
ダイニック	7,300	727.000	5,307,100
セーレン	15,400	2,249.000	34,634,600
小松マテーレ	13,300	680.000	9,044,000
ワコールホールディングス	15,400	2,570.000	39,578,000
ホギメディカル	10,900	3,150.000	34,335,000
T S Iホールディングス	28,000	649.000	18,172,000
ワールド	10,700	1,474.000	15,771,800
三陽商会	3,500	1,583.000	5,540,500
オンワードホールディングス	53,400	377.000	20,131,800
ルックホールディングス	2,900	2,213.000	6,417,700
ゴールドウイン	14,000	12,650.000	177,100,000
デサント	13,700	4,150.000	56,855,000
特種東海製紙	3,900	2,845.000	11,095,500
王子ホールディングス	328,300	527.000	173,014,100
日本製紙	42,500	1,030.000	43,775,000
北越コーポレーション	50,600	885.000	44,781,000
大王製紙	35,600	1,068.000	38,020,800
レンゴー	73,000	866.000	63,218,000
トーモク	5,400	1,601.000	8,645,400
ザ・パックス	6,000	2,963.000	17,778,000
北の達人コーポレーション	35,900	340.000	12,206,000
クラレ	125,300	1,224.000	153,367,200
旭化成	491,400	939.300	461,572,020
レゾナック・ホールディングス	76,100	2,198.000	167,267,800
住友化学	583,600	458.000	267,288,800
住友精化	3,400	4,260.000	14,484,000
日産化学	37,300	5,990.000	223,427,000
ラサ工業	3,400	2,072.000	7,044,800
クレハ	6,700	8,430.000	56,481,000
多木化学	3,100	4,480.000	13,888,000
テイカ	5,800	1,177.000	6,826,600
石原産業	14,400	1,130.000	16,272,000
片倉コープアグリ	2,600	1,644.000	4,274,400
日本曹達	8,500	4,540.000	38,590,000
東ソー	104,700	1,801.000	188,564,700

トクヤマ	25,400	2,120.000	53,848,000
セントラル硝子	12,900	2,839.000	36,623,100
東亜合成	38,900	1,208.000	46,991,200
大阪ソーダ	4,800	4,705.000	22,584,000
関東電化工業	14,900	1,012.000	15,078,800
デンカ	28,800	2,721.000	78,364,800
信越化学工業	655,000	4,081.000	2,673,055,000
堺化学工業	6,100	1,794.000	10,943,400
第一稀元素化学工業	7,800	1,003.000	7,823,400
エア・ウォーター	74,100	1,649.000	122,190,900
日本酸素ホールディングス	76,200	2,361.000	179,908,200
日本化学工業	3,000	1,909.000	5,727,000
日本パーカラライジング	38,100	1,014.000	38,633,400
高压ガス工業	12,400	716.000	8,878,400
四国化成ホールディングス	9,700	1,383.000	13,415,100
戸田工業	2,000	2,458.000	4,916,000
ステラ ケミファ	4,800	2,625.000	12,600,000
保土谷化学工業	2,400	3,025.000	7,260,000
日本触媒	12,000	5,390.000	64,680,000
大日精化工業	5,700	1,792.000	10,214,400
カネカ	17,700	3,470.000	61,419,000
三菱瓦斯化学	57,900	1,964.000	113,715,600
三井化学	64,700	3,320.000	214,804,000
J S R	73,700	3,115.000	229,575,500
東京応化工業	13,800	7,070.000	97,566,000
大阪有機化学工業	6,000	1,910.000	11,460,000
三菱ケミカルグループ	532,600	791.000	421,286,600
K Hネオケム	13,100	2,310.000	30,261,000
ダイセル	116,300	998.000	116,067,400
住友ベークライト	11,500	4,955.000	56,982,500
積水化学工業	160,400	1,886.000	302,514,400
日本ゼオン	47,300	1,401.000	66,267,300
アイカ工業	19,800	3,005.000	59,499,000
U B E	40,100	2,130.000	85,413,000
積水樹脂	11,300	2,044.000	23,097,200
タキロンシーアイ	17,900	491.000	8,788,900
旭有機材	5,400	3,090.000	16,686,000
ニチバン	5,500	1,948.000	10,714,000
リケンテクノス	17,200	585.000	10,062,000
大倉工業	4,000	2,039.000	8,156,000
群栄化学工業	2,200	2,672.000	5,878,400
ミライアル	3,000	1,549.000	4,647,000
ダイキョーニシカワ	17,900	640.000	11,456,000
森六ホールディングス	4,300	1,888.000	8,118,400
恵和	5,200	1,404.000	7,300,800
日本化薬	59,400	1,211.000	71,933,400
カーリットホールディングス	8,700	700.000	6,090,000
日本精化	4,600	2,585.000	11,891,000

扶桑化学工業	7,200	3,650.000	26,280,000
トリケミカル研究所	10,600	2,308.000	24,464,800
A D E K A	26,800	2,223.000	59,576,400
日油	24,300	6,050.000	147,015,000
新日本理化	20,700	215.000	4,450,500
ハリマ化成グループ	6,400	866.000	5,542,400
花王	192,200	5,305.000	1,019,621,000
第一工業製薬	3,300	1,893.000	6,246,900
石原ケミカル	4,200	1,468.000	6,165,600
三洋化成工業	4,600	4,205.000	19,343,000
有機合成薬品工業	2,100	290.000	609,000
大日本塗料	10,800	846.000	9,136,800
日本ペイントホールディングス	349,000	1,232.000	429,968,000
関西ペイント	72,400	1,834.000	132,781,600
中国塗料	13,900	1,106.000	15,373,400
日本特殊塗料	5,700	956.000	5,449,200
藤倉化成	12,900	431.000	5,559,900
太陽ホールディングス	11,800	2,371.000	27,977,800
D I C	30,200	2,401.000	72,510,200
サカタインクス	17,500	1,057.000	18,497,500
東洋インキS Cホールディングス	14,900	2,073.000	30,887,700
T & K T O K A	7,700	1,086.000	8,362,200
富士フイルムホールディングス	151,500	6,758.000	1,023,837,000
資生堂	165,000	6,542.000	1,079,430,000
ライオン	95,500	1,428.000	136,374,000
高砂香料工業	5,400	2,545.000	13,743,000
マンダム	17,600	1,505.000	26,488,000
ミルボン	11,800	5,630.000	66,434,000
ファンケル	34,700	2,477.000	85,951,900
コーセー	16,100	16,040.000	258,244,000
コタ	7,480	1,569.000	11,736,120
ポーラ・オルビスホールディングス	40,700	1,780.000	72,446,000
ノエビアホールディングス	7,200	5,400.000	38,880,000
新日本製薬	4,900	1,431.000	7,011,900
アクシージア	4,300	1,041.000	4,476,300
エステー	6,900	1,566.000	10,805,400
アグロ カネショウ	3,900	1,796.000	7,004,400
コニシ	13,000	1,873.000	24,349,000
長谷川香料	16,300	3,090.000	50,367,000
小林製薬	23,000	8,200.000	188,600,000
荒川化学工業	8,000	983.000	7,864,000
メック	6,500	2,410.000	15,665,000
日本高純度化学	2,400	2,526.000	6,062,400
タカラバイオ	21,400	1,734.000	37,107,600
J C U	8,800	3,205.000	28,204,000
新田ゼラチン	6,000	823.000	4,938,000
O A Tアグリオ	3,400	1,320.000	4,488,000
デクセリアルズ	22,900	2,562.000	58,669,800

アース製薬	7,200	4,765.000	34,308,000
北興化学工業	10,200	894.000	9,118,800
大成ラミック	3,500	2,864.000	10,024,000
クミアイ化学工業	32,200	868.000	27,949,600
日本農薬	15,600	674.000	10,514,400
アキレス	6,000	1,417.000	8,502,000
有沢製作所	13,200	1,219.000	16,090,800
日東電工	57,100	8,490.000	484,779,000
レック	12,400	836.000	10,366,400
三光合成	11,500	517.000	5,945,500
きもと	21,600	196.000	4,233,600
藤森工業	6,000	3,085.000	18,510,000
前澤化成工業	6,000	1,543.000	9,258,000
未来工業	3,300	1,792.000	5,913,600
J S P	5,800	1,548.000	8,978,400
エフピコ	15,300	3,195.000	48,883,500
天馬	6,600	2,309.000	15,239,400
信越ポリマー	14,400	1,413.000	20,347,200
東リ	20,900	269.000	5,622,100
ニフコ	28,400	3,685.000	104,654,000
バルカー	6,700	3,365.000	22,545,500
ユニ・チャーム	164,700	5,380.000	886,086,000
協和キリン	95,100	3,040.000	289,104,000
武田薬品工業	698,600	4,440.000	3,101,784,000
アステラス製薬	756,500	1,941.000	1,468,366,500
住友ファーマ	58,800	841.000	49,450,800
塩野義製薬	99,600	6,073.000	604,870,800
日本新薬	18,600	5,920.000	110,112,000
中外製薬	247,000	3,312.000	818,064,000
科研製薬	13,400	3,700.000	49,580,000
エーザイ	96,200	7,615.000	732,563,000
ロート製薬	76,600	2,777.000	212,718,200
小野薬品工業	152,400	2,747.500	418,719,000
久光製薬	17,600	3,830.000	67,408,000
持田製薬	9,300	3,410.000	31,713,000
参天製薬	148,400	1,115.000	165,466,000
扶桑薬品工業	3,000	2,020.000	6,060,000
ツムラ	24,800	2,657.000	65,893,600
キッセイ薬品工業	12,200	2,669.000	32,561,800
生化学工業	15,200	816.000	12,403,200
栄研化学	13,000	1,568.000	20,384,000
鳥居薬品	4,200	3,240.000	13,608,000
J C R ファーマ	27,100	1,451.000	39,322,100
東和薬品	12,200	1,911.000	23,314,200
富士製薬工業	6,000	1,234.000	7,404,000
ゼリア新薬工業	11,000	2,347.000	25,817,000
第一三共	687,900	4,719.000	3,246,200,100
杏林製薬	16,700	1,714.000	28,623,800

大幸薬品	16,800	378.000	6,350,400
ダイト	5,700	2,520.000	14,364,000
大塚ホールディングス	180,500	4,412.000	796,366,000
大正製薬ホールディングス	17,900	5,730.000	102,567,000
ペプチドリーム	38,700	1,923.000	74,420,100
あすか製薬ホールディングス	8,500	1,188.000	10,098,000
サワイグループホールディングス	18,100	3,830.000	69,323,000
日本コークス工業	83,300	90.000	7,497,000
ニチレキ	9,600	1,572.000	15,091,200
ユシロ化学工業	8,500	858.000	7,293,000
富士石油	22,100	266.000	5,878,600
出光興産	87,400	2,866.000	250,488,400
E N E O Sホールディングス	1,338,500	470.700	630,031,950
コスモエネルギーホールディングス	31,300	4,360.000	136,468,000
横浜ゴム	44,800	2,704.000	121,139,200
TOYO TIRE	45,100	1,539.000	69,408,900
ブリヂストン	251,900	5,279.000	1,329,780,100
住友ゴム工業	77,600	1,176.000	91,257,600
藤倉コンポジット	5,500	1,001.000	5,505,500
オカモト	4,500	3,950.000	17,775,000
フコク	5,400	1,040.000	5,616,000
ニッタ	7,800	2,980.000	23,244,000
住友理工	16,300	668.000	10,888,400
三ツ星ベルト	11,500	3,830.000	44,045,000
バンドー化学	12,900	1,058.000	13,648,200
日東紡績	9,500	1,890.000	17,955,000
A G C	80,300	4,975.000	399,492,500
日本電気硝子	32,500	2,525.000	82,062,500
オハラ	5,500	1,125.000	6,187,500
住友大阪セメント	11,600	3,620.000	41,992,000
太平洋セメント	50,600	2,405.000	121,693,000
日本ヒューム	9,800	780.000	7,644,000
日本コンクリート工業	22,500	248.000	5,580,000
三谷セキサン	3,600	4,645.000	16,722,000
アジアパイルホールディングス	14,000	707.000	9,898,000
東海カーボン	66,800	1,217.000	81,295,600
日本カーボン	4,900	4,075.000	19,967,500
東洋炭素	5,300	3,965.000	21,014,500
ノリタケカンパニーリミテド	4,200	4,475.000	18,795,000
T O T O	52,100	4,550.000	237,055,000
日本碍子	93,200	1,757.000	163,752,400
日本特殊陶業	60,300	2,725.000	164,317,500
ダントーホールディングス	6,600	576.000	3,801,600
M A R U W A	3,100	17,730.000	54,963,000
品川リフラクトリーズ	2,400	4,605.000	11,052,000
黒崎播磨	1,800	6,420.000	11,556,000
ヨータイ	5,900	1,513.000	8,926,700
東京窯業	5,500	323.000	1,776,500

フジインコーポレーテッド	6,500	6,960.000	45,240,000
ニチアス	21,000	2,608.000	54,768,000
ニチハ	11,000	2,689.000	29,579,000
日本製鉄	363,500	3,003.000	1,091,590,500
神戸製鋼所	163,400	1,035.000	169,119,000
中山製鋼所	17,400	915.000	15,921,000
合同製鐵	4,300	3,275.000	14,082,500
J F Eホールディングス	216,500	1,632.000	353,328,000
東京製鐵	22,900	1,367.000	31,304,300
共英製鋼	9,400	1,601.000	15,049,400
大和工業	13,300	5,280.000	70,224,000
東京鐵鋼	4,400	1,794.000	7,893,600
大阪製鐵	5,300	1,292.000	6,847,600
淀川製鋼所	9,000	2,742.000	24,678,000
中部鋼鈹	7,000	2,157.000	15,099,000
丸一鋼管	24,600	2,895.000	71,217,000
モリ工業	2,100	3,560.000	7,476,000
大同特殊鋼	10,200	5,160.000	52,632,000
日本冶金工業	6,100	4,090.000	24,949,000
山陽特殊製鋼	7,900	2,328.000	18,391,200
愛知製鋼	5,200	2,439.000	12,682,800
大太平洋金属	6,100	1,896.000	11,565,600
新日本電工	54,100	340.000	18,394,000
栗本鐵工所	4,600	1,993.000	9,167,800
三菱製鋼	5,800	1,155.000	6,699,000
日本精線	1,300	4,515.000	5,869,500
新家工業	2,500	2,110.000	5,275,000
大紀アルミニウム工業所	11,700	1,400.000	16,380,000
日本輕金属ホールディングス	22,200	1,443.000	32,034,600
三井金属鈹業	23,500	3,215.000	75,552,500
東邦亜鉛	5,200	1,866.000	9,703,200
三菱マテリアル	54,600	2,219.000	121,157,400
住友金属鈹山	94,300	5,179.000	488,379,700
D O W Aホールディングス	18,300	4,290.000	78,507,000
古河機械金属	12,500	1,307.000	16,337,500
大阪チタニウムテクノロジーズ	12,100	3,210.000	38,841,000
東邦チタニウム	15,000	2,138.000	32,070,000
U A C J	11,500	2,641.000	30,371,500
C Kサンエツ	2,200	4,145.000	9,119,000
古河電氣工業	27,400	2,426.000	66,472,400
住友電氣工業	280,600	1,665.500	467,339,300
フジクラ	87,800	895.000	78,581,000
S W C C	9,500	1,761.000	16,729,500
平河ヒューテック	5,200	1,415.000	7,358,000
リョービ	9,300	1,501.000	13,959,300
アーレスティ	10,100	551.000	5,565,100
アサヒホールディングス	33,200	2,024.000	67,196,800
稲葉製作所	6,800	1,424.000	9,683,200

宮地エンジニアリンググループ	2,500	3,750.000	9,375,000
トーカロ	21,800	1,250.000	27,250,000
アルファ	6,000	965.000	5,790,000
SUMCO	154,500	1,923.000	297,103,500
川田テクノロジーズ	2,300	4,000.000	9,200,000
RS TECHNOLOGIES	5,600	3,255.000	18,228,000
ジェイテックコーポレーション	1,300	2,667.000	3,467,100
信和	9,300	718.000	6,677,400
東洋製罐グループホールディングス	54,000	1,866.000	100,764,000
ホッカンホールディングス	5,800	1,367.000	7,928,600
横河ブリッジホールディングス	10,100	2,140.000	21,614,000
三和ホールディングス	74,500	1,404.000	104,598,000
文化シャッター	23,500	1,090.000	25,615,000
三協立山	10,700	689.000	7,372,300
アルインコ	7,600	1,021.000	7,759,600
LIXIL	118,300	2,137.000	252,807,100
ノーリツ	12,000	1,767.000	21,204,000
長府製作所	8,300	2,269.000	18,832,700
リンナイ	44,100	3,265.000	143,986,500
日東精工	12,800	559.000	7,155,200
岡部	14,100	792.000	11,167,200
ジーテクト	9,300	1,428.000	13,280,400
東ブレ	14,300	1,258.000	17,989,400
高周波熱錬	13,700	698.000	9,562,600
東京製網	5,400	1,118.000	6,037,200
パイオラックス	11,400	1,910.000	21,774,000
エイチワン	9,600	641.000	6,153,600
日本発条	71,800	933.000	66,989,400
立川ブラインド工業	4,500	1,333.000	5,998,500
三益半導体工業	6,200	2,698.000	16,727,600
日本製鋼所	22,100	2,426.000	53,614,600
三浦工業	33,200	3,325.000	110,390,000
タクマ	24,600	1,311.000	32,250,600
ツガミ	17,700	1,337.000	23,664,900
オークマ	7,800	5,800.000	45,240,000
芝浦機械	8,000	3,075.000	24,600,000
アマダ	125,300	1,230.000	154,119,000
アイダエンジニアリング	17,000	832.000	14,144,000
FUJ I	34,200	2,195.000	75,069,000
牧野フライス製作所	8,700	4,665.000	40,585,500
オーエスジー	37,800	1,878.000	70,988,400
旭ダイヤモンド工業	22,600	876.000	19,797,600
D M G 森精機	47,900	2,115.000	101,308,500
ソディック	22,400	744.000	16,665,600
ディスコ	38,400	14,460.000	555,264,000
日東工器	4,400	1,849.000	8,135,600
日進工具	6,800	1,087.000	7,391,600
富士ダイス	4,100	772.000	3,165,200

豊和工業	5,500	883.000	4,856,500
石川製作所	3,600	1,424.000	5,126,400
島精機製作所	12,400	1,840.000	22,816,000
オプトラン	12,100	2,139.000	25,881,900
NCホールディングス	2,200	1,913.000	4,208,600
イワキ	6,300	1,267.000	7,982,100
フリー	8,900	1,145.000	10,190,500
ヤマシンフィルタ	21,800	332.000	7,237,600
日阪製作所	8,800	882.000	7,761,600
やまびこ	13,300	1,310.000	17,423,000
野村マイクロ・サイエンス	2,700	3,925.000	10,597,500
平田機工	3,800	6,690.000	25,422,000
PEGASUS	10,400	615.000	6,396,000
マルマエ	4,300	1,571.000	6,755,300
タツモ	4,700	1,896.000	8,911,200
ナプテスコ	49,900	3,110.000	155,189,000
三井海洋開発	10,300	1,397.000	14,389,100
レオン自動機	8,800	1,244.000	10,947,200
SMC	25,800	69,360.000	1,789,488,000
ホソカワミクロン	6,100	2,933.000	17,891,300
ユニオンツール	3,400	3,205.000	10,897,000
オイレス工業	10,900	1,675.000	18,257,500
日精エー・エス・ビー機械	3,700	4,115.000	15,225,500
サトーホールディングス	11,300	2,225.000	25,142,500
技研製作所	8,300	2,227.000	18,484,100
日本エアテック	5,100	1,083.000	5,523,300
日精樹脂工業	6,900	980.000	6,762,000
ワイエイシイホールディングス	3,200	2,579.000	8,252,800
小松製作所	372,400	3,243.000	1,207,693,200
住友重機械工業	46,600	3,165.000	147,489,000
日立建機	31,500	3,090.000	97,335,000
日工	13,700	635.000	8,699,500
巴工業	4,000	2,423.000	9,692,000
井関農機	8,400	1,183.000	9,937,200
TOWA	8,100	2,022.000	16,378,200
ローツェ	4,100	9,190.000	37,679,000
クボタ	420,600	1,940.500	816,174,300
荏原実業	4,100	2,908.000	11,922,800
三菱化工機	2,900	2,404.000	6,971,600
月島ホールディングス	11,500	1,087.000	12,500,500
帝国電機製作所	5,900	2,375.000	14,012,500
新東工業	16,900	895.000	15,125,500
澁谷工業	7,300	2,468.000	18,016,400
アイチコーポレーション	11,900	789.000	9,389,100
小森コーポレーション	19,200	946.000	18,163,200
鶴見製作所	6,600	2,116.000	13,965,600
酒井重工業	1,500	4,040.000	6,060,000
荏原製作所	32,400	5,980.000	193,752,000

西島製作所	7,600	1,544.000	11,734,400
北越工業	8,700	1,335.000	11,614,500
ダイキン工業	94,900	22,765.000	2,160,398,500
オルガノ	10,900	3,340.000	36,406,000
トーヨーカネツ	3,400	2,640.000	8,976,000
栗田工業	44,400	6,120.000	271,728,000
椿本チエイン	10,900	3,210.000	34,989,000
大同工業	6,700	755.000	5,058,500
木村化工機	8,700	698.000	6,072,600
アネスト岩田	14,100	1,000.000	14,100,000
ダイフク	122,700	2,426.000	297,670,200
サムコ	2,700	4,745.000	12,811,500
加藤製作所	4,800	1,163.000	5,582,400
タダノ	42,000	1,046.000	43,932,000
フジテック	28,000	3,410.000	95,480,000
C K D	21,700	2,061.000	44,723,700
平和	26,900	2,610.000	70,209,000
理想科学工業	7,300	2,274.000	16,600,200
S A N K Y O	15,800	5,570.000	88,006,000
日本金銭機械	9,600	1,414.000	13,574,400
マースグループホールディングス	5,000	3,050.000	15,250,000
フクシマガリレイ	5,900	4,760.000	28,084,000
ダイコク電機	4,700	3,195.000	15,016,500
竹内製作所	14,400	3,395.000	48,888,000
アマノ	22,700	2,547.000	57,816,900
J U K I	13,700	612.000	8,384,400
ジャノメ	9,400	622.000	5,846,800
マックス	9,700	2,091.000	20,282,700
グローリー	19,400	2,844.000	55,173,600
新晃工業	8,400	1,695.000	14,238,000
大和冷機工業	12,300	1,380.000	16,974,000
セガサミーホールディングス	64,200	2,615.000	167,883,000
リケン	3,500	2,607.000	9,124,500
T P R	9,200	1,333.000	12,263,600
ツバキ・ナカシマ	20,300	954.000	19,366,200
ホシザキ	51,200	4,635.000	237,312,000
大豊工業	8,300	638.000	5,295,400
日本精工	145,100	751.000	108,970,100
N T N	157,500	329.000	51,817,500
ジェイテクト	70,200	1,011.000	70,972,200
不二越	5,800	3,815.000	22,127,000
日本トムソン	20,600	575.000	11,845,000
T H K	45,700	3,000.000	137,100,000
ユーシン精機	7,700	759.000	5,844,300
前澤給装工業	6,800	985.000	6,698,000
イーグル工業	9,000	1,209.000	10,881,000
前澤工業	8,400	676.000	5,678,400
日本ピラー工業	7,300	3,600.000	26,280,000

キット	29,800	897.000	26,730,600
マキタ	99,000	3,225.000	319,275,000
日立造船	65,700	856.000	56,239,200
三菱重工業	139,200	5,088.000	708,249,600
I H I	50,100	3,330.000	166,833,000
スター精密	14,800	1,749.000	25,885,200
日清紡ホールディングス	65,400	1,004.000	65,661,600
イビデン	45,700	5,160.000	235,812,000
コニカミノルタ	178,400	542.000	96,692,800
ブラザー工業	106,100	2,038.000	216,231,800
ミネベアミツミ	137,800	2,408.000	331,822,400
日立製作所	386,600	7,305.000	2,824,113,000
東芝	153,400	4,427.000	679,101,800
三菱電機	821,900	1,559.500	1,281,753,050
富士電機	48,200	5,080.000	244,856,000
東洋電機製造	6,800	937.000	6,371,600
安川電機	94,200	5,620.000	529,404,000
シンフォニア テクノロジー	9,100	1,584.000	14,414,400
明電舎	12,500	1,800.000	22,500,000
オリジン	3,700	1,250.000	4,625,000
山洋電気	3,600	6,120.000	22,032,000
デンヨー	6,800	1,723.000	11,716,400
PHCホールディングス	11,300	1,465.000	16,554,500
ソシオネクスト	8,200	9,590.000	78,638,000
東芝テック	12,100	3,880.000	46,948,000
芝浦メカトロニクス	1,500	15,450.000	23,175,000
マブチモーター	19,700	3,860.000	76,042,000
ニデック	193,500	6,715.000	1,299,352,500
トレックス・セミコンダクター	4,100	2,371.000	9,721,100
東光高岳	5,100	2,296.000	11,709,600
ダブル・スコープ	26,400	1,228.000	32,419,200
ダイヘン	7,200	4,350.000	31,320,000
ヤーマン	14,500	1,202.000	17,429,000
JVCケンウッド	75,400	383.000	28,878,200
ミマキエンジニアリング	9,000	649.000	5,841,000
I - P E X	5,300	1,394.000	7,388,200
大崎電気工業	22,500	540.000	12,150,000
オムロン	72,800	7,552.000	549,785,600
日東工業	11,000	2,577.000	28,347,000
I D E C	12,000	3,260.000	39,120,000
ジーエス・ユアサ コーポレーション	26,300	2,255.000	59,306,500
メルコホールディングス	2,400	3,180.000	7,632,000
日本電気	112,500	5,120.000	576,000,000
富士通	79,200	17,595.000	1,393,524,000
沖電気工業	37,900	711.000	26,946,900
電気興業	3,800	2,247.000	8,538,600
サンケン電気	7,400	10,610.000	78,514,000
アイホン	5,400	2,048.000	11,059,200

ルネサスエレクトロニクス	519,000	1,825.000	947,175,000
セイコーエプソン	105,800	1,942.000	205,463,600
ワコム	60,900	662.000	40,315,800
アルバック	18,900	5,570.000	105,273,000
アクセル	3,200	1,591.000	5,091,200
E I Z O	6,000	4,260.000	25,560,000
日本信号	18,900	1,088.000	20,563,200
京三製作所	20,700	418.000	8,652,600
能美防災	11,200	1,675.000	18,760,000
ホーチキ	6,800	1,559.000	10,601,200
エレコム	19,500	1,248.000	24,336,000
パナソニック ホールディングス	939,700	1,235.500	1,160,999,350
シャープ	96,400	958.000	92,351,200
アンリツ	57,000	1,226.000	69,882,000
富士通ゼネラル	22,700	3,880.000	88,076,000
ソニーグループ	556,900	11,900.000	6,627,110,000
T D K	125,900	4,585.000	577,251,500
帝国通信工業	4,500	1,529.000	6,880,500
タムラ製作所	35,200	802.000	28,230,400
アルプスアルパイン	71,600	1,249.000	89,428,400
日本電波工業	10,200	1,205.000	12,291,000
鈴木	5,500	996.000	5,478,000
メイコー	8,800	2,788.000	24,534,400
日本トリム	2,200	2,864.000	6,300,800
ローランド ディー . ジー .	4,600	3,305.000	15,203,000
フォスター電機	8,400	1,216.000	10,214,400
S M K	2,500	2,560.000	6,400,000
ヨコオ	6,800	2,011.000	13,674,800
ホシデン	19,100	1,627.000	31,075,700
ヒロセ電機	13,200	17,140.000	226,248,000
日本航空電子工業	16,400	2,238.000	36,703,200
T O A	10,900	824.000	8,981,600
マクセル	17,800	1,489.000	26,504,200
古野電気	11,700	953.000	11,150,100
スミダコーポレーション	7,800	1,634.000	12,745,200
アイコム	3,700	2,640.000	9,768,000
リオン	3,800	1,948.000	7,402,400
横河電機	87,000	2,164.000	188,268,000
新電元工業	3,300	3,365.000	11,104,500
アズビル	55,100	3,555.000	195,880,500
東亜ディーケーケー	7,900	810.000	6,399,000
日本光電工業	36,700	3,640.000	133,588,000
チノー	4,000	2,169.000	8,676,000
日本電子材料	6,300	1,457.000	9,179,100
堀場製作所	17,600	7,460.000	131,296,000
アドバンテスト	62,000	11,560.000	716,720,000
エスベック	6,700	2,013.000	13,487,100
キーエンス	78,800	61,750.000	4,865,900,000

日置電機	4,200	8,800.000	36,960,000
シスメックス	68,000	8,739.000	594,252,000
日本マイクロニクス	13,200	1,303.000	17,199,600
メガチップス	6,600	3,350.000	22,110,000
O B A R A G R O U P	4,300	3,905.000	16,791,500
コーセル	10,600	1,076.000	11,405,600
イリソ電子工業	7,400	4,725.000	34,965,000
オブテックスグループ	14,700	1,960.000	28,812,000
千代田インテグレ	4,100	2,234.000	9,159,400
レーザーテック	36,100	21,740.000	784,814,000
スタンレー電気	55,900	2,890.000	161,551,000
ウシオ電機	40,300	1,642.000	66,172,600
ヘリオス テクノ ホールディング	11,900	561.000	6,675,900
エノモト	2,500	1,695.000	4,237,500
日本セラミック	8,200	2,589.000	21,229,800
古河電池	6,600	1,086.000	7,167,600
山一電機	7,300	1,856.000	13,548,800
図研	7,100	3,470.000	24,637,000
日本電子	19,800	4,245.000	84,051,000
カシオ計算機	59,000	1,283.000	75,697,000
ファナック	386,500	4,567.000	1,765,145,500
日本シイエムケイ	19,800	448.000	8,870,400
エンブラス	2,500	4,620.000	11,550,000
大真空	10,800	695.000	7,506,000
ローム	36,400	10,460.000	380,744,000
浜松ホトニクス	63,000	7,080.000	446,040,000
三井ハイテック	8,100	8,620.000	69,822,000
新光電気工業	27,900	4,040.000	112,716,000
京セラ	122,400	6,936.000	848,966,400
太陽誘電	38,300	4,360.000	166,988,000
村田製作所	238,600	7,782.000	1,856,785,200
双葉電子工業	18,700	521.000	9,742,700
北陸電気工業	3,000	1,263.000	3,789,000
ニチコン	16,400	1,301.000	21,336,400
日本ケミコン	8,100	2,048.000	16,588,800
K O A	12,300	1,745.000	21,463,500
市光工業	13,000	490.000	6,370,000
小糸製作所	94,300	2,447.000	230,752,100
ミツバ	16,200	568.000	9,201,600
S C R E E Nホールディングス	13,500	11,080.000	149,580,000
キャノン電子	9,200	1,856.000	17,075,200
キャノン	432,200	2,932.000	1,267,210,400
リコー	197,900	1,015.000	200,868,500
象印マホービン	23,900	1,662.000	39,721,800
東京エレクトロン	166,500	15,695.000	2,613,217,500
イノテック	6,200	1,362.000	8,444,400
トヨタ紡織	33,000	2,089.000	68,937,000
ユニプレス	15,100	890.000	13,439,000

豊田自動織機	57,500	7,250.000	416,875,000
モリタホールディングス	14,700	1,322.000	19,433,400
三櫻工業	12,500	663.000	8,287,500
デンソー	162,200	7,401.000	1,200,442,200
東海理化電機製作所	21,800	1,589.000	34,640,200
川崎重工業	59,500	2,880.000	171,360,000
日本車輛製造	3,900	2,040.000	7,956,000
三菱ロジスネクスト	14,000	905.000	12,670,000
日産自動車	1,118,500	495.000	553,657,500
いすゞ自動車	228,100	1,535.000	350,133,500
トヨタ自動車	4,322,700	1,812.500	7,834,893,750
日野自動車	102,100	550.000	56,155,000
三菱自動車工業	308,600	504.000	155,534,400
武蔵精密工業	19,200	1,797.000	34,502,400
日産車体	14,800	871.000	12,890,800
新明和工業	25,400	1,142.000	29,006,800
極東開発工業	14,100	1,620.000	22,842,000
トピー工業	7,100	1,905.000	13,525,500
ティラド	2,500	2,329.000	5,822,500
曙ブレーキ工業	56,900	147.000	8,364,300
タチエス	13,200	1,165.000	15,378,000
N O K	30,900	1,522.000	47,029,800
フタバ産業	23,000	423.000	9,729,000
K Y B	7,500	4,095.000	30,712,500
大同メタル工業	19,500	510.000	9,945,000
プレス工業	35,400	520.000	18,408,000
ミクニ	14,000	328.000	4,592,000
太平洋工業	18,200	1,111.000	20,220,200
アイシン	60,400	3,675.000	221,970,000
マツダ	260,500	1,173.000	305,566,500
今仙電機製作所	6,300	714.000	4,498,200
本田技研工業	639,800	3,525.000	2,255,295,000
スズキ	144,600	4,668.000	674,992,800
S U B A R U	249,500	2,099.500	523,825,250
安永	3,600	1,107.000	3,985,200
ヤマハ発動機	123,400	3,385.000	417,709,000
エクセディ	13,000	1,836.000	23,868,000
豊田合成	22,800	2,208.000	50,342,400
愛三工業	13,800	859.000	11,854,200
日本プラスト	14,400	415.000	5,976,000
ヨロズ	8,700	884.000	7,690,800
エフ・シー・シー	13,700	1,567.000	21,467,900
シマノ	32,200	23,515.000	757,183,000
テイ・エス テック	35,900	1,643.000	58,983,700
ジャムコ	4,400	1,442.000	6,344,800
テルモ	242,100	3,813.000	923,127,300
日機装	18,800	948.000	17,822,400
日本エム・ディ・エム	5,500	1,001.000	5,505,500

島津製作所	95,600	4,155.000	397,218,000
長野計器	6,100	1,284.000	7,832,400
ブイ・テクノロジー	4,100	3,000.000	12,300,000
東京計器	7,100	1,211.000	8,598,100
愛知時計電機	3,900	1,481.000	5,775,900
インターアクション	4,100	1,374.000	5,633,400
オーバル	8,300	459.000	3,809,700
東京精密	17,200	5,020.000	86,344,000
マニー	35,000	1,762.000	61,670,000
ニコン	122,500	1,298.000	159,005,000
トプコン	41,300	1,860.000	76,818,000
オリンパス	492,200	2,443.500	1,202,690,700
理研計器	4,900	5,200.000	25,480,000
タムロン	5,900	3,025.000	17,847,500
HOYA	168,100	14,330.000	2,408,873,000
ノーリツ鋼機	7,700	2,197.000	16,916,900
A & D ホロンホールディングス	11,400	1,369.000	15,606,600
朝日インテック	88,000	2,384.000	209,792,000
シチズン時計	87,000	782.000	68,034,000
リズム	2,700	2,039.000	5,505,300
メニコン	27,300	2,791.000	76,194,300
松風	4,000	2,072.000	8,288,000
セイコーグループ	12,400	2,845.000	35,278,000
ニプロ	66,700	1,011.000	67,433,700
スノーピーク	13,800	2,022.000	27,903,600
パラマウントベッドホールディングス	18,200	2,344.000	42,660,800
トランザクション	6,500	1,605.000	10,432,500
ニホンフラッシュ	8,000	978.000	7,824,000
前田工織	6,800	3,300.000	22,440,000
永大産業	24,100	224.000	5,398,400
アートネイチャー	9,200	776.000	7,139,200
バンダイナムコホールディングス	215,400	2,928.500	630,798,900
SHOEI	16,600	2,604.000	43,226,400
フランスベッドホールディングス	10,500	1,046.000	10,983,000
パイロットコーポレーション	12,400	4,285.000	53,134,000
萩原工業	6,300	1,288.000	8,114,400
フジシールインターナショナル	16,000	1,475.000	23,600,000
タカラトミー	36,300	1,428.000	51,836,400
広済堂ホールディングス	5,000	2,956.000	14,780,000
プロネクサス	7,100	979.000	6,950,900
ウッドワン	3,200	1,264.000	4,044,800
大建工業	5,000	2,269.000	11,345,000
凸版印刷	102,700	2,729.000	280,268,300
大日本印刷	93,500	3,770.000	352,495,000
共同印刷	2,800	2,813.000	7,876,400
NISSHA	15,000	1,827.000	27,405,000
TAKARA & COMPANY	5,600	2,370.000	13,272,000
アシックス	72,700	3,820.000	277,714,000

ツツミ	2,200	2,210.000	4,862,000
ローランド	6,000	3,990.000	23,940,000
小松ウオール工業	3,100	1,999.000	6,196,900
ヤマハ	49,300	5,230.000	257,839,000
河合楽器製作所	2,200	3,075.000	6,765,000
クリナップ	9,700	716.000	6,945,200
ビジョン	50,600	2,047.000	103,578,200
キングジム	8,000	910.000	7,280,000
リンテック	15,400	2,180.000	33,572,000
イトーキ	17,100	766.000	13,098,600
任天堂	497,100	5,379.000	2,673,900,900
三菱鉛筆	11,100	1,668.000	18,514,800
タカラスタANDARD	15,000	1,519.000	22,785,000
コクヨ	37,800	1,824.000	68,947,200
グローブライド	6,300	2,450.000	15,435,000
オカムラ	23,600	1,354.000	31,954,400
美津濃	7,900	3,225.000	25,477,500
東京電力ホールディングス	710,600	489.000	347,483,400
中部電力	289,100	1,423.000	411,389,300
関西電力	303,300	1,309.000	397,019,700
中国電力	125,900	682.000	85,863,800
北陸電力	75,300	621.000	46,761,300
東北電力	193,100	673.000	129,956,300
四国電力	67,300	770.000	51,821,000
九州電力	180,100	772.000	139,037,200
北海道電力	75,900	503.000	38,177,700
沖縄電力	19,400	1,087.000	21,087,800
電源開発	59,400	2,148.000	127,591,200
エフオン	6,200	626.000	3,881,200
イーレックス	14,100	1,792.000	25,267,200
レノバ	21,200	1,967.000	41,700,400
東京瓦斯	166,500	2,496.000	415,584,000
大阪瓦斯	159,300	2,190.000	348,867,000
東邦瓦斯	31,000	2,472.000	76,632,000
北海道瓦斯	5,100	1,905.000	9,715,500
広島ガス	18,900	352.000	6,652,800
西部ガスホールディングス	7,200	1,799.000	12,952,800
静岡ガス	17,800	1,127.000	20,060,600
メタウォーター	9,700	1,782.000	17,285,400
SBSホールディングス	7,000	3,210.000	22,470,000
東武鉄道	86,100	3,315.000	285,421,500
相鉄ホールディングス	26,100	2,291.000	59,795,100
東急	219,900	1,806.000	397,139,400
京浜急行電鉄	89,500	1,281.000	114,649,500
小田急電鉄	118,900	1,842.000	219,013,800
京王電鉄	41,600	4,870.000	202,592,000
京成電鉄	50,600	4,505.000	227,953,000
富士急行	9,800	4,960.000	48,608,000

東日本旅客鉄道	133,600	7,485.000	999,996,000
西日本旅客鉄道	100,800	5,650.000	569,520,000
東海旅客鉄道	60,700	16,090.000	976,663,000
西武ホールディングス	95,500	1,463.000	139,716,500
鴻池運輸	13,600	1,518.000	20,644,800
西日本鉄道	20,800	2,413.000	50,190,400
ハマキョウレックス	6,100	3,280.000	20,008,000
サカイ引越センター	3,800	4,555.000	17,309,000
近鉄グループホールディングス	78,400	4,390.000	344,176,000
阪急阪神ホールディングス	104,300	4,075.000	425,022,500
南海電気鉄道	37,600	2,973.000	111,784,800
京阪ホールディングス	32,600	3,665.000	119,479,000
神戸電鉄	2,800	3,180.000	8,904,000
名古屋鉄道	86,800	2,092.000	181,585,600
山陽電気鉄道	6,600	2,272.000	14,995,200
アルプス物流	6,400	1,262.000	8,076,800
ヤマトホールディングス	100,700	2,290.000	230,603,000
山九	20,000	4,645.000	92,900,000
丸全昭和運輸	4,900	3,275.000	16,047,500
センコーグループホールディングス	41,200	933.000	38,439,600
トナミホールディングス	1,900	4,275.000	8,122,500
ニッコンホールディングス	24,800	2,461.000	61,032,800
福山通運	6,100	3,450.000	21,045,000
セイノーホールディングス	48,900	1,425.000	69,682,500
神奈川中央交通	2,700	3,225.000	8,707,500
A Z - C O M丸和ホールディングス	19,300	1,869.000	36,071,700
C & F ロジホールディングス	7,900	1,250.000	9,875,000
九州旅客鉄道	55,700	2,988.000	166,431,600
S Gホールディングス	150,700	1,927.000	290,398,900
N I P P O N E X P R E S Sホールディングス	29,200	7,780.000	227,176,000
日本郵船	209,800	3,414.000	716,257,200
商船三井	137,900	3,525.000	486,097,500
川崎汽船	66,900	3,375.000	225,787,500
N S ユナイテッド海運	4,300	4,520.000	19,436,000
明治海運	9,400	633.000	5,950,200
飯野海運	29,600	1,074.000	31,790,400
乾汽船	10,800	1,794.000	19,375,200
日本航空	192,800	2,508.000	483,542,400
A N Aホールディングス	214,800	2,781.500	597,466,200
トランコム	2,400	7,120.000	17,088,000
日新	6,300	2,068.000	13,028,400
三菱倉庫	16,700	3,180.000	53,106,000
三井倉庫ホールディングス	7,300	3,895.000	28,433,500
住友倉庫	21,000	2,205.000	46,305,000
滋澤倉庫	3,200	2,190.000	7,008,000
東陽倉庫	19,100	275.000	5,252,500
日本トランスシティ	15,800	637.000	10,064,600

川西倉庫	5,800	999.000	5,794,200
安田倉庫	6,600	1,021.000	6,738,600
上組	37,300	2,746.000	102,425,800
キムラユニティー	4,000	999.000	3,996,000
キューソー流通システム	7,100	986.000	7,000,600
エーアイテイー	5,300	1,630.000	8,639,000
内外トランスライン	3,100	2,498.000	7,743,800
日本コンセプト	3,000	1,649.000	4,947,000
NEC ネットズエスアイ	26,400	1,625.000	42,900,000
クロスキャット	5,200	1,252.000	6,510,400
システナ	133,100	286.000	38,066,600
デジタルアーツ	5,100	5,250.000	26,775,000
日鉄ソリューションズ	13,300	3,615.000	48,079,500
キューブシステム	5,600	1,144.000	6,406,400
コア	3,700	1,600.000	5,920,000
手間いらず	1,400	4,700.000	6,580,000
ラクーンホールディングス	7,700	781.000	6,013,700
ソリトンシステムズ	4,800	1,084.000	5,203,200
ソフトクリエイティブホールディングス	7,000	1,726.000	12,082,000
T I S	86,200	3,635.000	313,337,000
グリー	22,400	687.000	15,388,800
コーエーテックホールディングス	49,600	2,321.000	115,121,600
三菱総合研究所	3,900	4,880.000	19,032,000
ファインデックス	7,500	649.000	4,867,500
ブレインパッド	6,600	696.000	4,593,600
K L a b	18,700	372.000	6,956,400
ポルトゥウィンホールディングス	14,300	870.000	12,441,000
ネクソン	204,500	3,125.000	639,062,500
アイスタイル	24,000	551.000	13,224,000
エムアップホールディングス	10,200	1,210.000	12,342,000
エイチーム	7,200	674.000	4,852,800
エニグモ	11,700	460.000	5,382,000
コロプラ	30,800	631.000	19,434,800
ブロードリーフ	48,400	415.000	20,086,000
クロス・マーケティンググループ	5,400	675.000	3,645,000
デジタルハーツホールディングス	5,400	1,450.000	7,830,000
システム情報	7,800	809.000	6,310,200
メディアドゥ	3,700	1,425.000	5,272,500
じげん	24,400	481.000	11,736,400
ブイキューブ	11,300	512.000	5,785,600
フィックスターズ	9,500	1,484.000	14,098,000
C A R T A H O L D I N G S	4,300	1,383.000	5,946,900
オブティム	7,000	924.000	6,468,000
セレス	3,600	1,373.000	4,942,800
S H I F T	5,800	26,640.000	154,512,000
ティーガイア	8,900	1,688.000	15,023,200
テクマトリックス	14,800	1,536.000	22,732,800
プロシップ	4,100	1,345.000	5,514,500

ガンホー・オンライン・エンターテイメント	24,500	2,463.000	60,343,500
GMOペイメントゲートウェイ	18,100	10,900.000	197,290,000
システムリサーチ	2,800	2,233.000	6,252,400
インターネットイニシアティブ	44,100	2,736.000	120,657,600
さくらインターネット	10,300	619.000	6,375,700
ヴィンクス	3,400	1,375.000	4,675,000
GMOグローバルサイン・ホールディングス	2,500	3,970.000	9,925,000
SRAホールディングス	4,300	2,953.000	12,697,900
朝日ネット	9,400	583.000	5,480,200
eBASE	11,800	671.000	7,917,800
アバントグループ	10,200	1,416.000	14,443,200
アドソル日進	3,700	1,728.000	6,393,600
フリービット	4,700	1,480.000	6,956,000
コムチュア	10,700	2,024.000	21,656,800
アステリア	7,200	725.000	5,220,000
アイル	4,600	2,475.000	11,385,000
マークラインズ	4,700	2,431.000	11,425,700
メディカル・データ・ビジョン	12,600	869.000	10,949,400
gumi	12,800	721.000	9,228,800
テラスカイ	4,000	1,794.000	7,176,000
デジタル・インフォメーション・テクノロ ジー	5,000	1,643.000	8,215,000
PR TIMES	2,400	1,895.000	4,548,000
ラクス	37,500	1,981.000	74,287,500
ダブルスタンダード	3,600	2,023.000	7,282,800
オーブンドア	6,000	1,545.000	9,270,000
アカツキ	4,100	2,230.000	9,143,000
UBICOMホールディングス	2,900	2,211.000	6,411,900
カナミックネットワーク	14,300	480.000	6,864,000
チェンジホールディングス	19,500	2,465.000	48,067,500
オークネット	4,600	1,510.000	6,946,000
マクロミル	16,300	912.000	14,865,600
オロ	2,700	2,520.000	6,804,000
ユーザーローカル	3,100	2,208.000	6,844,800
マネーフォワード	19,200	4,930.000	94,656,000
SUN ASTERISK	4,800	1,009.000	4,843,200
電算システムホールディングス	4,200	2,593.000	10,890,600
APPIER GROUP	22,700	1,561.000	35,434,700
プロトコーポレーション	10,300	1,188.000	12,236,400
野村総合研究所	162,100	3,195.000	517,909,500
サイバネットシステム	8,800	844.000	7,427,200
日本システム技術	3,500	1,956.000	6,846,000
インテージホールディングス	9,300	1,527.000	14,201,100
ソースネクスト	34,100	211.000	7,195,100
インフォコム	10,200	2,356.000	24,031,200
シンプレクス・ホールディングス	13,600	2,417.000	32,871,200
HEROZ	3,000	1,200.000	3,600,000
ラクスル	22,800	1,331.000	30,346,800

メルカリ	35,900	2,203.000	79,087,700
I P S	2,800	2,463.000	6,896,400
システムサポート	3,500	1,958.000	6,853,000
イーソル	5,900	914.000	5,392,600
アルテリア・ネットワークス	8,200	1,266.000	10,381,200
ウイングアーク1 s t	8,500	1,939.000	16,481,500
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	2,600	1,525.000	3,965,000
サーバーワークス	1,900	2,423.000	4,603,700
S a n s a n	26,200	1,546.000	40,505,200
ギフトィ	8,800	2,119.000	18,647,200
メドレー	8,000	3,900.000	31,200,000
ベース	2,700	6,110.000	16,497,000
J M D C	13,100	4,975.000	65,172,500
フォーカスシステムズ	6,800	1,005.000	6,834,000
クレスコ	6,300	1,771.000	11,157,300
フジ・メディア・ホールディングス	76,300	1,196.000	91,254,800
オービック	26,300	21,350.000	561,505,000
ジャストシステム	11,400	3,570.000	40,698,000
T D C ソフト	7,100	1,465.000	10,401,500
Zホールディングス	1,125,700	375.700	422,925,490
トレンドマイクロ	45,700	6,580.000	300,706,000
I Dホールディングス	3,500	1,010.000	3,535,000
日本オラクル	15,300	9,150.000	139,995,000
アルファシステムズ	2,600	4,010.000	10,426,000
フューチャー	19,700	1,833.000	36,110,100
C A C H O L D I N G S	5,300	1,690.000	8,957,000
S Bテクノロジー	3,700	2,066.000	7,644,200
オービックビジネスコンサルタント	15,600	4,880.000	76,128,000
伊藤忠テクノソリューションズ	42,300	3,330.000	140,859,000
アイティフォー	10,900	857.000	9,341,300
東計電算	1,400	6,370.000	8,918,000
大塚商会	44,800	4,795.000	214,816,000
サイボウズ	11,100	2,712.000	30,103,200
電通国際情報サービス	9,600	5,080.000	48,768,000
A C C E S S	10,400	846.000	8,798,400
デジタルガレージ	14,200	4,515.000	64,113,000
イーエムシステムズ	14,100	791.000	11,153,100
ウェザーニューズ	2,500	6,900.000	17,250,000
C I J	14,400	534.000	7,689,600
ビジネスエンジニアリング	1,800	3,220.000	5,796,000
WOWOW	5,700	1,248.000	7,113,600
スカラ	8,700	752.000	6,542,400
I M A G I C A G R O U P	8,000	600.000	4,800,000
ネットワンシステムズ	29,600	3,140.000	92,944,000
アルゴグラフィックス	7,300	3,770.000	27,521,000
マーベラス	14,000	668.000	9,352,000
エイベックス	14,100	1,494.000	21,065,400

B I P R O G Y	29,200	3,185.000	93,002,000
都築電気	4,700	1,555.000	7,308,500
T B S ホールディングス	40,600	1,942.000	78,845,200
日本テレビホールディングス	70,200	1,150.000	80,730,000
朝日放送グループホールディングス	10,000	657.000	6,570,000
テレビ朝日ホールディングス	19,100	1,507.000	28,783,700
スカパーJ S A Tホールディングス	71,300	527.000	37,575,100
テレビ東京ホールディングス	6,000	2,515.000	15,090,000
日本BS放送	3,700	892.000	3,300,400
ビジョン	10,700	1,640.000	17,548,000
U S E N - N E X T H O L D I N G S	7,200	2,796.000	20,131,200
日本通信	76,300	254.000	19,380,200
日本電信電話	1,011,800	3,980.000	4,026,964,000
K D D I	610,300	4,047.000	2,469,884,100
ソフトバンク	1,268,700	1,512.000	1,918,274,400
光通信	9,300	17,860.000	166,098,000
エムティーアイ	9,300	526.000	4,891,800
G M O インターネットグループ	29,400	2,657.000	78,115,800
ファイバーゲート	5,100	1,097.000	5,594,700
K A D O K A W A	41,800	2,863.000	119,673,400
学研ホールディングス	14,400	865.000	12,456,000
ゼンリン	13,800	811.000	11,191,800
アイネット	5,700	1,308.000	7,455,600
松竹	4,600	12,060.000	55,476,000
東宝	49,300	5,270.000	259,811,000
東映	2,200	17,290.000	38,038,000
エヌ・ティ・ティ・データ	247,200	1,798.000	444,465,600
ピー・シー・エー	5,200	1,219.000	6,338,800
ビジネスブレイン太田昭和	3,900	2,091.000	8,154,900
D T S	16,500	3,210.000	52,965,000
スクウェア・エニックス・ホールディングス	39,700	6,330.000	251,301,000
シーイーシー	11,500	1,309.000	15,053,500
カプコン	78,500	4,740.000	372,090,000
アイ・エス・ビー	4,500	1,178.000	5,301,000
ジャステック	5,500	1,231.000	6,770,500
S C S K	64,100	1,993.000	127,751,300
N S W	3,200	2,088.000	6,681,600
アイネス	6,300	1,330.000	8,379,000
T K C	13,800	3,605.000	49,749,000
富士ソフト	8,900	7,690.000	68,441,000
N S D	27,800	2,386.000	66,330,800
コナミグループ	33,800	6,430.000	217,334,000
福井コンピュータホールディングス	5,600	2,650.000	14,840,000
J B C C ホールディングス	6,000	2,121.000	12,726,000
ミロク情報サービス	7,700	1,678.000	12,920,600
ソフトバンクグループ	456,600	5,128.000	2,341,444,800
高千穂交易	3,000	2,377.000	7,131,000
伊藤忠食品	2,100	5,180.000	10,878,000

エレマテック	7,800	1,735.000	13,533,000
あらた	6,500	4,065.000	26,422,500
トーメンデバイス	1,300	6,430.000	8,359,000
東京エレクトロン デバイス	3,100	8,260.000	25,606,000
円谷フィールズホールディングス	14,600	2,007.000	29,302,200
双日	88,300	2,852.000	251,831,600
アルフレッサ ホールディングス	84,200	1,842.000	155,096,400
横浜冷凍	24,800	1,010.000	25,048,000
ラサ商事	4,800	1,419.000	6,811,200
アルコニックス	11,900	1,358.000	16,160,200
神戸物産	64,600	3,715.000	239,989,000
あい ホールディングス	13,200	2,292.000	30,254,400
ダイワボウホールディングス	34,200	2,408.000	82,353,600
マクニカホールディングス	20,300	3,615.000	73,384,500
ラクト・ジャパン	3,800	2,014.000	7,653,200
グリムス	3,700	2,402.000	8,887,400
バイタルケーエスケー・ホールディングス	13,900	940.000	13,066,000
八洲電機	7,900	1,233.000	9,740,700
メディアスホールディングス	7,000	820.000	5,740,000
レスターホールディングス	8,000	2,122.000	16,976,000
ジューテックホールディングス	2,500	1,144.000	2,860,000
大光	9,500	602.000	5,719,000
T O K A Iホールディングス	42,300	862.000	36,462,600
三洋貿易	9,100	1,255.000	11,420,500
ビューティガレージ	1,500	3,920.000	5,880,000
ウイン・パートナーズ	6,700	1,007.000	6,746,900
ミタチ産業	3,200	1,323.000	4,233,600
シップヘルスケアホールディングス	30,300	2,419.000	73,295,700
コメダホールディングス	21,200	2,685.000	56,922,000
フルサト・マルカホールディングス	8,400	2,620.000	22,008,000
ヤマエグループホールディングス	5,300	1,888.000	10,006,400
小野建	8,400	1,481.000	12,440,400
南陽	2,400	2,204.000	5,289,600
佐鳥電機	5,400	1,655.000	8,937,000
伯東	4,800	4,560.000	21,888,000
コンドーテック	7,600	1,000.000	7,600,000
ナガイレーベン	11,000	2,069.000	22,759,000
三菱食品	8,500	3,230.000	27,455,000
松田産業	6,500	2,216.000	14,404,000
第一興商	32,600	2,303.000	75,077,800
メディバルホールディングス	80,100	1,951.000	156,275,100
S P K	4,500	1,727.000	7,771,500
萩原電気ホールディングス	3,500	3,315.000	11,602,500
アズワン	12,000	5,630.000	67,560,000
スズデン	3,900	2,440.000	9,516,000
尾家産業	4,700	1,077.000	5,061,900
シモジマ	7,000	1,027.000	7,189,000
ドウシシャ	8,900	2,017.000	17,951,300

高速	4,600	2,051.000	9,434,600
たけびし	2,500	1,721.000	4,302,500
リックス	2,200	2,441.000	5,370,200
丸文	8,200	1,243.000	10,192,600
ハピネット	7,900	1,861.000	14,701,900
日本ライフライン	25,100	915.000	22,966,500
タカショー	9,100	680.000	6,188,000
I D O M	26,200	828.000	21,693,600
進和	6,100	2,109.000	12,864,900
ダイトロン	3,500	2,585.000	9,047,500
シークス	12,000	1,353.000	16,236,000
オーハシテクニカ	5,000	1,589.000	7,945,000
白銅	3,300	2,586.000	8,533,800
伊藤忠商事	513,000	4,335.000	2,223,855,000
丸紅	649,800	1,897.000	1,232,670,600
長瀬産業	37,900	2,034.000	77,088,600
蝶理	4,600	2,435.000	11,201,000
豊田通商	72,600	5,600.000	406,560,000
三共生興	15,900	544.000	8,649,600
兼松	31,900	1,665.000	53,113,500
三井物産	609,400	4,154.000	2,531,447,600
日本紙パルプ商事	4,500	5,220.000	23,490,000
カメイ	9,300	1,472.000	13,689,600
スターゼン	6,600	2,222.000	14,665,200
山善	22,300	1,019.000	22,723,700
椿本興業	1,600	4,135.000	6,616,000
住友商事	515,800	2,422.500	1,249,525,500
内田洋行	3,800	4,950.000	18,810,000
三菱商事	520,800	4,959.000	2,582,647,200
第一実業	3,100	5,520.000	17,112,000
キャノンマーケティングジャパン	19,500	3,080.000	60,060,000
西華産業	3,900	2,185.000	8,521,500
佐藤商事	6,300	1,363.000	8,586,900
菱洋エレクトロ	7,500	2,453.000	18,397,500
東京産業	9,300	805.000	7,486,500
ユアサ商事	7,500	3,860.000	28,950,000
神鋼商事	2,200	5,740.000	12,628,000
阪和興業	14,900	3,865.000	57,588,500
正栄食品工業	5,800	4,075.000	23,635,000
カナデン	7,700	1,152.000	8,870,400
R Y O D E N	7,100	1,898.000	13,475,800
岩谷産業	19,100	6,320.000	120,712,000
ナイス	3,300	1,361.000	4,491,300
極東貿易	6,000	1,464.000	8,784,000
アステナホールディングス	17,700	444.000	7,858,800
三愛オブリ	22,200	1,358.000	30,147,600
稲畑産業	16,600	2,701.000	44,836,600
G S I クレオス	5,600	1,810.000	10,136,000

明和産業	12,500	703.000	8,787,500
ワキタ	16,300	1,291.000	21,043,300
東邦ホールディングス	21,500	2,534.000	54,481,000
サンゲツ	21,500	2,191.000	47,106,500
ミツウロコグループホールディングス	11,900	1,307.000	15,553,300
シナネンホールディングス	3,100	3,240.000	10,044,000
伊藤忠エネクス	20,700	1,097.000	22,707,900
サンリオ	23,700	6,330.000	150,021,000
サンワ テクノス	4,700	1,853.000	8,709,100
リョーサン	9,200	3,235.000	29,762,000
新光商事	12,100	1,193.000	14,435,300
トーホー	4,000	2,408.000	9,632,000
三信電気	3,900	2,275.000	8,872,500
東陽テクニカ	9,800	1,400.000	13,720,000
モスフードサービス	12,500	3,080.000	38,500,000
加賀電子	6,700	4,745.000	31,791,500
ソーダニッカ	7,300	800.000	5,840,000
立花エレテック	6,300	1,949.000	12,278,700
PALTA C	13,300	4,945.000	65,768,500
三谷産業	20,100	316.000	6,351,600
太平洋興発	6,200	835.000	5,177,000
西本Wismettacホールディングス	2,400	3,740.000	8,976,000
KPPグループホールディングス	20,600	647.000	13,328,200
ヤマタネ	5,000	1,679.000	8,395,000
泉州電業	4,300	3,215.000	13,824,500
トラスコ中山	17,700	2,171.000	38,426,700
オートバックスセブン	29,600	1,471.000	43,541,600
モリト	7,300	1,020.000	7,446,000
加藤産業	10,100	3,370.000	34,037,000
イエローハット	14,900	1,793.000	26,715,700
JKホールディングス	7,200	1,023.000	7,365,600
日伝	5,300	1,942.000	10,292,600
杉本商事	4,000	1,991.000	7,964,000
因幡電機産業	21,200	2,889.000	61,246,800
東テク	3,000	4,220.000	12,660,000
ミスミグループ本社	125,700	3,225.000	405,382,500
タキヒヨー	4,400	1,095.000	4,818,000
スズケン	26,300	3,535.000	92,970,500
ジェコス	6,500	908.000	5,902,000
グローセル	14,200	411.000	5,836,200
ローソン	20,800	5,500.000	114,400,000
サンエー	6,400	4,490.000	28,736,000
カワチ薬品	6,700	2,246.000	15,048,200
エービーシー・マート	12,200	7,410.000	90,402,000
ハードオフコーポレーション	4,000	1,306.000	5,224,000
アスクル	17,600	1,747.000	30,747,200
ゲオホールディングス	8,900	1,664.000	14,809,600
アダストリア	10,300	2,573.000	26,501,900

くら寿司	9,900	3,410.000	33,759,000
キャンドウ	4,200	2,428.000	10,197,600
パルグループホールディングス	8,400	3,235.000	27,174,000
エディオン	32,600	1,301.000	42,412,600
サーラコーポレーション	18,900	754.000	14,250,600
ハローズ	3,900	3,145.000	12,265,500
あみやき亭	1,500	3,695.000	5,542,500
大黒天物産	2,800	4,775.000	13,370,000
ハニーズホールディングス	7,000	1,564.000	10,948,000
アルペン	7,100	2,019.000	14,334,900
クオールホールディングス	12,100	1,196.000	14,471,600
ジンスホールディングス	5,200	3,480.000	18,096,000
ビックカメラ	55,800	1,101.000	61,435,800
D C Mホールディングス	51,600	1,269.000	65,480,400
Monotaro	118,100	1,786.000	210,926,600
アークランドサービスホールディングス	6,700	2,250.000	15,075,000
J . フロント リテイリング	104,100	1,356.000	141,159,600
ドトール・日レスホールディングス	14,900	1,963.000	29,248,700
マツキヨココカラ&カンパニー	50,600	7,100.000	359,260,000
broncoビリー	4,500	2,567.000	11,551,500
Z O Z O	55,200	3,050.000	168,360,000
トレジャー・ファクトリー	5,100	1,643.000	8,379,300
物語コーポレーション	14,100	2,909.000	41,016,900
三越伊勢丹ホールディングス	140,500	1,450.000	203,725,000
ウエルシアホールディングス	43,400	2,840.000	123,256,000
クリエイトSDホールディングス	13,600	3,305.000	44,948,000
チムニー	6,300	1,236.000	7,786,800
シュッピン	7,200	888.000	6,393,600
オイシックス・ラ・大地	11,400	2,468.000	28,135,200
ネクステージ	19,200	2,381.000	45,715,200
ジョイフル本田	24,800	1,729.000	42,879,200
鳥貴族ホールディングス	3,700	2,179.000	8,062,300
ホットランド	7,100	1,503.000	10,671,300
すかいらくホールディングス	113,900	1,763.000	200,805,700
S F Pホールディングス	5,000	2,028.000	10,140,000
綿半ホールディングス	7,000	1,376.000	9,632,000
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	29,300	1,097.000	32,142,100
B E E N O S	5,000	1,961.000	9,805,000
あさひ	7,100	1,318.000	9,357,800
日本調剤	6,400	1,169.000	7,481,600
コスモス薬品	8,300	12,500.000	103,750,000
セブン&アイ・ホールディングス	287,200	5,778.000	1,659,441,600
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	63,100	1,025.000	64,677,500
ツルハホールディングス	17,600	8,760.000	154,176,000
サンマルクホールディングス	7,100	1,812.000	12,865,200
フェリシモ	4,600	996.000	4,581,600

トリドールホールディングス	20,800	2,953.000	61,422,400
TOKYO BASE	9,500	459.000	4,360,500
JMホールディングス	7,400	1,916.000	14,178,400
アレンザホールディングス	7,300	989.000	7,219,700
串カツ田中ホールディングス	3,500	1,656.000	5,796,000
クスリのアオキホールディングス	7,600	6,400.000	48,640,000
力の源ホールディングス	4,900	1,512.000	7,408,800
FOOD & LIFE COMPANIES	48,000	3,485.000	167,280,000
ノジマ	27,300	1,414.000	38,602,200
カップ・クリエイト	13,700	1,454.000	19,919,800
ライトオン	1,000	562.000	562,000
良品計画	107,700	1,483.000	159,719,100
アドヴァングループ	10,200	940.000	9,588,000
アルピス	3,200	2,498.000	7,993,600
G-7ホールディングス	10,600	1,402.000	14,861,200
イオン北海道	14,500	820.000	11,890,000
コジマ	17,400	556.000	9,674,400
コーナン商事	11,400	3,445.000	39,273,000
エコス	3,700	1,815.000	6,715,500
ワタミ	11,000	920.000	10,120,000
パン・パシフィック・インターナショナル ホールディングス	168,300	2,541.000	427,650,300
西松屋チェーン	18,800	1,616.000	30,380,800
ゼンショーホールディングス	45,600	4,125.000	188,100,000
幸楽苑ホールディングス	6,500	1,057.000	6,870,500
サイゼリヤ	14,100	3,295.000	46,459,500
VTホールディングス	31,300	524.000	16,401,200
フジ・コーポレーション	5,000	1,283.000	6,415,000
ユナイテッドアローズ	9,200	1,914.000	17,608,800
ハイデイ日高	12,300	2,355.000	28,966,500
コロワイド	38,700	2,043.000	79,064,100
壱番屋	6,500	5,260.000	34,190,000
スギホールディングス	16,900	5,830.000	98,527,000
薬王堂ホールディングス	5,100	2,442.000	12,454,200
スクロール	12,900	782.000	10,087,800
ヨンドシーホールディングス	7,600	1,792.000	13,619,200
木曽路	12,800	2,300.000	29,440,000
SRSホールディングス	15,700	979.000	15,370,300
千趣会	18,000	408.000	7,344,000
リテールパートナーズ	12,500	1,296.000	16,200,000
ケーヨー	14,900	819.000	12,203,100
上新電機	7,100	1,970.000	13,987,000
日本瓦斯	45,200	1,946.000	87,959,200
ロイヤルホールディングス	16,300	2,775.000	45,232,500
いなげや	8,600	1,263.000	10,861,800
チヨダ	10,600	807.000	8,554,200
ライフコーポレーション	7,500	2,824.000	21,180,000

リンガーハット	11,100	2,317.000	25,718,700
MrMaxHD	13,000	665.000	8,645,000
AOKIホールディングス	16,200	880.000	14,256,000
オークワ	14,700	854.000	12,553,800
コメリ	12,900	2,805.000	36,184,500
青山商事	19,000	906.000	17,214,000
しまむら	9,800	12,550.000	122,990,000
高島屋	63,300	1,917.000	121,346,100
松屋	14,800	1,176.000	17,404,800
エイチ・ツー・オー リテイリング	40,900	1,534.000	62,740,600
近鉄百貨店	4,000	2,427.000	9,708,000
丸井グループ	61,400	2,080.000	127,712,000
アクシアル リテイリング	5,700	3,430.000	19,551,000
イオン	282,400	2,664.000	752,313,600
イズミ	12,800	3,095.000	39,616,000
平和堂	13,800	1,989.000	27,448,200
フジ	13,000	1,788.000	23,244,000
ヤオコー	9,400	6,910.000	64,954,000
ゼビオホールディングス	11,500	1,118.000	12,857,000
ケーズホールディングス	66,400	1,171.000	77,754,400
OLYMPICグループ	2,400	504.000	1,209,600
シルバーライフ	2,500	1,252.000	3,130,000
Genky DrugStores	3,800	3,965.000	15,067,000
ブックオフグループホールディングス	5,700	1,308.000	7,455,600
ギフトホールディングス	1,900	4,935.000	9,376,500
アインホールディングス	11,600	5,430.000	62,988,000
元気寿司	3,200	3,120.000	9,984,000
ヤマダホールディングス	341,800	473.000	161,671,400
アーケランズ	12,900	1,596.000	20,588,400
ニトリホールディングス	33,700	16,675.000	561,947,500
グルメ杵屋	8,300	1,024.000	8,499,200
ケーユーホールディングス	5,800	1,352.000	7,841,600
吉野家ホールディングス	32,700	2,524.000	82,534,800
松屋フーズホールディングス	3,900	4,110.000	16,029,000
サガミホールディングス	13,900	1,307.000	18,167,300
関西フードマーケット	8,700	1,570.000	13,659,000
王将フードサービス	5,300	6,110.000	32,383,000
ミニストップ	6,700	1,409.000	9,440,300
アークス	15,000	2,304.000	34,560,000
パローホールディングス	15,700	1,976.000	31,023,200
ベルク	4,100	5,540.000	22,714,000
大庄	7,100	1,042.000	7,398,200
ファーストリテイリング	37,500	30,270.000	1,135,125,000
サンドラッグ	31,700	3,605.000	114,278,500
サックスパー ホールディングス	9,300	808.000	7,514,400
やまや	3,100	2,605.000	8,075,500
ベルーナ	20,700	704.000	14,572,800
いよぎんホールディングス	92,900	755.000	70,139,500

しずおかフィナンシャルグループ	175,100	971.000	170,022,100
ちゅうぎんフィナンシャルグループ	65,000	904.000	58,760,000
じもとホールディングス	2,100	396.000	831,600
めぶきフィナンシャルグループ	383,700	329.000	126,237,300
東京きらぼしフィナンシャルグループ	10,100	2,722.000	27,492,200
九州フィナンシャルグループ	134,600	473.000	63,665,800
ゆうちょ銀行	221,300	1,093.000	241,880,900
富山第一銀行	21,100	572.000	12,069,200
コンコルディア・フィナンシャルグループ	427,000	496.000	211,792,000
西日本フィナンシャルホールディングス	48,900	1,104.000	53,985,600
三十三フィナンシャルグループ	7,500	1,559.000	11,692,500
第四北越フィナンシャルグループ	11,800	2,921.000	34,467,800
ひろぎんホールディングス	99,900	636.000	63,536,400
おきなわフィナンシャルグループ	7,800	2,106.000	16,426,800
十六フィナンシャルグループ	9,900	2,903.000	28,739,700
北國フィナンシャルホールディングス	6,800	4,410.000	29,988,000
プロクレアホールディングス	9,900	2,079.000	20,582,100
あいちフィナンシャルグループ	11,000	2,079.000	22,869,000
S B I 新生銀行	23,600	2,376.000	56,073,600
あおぞら銀行	48,300	2,450.000	118,335,000
三菱UFJフィナンシャル・グループ	4,854,300	850.700	4,129,553,010
りそなホールディングス	979,100	644.700	631,225,770
三井住友トラスト・ホールディングス	140,500	4,632.000	650,796,000
三井住友フィナンシャルグループ	566,200	5,420.000	3,068,804,000
千葉銀行	215,200	860.000	185,072,000
群馬銀行	149,100	448.000	66,796,800
武蔵野銀行	9,600	2,189.000	21,014,400
千葉興業銀行	17,800	551.000	9,807,800
筑波銀行	38,800	209.000	8,109,200
七十七銀行	24,800	2,143.000	53,146,400
秋田銀行	5,800	1,719.000	9,970,200
山形銀行	9,900	1,026.000	10,157,400
岩手銀行	5,700	2,070.000	11,799,000
東邦銀行	65,800	216.000	14,212,800
東北銀行	7,200	969.000	6,976,800
ふくおかフィナンシャルグループ	61,700	2,506.000	154,620,200
スルガ銀行	69,500	467.000	32,456,500
八十二銀行	132,600	568.000	75,316,800
山梨中央銀行	9,100	1,112.000	10,119,200
大垣共立銀行	14,400	1,803.000	25,963,200
福井銀行	7,500	1,479.000	11,092,500
清水銀行	1,600	1,438.000	2,300,800
滋賀銀行	13,000	2,740.000	35,620,000
南都銀行	11,600	2,382.000	27,631,200
百五銀行	72,600	381.000	27,660,600
京都銀行	24,400	6,240.000	152,256,000
紀陽銀行	27,300	1,510.000	41,223,000
ほくほくフィナンシャルグループ	48,800	955.000	46,604,000

山陰合同銀行	48,000	751.000	36,048,000
鳥取銀行	5,500	1,148.000	6,314,000
百十四銀行	7,500	1,819.000	13,642,500
四国銀行	13,400	867.000	11,617,800
阿波銀行	11,400	1,997.000	22,765,800
大分銀行	5,200	2,031.000	10,561,200
宮崎銀行	5,200	2,352.000	12,230,400
佐賀銀行	5,000	1,606.000	8,030,000
琉球銀行	18,600	903.000	16,795,800
セブン銀行	278,500	269.000	74,916,500
みずほフィナンシャルグループ	1,120,400	1,933.500	2,166,293,400
山口フィナンシャルグループ	85,300	811.000	69,178,300
長野銀行	10,700	1,435.000	15,354,500
名古屋銀行	5,100	3,295.000	16,804,500
北洋銀行	117,400	283.000	33,224,200
愛媛銀行	11,700	840.000	9,828,000
京葉銀行	36,800	566.000	20,828,800
栃木銀行	39,200	274.000	10,740,800
北日本銀行	3,300	1,977.000	6,524,100
東和銀行	15,900	539.000	8,570,100
トモニホールディングス	63,500	355.000	22,542,500
フィデアホールディングス	8,600	1,333.000	11,463,800
池田泉州ホールディングス	102,400	238.000	24,371,200
F P G	31,900	1,151.000	36,716,900
ジャパンインベストメントアドバイザー	6,800	1,097.000	7,459,600
マーキュリアホールディングス	5,700	723.000	4,121,100
S B Iホールディングス	111,600	2,657.000	296,521,200
ジャフコ グループ	26,300	1,870.000	49,181,000
大和証券グループ本社	550,600	619.000	340,821,400
野村ホールディングス	1,425,000	500.300	712,927,500
岡三証券グループ	67,800	467.000	31,662,600
丸三証券	28,500	426.000	12,141,000
東洋証券	28,500	325.000	9,262,500
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	81,400	368.000	29,955,200
水戸証券	23,800	299.000	7,116,200
いちよし証券	15,600	593.000	9,250,800
松井証券	45,900	778.000	35,710,200
マネックスグループ	86,800	494.000	42,879,200
極東証券	12,700	594.000	7,543,800
岩井コスモホールディングス	9,300	1,348.000	12,536,400
アイザワ証券グループ	12,700	703.000	8,928,100
スパークス・グループ	8,900	1,487.000	13,234,300
かんぽ生命保険	94,200	2,125.000	200,175,000
S O M P Oホールディングス	133,000	5,374.000	714,742,000
アニコム ホールディングス	29,100	516.000	15,015,600
M S & A D インシュアランスグループホールディングス	157,300	4,257.000	669,626,100
第一生命ホールディングス	394,800	2,469.000	974,761,200

東京海上ホールディングス	780,400	2,634.000	2,055,573,600
T & Dホールディングス	208,300	1,655.000	344,736,500
アドバンスクリエイト	6,500	1,130.000	7,345,000
全国保証	20,400	4,870.000	99,348,000
ジェイリース	2,700	2,028.000	5,475,600
日本モーゲージサービス	7,800	687.000	5,358,600
アルヒ	11,000	1,085.000	11,935,000
プレミアグループ	13,500	1,611.000	21,748,500
ネットプロテクションズホールディングス	26,700	505.000	13,483,500
クレディセゾン	49,500	1,758.000	87,021,000
芙蓉総合リース	7,100	9,490.000	67,379,000
みずほリース	11,200	3,680.000	41,216,000
東京センチュリー	14,300	4,505.000	64,421,500
日本証券金融	32,000	975.000	31,200,000
アイフル	130,400	362.000	47,204,800
リコーリース	7,400	3,795.000	28,083,000
イオンフィナンシャルサービス	44,400	1,230.000	54,612,000
アコム	146,500	321.000	47,026,500
ジャックス	8,300	4,410.000	36,603,000
オリエントコーポレーション	20,400	1,121.000	22,868,400
オリックス	508,100	2,267.000	1,151,862,700
三菱HCキャピタル	298,800	686.000	204,976,800
九州リースサービス	6,100	830.000	5,063,000
日本取引所グループ	217,800	2,088.000	454,766,400
イー・ギャランティ	13,300	2,170.000	28,861,000
NECキャピタルソリューション	4,100	2,536.000	10,397,600
大東建託	28,400	13,350.000	379,140,000
いちご	105,000	270.000	28,350,000
日本駐車場開発	98,300	231.000	22,707,300
スター・マイカ・ホールディングス	8,900	667.000	5,936,300
SREホールディングス	4,000	3,175.000	12,700,000
ヒューリック	180,500	1,120.000	202,160,000
三栄建築設計	4,800	1,541.000	7,396,800
野村不動産ホールディングス	48,300	3,045.000	147,073,500
三重交通グループホールディングス	19,100	557.000	10,638,700
サムティ	10,100	2,154.000	21,755,400
ディア・ライフ	14,100	686.000	9,672,600
地主	7,000	1,925.000	13,475,000
プレサンスコーポレーション	10,900	1,818.000	19,816,200
JPMC	5,600	1,098.000	6,148,800
フージャースホールディングス	13,400	819.000	10,974,600
オープンハウスグループ	28,400	5,020.000	142,568,000
東急不動産ホールディングス	233,100	648.000	151,048,800
飯田グループホールディングス	67,600	2,218.000	149,936,800
シーアールイー	4,500	1,270.000	5,715,000
ケイアイスター不動産	5,000	4,100.000	20,500,000
グッドコムアセット	8,500	783.000	6,655,500
ジェイ・エス・ビー	2,200	4,295.000	9,449,000

ロードスターキャピタル	4,000	1,351.000	5,404,000
パーク24	60,800	1,999.000	121,539,200
パラカ	3,900	1,977.000	7,710,300
宮越ホールディングス	4,600	839.000	3,859,400
三井不動産	335,300	2,481.000	831,879,300
三菱地所	468,400	1,605.500	752,016,200
平和不動産	14,000	3,875.000	54,250,000
東京建物	73,900	1,624.000	120,013,600
京阪神ビルディング	10,900	1,216.000	13,254,400
住友不動産	140,300	3,005.000	421,601,500
テオーシー	17,700	611.000	10,814,700
東京楽天地	1,800	4,210.000	7,578,000
スターツコーポレーション	13,000	2,427.000	31,551,000
フジ住宅	12,700	692.000	8,788,400
空港施設	12,000	559.000	6,708,000
ゴールドクレスト	8,200	1,729.000	14,177,800
エスリード	4,100	2,188.000	8,970,800
日神グループホールディングス	15,200	455.000	6,916,000
日本エスコン	24,000	847.000	20,328,000
MIRARTHホールディングス	42,800	385.000	16,478,000
イオンモール	40,600	1,790.000	72,674,000
毎日コムネット	4,000	813.000	3,252,000
カチタス	23,000	2,589.000	59,547,000
トーセイ	16,000	1,505.000	24,080,000
穴吹興産	2,900	2,265.000	6,568,500
サンフロンティア不動産	16,000	1,288.000	20,608,000
FJネクストホールディングス	9,000	987.000	8,883,000
日本空港ビルデング	27,600	6,570.000	181,332,000
日本工営	5,100	3,410.000	17,391,000
LIFULL	32,400	216.000	6,998,400
MIXI	18,800	2,708.000	50,910,400
ジェイエイシーリクルートメント	7,300	2,553.000	18,636,900
日本M&Aセンターホールディングス	139,500	1,001.000	139,639,500
メンバーズ	3,100	1,216.000	3,769,600
UTグループ	12,000	2,548.000	30,576,000
アイティメディア	3,500	1,420.000	4,970,000
E・Jホールディングス	5,400	1,516.000	8,186,400
オープンアップグループ	24,300	1,894.000	46,024,200
コシダカホールディングス	25,200	1,112.000	28,022,400
パソナグループ	10,000	1,784.000	17,840,000
リンクアンドモチベーション	24,600	502.000	12,349,200
エス・エム・エス	30,900	3,195.000	98,725,500
パーソルホールディングス	90,400	2,688.000	242,995,200
リニカル	6,300	716.000	4,510,800
クックパッド	33,500	198.000	6,633,000
学情	4,100	1,807.000	7,408,700
スタジオアリス	4,800	2,192.000	10,521,600
シミックホールディングス	5,100	2,135.000	10,888,500

総合警備保障	30,200	3,615.000	109,173,000
カカクコム	59,700	1,850.000	110,445,000
アイロムグループ	3,500	1,840.000	6,440,000
セントケア・ホールディング	1,800	759.000	1,366,200
ルネサンス	6,600	938.000	6,190,800
ディップ	14,300	3,450.000	49,335,000
デジタルホールディングス	7,300	1,098.000	8,015,400
新日本科学	8,800	2,963.000	26,074,400
キャリアデザインセンター	2,000	2,117.000	4,234,000
ベネフィット・ワン	37,700	1,832.000	69,066,400
エムスリー	160,100	3,372.000	539,857,200
アウトソーシング	48,500	1,346.000	65,281,000
ウェルネット	8,400	657.000	5,518,800
ワールドホールディングス	3,800	2,515.000	9,557,000
ディー・エヌ・エー	34,900	1,853.000	64,669,700
博報堂D Yホールディングス	103,100	1,533.000	158,052,300
タカミヤ	14,000	421.000	5,894,000
ジャパンベストレスキューシステム	6,400	709.000	4,537,600
ファンコミュニケーションズ	20,300	397.000	8,059,100
ライク	3,700	1,960.000	7,252,000
エスプール	24,600	648.000	15,940,800
WDBホールディングス	4,500	1,979.000	8,905,500
アドウェイズ	12,000	676.000	8,112,000
パリュコマース	6,400	1,729.000	11,065,600
インフォマート	85,600	275.000	23,540,000
J Pホールディングス	27,100	337.000	9,132,700
プレステージ・インターナショナル	35,400	575.000	20,355,000
アミューズ	5,000	1,809.000	9,045,000
ドリームインキュベータ	2,800	2,710.000	7,588,000
クイック	6,500	1,759.000	11,433,500
電通グループ	79,500	4,710.000	374,445,000
テイクアンドギヴ・ニーズ	2,700	1,312.000	3,542,400
ぴあ	3,000	3,210.000	9,630,000
イオンファンタジー	3,900	3,200.000	12,480,000
シーティーエス	10,600	789.000	8,363,400
H . U . グループホールディングス	24,100	2,730.000	65,793,000
アルプス技研	7,200	2,478.000	17,841,600
日本空調サービス	10,700	719.000	7,693,300
オリエンタルランド	428,500	4,844.000	2,075,654,000
ダスキン	18,200	3,195.000	58,149,000
明光ネットワークジャパン	13,800	636.000	8,776,800
ファルコホールディングス	4,400	1,991.000	8,760,400
ラウンドワン	69,000	544.000	37,536,000
リゾートトラスト	32,300	2,180.000	70,414,000
ビー・エム・エル	10,100	3,075.000	31,057,500
リソー教育	41,100	322.000	13,234,200
早稲田アカデミー	5,900	1,419.000	8,372,100
ユー・エス・エス	83,300	2,228.000	185,592,400

東京個別指導学院	12,400	541.000	6,708,400
サイバーエージェント	194,200	1,118.000	217,115,600
楽天グループ	355,000	651.000	231,105,000
クリーク・アンド・リバー社	5,100	2,343.000	11,949,300
S B I グローバルアセットマネジメント	15,800	486.000	7,678,800
テー・オー・ダブリュー	19,300	318.000	6,137,400
山田コンサルティンググループ	4,800	1,443.000	6,926,400
セントラルスポーツ	3,700	2,505.000	9,268,500
フルキャストホールディングス	8,100	2,349.000	19,026,900
エン・ジャパン	14,900	2,393.000	35,655,700
テクノプロ・ホールディングス	47,900	3,625.000	173,637,500
アイ・アールジャパンホールディングス	4,500	2,392.000	10,764,000
K e e P e r 技研	5,100	4,655.000	23,740,500
G u n o s y	8,100	610.000	4,941,000
イー・ガーディアン	3,500	2,265.000	7,927,500
ジャパンマテリアル	24,900	2,109.000	52,514,100
ベクトル	13,100	1,453.000	19,034,300
チャーム・ケア・コーポレーション	7,400	1,116.000	8,258,400
キャリアリンク	3,200	2,317.000	7,414,400
I B J	6,000	666.000	3,996,000
アサンテ	5,200	1,650.000	8,580,000
バリューHR	7,900	1,539.000	12,158,100
M&Aキャピタルパートナーズ	7,600	3,750.000	28,500,000
ライドオンエクスプレスホールディングス	4,200	1,099.000	4,615,800
E R I ホールディングス	2,800	1,586.000	4,440,800
シグマクシス・ホールディングス	13,000	1,117.000	14,521,000
ウィルグループ	7,000	1,054.000	7,378,000
メドピア	6,900	1,126.000	7,769,400
リクルートホールディングス	599,100	3,735.000	2,237,638,500
エラン	10,800	1,005.000	10,854,000
日本郵政	1,062,000	1,083.000	1,150,146,000
ベルシステム24ホールディングス	11,500	1,374.000	15,801,000
鎌倉新書	10,100	935.000	9,443,500
エアトリ	5,500	2,665.000	14,657,500
アトラエ	7,000	878.000	6,146,000
ストライク	4,100	3,845.000	15,764,500
ソラスト	23,200	604.000	14,012,800
セラク	3,300	1,669.000	5,507,700
インソース	20,400	1,260.000	25,704,000
ベイカレント・コンサルティング	64,200	5,040.000	323,568,000
アイモバイル	5,000	1,297.000	6,485,000
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	29,000	2,118.000	61,422,000
ウェルビー	7,700	593.000	4,566,100
エル・ティー・エス	1,300	2,691.000	3,498,300
ミダックホールディングス	5,100	1,967.000	10,031,700
日総工産	6,800	721.000	4,902,800
キュービーネットホールディングス	4,700	1,376.000	6,467,200

R P Aホールディングス	12,900	404.000	5,211,600	
マネジメントソリューションズ	4,600	3,245.000	14,927,000	
フロンティア・マネジメント	3,500	943.000	3,300,500	
カーブスホールディングス	25,500	802.000	20,451,000	
F A S T F I T N E S S J A P A N	3,400	1,621.000	5,511,400	
ダイレクトマーケティングミックス	10,300	1,290.000	13,287,000	
L I T A L I C O	6,500	2,451.000	15,931,500	
リログループ	45,400	1,945.000	88,303,000	
東祥	6,900	1,222.000	8,431,800	
ビーウィズ	2,200	1,586.000	3,489,200	
T R Eホールディングス	17,600	1,251.000	22,017,600	
人・夢・技術グループ	4,200	1,502.000	6,308,400	
大栄環境	15,900	1,830.000	29,097,000	
日本管財ホールディングス	8,300	2,467.000	20,476,100	
エイチ・アイ・エス	21,500	2,012.000	43,258,000	
ラックランド	3,100	2,968.000	9,200,800	
共立メンテナンス	14,000	5,310.000	74,340,000	
イチネンホールディングス	9,100	1,291.000	11,748,100	
建設技術研究所	4,400	3,100.000	13,640,000	
スペース	7,400	920.000	6,808,000	
燦ホールディングス	3,900	2,335.000	9,106,500	
スバル興業	800	9,110.000	7,288,000	
東京テアトル	9,000	1,121.000	10,089,000	
ナガワ	2,200	6,320.000	13,904,000	
東京都競馬	7,000	4,275.000	29,925,000	
カナモト	14,900	2,201.000	32,794,900	
ニシオホールディングス	7,600	3,090.000	23,484,000	
トランス・コスモス	10,200	3,105.000	31,671,000	
乃村工藝社	35,600	891.000	31,719,600	
藤田観光	4,100	3,200.000	13,120,000	
K N T - C Tホールディングス	5,800	1,637.000	9,494,600	
トーカイ	7,500	1,978.000	14,835,000	
セコム	82,400	8,381.000	690,594,400	
セントラル警備保障	4,700	2,599.000	12,215,300	
丹青社	16,800	780.000	13,104,000	
メイテック	32,500	2,293.000	74,522,500	
応用地質	7,900	2,068.000	16,337,200	
船井総研ホールディングス	16,900	2,580.000	43,602,000	
いであ	2,800	1,601.000	4,482,800	
学究社	4,200	2,018.000	8,475,600	
ベネッセホールディングス	31,100	1,921.000	59,743,100	
イオンディライト	9,100	2,927.000	26,635,700	
ダイセキ	16,600	3,570.000	59,262,000	
ステップ	3,700	1,909.000	7,063,300	
合 計	92,214,980		226,980,178,810	

(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)

	(2022年4月13日現在)	(2023年4月13日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	78,454,043	18,040,734
コール・ローン	3,009,448,965	404,157,328
国債証券	109,049,192,830	94,923,942,650
地方債証券	9,573,035,400	9,394,088,900
特殊債券	9,360,292,837	8,916,392,687
社債券	5,074,875,400	6,569,523,900
未収入金	-	28,219,500
未収利息	206,523,392	190,297,685
前払費用	3,702,938	6,082,219
流動資産合計	136,355,525,805	120,450,745,603
資産合計	136,355,525,805	120,450,745,603
負債の部		
流動負債		
未払金	2,783,309,300	-
未払解約金	28,069,291	70,410,000
その他未払費用	1,645	1,880
流動負債合計	2,811,380,236	70,411,880
負債合計	2,811,380,236	70,411,880
純資産の部		
元本等		
元本	106,340,184,500	97,440,897,328
剰余金		
剰余金又は欠損金 ()	27,203,961,069	22,939,436,395
元本等合計	133,544,145,569	120,380,333,723
純資産合計	133,544,145,569	120,380,333,723
負債純資産合計	136,355,525,805	120,450,745,603

(2) 注記表

(重要な会計方針の注記)

項 目	自 2022年4月14日 至 2023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</p> <p>金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p>

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

（重要な会計上の見積りに関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

項目	（2022年4月13日現在）	（2023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	106,340,184,500口	97,440,897,328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 1.2354円 （1万口当たりの純資産額12,354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 2022年4月14日 至 2023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</p> <p>当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引</p> <p>当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク</p> <p>有価証券およびデリバティブ取引等</p> <p>当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>

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

・金融商品の時価等に関する事項

項目	(2023年4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>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。

(デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

自 2022年4月14日 至 2023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)

(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

SMAM・インデックス・バランスVA25<適格機関投資家専用>	1,830,653,508円
SMAM・インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用>	2,180,257,745円
SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用>	2,384,904,244円
SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>	8,380,559,091円
SMAM・バランスVA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・VAS(適格機関投資家専用)	1,159,868,412円
SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	446,913,980円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>	535,210,250円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>	179,486,947円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用>	44,152,419円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>	1,440,382,485円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	2,107,627,635円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A2<適格機関投資家専用>	683,112,177円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A2<適格機関投資家専用>	205,571,184円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A2<適格機関投資家専用>	18,779,320円
SMAM・アセットバランスファンドVA30L2<適格機関投資家専用>	272,432,388円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L2<適格機関投資家専用>	5,120,316,774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>	1,146,512,165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>	1,157,293,722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>	1,481,392,104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>	5,928,068,863円
合計	106,340,184,500円

(2023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	106,340,184,500円
同期中における追加設定元本額	23,003,419,591円
同期中における一部解約元本額	31,902,706,763円
2023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)	8,066,562,266円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	12,893,291,980円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	3,067,494,543円
SMAM・グローバルバランスファンド(機動的資産配分型)	728,176,754円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2020(4資産タイプ)	41,660,405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)	199,069,008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)	551,312,023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)	955,391,122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)	504,847,368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)	643,501,192円
三井住友・DC年金バランスゼロ(債券型)	142,561,825円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	1,320,949,723円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	681,405,675円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	197,981,789円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050	69,731,154円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	2,228,903,724円

三井住友・資産最適化ファンド(2 やや安定型)	763,783,268円
三井住友・資産最適化ファンド(3 バランス型)	1,153,723,242円
三井住友・資産最適化ファンド(4 やや成長型)	259,384,894円
三井住友・資産最適化ファンド(5 成長重視型)	43,469,971円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	228,473,492円
三井住友DS・年金バランス30(債券重点型)	320,065,463円
三井住友DS・年金バランス50(標準型)	645,050,541円
三井住友DS・年金バランス70(株式重点型)	185,890,643円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	8,692,626円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2035	363,085円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2040	298,337円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2045	201,623円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2055	109,828円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2065	109,828円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル1(保守型)	215,601円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル2(安定型)	144,709円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル3(安定成長型)	97,059円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル4(成長型)	54,198円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル5(積極成長型)	12,947円
SMAM・年金グローバル債券ファンド<適格機関投資家限定>	1,148,582,155円
SMAM・バランスファンドVA25<適格機関投資家専用>	9,696,497,158円
SMAM・バランスファンドVA37.5<適格機関投資家専用>	5,706,550,972円
SMAM・バランスファンドVA50<適格機関投資家専用>	14,439,786,152円
SMAM・バランスファンドVL30<適格機関投資家限定>	291,755,610円
SMAM・バランスファンドVL50<適格機関投資家限定>	466,061,460円
SMAM・バランスファンドVA75<適格機関投資家専用>	242,428,375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>	116,608,704円
SMAM・インデックス・バランスVA25<適格機関投資家専用>	1,681,190,812円
SMAM・インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用>	1,969,539,677円
SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用>	2,120,208,354円
SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>	7,472,345,986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)	1,041,143,136円
SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	369,354,331円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>	475,881,321円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>	162,026,305円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用>	44,327,528円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>	1,232,890,521円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	1,957,126,760円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A2<適格機関投資家専用>	598,143,282円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A2<適格機関投資家専用>	204,865,104円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A2<適格機関投資家専用>	20,783,621円
SMAM・アセットバランスファンドVA30L2<適格機関投資家専用>	250,396,742円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L2<適格機関投資家専用>	4,609,020,015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>	1,071,394,428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>	1,022,405,764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>	1,305,795,760円

S M A M ・ マルチアセット ・ ダイナミックアロケーション ・ ストラテジー ・ ファンド

< 適格機関投資家限定 >

1,819,843,422円

合 計

97,440,897,328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 4 4 2年国債	2,920,000,000	2,924,263,200	
	4 4 6 2年国債	580,000,000	580,759,800	
	4 4 7 2年国債	90,000,000	90,105,300	
	1 4 3 5年国債	770,000,000	772,456,300	
	1 4 4 5年国債	980,000,000	983,312,400	
	1 4 5 5年国債	1,180,000,000	1,184,307,000	
	1 4 6 5年国債	1,000,000,000	1,003,890,000	
	1 4 7 5年国債	1,310,000,000	1,311,532,700	
	1 4 8 5年国債	1,130,000,000	1,130,711,900	
	1 4 9 5年国債	1,240,000,000	1,239,776,800	
	1 5 0 5年国債	1,230,000,000	1,228,634,700	
	1 5 1 5年国債	230,000,000	229,503,200	
	1 5 2 5年国債	340,000,000	340,530,400	
	1 5 3 5年国債	1,140,000,000	1,136,192,400	
	1 5 4 5年国債	1,020,000,000	1,019,765,400	
	1 5 6 5年国債	1,320,000,000	1,324,290,000	
	1 4 0年国債	40,000,000	50,223,200	
	2 4 0年国債	242,000,000	292,754,660	
	3 4 0年国債	185,000,000	223,335,700	
	4 4 0年国債	247,000,000	299,297,310	
	5 4 0年国債	235,000,000	274,783,150	
	6 4 0年国債	240,000,000	275,479,200	
	7 4 0年国債	265,000,000	290,951,450	
	8 4 0年国債	250,000,000	255,065,000	
	9 4 0年国債	473,000,000	355,956,150	
	1 0 4 0年国債	420,000,000	370,410,600	
	1 1 4 0年国債	340,000,000	289,088,400	
	1 2 4 0年国債	370,000,000	281,311,000	
	1 3 4 0年国債	435,000,000	328,494,600	
	1 4 4 0年国債	435,000,000	350,440,350	
	1 5 4 0年国債	490,000,000	432,973,800	
	3 3 8 1 0年国債	805,000,000	812,236,950	
	3 3 9 1 0年国債	785,000,000	792,802,900	
	3 4 0 1 0年国債	770,000,000	778,446,900	
3 4 1 1 0年国債	557,000,000	562,163,390		

3 4 2	1 0 年国債	350,000,000	351,386,000	
3 4 3	1 0 年国債	310,000,000	311,134,600	
3 4 4	1 0 年国債	811,000,000	813,505,990	
3 4 5	1 0 年国債	258,000,000	258,616,620	
3 4 6	1 0 年国債	340,000,000	340,530,400	
3 4 7	1 0 年国債	100,000,000	100,062,000	
3 4 8	1 0 年国債	145,000,000	144,966,650	
3 4 9	1 0 年国債	550,000,000	549,356,500	
3 5 0	1 0 年国債	510,000,000	508,750,500	
3 5 1	1 0 年国債	450,000,000	448,492,500	
3 5 2	1 0 年国債	100,000,000	99,596,000	
3 5 3	1 0 年国債	450,000,000	447,844,500	
3 5 4	1 0 年国債	695,000,000	690,920,350	
3 5 5	1 0 年国債	600,000,000	595,788,000	
3 5 6	1 0 年国債	850,000,000	842,987,500	
3 5 7	1 0 年国債	650,000,000	643,799,000	
3 5 8	1 0 年国債	940,000,000	929,754,000	
3 5 9	1 0 年国債	1,000,000,000	986,970,000	
3 6 0	1 0 年国債	910,000,000	896,104,300	
3 6 1	1 0 年国債	980,000,000	963,467,400	
3 6 2	1 0 年国債	1,150,000,000	1,128,242,000	
3 6 3	1 0 年国債	1,610,000,000	1,576,093,400	
3 6 4	1 0 年国債	820,000,000	801,558,200	
3 6 5	1 0 年国債	890,000,000	869,040,500	
3 6 7	1 0 年国債	750,000,000	737,362,500	
3 6 8	1 0 年国債	500,000,000	491,350,000	
3 6 9	1 0 年国債	1,110,000,000	1,120,345,200	
2	3 0 年国債	510,000,000	584,485,500	
4	3 0 年国債	340,000,000	406,011,000	
5	3 0 年国債	290,000,000	332,641,600	
7	3 0 年国債	474,000,000	554,034,900	
9	3 0 年国債	240,000,000	261,158,400	
1 0	3 0 年国債	465,000,000	492,560,550	
1 1	3 0 年国債	430,000,000	480,697,000	
1 2	3 0 年国債	570,000,000	660,778,200	
1 4	3 0 年国債	392,000,000	467,985,280	
1 6	3 0 年国債	445,000,000	537,778,050	
1 8	3 0 年国債	190,000,000	226,088,600	
1 9	3 0 年国債	470,000,000	560,075,500	
2 1	3 0 年国債	345,000,000	412,188,750	
2 2	3 0 年国債	315,000,000	384,514,200	
2 3	3 0 年国債	299,000,000	365,724,840	
2 4	3 0 年国債	310,000,000	379,455,500	
2 5	3 0 年国債	290,000,000	348,162,400	
2 6	3 0 年国債	363,000,000	441,052,260	

27	30年国債	250,000,000	307,787,500	
28	30年国債	96,000,000	118,399,680	
29	30年国債	157,000,000	191,643,620	
30	30年国債	212,000,000	256,030,280	
31	30年国債	235,000,000	280,345,600	
32	30年国債	360,000,000	435,326,400	
33	30年国債	368,000,000	428,035,520	
34	30年国債	87,000,000	103,980,660	
35	30年国債	340,000,000	395,695,400	
36	30年国債	90,000,000	104,826,600	
37	30年国債	385,000,000	441,741,300	
38	30年国債	220,000,000	248,421,800	
39	30年国債	220,000,000	252,192,600	
40	30年国債	240,000,000	270,739,200	
41	30年国債	240,000,000	266,282,400	
42	30年国債	280,000,000	310,696,400	
43	30年国債	225,000,000	249,693,750	
44	30年国債	290,000,000	321,853,600	
45	30年国債	315,000,000	337,355,550	
46	30年国債	315,000,000	337,261,050	
47	30年国債	540,000,000	588,670,200	
49	30年国債	345,000,000	362,143,050	
50	30年国債	325,000,000	301,619,500	
51	30年国債	265,000,000	218,765,450	
52	30年国債	213,000,000	184,042,650	
53	30年国債	277,000,000	244,319,540	
54	30年国債	75,000,000	69,100,500	
55	30年国債	275,000,000	252,722,250	
56	30年国債	300,000,000	274,986,000	
57	30年国債	305,000,000	278,843,200	
58	30年国債	420,000,000	382,981,200	
59	30年国債	280,000,000	248,598,000	
60	30年国債	310,000,000	287,670,700	
61	30年国債	285,000,000	251,104,950	
62	30年国債	235,000,000	195,879,550	
63	30年国債	230,000,000	185,752,600	
64	30年国債	255,000,000	205,007,250	
65	30年国債	235,000,000	188,611,000	
66	30年国債	310,000,000	247,435,800	
67	30年国債	320,000,000	269,328,000	
68	30年国債	390,000,000	327,502,500	
69	30年国債	310,000,000	267,235,500	
70	30年国債	350,000,000	301,105,000	
71	30年国債	370,000,000	317,656,100	
72	30年国債	340,000,000	291,590,800	

73	30年国債	290,000,000	248,451,700	
74	30年国債	320,000,000	297,004,800	
75	30年国債	210,000,000	210,000,000	
76	30年国債	370,000,000	379,490,500	
77	30年国債	350,000,000	376,113,500	
75	20年国債	490,000,000	510,511,400	
78	20年国債	590,000,000	615,210,700	
82	20年国債	620,000,000	652,500,400	
84	20年国債	500,000,000	527,485,000	
85	20年国債	645,000,000	685,409,250	
88	20年国債	742,000,000	796,707,660	
89	20年国債	20,000,000	21,410,800	
90	20年国債	580,000,000	623,621,800	
92	20年国債	324,000,000	348,620,760	
93	20年国債	632,000,000	680,088,880	
95	20年国債	305,000,000	333,230,800	
97	20年国債	327,000,000	357,322,710	
99	20年国債	153,000,000	167,112,720	
100	20年国債	207,000,000	227,828,340	
101	20年国債	355,000,000	394,195,550	
102	20年国債	457,000,000	509,756,080	
105	20年国債	370,000,000	408,568,800	
106	20年国債	370,000,000	410,563,100	
107	20年国債	378,000,000	418,956,300	
109	20年国債	140,000,000	154,040,600	
111	20年国債	386,000,000	433,018,660	
113	20年国債	227,000,000	254,081,100	
114	20年国債	263,000,000	295,377,930	
116	20年国債	100,000,000	113,324,000	
118	20年国債	200,000,000	224,382,000	
119	20年国債	295,000,000	326,803,950	
120	20年国債	200,000,000	218,744,000	
121	20年国債	55,000,000	61,422,900	
122	20年国債	330,000,000	366,135,000	
123	20年国債	80,000,000	90,782,400	
124	20年国債	190,000,000	214,181,300	
125	20年国債	205,000,000	234,811,100	
126	20年国債	180,000,000	203,311,800	
127	20年国債	145,000,000	162,658,100	
128	20年国債	65,000,000	73,044,400	
130	20年国債	155,000,000	173,344,250	
131	20年国債	380,000,000	421,860,800	
132	20年国債	450,000,000	500,778,000	
133	20年国債	190,000,000	213,041,300	
134	20年国債	200,000,000	224,628,000	

135	20年国債	155,000,000	172,747,500	
136	20年国債	120,000,000	132,703,200	
137	20年国債	185,000,000	206,395,250	
139	20年国債	60,000,000	66,406,800	
140	20年国債	420,000,000	469,001,400	
141	20年国債	360,000,000	402,134,400	
142	20年国債	240,000,000	270,319,200	
143	20年国債	150,000,000	166,161,000	
144	20年国債	170,000,000	186,702,500	
145	20年国債	110,000,000	122,969,000	
146	20年国債	195,000,000	218,099,700	
147	20年国債	260,000,000	288,277,600	
148	20年国債	319,000,000	350,427,880	
149	20年国債	495,000,000	543,683,250	
150	20年国債	451,000,000	490,394,850	
151	20年国債	840,000,000	894,054,000	
152	20年国債	160,000,000	170,214,400	
153	20年国債	527,000,000	566,308,930	
154	20年国債	440,000,000	467,302,000	
155	20年国債	410,000,000	425,071,600	
157	20年国債	495,000,000	462,334,950	
158	20年国債	380,000,000	368,178,200	
159	20年国債	388,000,000	380,065,400	
160	20年国債	295,000,000	292,215,200	
161	20年国債	380,000,000	370,553,200	
162	20年国債	410,000,000	398,614,300	
163	20年国債	430,000,000	417,052,700	
164	20年国債	405,000,000	385,960,950	
165	20年国債	410,000,000	389,389,300	
166	20年国債	445,000,000	434,110,850	
167	20年国債	480,000,000	452,985,600	
168	20年国債	450,000,000	416,614,500	
169	20年国債	400,000,000	363,020,000	
170	20年国債	405,000,000	366,014,700	
171	20年国債	385,000,000	346,707,900	
172	20年国債	480,000,000	438,297,600	
173	20年国債	365,000,000	332,153,650	
174	20年国債	550,000,000	498,778,500	
175	20年国債	565,000,000	519,811,300	
176	20年国債	670,000,000	614,390,000	
177	20年国債	590,000,000	529,825,900	
178	20年国債	500,000,000	456,115,000	
179	20年国債	400,000,000	363,928,000	
180	20年国債	500,000,000	479,500,000	
181	20年国債	450,000,000	438,520,500	

	1 8 2	2 0 年国債	410,000,000	412,972,500	
	1 8 3	2 0 年国債	440,000,000	465,880,800	
		国債証券 小計		94,923,942,650	
地方債証券	7 2 7	東京都公債	500,000,000	502,458,000	
	1	東京都 3 0 年	100,000,000	114,227,200	
	8	東京都 3 0 年	400,000,000	466,366,400	
	1 3	東京都 3 0 年	500,000,000	563,876,000	
	6	東京都 2 0 年	100,000,000	103,754,300	
	2 6 - 1 5	北海道公債	100,000,000	100,675,800	
	3 0 - 1 8	北海道公債	200,000,000	197,275,600	
	2 0 8	神奈川県公債	200,000,000	201,269,000	
	2 1 0	神奈川県公債	100,000,000	100,671,000	
	2 1 1	神奈川県公債	100,000,000	100,650,800	
	1	神奈川県 2 0 年	100,000,000	103,009,100	
	3	神奈川県 2 0 年	100,000,000	104,476,000	
	7	神奈川県 2 0 年	100,000,000	107,984,900	
	1 3	神奈川県 2 0 年	100,000,000	111,840,300	
	3 7 7	大阪府公債	100,000,000	100,389,600	
	3 8 8	大阪府公債	100,000,000	100,711,900	
	3 9 2	大阪府公債	100,000,000	100,519,600	
	1 9 3	大阪府 5 年	300,000,000	297,600,600	
	2 7 - 4	京都府公債	100,000,000	101,070,600	
	1 - 6	京都府 5 年	200,000,000	199,910,600	
	5	兵庫県公債 1 5 年	300,000,000	315,215,100	
	1 0	兵庫県公債 2 0 年	100,000,000	111,928,600	
	7	静岡県 3 0 年	100,000,000	113,578,800	
	1	静岡県 2 0 年	100,000,000	105,125,200	
	2 2 - 8	愛知県 2 0 年	200,000,000	220,401,600	
	2 7 - 1 6	愛知県公債	400,000,000	404,130,400	
	2 5 - 1 1	福岡県公債	100,000,000	100,606,200	
	2 6 - 3	福岡県公債	100,000,000	100,730,700	
	2 6 - 1 0	福岡県公債	100,000,000	100,755,400	
	1 - 1	福岡県公債	200,000,000	195,789,400	
	1 - 3	福岡県 3 0 年	100,000,000	78,224,800	
	2 5 - 8	千葉県公債	100,000,000	100,410,800	
	2 6 - 4	千葉県公債	100,000,000	100,751,900	
	1 3 7	共同発行地方	200,000,000	201,460,000	
	1 3 8	共同発行地方	200,000,000	201,503,800	
	1 7 2	共同発行地方	500,000,000	500,148,000	
	1 8 3	共同発行地方	600,000,000	597,175,800	
	1 - 1	大阪市 5 年	300,000,000	299,991,900	
	1	名古屋市 2 0 年	200,000,000	202,736,800	
	3	名古屋市 2 0 年	100,000,000	104,296,800	
	5	名古屋市 2 0 年	100,000,000	107,427,600	
	1	京都市 3 0 年	100,000,000	120,791,900	

	7 京都市 20年	100,000,000	111,119,000	
	26-4 神戸市公債	200,000,000	201,473,400	
	26-17 神戸市公債	100,000,000	100,408,600	
	26-3 横浜市公債	200,000,000	201,480,400	
	4 横浜市 20年	100,000,000	103,814,200	
	9 横浜市 20年	100,000,000	107,143,600	
	14 横浜市 20年	100,000,000	110,025,100	
	26-4 札幌市公債	100,000,000	100,625,000	
	94 川崎市公債	100,000,000	96,127,400	
	1-2 北九州市 5年	100,000,000	99,953,400	
	地方債証券 小計		9,394,088,900	
特殊債券	47 日本政策投資CO	100,000,000	103,519,600	
	3 政保政策投資CO	200,000,000	202,914,600	
	36 日本政策投資B	100,000,000	107,892,700	
	18 道路機構	100,000,000	128,930,600	
	22 道路機構	300,000,000	374,678,400	
	27 道路機構	100,000,000	108,988,100	
	37 道路機構	300,000,000	331,194,000	
	47 道路機構	200,000,000	223,399,600	
	79 政保道路機構	200,000,000	221,548,200	
	81 政保道路機構	200,000,000	221,806,800	
	88 政保道路機構	100,000,000	119,579,700	
	90 政保道路機構	500,000,000	556,564,000	
	99 政保道路機構	100,000,000	112,407,400	
	176 政保道路機構	100,000,000	109,761,400	
	196 政保道路機構	100,000,000	110,328,000	
	210 政保道路機構	200,000,000	216,339,600	
	227 政保道路機構	200,000,000	201,604,400	
	231 政保道路機構	300,000,000	302,388,600	
	288 政保道路機構	189,000,000	188,435,268	
	9 道路債券	100,000,000	119,622,100	
	2 地方公営 20年	100,000,000	111,012,400	
	61 地方公共団体	100,000,000	100,755,000	
	62 地方公共団体	400,000,000	402,833,600	
	63 地方公共団体	100,000,000	100,671,200	
	64 地方公共団体	100,000,000	100,682,200	
	67 政保地方公共団	100,000,000	100,762,700	
	101 地方公共団体	100,000,000	99,548,900	
	106 地方公共団体	200,000,000	198,458,400	
	5 公営企業 20年	100,000,000	100,904,500	
	17 公営企業 20年	100,000,000	106,480,800	
	20 公営企業 20年	100,000,000	107,715,700	
	22 公営企業 20年	100,000,000	108,346,000	
	24 公営企業 20年	200,000,000	219,038,800	
	117 都市再生	100,000,000	101,777,700	

5 2	住宅支援機構	100,000,000	110,339,400	
9 3	住宅支援機構	100,000,000	104,750,300	
1 2 4	住宅支援機構	100,000,000	105,054,100	
1 3 0	住宅支援機構	200,000,000	218,633,400	
2 2 6	住宅支援機構	100,000,000	99,533,900	
S 3	住宅機構 R M B S	9,899,000	9,983,141	
S 5	住宅機構 R M B S	20,992,000	21,159,936	
S 7	住宅機構 R M B S	10,731,000	10,891,965	
S 9	住宅機構 R M B S	11,024,000	11,213,612	
S 1 0	住宅機構 R M B S	10,830,000	10,997,865	
S 1 1	住宅機構 R M B S	11,651,000	11,922,468	
3 5	住宅金融 R M B S	10,559,000	10,638,192	
4 1	住宅金融 R M B S	10,297,000	10,381,435	
5 3	住宅金融 R M B S	10,201,000	10,286,688	
2	住宅機構 R M B S	20,858,000	21,049,893	
1 9	住宅機構 R M B S	14,168,000	14,714,884	
2 4	住宅機構 R M B S	28,436,000	29,672,966	
2 6	住宅機構 R M B S	45,423,000	47,457,950	
2 7	住宅機構 R M B S	15,850,000	16,583,855	
2 8	住宅機構 R M B S	18,276,000	19,257,421	
2 9	住宅機構 R M B S	19,839,000	20,959,903	
3 0	住宅機構 R M B S	19,469,000	20,567,051	
3 2	住宅機構 R M B S	38,478,000	40,386,508	
3 5	住宅機構 R M B S	19,531,000	20,529,034	
3 6	住宅機構 R M B S	18,874,000	19,772,402	
4 3	住宅機構 R M B S	24,121,000	25,288,456	
4 6	住宅機構 R M B S	18,853,000	19,784,338	
4 8	住宅機構 R M B S	35,606,000	37,315,088	
4 9	住宅機構 R M B S	18,152,000	18,957,948	
5 1	住宅機構 R M B S	39,530,000	41,245,602	
5 5	住宅機構 R M B S	52,840,000	54,958,884	
5 7	住宅機構 R M B S	25,256,000	26,281,393	
5 8	住宅機構 R M B S	28,285,000	29,439,028	
5 9	住宅機構 R M B S	54,042,000	56,311,764	
6 0	住宅機構 R M B S	82,215,000	85,314,505	
6 1	住宅機構 R M B S	27,633,000	28,580,811	
6 7	住宅機構 R M B S	35,067,000	35,968,221	
6 9	住宅機構 R M B S	72,904,000	75,470,220	
7 0	住宅機構 R M B S	63,562,000	65,710,395	
7 3	住宅機構 R M B S	36,375,000	37,695,412	
9 9	住宅機構 R M B S	56,203,000	56,793,131	
1 2 3	住宅機構 R M B S	73,879,000	72,135,455	
1 2 4	住宅機構 R M B S	73,674,000	71,714,271	
1 2 5	住宅機構 R M B S	73,699,000	71,745,976	
1 2 7	住宅機構 R M B S	75,639,000	73,430,341	

	1 2 8 住宅機構R M B S	74,578,000	72,542,020	
	1 2 9 住宅機構R M B S	76,301,000	74,370,584	
	1 3 7 住宅機構R M B S	78,662,000	76,506,661	
	1 6 7 住宅機構R M B S	91,425,000	87,722,287	
	1 8 3 住宅機構R M B S	194,732,000	187,721,648	
	1 8 6 住宅機構R M B S	98,427,000	96,793,111	
	8 5 中日本高速道	300,000,000	298,965,900	
	特殊債券 小計		8,916,392,687	
社債券	2 BPCE S.A.	200,000,000	200,007,400	
	8 6 東日本高速道	200,000,000	197,970,600	
	2 0 西日本高速道	100,000,000	100,298,400	
	2 3 西日本高速道	100,000,000	100,594,800	
	1 3 大和ハウス	100,000,000	99,524,600	
	1 7 アサヒグループHD	200,000,000	199,017,000	
	3 0 東レ	100,000,000	99,753,300	
	5 6 住友化学	200,000,000	198,379,000	
	2 4 三菱ケミカルホールデイ	100,000,000	98,809,400	
	1 6 日立製作所	100,000,000	100,461,200	
	2 2 パナソニック	100,000,000	98,523,400	
	9 TDK	100,000,000	98,071,100	
	6 3 三井物産	100,000,000	107,689,500	
	8 みずほコーポレート	100,000,000	108,965,700	
	1 三井住友FG劣後	100,000,000	100,263,100	
	8 住友信託 劣後	100,000,000	106,316,600	
	1 みずほFG劣後	100,000,000	100,288,300	
	9 みずほ銀行劣後	100,000,000	106,320,900	
	1 7 NTTファイナンス	200,000,000	198,175,200	
	7 3 ホンダファイナンス	200,000,000	197,831,200	
	2 0 7 オリックス	200,000,000	198,007,200	
	2 三菱HCキャピタル	200,000,000	197,255,600	
	1 野村ホールディングス	100,000,000	99,922,100	
	5 8 三菱地所	100,000,000	118,186,600	
	1 3 5 三菱地所	200,000,000	191,820,000	
	1 0 東急	100,000,000	95,226,800	
	3 8 京王電鉄	100,000,000	99,353,700	
	1 1 0 東日本旅客鉄	100,000,000	104,946,500	
	1 6 9 東日本旅客鉄	200,000,000	189,260,000	
	6 0 西日本旅客鉄	200,000,000	193,540,600	
	4 1 東海旅客鉄道	100,000,000	109,138,300	
	4 2 東海旅客鉄道	100,000,000	110,180,400	
	4 5 東京地下鉄	100,000,000	96,063,600	
	6 4 阪急阪神HLDG	100,000,000	99,118,200	
	3 1 KDDI	200,000,000	199,494,400	
	5 4 6 中部電力	200,000,000	188,190,800	
	5 5 3 中部電力	200,000,000	198,137,200	

550	関西電力	300,000,000	297,870,600	
508	東北電力	200,000,000	196,572,800	
547	東北電力	100,000,000	98,359,700	
496	九州電力	300,000,000	282,533,700	
38	東京電力パワー	100,000,000	99,858,600	
56	東京電力P G	200,000,000	200,166,200	
41	大阪瓦斯	200,000,000	189,975,000	
7	ファーストリテイリング	100,000,000	99,084,600	
	社債券 小計		6,569,523,900	
	合計		119,803,948,137	

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)

	(2022年4月13日現在)	(2023年4月13日現在)
資産の部		
流動資産		
預金	1,936,532,460	5,775,149,329
金銭信託	75,671,589	118,672,156
コール・ローン	2,902,715,751	2,658,551,523
株式	372,473,853,310	452,167,668,517
投資証券	9,939,902,140	10,477,751,964
派生商品評価勘定	71,064,623	356,501,053
未収入金	24,703,555	31,924,259
未収配当金	456,665,778	579,126,829
差入委託証拠金	1,059,785,844	2,499,768,060
流動資産合計	388,940,895,050	474,665,113,690
資産合計	388,940,895,050	474,665,113,690
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	45,750,848	14,936,060
未払金	-	34,451,469
未払解約金	582,876,494	243,648,981
その他未払費用	2,331	3,236
流動負債合計	628,629,673	293,039,746
負債合計	628,629,673	293,039,746
純資産の部		
元本等		
元本	63,653,360,828	76,203,741,596
剰余金		
剰余金又は欠損金()	324,658,904,549	398,168,332,348
元本等合計	388,312,265,377	474,372,073,944
純資産合計	388,312,265,377	474,372,073,944

負債純資産合計

388,940,895,050

474,665,113,690

(2) 注記表

(重要な会計方針の注記)

項目	自 2022年4月14日 至 2023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. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	<p>外貨建資産等の会計処理 「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。</p>

(重要な会計上の見積りに関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

項目	(2022年4月13日現在)	(2023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	63,653,360,828口	76,203,741,596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 6.2250円 (1万口当たりの純資産額62,250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 2022年4月14日 至 2023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、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。 当計算期間については、先物取引、為替予約取引を行っております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する会議をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用部署に是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用部署は、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。なお、投資信託協会の流動性リスク管理規制に抵触する場合には、流動性リスクを管理する会議で審議の上、流動性リスクの管理責任者が対処方針を決定します。その後、決定した対処方針やその実施等について、リスク管理会議に報告を行う体制となっております。</p> <p>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド(外部ファンド)を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する会議にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。</p>

. 金融商品の時価等に関する事項

項 目	(2023年4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。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等による場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。

(デリバティブ取引に関する注記)

(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
	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

市場取引以外の取引	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

(2023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 JUN23	8,422,894,626	-	8,676,492,264	253,597,638
	SPI 200 FUTURES JUN23	429,254,300	-	443,294,640	14,040,340
	FTSE 100 IDX FUT JUN23	517,570,803	-	533,896,424	16,325,621
	EURO STOXX 50 JUN23	1,765,092,482	-	1,827,225,317	62,132,835
	小計	11,134,812,211	-	11,480,908,645	346,096,434
	合計	11,134,812,211	-	11,480,908,645	346,096,434

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価の算定方法については以下のように評価しております。

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

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

2) 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち 1年超		
	為替予約取引 買建				

市場取引以 外の取引	アメリカ・ドル	1,894,133,620	-	1,888,571,564	5,562,056
	オーストラリア・ドル	26,798,601	-	26,846,942	48,341
	シンガポール・ドル	25,095,675	-	25,091,250	4,425
	イギリス・ポンド	117,333,317	-	117,504,875	171,558
	スイス・フラン	91,414,226	-	91,802,689	388,463
	ユーロ	264,150,969	-	265,028,030	877,061
	小計	2,418,926,408	-	2,414,845,350	4,081,058
	売建				
	アメリカ・ドル	215,817,534	-	215,821,422	3,888
	カナダ・ドル	45,192,192	-	45,112,112	80,080
スウェーデン・ク ローナ	35,874,966	-	36,398,818	523,852	
ユーロ	43,382,825	-	43,385,548	2,723	
小計	340,267,517	-	340,717,900	450,383	
合 計	2,759,193,925	-	2,755,563,250	4,531,441	

(注) 1. 時価の算定方法

為替予約取引の時価の算定方法については以下のように評価しております。

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

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

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

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

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

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

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

自 2022年4月14日
至 2023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)

(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
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)	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N I S A・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D S・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N I S A・世界分散ファンド	43,921,433円
三井住友D S・外国株式インデックス年金ファンド	745,787,382円
三井住友D S・年金バランス30(債券重点型)	4,562,841円
三井住友D S・年金バランス50(標準型)	20,366,246円
三井住友D S・年金バランス70(株式重点型)	19,837,949円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2060	1,976,165円
S M B C・DCインデックスファンド(M S C I コクサイ)	170,769,804円
日興F W S・先進国株インデックス(為替ヘッジあり)	162,944,584円
日興F W S・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D S・先進国株式インデックス・ファンド	21,467,988円
S M A M・外国株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	509,401,113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 >	3,309,072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 >	25,733,245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 >	627,813,023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 >	773,029,117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 >	3,346,842,453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 >	10,889,499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 >	56,580,424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 >	451,874,051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 >	37,545,497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 >	93,355,655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 >	461,868,419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 >	326,103,369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 >	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

(2023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	63,653,360,828円
同期中における追加設定元本額	22,909,073,594円
同期中における一部解約元本額	10,358,692,826円
2023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	38,145,564,153円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	298,898,252円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	1,140,482,332円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	835,411,248円
SMAM・グローバルバランスファンド(機動的資産配分型)	35,335,134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)	1,016,278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)	5,550,898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)	17,828,630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)	52,498,611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)	60,451,799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)	112,145,937円
外国株式指数ファンド	987,579,804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	19,632,434,294円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	98,647,755円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	137,664,681円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	85,754,219円
イオン・バランス戦略ファンド	27,378,779円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050	24,361,752円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	145,060,261円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	131,273,820円

三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	485,411,437円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	261,652,436円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	302,698,472円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	60,821,912円
三井住友DS・外国株式インデックス年金ファンド	1,973,496,097円
三井住友DS・年金バランス30(債券重点型)	12,262,423円
三井住友DS・年金バランス50(標準型)	55,814,025円
三井住友DS・年金バランス70(株式重点型)	50,069,070円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	3,075,948円
SMBC・DCインデックスファンド(MSCIコクサイ)	627,241,642円
日興FWS・先進国株インデックス(為替ヘッジあり)	319,863,372円
日興FWS・先進国株インデックス(為替ヘッジなし)	1,791,228,980円
三井住友DS・先進国株式インデックス・ファンド	71,441,453円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2035	22,505円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2040	27,108円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2045	33,586円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2055	39,724円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2065	39,724円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル1(保守型)	10,556円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル2(安定型)	15,546円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル3(安定成長型)	18,945円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル4(成長型)	21,986円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル5(積極成長型)	25,027円
SMAM・外国株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	415,792,476円
バランスファンドVA(安定運用型) < 適格機関投資家限定 >	3,187,817円
SMAM・バランスファンドVA安定成長型 < 適格機関投資家限定 >	18,661,339円
SMAM・バランスファンドVA25 < 適格機関投資家専用 >	485,243,320円
SMAM・バランスファンドVA37.5 < 適格機関投資家専用 >	677,661,461円
SMAM・バランスファンドVA50 < 適格機関投資家専用 >	2,951,776,006円
SMAM・バランスファンドVL30 < 適格機関投資家限定 >	9,822,476円
SMAM・バランスファンドVL50 < 適格機関投資家限定 >	47,808,223円
SMAM・バランスファンドVA75 < 適格機関投資家専用 >	402,126,462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 >	35,766,460円
SMAM・インデックス・バランスVA25 < 適格機関投資家専用 >	84,832,561円
SMAM・インデックス・バランスVA50 < 適格機関投資家専用 >	411,687,872円
SMAM・バランスファンドVA40 < 適格機関投資家専用 >	285,500,776円
SMAM・バランスファンドVA35 < 適格機関投資家専用 >	651,589,743円
SMAM・バランスVA株40T < 適格機関投資家限定 >	195,290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)	184,667,496円
SMAM・グローバルバランス40VA < 適格機関投資家限定 >	56,631,240円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A < 適格機関投資家専用 >	7,051,860円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A < 適格機関投資家専用 >	6,575,296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 >	16,578,047円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L < 適格機関投資家専用 >	51,140,413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 >	103,245,103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 >	44,957,268円
SMAM・世界バランスファンドVA < 適格機関投資家限定 >	245,130,060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 >	68,183,758円
S M A M ・ 外国株式インデックスファンドS A < 適格機関投資家限定 >	678,535,453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 >	21,466,696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 >	14,979,993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 >	19,482,776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 >	208,960,218円
合 計	76,203,741,596円

(3) 附属明細表

有価証券明細表

(a) 株式

通貨	銘柄	株数	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカ・ドル	APA CORP	19,759	39.640	783,246.76	
	BAKER HUGHES CO	69,679	29.250	2,038,110.75	
	CHENIERE ENERGY INC	14,977	153.010	2,291,630.77	
	CHESAPEAKE ENERGY CORP	7,695	79.050	608,289.75	
	CHEVRON CORP	127,235	169.820	21,607,047.70	
	CONOCOPHILLIPS	86,690	107.530	9,321,775.70	
	COTERRA ENERGY INC	49,908	25.760	1,285,630.08	
	DEVON ENERGY CORP	44,032	54.540	2,401,505.28	
	DIAMONDBACK ENERGY INC	11,049	145.010	1,602,215.49	
	EOG RESOURCES INC	39,908	122.310	4,881,147.48	
	EQT CORP	19,298	32.650	630,079.70	
	EXXON MOBIL CORP	284,707	115.230	32,806,787.61	
	HALLIBURTON CO	59,461	33.590	1,997,294.99	
	HESS CORP	18,976	146.170	2,773,721.92	
	HF SINCLAIR CORP	10,663	46.340	494,123.42	
	KINDER MORGAN INC	138,727	17.820	2,472,115.14	
	MARATHON OIL CORP	42,380	25.620	1,085,775.60	
	MARATHON PETROLEUM CORP	33,195	130.220	4,322,652.90	
	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	51,961	64.840	3,369,151.24	
	ONEOK INC	31,946	66.250	2,116,422.50	
	OVINTIV INC	16,672	38.440	640,871.68	
	PHILLIPS 66	33,814	106.030	3,585,298.42	
	PIONEER NATURAL RESOURCES CO	15,440	225.100	3,475,544.00	
	SCHLUMBERGER LTD	99,086	51.980	5,150,490.28	
	TARGA RESOURCES CORP	15,416	76.120	1,173,465.92	
	TEXAS PACIFIC LAND CORP	417	1,735.900	723,870.30	
VALERO ENERGY CORP	27,588	133.720	3,689,067.36		
WILLIAMS COS INC	82,707	30.330	2,508,503.31		
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	15,122	287.170	4,342,584.74		

ALBEMARLE CORP	8,338	201.700	1,681,774.60	
ALCOA CORP	11,849	39.640	469,694.36	
AMCOR PLC	97,610	11.020	1,075,662.20	
AVERY DENNISON CORP	5,454	177.190	966,394.26	
BALL CORP	23,469	50.750	1,191,051.75	
CELANESE CORP	6,643	109.660	728,471.38	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	14,020	77.060	1,080,381.20	
CLEVELAND-CLIFFS INC	33,403	18.030	602,256.09	
CORTEVA INC	48,566	61.790	3,000,893.14	
CROWN HOLDINGS INC	9,413	76.940	724,236.22	
DOW INC	48,964	56.890	2,785,561.96	
DUPONT DE NEMOURS INC	34,201	70.830	2,422,456.83	
EASTMAN CHEMICAL CO	9,517	83.010	790,006.17	
ECOLAB INC	18,131	164.250	2,978,016.75	
FMC CORP	8,548	122.500	1,047,130.00	
FREEMPORT-MCMORAN INC	99,638	41.120	4,097,114.56	
INTERNATIONAL PAPER CO	23,472	36.470	856,023.84	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	17,659	92.550	1,634,340.45	
LINDE PLC	33,937	359.350	12,195,260.95	
LYONDELLBASELL INDU-CL A	17,144	97.210	1,666,568.24	
MARTIN MARIETTA MATERIALS	4,203	346.060	1,454,490.18	
MOSAIC CO/THE	25,489	46.760	1,191,865.64	
NEWMONT CORP	55,957	49.710	2,781,622.47	
NUCOR CORP	17,484	147.660	2,581,687.44	
PACKAGING CORP OF AMERICA	7,111	142.190	1,011,113.09	
PPG INDUSTRIES INC	16,735	138.010	2,309,597.35	
RELIANCE STEEL & ALUMINUM	4,056	246.170	998,465.52	
RPM INTERNATIONAL INC	7,696	81.890	630,225.44	
SEALED AIR CORP	7,895	46.210	364,827.95	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	17,193	225.780	3,881,835.54	
STEEL DYNAMICS INC	12,713	106.570	1,354,824.41	
VULCAN MATERIALS CO	8,762	167.320	1,466,057.84	
WESTLAKE CORP	2,189	117.550	257,316.95	
WESTROCK CO	16,766	30.180	505,997.88	
3M CO	37,053	104.370	3,867,221.61	
AECOM	10,261	82.210	843,556.81	
AERCAP HOLDINGS NV	10,065	55.500	558,607.50	
ALLEGION PLC	6,843	101.550	694,906.65	
AMETEK INC	16,587	138.530	2,297,797.11	
AXON ENTERPRISE INC	4,672	222.220	1,038,211.84	
BOEING CO/THE	38,897	212.340	8,259,388.98	
CARLISLE COS INC	3,499	210.600	736,889.40	
CARRIER GLOBAL CORP	55,822	43.860	2,448,352.92	
CATERPILLAR INC	36,294	220.500	8,002,827.00	

CUMMINS INC	10,159	232.820	2,365,218.38	
DEERE & CO	20,015	384.390	7,693,565.85	
DOVER CORP	10,436	147.120	1,535,344.32	
EATON CORP PLC	28,066	162.220	4,552,866.52	
EMERSON ELECTRIC CO	39,768	83.640	3,326,195.52	
FASTENAL CO	41,551	52.560	2,183,920.56	
FERGUSON PLC	14,464	127.480	1,843,870.72	
FORTIVE CORP	21,981	66.830	1,468,990.23	
FORTUNE BRANDS INNOVATIONS I	7,166	58.240	417,347.84	
GENERAC HOLDINGS INC	3,973	100.140	397,856.22	
GENERAL DYNAMICS CORP	15,874	229.240	3,638,955.76	
GENERAL ELECTRIC CO	74,672	94.100	7,026,635.20	
GRACO INC	11,645	70.660	822,835.70	
HEICO CORP	3,085	169.060	521,550.10	
HEICO CORP-CLASS A	4,570	133.930	612,060.10	
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	45,877	193.230	8,864,812.71	
HOWMET AEROSPACE INC	23,889	43.410	1,037,021.49	
HUBBELL INC	3,897	226.770	883,722.69	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	2,888	210.530	608,010.64	
IDEX CORP	4,788	221.860	1,062,265.68	
ILLINOIS TOOL WORKS	20,720	232.350	4,814,292.00	
INGERSOLL-RAND INC	29,314	56.420	1,653,895.88	
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	11,600	48.790	565,964.00	
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	46,593	57.370	2,673,040.41	
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	12,963	199.620	2,587,674.06	
LENNOX INTERNATIONAL INC	2,104	247.100	519,898.40	
LOCKHEED MARTIN CORP	16,474	488.100	8,040,959.40	
MASCO CORP	14,885	48.390	720,285.15	
NORDSON CORP	3,927	216.770	851,255.79	
NORTHROP GRUMMAN CORP	10,242	472.770	4,842,110.34	
OTIS WORLDWIDE CORP	28,787	80.730	2,323,974.51	
OWENS CORNING	7,597	98.040	744,809.88	
PACCAR INC	36,912	72.110	2,661,724.32	
PARKER HANNIFIN CORP	8,744	324.520	2,837,602.88	
PENTAIR PLC	11,509	53.170	611,933.53	
PLUG POWER INC	28,584	9.390	268,403.76	
QUANTA SERVICES INC	10,416	165.000	1,718,640.00	
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	100,547	101.520	10,207,531.44	
ROCKWELL AUTOMATION INC	7,930	281.120	2,229,281.60	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	12,538	46.750	586,151.50	
SMITH (A.O.) CORP	7,157	66.020	472,505.14	
SNAP-ON INC	4,041	237.930	961,475.13	
STANLEY BLACK & DECKER INC	9,129	78.110	713,066.19	
TEXTRON INC	14,870	67.670	1,006,252.90	

TORO CO	8,097	104.160	843,383.52	
TRANE TECHNOLOGIES PLC	15,733	174.900	2,751,701.70	
TRANSDIGM GROUP INC	3,706	745.430	2,762,563.58	
UNITED RENTALS INC	4,798	376.070	1,804,383.86	
WABTEC CORP	11,284	99.620	1,124,112.08	
WW GRAINGER INC	3,160	655.380	2,071,000.80	
XYLEM INC	12,201	103.490	1,262,681.49	
AUTOMATIC DATA PROCESSING	28,752	215.610	6,199,218.72	
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	8,029	96.620	775,761.98	
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO	7,244	145.530	1,054,219.32	
CINTAS CORP	6,178	453.940	2,804,441.32	
CLARIVATE PLC	19,939	8.990	179,251.61	
COPART INC	31,082	76.140	2,366,583.48	
COSTAR GROUP INC	28,273	68.590	1,939,245.07	
EQUIFAX INC	7,922	195.590	1,549,463.98	
JACOBS SOLUTIONS INC	8,422	114.350	963,055.70	
LEIDOS HOLDINGS INC	8,863	92.680	821,422.84	
PAYCHEX INC	22,937	108.410	2,486,600.17	
REPUBLIC SERVICES INC	16,065	136.980	2,200,583.70	
ROBERT HALF INTL INC	8,149	73.940	602,537.06	
ROLLINS INC	16,081	39.170	629,892.77	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	14,487	57.240	829,235.88	
TRANSUNION	14,503	62.670	908,903.01	
VERISK ANALYTICS INC	11,250	192.170	2,161,912.50	
WASTE CONNECTIONS INC	18,291	142.420	2,605,004.22	
WASTE MANAGEMENT INC	28,817	165.500	4,769,213.50	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	8,726	94.730	826,613.98	
CSX CORP	145,813	30.160	4,397,720.08	
DELTA AIR LINES INC	8,299	33.740	280,008.26	
EXPEDITORS INTL WASH INC	10,436	109.770	1,145,559.72	
FEDEX CORP	16,733	229.470	3,839,721.51	
GRAB HOLDINGS LTD - CL A	96,661	2.990	289,016.39	
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	5,530	175.470	970,349.10	
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	12,089	56.570	683,874.73	
NORFOLK SOUTHERN CORP	15,994	206.320	3,299,882.08	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	6,292	340.060	2,139,657.52	
SOUTHWEST AIRLINES CO	7,076	32.240	228,130.24	
UBER TECHNOLOGIES INC	104,406	30.590	3,193,779.54	
U-HAUL HOLDING CO-NON VOTING	5,850	53.720	314,262.00	
UNION PACIFIC CORP	42,525	198.730	8,450,993.25	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	49,837	189.850	9,461,554.45	
APTIV PLC	18,724	104.190	1,950,853.56	
BORGWARNER INC	17,433	48.070	838,004.31	
FORD MOTOR CO	276,446	12.670	3,502,570.82	

GENERAL MOTORS CO	96,958	34.620	3,356,685.96	
LEAR CORP	3,736	134.460	502,342.56	
LUCID GROUP INC	21,730	8.130	176,664.90	
RIVIAN AUTOMOTIVE INC-A	19,354	14.190	274,633.26	
TESLA INC	185,930	180.540	33,567,802.20	
DR HORTON INC	23,515	98.860	2,324,692.90	
GARMIN LTD	10,774	98.280	1,058,868.72	
HASBRO INC	7,491	51.300	384,288.30	
LENNAR CORP-A	17,126	105.390	1,804,909.14	
LULULEMON ATHLETICA INC	8,357	363.540	3,038,103.78	
MOHAWK INDUSTRIES INC	2,863	97.830	280,087.29	
NEWELL BRANDS INC	26,997	12.210	329,633.37	
NIKE INC -CL B	86,051	123.660	10,641,066.66	
NVR INC	204	5,590.220	1,140,404.88	
PULTEGROUP INC	17,535	59.750	1,047,716.25	
VF CORP	20,583	21.570	443,975.31	
WHIRLPOOL CORP	3,212	133.950	430,247.40	
AIRBNB INC-CLASS A	25,852	112.420	2,906,281.84	
ARAMARK	13,242	35.020	463,734.84	
BOOKING HOLDINGS INC	2,713	2,547.250	6,910,689.25	
CAESARS ENTERTAINMENT INC	13,336	44.120	588,384.32	
CARNIVAL CORP	69,745	9.620	670,946.90	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	1,953	1,695.770	3,311,838.81	
DARDEN RESTAURANTS INC	7,606	151.740	1,154,134.44	
DOMINO'S PIZZA INC	2,121	326.440	692,379.24	
DOORDASH INC - A	16,981	60.100	1,020,558.10	
EXPEDIA GROUP INC	10,081	89.340	900,636.54	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	19,380	138.360	2,681,416.80	
LAS VEGAS SANDS CORP	23,449	55.880	1,310,330.12	
MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A	18,185	161.470	2,936,331.95	
MCDONALD'S CORP	50,614	285.300	14,440,174.20	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	22,198	42.980	954,070.04	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	16,097	61.580	991,253.26	
STARBUCKS CORP	79,076	105.600	8,350,425.60	
VAIL RESORTS INC	2,860	237.240	678,506.40	
WYNN RESORTS LTD	7,730	106.060	819,843.80	
YUM! BRANDS INC	20,179	131.980	2,663,224.42	
ADVANCE AUTO PARTS INC	3,426	121.340	415,710.84	
AMAZON.COM INC	634,483	97.830	62,071,471.89	
AUTOZONE INC	1,315	2,598.890	3,417,540.35	
BATH & BODY WORKS INC	15,400	36.370	560,098.00	
BEST BUY CO INC	14,954	73.170	1,094,184.18	
BURLINGTON STORES INC	4,802	188.940	907,289.88	
CARMAX INC	10,366	68.580	710,900.28	

CHEWY INC - CLASS A	3,969	34.390	136,493.91	
EBAY INC	35,551	42.780	1,520,871.78	
ETSY INC	9,090	100.160	910,454.40	
GENUINE PARTS CO	10,245	166.620	1,707,021.90	
HOME DEPOT INC	70,430	290.440	20,455,689.20	
LKQ CORP	15,922	56.310	896,567.82	
LOWE'S COS INC	42,268	199.770	8,443,878.36	
MERCADOLIBRE INC	3,170	1,256.040	3,981,646.80	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	4,265	877.350	3,741,897.75	
POOL CORP	2,578	333.900	860,794.20	
ROSS STORES INC	24,702	102.890	2,541,588.78	
TJX COMPANIES INC	80,320	76.700	6,160,544.00	
TRACTOR SUPPLY COMPANY	8,071	232.640	1,877,637.44	
ULTA BEAUTY INC	3,734	523.130	1,953,367.42	
COSTCO WHOLESALE CORP	30,793	489.350	15,068,554.55	
DOLLAR GENERAL CORP	15,800	216.240	3,416,592.00	
DOLLAR TREE INC	15,923	150.170	2,391,156.91	
KROGER CO	44,568	47.320	2,108,957.76	
SYSCO CORP	36,352	74.830	2,720,220.16	
TARGET CORP	31,809	163.510	5,201,089.59	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	52,808	35.690	1,884,717.52	
WALMART INC	103,381	149.340	15,438,918.54	
ALTRIA GROUP INC	122,631	44.830	5,497,547.73	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	39,414	81.110	3,196,869.54	
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	22,643	62.560	1,416,546.08	
BUNGE LTD	10,263	94.530	970,161.39	
CAMPBELL SOUP CO	12,945	55.360	716,635.20	
COCA-COLA CO/THE	285,588	62.690	17,903,511.72	
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	13,260	59.390	787,511.40	
CONAGRA BRANDS INC	30,896	37.620	1,162,307.52	
CONSTELLATION BRANDS INC-A	11,695	226.420	2,647,981.90	
DARLING INGREDIENTS INC	10,514	59.020	620,536.28	
GENERAL MILLS INC	42,268	87.010	3,677,738.68	
HERSHEY CO/THE	10,035	258.610	2,595,151.35	
HORMEL FOODS CORP	19,475	40.220	783,284.50	
JM SMUCKER CO/THE	6,647	154.310	1,025,698.57	
KELLOGG CO	15,843	68.370	1,083,185.91	
KEURIG DR PEPPER INC	53,534	35.210	1,884,932.14	
KRAFT HEINZ CO/THE	48,205	39.280	1,893,492.40	
LAMB WESTON HOLDINGS INC	10,534	108.170	1,139,462.78	
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	18,425	85.890	1,582,523.25	
MOLSON COORS BEVERAGE CO - B	12,477	54.270	677,126.79	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	93,332	70.210	6,552,839.72	
MONSTER BEVERAGE CORP	52,042	52.470	2,730,643.74	

PEPSICO INC	94,583	182.560	17,267,072.48	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	108,150	98.790	10,684,138.50	
TYSON FOODS INC-CL A	19,731	61.580	1,215,034.98	
CHURCH & DWIGHT CO INC	17,113	89.760	1,536,062.88	
CLOROX COMPANY	9,104	157.230	1,431,421.92	
COLGATE-PALMOLIVE CO	55,341	76.050	4,208,683.05	
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	15,603	247.050	3,854,721.15	
KIMBERLY-CLARK CORP	22,991	136.730	3,143,559.43	
PROCTER & GAMBLE CO/THE	164,482	151.070	24,848,295.74	
ABBOTT LABORATORIES	121,493	102.560	12,460,322.08	
ALIGN TECHNOLOGY INC	4,914	332.250	1,632,676.50	
AMERISOURCEBERGEN CORP	10,249	165.420	1,695,389.58	
BAXTER INTERNATIONAL INC	33,018	42.670	1,408,878.06	
BECTON DICKINSON AND CO	19,828	253.850	5,033,337.80	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	99,665	51.110	5,093,878.15	
CARDINAL HEALTH INC	18,000	79.150	1,424,700.00	
CENTENE CORP	40,300	67.180	2,707,354.00	
COOPER COS INC/THE	3,384	372.880	1,261,825.92	
CVS HEALTH CORP	91,978	74.920	6,890,991.76	
DAVITA INC	4,138	83.290	344,654.02	
DENTSPLY SIRONA INC	11,864	40.510	480,610.64	
DEXCOM INC	27,694	114.820	3,179,825.08	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	44,049	82.920	3,652,543.08	
ELEVANCE HEALTH INC	16,551	492.990	8,159,477.49	
GE HEALTHCARE TECHNOLOGY	26,484	81.750	2,165,067.00	
HCA HEALTHCARE INC	15,058	272.380	4,101,498.04	
HENRY SCHEIN INC	10,457	82.170	859,251.69	
HOLOGIC INC	16,591	83.730	1,389,164.43	
HUMANA INC	8,820	532.050	4,692,681.00	
IDEXX LABORATORIES INC	5,548	470.900	2,612,553.20	
INSULET CORP	5,082	316.290	1,607,385.78	
INTUITIVE SURGICAL INC	24,730	261.770	6,473,572.10	
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	6,245	230.300	1,438,223.50	
MASIMO CORP	2,941	191.160	562,201.56	
MCKESSON CORP	10,067	362.560	3,649,891.52	
MEDTRONIC PLC	91,754	80.810	7,414,640.74	
MOLINA HEALTHCARE INC	3,809	296.050	1,127,654.45	
NOVOCURE LTD	6,929	64.170	444,633.93	
QUEST DIAGNOSTICS INC	7,645	142.470	1,089,183.15	
RESMED INC	9,600	222.180	2,132,928.00	
STERIS PLC	6,271	193.510	1,213,501.21	
STRYKER CORP	23,557	290.100	6,833,885.70	
TELEFLEX INC	3,067	261.550	802,173.85	
THE CIGNA GROUP	21,108	260.770	5,504,333.16	

UNITEDHEALTH GROUP INC	64,776	521.190	33,760,603.44	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	4,203	134.080	563,538.24	
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	9,184	176.660	1,622,445.44	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	13,599	131.590	1,789,492.41	
ABBVIE INC	122,871	162.360	19,949,335.56	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	21,101	138.360	2,919,534.36	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	7,912	202.890	1,605,265.68	
AMGEN INC	36,847	249.500	9,193,326.50	
AVANTOR INC	44,191	21.290	940,826.39	
BIOGEN INC	9,574	285.790	2,736,153.46	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	13,832	97.960	1,354,982.72	
BIO-RAD LABORATORIES-A	1,728	476.830	823,962.24	
BIO-TECHNE CORP	10,204	81.220	828,768.88	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	145,406	70.210	10,208,955.26	
CATALENT INC	10,797	64.250	693,707.25	
CHARLES RIVER LABORATORIES	3,467	201.470	698,496.49	
DANAHER CORP	47,447	249.970	11,860,326.59	
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	20,811	9.220	191,877.42	
ELI LILLY & CO	56,126	369.050	20,713,300.30	
EXACT SCIENCES CORP	13,570	64.910	880,828.70	
GILEAD SCIENCES INC	86,583	82.160	7,113,659.28	
HORIZON THERAPEUTICS PLC	13,945	109.680	1,529,487.60	
ILLUMINA INC	10,327	226.880	2,342,989.76	
INCYTE CORP	11,842	73.940	875,597.48	
IQVIA HOLDINGS INC	12,401	197.990	2,455,273.99	
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	4,089	144.050	589,020.45	
JOHNSON & JOHNSON	181,319	163.920	29,721,810.48	
MERCK & CO. INC.	176,126	113.750	20,034,332.50	
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	1,476	1,533.440	2,263,357.44	
MODERNA INC	21,941	155.560	3,413,141.96	
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	6,359	102.960	654,722.64	
PERKINELMER INC	8,323	134.340	1,118,111.82	
PFIZER INC	390,323	41.370	16,147,662.51	
REGENERON PHARMACEUTICALS	7,436	820.430	6,100,717.48	
REPLIGEN CORP	3,456	179.700	621,043.20	
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	27,162	36.110	980,819.82	
SEAGEN INC	8,954	205.200	1,837,360.80	
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	82,214	9.360	769,523.04	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	27,288	579.350	15,809,302.80	
UNITED THERAPEUTICS CORP	3,537	225.800	798,654.60	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	17,790	326.370	5,806,122.30	
VIATRIS INC	83,466	9.820	819,636.12	
WATERS CORP	4,095	303.270	1,241,890.65	
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	5,276	358.770	1,892,870.52	

ZOETIS INC	32,496	171.450	5,571,439.20	
BANK OF AMERICA CORP	501,898	28.480	14,294,055.04	
CITIGROUP INC	133,869	46.920	6,281,133.48	
CITIZENS FINANCIAL GROUP	36,122	29.380	1,061,264.36	
FIFTH THIRD BANCORP	49,541	26.390	1,307,386.99	
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	670	976.650	654,355.50	
FIRST HORIZON CORP	39,014	17.860	696,790.04	
FIRST REPUBLIC BANK/CA	11,979	13.820	165,549.78	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	105,007	11.320	1,188,679.24	
JPMORGAN CHASE & CO	203,194	128.500	26,110,429.00	
KEYCORP	62,741	12.050	756,029.05	
M & T BANK CORP	12,629	116.340	1,469,257.86	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	27,928	119.700	3,342,981.60	
REGIONS FINANCIAL CORP	62,979	18.330	1,154,405.07	
TRUIST FINANCIAL CORP	92,408	33.210	3,068,869.68	
US BANCORP	96,119	35.400	3,402,612.60	
WEBSTER FINANCIAL CORP	13,918	37.030	515,383.54	
WELLS FARGO & CO	265,487	39.190	10,404,435.53	
ALLY FINANCIAL INC	20,139	26.370	531,065.43	
AMERICAN EXPRESS CO	43,398	159.290	6,912,867.42	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	7,131	304.960	2,174,669.76	
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	27,656	62.580	1,730,712.48	
ARES MANAGEMENT CORP - A	11,370	81.650	928,360.50	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	54,315	45.830	2,489,256.45	
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	90,305	314.550	28,405,437.75	
BLACKROCK INC	10,403	665.970	6,928,085.91	
BLACKSTONE INC	47,782	82.610	3,947,271.02	
BLOCK INC	38,443	62.740	2,411,913.82	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	27,026	95.690	2,586,117.94	
CARLYLE GROUP INC/THE	16,730	29.730	497,382.90	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	7,323	134.520	985,089.96	
CME GROUP INC	25,066	191.740	4,806,154.84	
COINBASE GLOBAL INC -CLASS A	7,252	67.840	491,975.68	
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	18,645	99.150	1,848,651.75	
EQUITABLE HOLDINGS INC	22,820	25.250	576,205.00	
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	2,377	411.720	978,658.44	
FIDELITY NATIONAL INFO SERV	42,749	55.310	2,364,447.19	
FISERV INC	42,333	114.490	4,846,705.17	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	4,371	213.990	935,350.29	
FRANKLIN RESOURCES INC	21,778	26.420	575,374.76	
FUTU HOLDINGS LTD-ADR	5,375	47.560	255,635.00	
GLOBAL PAYMENTS INC	18,157	105.210	1,910,297.97	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	23,245	330.240	7,676,428.80	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	38,979	107.090	4,174,261.11	

INVESCO LTD	18,328	16.130	295,630.64	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	4,971	151.610	753,653.31	
KKR & CO INC	37,308	51.290	1,913,527.32	
LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	4,992	196.760	982,225.92	
MARKETAXESS HOLDINGS INC	2,653	337.590	895,626.27	
MASTERCARD INC - A	59,607	361.780	21,564,620.46	
MOODY'S CORP	11,246	298.180	3,353,332.28	
MORGAN STANLEY	88,738	85.470	7,584,436.86	
MSCI INC	5,669	530.830	3,009,275.27	
NASDAQ INC	22,924	54.890	1,258,298.36	
NORTHERN TRUST CORP	13,026	88.910	1,158,141.66	
PAYPAL HOLDINGS INC	76,064	73.500	5,590,704.00	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	12,735	92.080	1,172,638.80	
S&P GLOBAL INC	23,240	342.790	7,966,439.60	
SCHWAB (CHARLES) CORP	100,352	51.920	5,210,275.84	
SEI INVESTMENTS COMPANY	7,550	57.430	433,596.50	
STATE STREET CORP	24,045	78.210	1,880,559.45	
SYNCHRONY FINANCIAL	32,112	29.530	948,267.36	
T ROWE PRICE GROUP INC	14,797	110.410	1,633,736.77	
TOAST INC-CLASS A	21,393	17.750	379,725.75	
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	8,688	70.720	614,415.36	
VISA INC-CLASS A SHARES	112,974	227.810	25,736,606.94	
AFLAC INC	40,880	65.980	2,697,262.40	
ALLSTATE CORP	18,070	116.080	2,097,565.60	
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	4,866	122.310	595,160.46	
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	50,566	51.320	2,595,047.12	
AON PLC-CLASS A	14,138	321.760	4,549,042.88	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	25,320	70.230	1,778,223.60	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	14,270	198.270	2,829,312.90	
ASSURANT INC	3,114	117.170	364,867.38	
BROWN & BROWN INC	18,424	58.480	1,077,435.52	
CHUBB LTD	28,440	199.230	5,666,101.20	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	10,510	110.430	1,160,619.30	
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	1,288	234.890	302,538.32	
EVEREST RE GROUP LTD	2,755	365.600	1,007,228.00	
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	19,058	35.510	676,749.58	
GLOBE LIFE INC	6,373	107.330	684,014.09	
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	21,767	70.840	1,541,974.28	
LOEWS CORP	12,727	56.590	720,220.93	
MARKEL CORP	837	1,327.800	1,111,368.60	
MARSH & MCLENNAN COS	34,900	170.080	5,935,792.00	
METLIFE INC	47,592	60.010	2,855,995.92	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	16,409	75.330	1,236,089.97	
PROGRESSIVE CORP	41,143	148.150	6,095,335.45	

PRUDENTIAL FINANCIAL INC	24,389	84.840	2,069,162.76	
TRAVELERS COS INC/THE	16,719	173.840	2,906,430.96	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	7,897	237.200	1,873,168.40	
WR BERKLEY CORP	14,486	62.840	910,300.24	
ACCENTURE PLC-CL A	43,075	283.760	12,222,962.00	
ADOBE INC	32,139	369.890	11,887,894.71	
AKAMA I TECHNOLOGIES INC	10,300	81.180	836,154.00	
ANSYS INC	5,908	316.490	1,869,822.92	
ASPEN TECHNOLOGY INC	1,901	244.340	464,490.34	
ATLISSIAN CORP-CL A	10,941	158.550	1,734,695.55	
AUTODESK INC	14,728	193.160	2,844,860.48	
BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	11,682	41.710	487,256.22	
BILL HOLDINGS INC	6,004	74.800	449,099.20	
BLACK KNIGHT INC	10,656	55.380	590,129.28	
CADENCE DESIGN SYS INC	19,198	212.180	4,073,431.64	
CERIDIAN HCM HOLDING INC	10,485	66.520	697,462.20	
CHECK POINT SOFTWARE TECH	7,561	132.820	1,004,252.02	
CLOUDFLARE INC - CLASS A	19,210	63.040	1,210,998.40	
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	36,763	60.280	2,216,073.64	
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	14,965	135.000	2,020,275.00	
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	3,173	132.560	420,612.88	
DATADOG INC - CLASS A	16,206	66.840	1,083,209.04	
DOCUSIGN INC	12,031	54.480	655,448.88	
DROPBOX INC-CLASS A	16,584	20.800	344,947.20	
DYNATRACE INC	15,753	41.250	649,811.25	
EPAM SYSTEMS INC	3,733	289.990	1,082,532.67	
FAIR ISAAC CORP	1,871	684.430	1,280,568.53	
FORTINET INC	47,604	67.190	3,198,512.76	
GARTNER INC	5,357	320.250	1,715,579.25	
GEN DIGITAL INC	41,779	17.610	735,728.19	
GODADDY INC - CLASS A	11,895	76.150	905,804.25	
HUBSPOT INC	3,318	413.660	1,372,523.88	
INTL BUSINESS MACHINES CORP	62,270	128.540	8,004,185.80	
INTUIT INC	18,486	435.090	8,043,073.74	
MICROSOFT CORP	489,744	283.490	138,837,526.56	
MONGODB INC	4,150	226.210	938,771.50	
OKTA INC	10,337	75.960	785,198.52	
ORACLE CORP	112,929	93.900	10,604,033.10	
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	128,742	8.330	1,072,420.86	
PALO ALTO NETWORKS INC	21,435	195.280	4,185,826.80	
PAYCOM SOFTWARE INC	3,778	294.210	1,111,525.38	
PAYLOCITY HOLDING CORP	2,718	190.370	517,425.66	
PTC INC	7,295	126.390	922,015.05	
ROPER TECHNOLOGIES INC	7,457	442.480	3,299,573.36	

SALESFORCE INC	68,700	190.320	13,074,984.00	
SERVICENOW INC	13,974	471.430	6,587,762.82	
SNOWFLAKE INC-CLASS A	14,743	139.660	2,059,007.38	
SPLUNK INC	12,234	90.060	1,101,794.04	
SYNOPSYS INC	10,312	376.520	3,882,674.24	
TWILIO INC - A	10,905	58.130	633,907.65	
TYLER TECHNOLOGIES INC	3,139	359.010	1,126,932.39	
UNITY SOFTWARE INC	19,066	28.910	551,198.06	
VERISIGN INC	6,425	212.600	1,365,955.00	
VMWARE INC-CLASS A	13,809	124.020	1,712,592.18	
WIX.COM LTD	4,119	88.750	365,561.25	
WORKDAY INC-CLASS A	14,441	191.740	2,768,917.34	
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	13,927	67.490	939,933.23	
ZSCALER INC	6,271	105.870	663,910.77	
AMPHENOL CORP-CL A	41,781	78.110	3,263,513.91	
APPLE INC	1,100,007	160.100	176,111,120.70	
ARISTA NETWORKS INC	16,665	161.410	2,689,897.65	
ARROW ELECTRONICS INC	4,130	118.390	488,950.70	
CDW CORP/DE	9,855	188.090	1,853,626.95	
CISCO SYSTEMS INC	281,989	50.110	14,130,468.79	
COGNEX CORP	11,368	48.370	549,870.16	
CORNING INC	58,470	34.740	2,031,247.80	
DELL TECHNOLOGIES -C	18,797	41.870	787,030.39	
F5 INC	3,921	144.250	565,604.25	
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	86,138	15.980	1,376,485.24	
HP INC	69,711	29.660	2,067,628.26	
JUNIPER NETWORKS INC	21,151	33.760	714,057.76	
KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	11,811	157.690	1,862,476.59	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	11,763	285.720	3,360,924.36	
NETAPP INC	13,273	66.400	881,327.20	
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	11,800	66.380	783,284.00	
TE CONNECTIVITY LTD	20,969	125.380	2,629,093.22	
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	3,432	439.370	1,507,917.84	
TRIMBLE INC	15,566	49.110	764,446.26	
WESTERN DIGITAL CORP	24,533	38.000	932,254.00	
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	3,257	301.410	981,692.37	
ADVANCED MICRO DEVICES	111,153	92.330	10,262,756.49	
ANALOG DEVICES INC	35,611	187.290	6,669,584.19	
APPLIED MATERIALS INC	59,454	113.160	6,727,814.64	
BROADCOM INC	28,817	616.700	17,771,443.90	
ENPHASE ENERGY INC	8,881	196.030	1,740,942.43	
ENTEGRIS INC	9,961	72.090	718,088.49	
FIRST SOLAR INC	6,859	207.890	1,425,917.51	
INTEL CORP	283,167	32.020	9,067,007.34	

KLA CORP	9,474	370.140	3,506,706.36	
LAM RESEARCH CORP	9,194	497.070	4,570,061.58	
MARVELL TECHNOLOGY INC	60,303	39.530	2,383,777.59	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	36,442	79.230	2,887,299.66	
MICRON TECHNOLOGY INC	76,774	61.960	4,756,917.04	
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	2,887	465.890	1,345,024.43	
NVIDIA CORP	169,563	264.950	44,925,716.85	
NXP SEMICONDUCTORS NV	18,416	170.220	3,134,771.52	
ON SEMICONDUCTOR	31,206	76.460	2,386,010.76	
QORVO INC	6,042	93.520	565,047.84	
QUALCOMM INC	77,221	120.270	9,287,369.67	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	10,677	107.890	1,151,941.53	
SOLAREEDGE TECHNOLOGIES INC	4,104	284.960	1,169,475.84	
TERADYNE INC	10,642	101.480	1,079,950.16	
TEXAS INSTRUMENTS INC	62,613	177.550	11,116,938.15	
WOLFSPEED INC	8,461	56.130	474,915.93	
AT&T INC	490,389	19.770	9,694,990.53	
LIBERTY GLOBAL PLC- C	21,079	20.190	425,585.01	
LIBERTY GLOBAL PLC-A	8,432	19.250	162,316.00	
T-MOBILE US INC	43,384	149.510	6,486,341.84	
VERIZON COMMUNICATIONS INC	288,471	39.200	11,308,063.20	
AES CORP	41,893	25.310	1,060,311.83	
ALLIANT ENERGY CORP	16,641	54.740	910,928.34	
AMEREN CORPORATION	16,937	89.970	1,523,821.89	
AMERICAN ELECTRIC POWER	34,672	94.260	3,268,182.72	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	13,278	150.820	2,002,587.96	
ATMOS ENERGY CORP	8,726	115.900	1,011,343.40	
CENTERPOINT ENERGY INC	44,329	30.670	1,359,570.43	
CMS ENERGY CORP	20,578	61.440	1,264,312.32	
CONSOLIDATED EDISON INC	25,230	98.690	2,489,948.70	
CONSTELLATION ENERGY	22,424	76.810	1,722,387.44	
DOMINION ENERGY INC	56,137	57.890	3,249,770.93	
DTE ENERGY COMPANY	14,083	113.720	1,601,518.76	
DUKE ENERGY CORP	53,442	99.410	5,312,669.22	
EDISON INTERNATIONAL	24,655	73.070	1,801,540.85	
ENTERGY CORP	14,800	110.080	1,629,184.00	
ESSENTIAL UTILITIES INC	16,329	44.280	723,048.12	
EVERGY INC	17,275	62.100	1,072,777.50	
EVERSOURCE ENERGY	25,375	79.770	2,024,163.75	
EXELON CORP	69,982	43.080	3,014,824.56	
FIRSTENERGY CORP	37,970	41.460	1,574,236.20	
NEXTERA ENERGY INC	138,380	78.590	10,875,284.20	
NISOURCE INC	25,829	28.660	740,259.14	
NRG ENERGY INC	13,547	35.760	484,440.72	

P G & E CORP	108,132	16.960	1,833,918.72	
PPL CORP	47,199	28.660	1,352,723.34	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	33,085	63.590	2,103,875.15	
SEMPRA ENERGY	22,372	153.950	3,444,169.40	
SOUTHERN CO/THE	76,796	72.120	5,538,527.52	
UGI CORP	15,256	35.030	534,417.68	
VISTRA CORP	25,777	24.550	632,825.35	
WEC ENERGY GROUP INC	22,571	98.150	2,215,343.65	
XCEL ENERGY INC	37,222	71.040	2,644,250.88	
ACTIVISION BLIZZARD INC	54,622	84.950	4,640,138.90	
ALPHABET INC-CL A	412,760	104.640	43,191,206.40	
ALPHABET INC-CL C	377,716	105.220	39,743,277.52	
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	7,703	343.280	2,644,285.84	
COMCAST CORP-CLASS A	300,293	37.640	11,303,028.52	
DISH NETWORK CORP-A	12,937	8.080	104,530.96	
ELECTRONIC ARTS INC	18,378	126.130	2,318,017.14	
FOX CORP - CLASS A	23,886	33.730	805,674.78	
FOX CORP - CLASS B	8,773	31.010	272,050.73	
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	26,027	37.450	974,711.15	
LIBERTY BROADBAND-C	8,196	78.640	644,533.44	
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	13,438	73.710	990,514.98	
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM A	4,141	29.230	121,041.43	
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM C	12,383	29.120	360,592.96	
LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	11,080	69.900	774,492.00	
MATCH GROUP INC	17,799	34.380	611,929.62	
META PLATFORMS INC-CLASS A	155,983	214.000	33,380,362.00	
NETFLIX INC	30,569	331.030	10,119,256.07	
NEWS CORP - CLASS A	23,102	17.300	399,664.60	
OMNICOM GROUP	15,106	93.590	1,413,770.54	
PARAMOUNT GLOBAL-CLASS B	40,964	22.130	906,533.32	
PINTEREST INC- CLASS A	38,300	27.740	1,062,442.00	
ROBLOX CORP -CLASS A	22,745	45.200	1,028,074.00	
ROKU INC	9,945	60.470	601,374.15	
SEA LTD-ADR	24,719	81.300	2,009,654.70	
SIRIUS XM HOLDINGS INC	56,550	3.980	225,069.00	
SNAP INC - A	85,415	10.620	907,107.30	
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	10,772	119.680	1,289,192.96	
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	32,608	60.020	1,957,132.16	
WALT DISNEY CO/THE	126,988	97.940	12,437,204.72	
WARNER BROS DISCOVERY INC	165,916	14.060	2,332,778.96	
ZOOMINFO TECHNOLOGIES INC	15,382	22.520	346,402.64	
CBRE GROUP INC - A	20,793	69.840	1,452,183.12	
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	79,100	4.380	346,458.00	
ZILLOW GROUP INC - C	10,672	45.740	488,137.28	

	アメリカ・ドル小計	23,371,031		2,438,909,350.50 (325,155,394,609)	
カナダ・ドル	ARC RESOURCES LTD	44,923	16.530	742,577.19	
	CAMECO CORP	33,586	34.040	1,143,267.44	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	77,007	80.270	6,181,351.89	
	CENOVUS ENERGY INC	99,824	24.260	2,421,730.24	
	ENBRIDGE INC	140,420	53.370	7,494,215.40	
	IMPERIAL OIL LTD	16,267	74.220	1,207,336.74	
	KEYERA CORP	19,802	31.320	620,198.64	
	PARKLAND CORP	7,666	31.890	244,468.74	
	PEMBINA PIPELINE CORP	37,348	45.070	1,683,274.36	
	SUNCOR ENERGY INC	91,066	43.830	3,991,422.78	
	TC ENERGY CORP	68,290	56.490	3,857,702.10	
	TOURMALINE OIL CORP	20,401	58.980	1,203,250.98	
	AGNICO EAGLE MINES LTD	31,873	77.590	2,473,026.07	
	BARRICK GOLD CORP	114,792	26.390	3,029,360.88	
	CCL INDUSTRIES INC - CL B	8,705	68.100	592,810.50	
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	41,452	32.830	1,360,869.16	
	FRANCO-NEVADA CORP	12,789	208.840	2,670,854.76	
	IVANHOE MINES LTD-CL A	32,698	12.040	393,683.92	
	KINROSS GOLD CORP	110,156	6.940	764,482.64	
	LUNDIN MINING CORP	46,446	9.860	457,957.56	
	NUTRIEN LTD	36,792	97.080	3,571,767.36	
	PAN AMERICAN SILVER CORP	25,157	25.690	646,283.33	
	TECK RESOURCES LTD-CLS B	34,947	57.820	2,020,635.54	
	WEST FRASER TIMBER CO LTD	4,438	100.030	443,933.14	
	WHEATON PRECIOUS METALS CORP	31,091	68.230	2,121,338.93	
	CAE INC	17,963	32.240	579,127.12	
	TOROMONT INDUSTRIES LTD	6,027	106.480	641,754.96	
	WSP GLOBAL INC	9,260	173.320	1,604,943.20	
	GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	9,913	46.930	465,217.09	
	RITCHIE BROS AUCTIONEERS	12,520	78.900	987,828.00	
	THOMSON REUTERS CORP	11,370	174.980	1,989,522.60	
	AIR CANADA	12,083	18.830	227,522.89	
	CANADIAN NATL RAILWAY CO	40,874	162.280	6,633,032.72	
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	65,344	103.640	6,772,252.16		
TFI INTERNATIONAL INC	5,097	154.710	788,556.87		
MAGNA INTERNATIONAL INC	18,921	72.150	1,365,150.15		
BRP INC/CA- SUB VOTING	3,082	100.560	309,925.92		
GILDAN ACTIVEWEAR INC	11,302	42.950	485,420.90		
RESTAURANT BRANDS INTERN	19,270	89.500	1,724,665.00		
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	3,001	178.630	536,068.63		
DOLLARAMA INC	20,468	81.940	1,677,147.92		
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	57,969	67.470	3,911,168.43		

EMPIRE CO LTD 'A'	9,148	36.910	337,652.68	
LOBLAW COMPANIES LTD	11,573	125.990	1,458,082.27	
METRO INC/CN	14,765	75.740	1,118,301.10	
WESTON (GEORGE) LTD	4,984	180.400	899,113.60	
SAPUTO INC	18,270	34.450	629,401.50	
BANK OF MONTREAL	47,679	121.020	5,770,112.58	
BANK OF NOVA SCOTIA	83,370	68.030	5,671,661.10	
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	64,792	57.680	3,737,202.56	
NATIONAL BANK OF CANADA	22,533	97.100	2,187,954.30	
ROYAL BANK OF CANADA	94,772	131.870	12,497,583.64	
TORONTO-DOMINION BANK	124,589	80.500	10,029,414.50	
BROOKFIELD ASSET MGMT-A	23,555	43.170	1,016,869.35	
BROOKFIELD CORP	94,219	43.070	4,058,012.33	
ELEMENT FLEET MANAGEMENT COR	32,674	17.660	577,022.84	
IGM FINANCIAL INC	4,949	40.250	199,197.25	
NUVEI CORP-SUBORDINATE VTG	5,042	57.110	287,948.62	
ONEX CORPORATION	4,217	61.440	259,092.48	
TMX GROUP LTD	3,142	138.450	435,009.90	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	1,393	874.120	1,217,649.16	
GREAT-WEST LIFECO INC	22,964	37.220	854,720.08	
IA FINANCIAL CORP INC	8,268	86.370	714,107.16	
INTACT FINANCIAL CORP	11,416	198.510	2,266,190.16	
MANULIFE FINANCIAL CORP	134,995	25.420	3,431,572.90	
POWER CORP OF CANADA	41,436	35.160	1,456,889.76	
SUN LIFE FINANCIAL INC	41,957	64.000	2,685,248.00	
CGI INC	15,720	132.500	2,082,900.00	
CONSTELLATION SOFTWARE INC	1,338	2,613.440	3,496,782.72	
DESCARTES SYSTEMS GRP/THE	6,424	108.040	694,048.96	
OPEN TEXT CORP	21,507	52.140	1,121,374.98	
SHOPIFY INC - CLASS A	80,264	60.890	4,887,274.96	
BCE INC	5,509	63.240	348,389.16	
ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	25,321	65.700	1,663,589.70	
TELUS CORP	15,222	28.250	430,021.50	
ALGONQUIN POWER & UTILITIES	44,154	11.720	517,484.88	
ALTAGAS LTD	17,347	23.020	399,327.94	
BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	6,336	44.960	284,866.56	
CANADIAN UTILITIES LTD-A	7,344	38.960	286,122.24	
EMERA INC	18,000	58.250	1,048,500.00	
FORTIS INC	35,086	60.070	2,107,616.02	
HYDRO ONE LTD	24,747	40.550	1,003,490.85	
NORTHLAND POWER INC	15,741	34.420	541,805.22	
QUEBECOR INC -CL B	14,578	34.410	501,628.98	
FIRSTSERVICE CORP	2,516	190.340	478,895.44	
カナダ・ドル小計	2,796,256		167,727,234.78	

				(16,638,541,690)	
オーストラ リア・ドル	AMPOL LTD	19,016	31.110	591,587.76	
	SANTOS LTD	213,811	7.220	1,543,715.42	
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	12,722	31.330	398,580.26	
	WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	132,981	34.160	4,542,630.96	
	BHP GROUP LTD	353,155	46.840	16,541,780.20	
	BLUESCOPE STEEL LTD	37,214	20.050	746,140.70	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	121,817	22.550	2,746,973.35	
	IGO LTD	54,323	12.580	683,383.34	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	26,108	32.690	853,470.52	
	MINERAL RESOURCES LTD	11,662	77.410	902,755.42	
	NEWCREST MINING LTD	54,082	29.660	1,604,072.12	
	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	65,844	13.700	902,062.80	
	ORICA LTD	36,212	16.120	583,737.44	
	PILBARA MINERALS LTD	197,160	3.540	697,946.40	
	RIO TINTO LTD	25,693	121.750	3,128,122.75	
	SOUTH32 LTD	276,348	4.380	1,210,404.24	
	REECE LTD	13,059	17.720	231,405.48	
	BRAMBLES LTD	105,161	13.870	1,458,583.07	
	COMPUTERSHARE LTD	38,485	22.360	860,524.60	
	AURIZON HOLDINGS LTD	130,251	3.420	445,458.42	
	QANTAS AIRWAYS LTD	78,226	6.500	508,469.00	
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	43,243	37.810	1,635,017.83	
	IDP EDUCATION LTD	15,855	27.480	435,695.40	
	LOTTERY CORP LTD/THE	139,785	5.180	724,086.30	
	WESFARMERS LTD	78,698	52.100	4,100,165.80	
	COLES GROUP LTD	91,859	18.620	1,710,414.58	
	ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALI	106,589	6.920	737,595.88	
	WOOLWORTHS GROUP LTD	83,181	39.510	3,286,481.31	
	TREASURY WINE ESTATES LTD	45,684	14.010	640,032.84	
	COCHLEAR LTD	4,095	248.180	1,016,297.10	
	RAMSAY HEALTH CARE LTD	14,565	68.640	999,741.60	
	SONIC HEALTHCARE LTD	31,126	36.570	1,138,277.82	
	CSL LTD	33,279	303.890	10,113,155.31	
	ANZ GROUP HOLDINGS LTD	209,348	23.610	4,942,706.28	
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	117,061	99.230	11,615,963.03		
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	220,259	28.110	6,191,480.49		
WESTPAC BANKING CORP	244,569	22.120	5,409,866.28		
ASX LTD	11,180	70.150	784,277.00		
MACQUARIE GROUP LTD	26,074	179.600	4,682,890.40		
INSURANCE AUSTRALIA GROUP	173,755	5.020	872,250.10		
MEDIBANK PRIVATE LTD	128,724	3.500	450,534.00		
QBE INSURANCE GROUP LTD	101,860	15.010	1,528,918.60		
SUNCORP GROUP LTD	88,234	12.450	1,098,513.30		

	WISETECH GLOBAL LTD	10,621	66.000	700,986.00	
	XERO LTD	8,683	91.510	794,581.33	
	TELSTRA GROUP LTD	273,343	4.270	1,167,174.61	
	ORIGIN ENERGY LTD	134,865	8.290	1,118,030.85	
	REA GROUP LTD	2,833	141.340	400,416.22	
	SEEK LTD	21,957	25.190	553,096.83	
	オーストラリア・ドル小計	4,464,655		110,030,451.34 (9,818,017,173)	
香港・ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	173,424	51.100	8,861,966.40	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	101,000	81.600	8,241,600.00	
	XINYI GLASS HOLDINGS LTD	94,000	14.260	1,340,440.00	
	MTR CORP	118,500	38.800	4,597,800.00	
	SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	70,000	17.200	1,204,000.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	149,000	55.200	8,224,800.00	
	SANDS CHINA LTD	142,400	28.250	4,022,800.00	
	BUDWEISER BREWING CO APAC LT	147,000	24.050	3,535,350.00	
	WH GROUP LTD	561,000	4.730	2,653,530.00	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	247,000	24.750	6,113,250.00	
	HANG SENG BANK LTD	48,200	113.400	5,465,880.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	83,600	344.000	28,758,400.00	
	AIA GROUP LTD	819,000	85.650	70,147,350.00	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	41,000	43.750	1,793,750.00	
	CLP HOLDINGS LTD	119,600	57.850	6,918,860.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	722,389	6.860	4,955,588.54	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	91,500	43.300	3,961,950.00	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	126,924	48.100	6,105,044.40	
	ESR GROUP LTD	157,000	13.560	2,128,920.00	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	190,000	15.080	2,865,200.00	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	83,384	27.750	2,313,906.00	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	84,833	21.700	1,840,876.10	
	SINO LAND CO	248,200	10.800	2,680,560.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	95,500	110.500	10,552,750.00	
	SWIRE PACIFIC LTD - CL A	27,000	58.450	1,578,150.00	
	SWIRE PROPERTIES LTD	116,800	20.300	2,371,040.00	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	125,000	45.400	5,675,000.00	
	香港・ドル小計	4,983,254		208,908,761.44 (3,549,359,857)	
シンガポール・ドル	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	10,800	32.550	351,540.00	
	KEPPEL CORP LTD	94,400	5.850	552,240.00	
	SEMBCORP MARINE LTD	1,801,627	0.120	216,195.24	
	SINGAPORE TECH ENGINEERING	108,600	3.650	396,390.00	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	113,566	5.800	658,682.80	
	GENTING SINGAPORE LTD	452,500	1.160	524,900.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	130,000	4.130	536,900.00	

	DBS GROUP HOLDINGS LTD	125,800	32.320	4,065,856.00	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	230,600	12.740	2,937,844.00	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	82,900	30.010	2,487,829.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	65,200	9.520	620,704.00	
	VENTURE CORP LTD	21,700	17.280	374,976.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	579,015	2.490	1,441,747.35	
	CAPITALAND INVESTMENT LTD/SI	176,200	3.710	653,702.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	25,800	7.330	189,114.00	
	UOL GROUP LTD	30,900	7.030	217,227.00	
	シンガポール・ドル小計	4,049,608		16,225,847.39 (1,629,237,336)	
ニュージー ランド・ド ル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	78,808	8.680	684,053.44	
	EBOS GROUP LTD	12,387	45.000	557,415.00	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	39,017	26.910	1,049,947.47	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	145,482	5.090	740,503.38	
	MERCURY NZ LTD	38,935	6.270	244,122.45	
	MERIDIAN ENERGY LTD	91,327	5.300	484,033.10	
	ニュージーランド・ドル小計	405,956		3,760,074.84 (311,446,999)	
イギリス・ ポンド	BP PLC	1,254,059	5.396	6,766,902.36	
	SHELL PLC	487,724	24.455	11,927,290.42	
	ANGLO AMERICAN PLC	85,329	26.755	2,282,977.39	
	ANTOFAGASTA PLC	30,983	15.805	489,686.31	
	CRODA INTERNATIONAL PLC	10,296	67.500	694,980.00	
	GLENCORE PLC	728,838	4.836	3,524,660.56	
	JOHNSON MATTHEY PLC	10,074	19.515	196,594.11	
	MONDI PLC	33,905	13.025	441,612.62	
	RIO TINTO PLC	76,572	55.200	4,226,774.40	
	ASHTREAD GROUP PLC	30,439	46.340	1,410,543.26	
	BAE SYSTEMS PLC	209,260	10.260	2,147,007.60	
	BUNZL PLC	22,658	30.840	698,772.72	
	DCC PLC	5,954	48.750	290,257.50	
	MELROSE INDUSTRIES PLC	305,227	1.669	509,423.86	
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	649,146	1.476	958,139.49	
	SMITHS GROUP PLC	24,369	16.750	408,180.75	
	SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	4,459	115.100	513,230.90	
	EXPERIAN PLC	63,031	26.850	1,692,382.35	
	INTERTEK GROUP PLC	11,884	40.520	481,539.68	
	RELX PLC	133,993	26.510	3,552,154.43	
	RENTOKIL INITIAL PLC	156,848	5.992	939,833.21	
	BARRATT DEVELOPMENTS PLC	64,766	4.671	302,521.98	
BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE	6,637	41.980	278,621.26		
BURBERRY GROUP PLC	26,233	24.980	655,300.34		
PERSIMMON PLC	27,665	12.765	353,143.72		

TAYLOR WIMPEY PLC	225,588	1.180	266,193.84	
COMPASS GROUP PLC	120,046	20.410	2,450,138.86	
ENTAIN PLC	42,158	12.800	539,622.40	
INTERCONTINENTAL HOTELS GROU	11,820	54.040	638,752.80	
PEARSON PLC	46,942	8.344	391,684.04	
WHITBREAD PLC	16,522	29.790	492,190.38	
JD SPORTS FASHION PLC	144,300	1.675	241,702.50	
KINGFISHER PLC	109,678	2.528	277,265.98	
NEXT PLC	9,030	64.500	582,435.00	
OCADO GROUP PLC	27,379	5.100	139,632.90	
SAINSBURY (J) PLC	113,480	2.799	317,630.52	
TESCO PLC	495,919	2.674	1,326,087.40	
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	24,258	19.645	476,548.41	
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	148,021	28.590	4,231,920.39	
COCA-COLA HBC AG-DI	17,866	23.000	410,918.00	
DIAGEO PLC	157,411	36.760	5,786,428.36	
IMPERIAL BRANDS PLC	59,422	18.780	1,115,945.16	
HALEON PLC	360,325	3.457	1,245,643.52	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	49,582	62.440	3,095,900.08	
UNILEVER PLC	175,349	42.920	7,525,979.08	
NMC HEALTH PLC	3,940	0.010	39.40	
SMITH & NEPHEW PLC	57,278	11.955	684,758.49	
ASTRAZENECA PLC	107,738	118.220	12,736,786.36	
GSK PLC	280,453	15.126	4,242,132.07	
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	14,590	17.765	259,191.35	
BARCLAYS PLC	1,083,154	1.530	1,657,225.62	
HSBC HOLDINGS PLC	1,365,566	5.616	7,669,018.65	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	4,801,858	0.498	2,391,325.28	
NATWEST GROUP PLC	347,420	2.706	940,118.52	
STANDARD CHARTERED PLC	182,397	6.170	1,125,389.49	
3I GROUP PLC	70,572	17.000	1,199,724.00	
ABRDN PLC	138,015	2.054	283,482.81	
HARGREAVES LANSDOWN PLC	31,008	8.060	249,924.48	
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	25,978	79.780	2,072,524.84	
M&G PLC	119,733	1.955	234,078.01	
SCHRODERS PLC	61,711	4.739	292,448.42	
ST JAMES'S PLACE PLC	33,823	12.115	409,765.64	
ADMIRAL GROUP PLC	11,535	22.890	264,036.15	
AVIVA PLC	174,060	4.227	735,751.62	
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	386,391	2.469	953,999.37	
PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	59,286	5.624	333,424.46	
PRUDENTIAL PLC	193,423	11.510	2,226,298.73	
SAGE GROUP PLC/THE	75,045	7.836	588,052.62	
HALMA PLC	24,375	22.130	539,418.75	

	BT GROUP PLC	540,623	1.549	837,425.02	
	VODAFONE GROUP PLC	1,775,294	0.920	1,633,270.48	
	NATIONAL GRID PLC	260,873	11.535	3,009,170.05	
	SEVERN TRENT PLC	20,117	29.620	595,865.54	
	SSE PLC	70,532	18.565	1,309,426.58	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	42,035	11.025	463,435.87	
	AUTO TRADER GROUP PLC	51,319	6.026	309,248.29	
	INFORMA PLC	102,755	6.770	695,651.35	
	WPP PLC	78,503	9.392	737,300.17	
	イギリス・bond小計	19,406,845		128,974,859.32 (21,476,893,574)	
イスラエル・シュケル	ICL GROUP LTD	41,773	22.880	955,766.24	
	ELBIT SYSTEMS LTD	1,389	635.700	882,987.30	
	BANK HAPOLIM BM	84,682	28.500	2,413,437.00	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	115,937	26.550	3,078,127.35	
	FIRST INTL BANK ISRAEL	2,252	121.000	272,492.00	
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	85,339	17.380	1,483,191.82	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	9,249	110.200	1,019,239.80	
	NICE LTD	3,919	815.000	3,193,985.00	
	TOWER SEMICONDUCTOR LTD	7,438	151.600	1,127,600.80	
	BEZEQ THE ISRAELI TELECOM CO	179,569	4.883	876,835.42	
	AZRIELI GROUP LTD	3,527	212.000	747,724.00	
	イスラエル・シュケル小計	535,074		16,051,386.73 (582,358,757)	
スイス・フラン	CLARIANT AG-REG	10,101	14.500	146,464.50	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	538	753.000	405,114.00	
	GIVAUDAN-REG	605	3,094.000	1,871,870.00	
	HOLCIM LTD	39,459	56.580	2,232,590.22	
	SIG GROUP AG	22,269	24.180	538,464.42	
	SIKA AG-REG	9,946	235.300	2,340,293.80	
	ABB LTD-REG	109,550	31.050	3,401,527.50	
	GEBERIT AG-REG	2,322	485.800	1,128,027.60	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	1,766	182.800	322,824.80	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	3,030	188.950	572,518.50	
	VAT GROUP AG	2,164	310.200	671,272.80	
	ADECCO GROUP AG-REG	9,118	32.360	295,058.48	
	SGS SA-REG	11,450	84.460	967,067.00	
	KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG	3,570	263.100	939,267.00	
	CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG	36,108	138.900	5,015,401.20	
	SWATCH GROUP AG/THE-BR	1,716	285.500	489,918.00	
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	5,225	53.100	277,447.50	
BARRY CALLEBAUT AG-REG	216	1,921.000	414,936.00		
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	72	11,020.000	793,440.00		
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	8	110,000.000	880,000.00		

	NESTLE SA-REG	190,037	112.940	21,462,778.78	
	ALCON INC	35,956	63.640	2,288,239.84	
	SONOVA HOLDING AG-REG	3,269	278.100	909,108.90	
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	7,044	136.400	960,801.60	
	BACHEM HOLDING AG	1,756	93.200	163,659.20	
	LONZA GROUP AG-REG	5,251	575.600	3,022,475.60	
	NOVARTIS AG-REG	148,488	86.750	12,881,334.00	
	ROCHE HOLDING AG-BR	1,740	290.600	505,644.00	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	48,896	275.400	13,465,958.40	
	BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	3,006	88.750	266,782.50	
	CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	241,102	0.836	201,561.27	
	JULIUS BAER GROUP LTD	15,168	61.080	926,461.44	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,585	850.200	1,347,567.00	
	UBS GROUP AG-REG	231,389	19.010	4,398,704.89	
	BALOISE HOLDING AG - REG	2,475	148.500	367,537.50	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	2,272	593.000	1,347,296.00	
	SWISS RE AG	20,843	94.520	1,970,080.36	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	10,454	432.800	4,524,491.20	
	TEMENOS AG - REG	3,743	64.120	240,001.16	
	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	13,555	51.100	692,660.50	
	SWISSCOM AG-REG	1,709	601.400	1,027,792.60	
	BKW AG	1,385	147.600	204,426.00	
	SWISS PRIME SITE-REG	5,572	78.750	438,795.00	
	スイス・フラン小計	1,265,928		97,317,661.06 (14,481,841,142)	
デンマーク・クローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	7,211	511.400	3,687,705.40	
	NOVOZYMES A/S-B SHARES	14,003	341.100	4,776,423.30	
	ROCKWOOL A/S-B SHS	513	1,579.000	810,027.00	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	72,299	196.180	14,183,617.82	
	AP MOLLER-MAERSK A/S-A	206	12,150.000	2,502,900.00	
	AP MOLLER-MAERSK A/S-B	311	12,365.000	3,845,515.00	
	DSV A/S	12,792	1,231.500	15,753,348.00	
	PANDORA A/S	5,888	595.800	3,508,070.40	
	CARLSBERG AS-B	6,611	1,078.500	7,129,963.50	
	COLOPLAST-B	8,316	919.200	7,644,067.20	
	DEMANT A/S	8,178	255.000	2,085,390.00	
	GENMAB A/S	4,315	2,656.000	11,460,640.00	
	NOVO NORDISK A/S-B	115,103	1,104.400	127,119,753.20	
	DANSKE BANK A/S	50,000	140.200	7,010,000.00	
	TRYG A/S	24,975	150.250	3,752,493.75	
ORSTED A/S	13,257	596.600	7,909,126.20		
	デンマーク・クローネ小計	343,978		223,179,040.77 (4,392,163,522)	
	AKER BP ASA	21,204	271.200	5,750,524.80	

ノル ウェー・ク ローネ	EQUINOR ASA	66,633	309.500	20,622,913.50	
	NORSK HYDRO ASA	87,753	78.740	6,909,671.22	
	YARA INTERNATIONAL ASA	12,718	461.600	5,870,628.80	
	KONGSBERG GRUPPEN ASA	6,526	441.000	2,877,966.00	
	MOWI ASA	30,723	190.700	5,858,876.10	
	ORKLA ASA	46,955	76.900	3,610,839.50	
	SALMAR ASA	4,188	432.000	1,809,216.00	
	DNB BANK ASA	61,691	193.900	11,961,884.90	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	11,412	178.600	2,038,183.20	
	TELENOR ASA	48,435	127.600	6,180,306.00	
	ADEVINTA ASA	15,540	75.750	1,177,155.00	
ノルウェー・クローネ小計		413,778		74,668,165.02 (952,765,787)	
スウェーデ ン・クロ ーナ	BOLIDEN AB	20,658	397.500	8,211,555.00	
	HOLMEN AB-B SHARES	7,024	397.800	2,794,147.20	
	SVENSKA CELLULOSA AB SCA-B	34,370	132.900	4,567,773.00	
	ALFA LAVAL AB	18,697	369.900	6,916,020.30	
	ASSA ABLOY AB-B	72,539	234.700	17,024,903.30	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	185,739	127.900	23,756,018.10	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	107,424	115.650	12,423,585.60	
	EPIROC AB-A	44,746	204.500	9,150,557.00	
	EPIROC AB-B	33,182	177.100	5,876,532.20	
	HUSQVARNA AB-B SHS	18,593	89.140	1,657,380.02	
	INDUTRADE AB	17,913	228.000	4,084,164.00	
	INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	8,223	211.200	1,736,697.60	
	LIFCO AB-B SHS	15,149	227.300	3,443,367.70	
	NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	109,274	116.700	12,752,275.80	
	SANDVIK AB	70,108	220.600	15,465,824.80	
	SKANSKA AB-B SHS	26,915	164.200	4,419,443.00	
	SKF AB-B SHARES	31,715	198.200	6,285,913.00	
	VOLVO AB-A SHS	13,283	217.200	2,885,067.60	
	VOLVO AB-B SHS	101,613	208.650	21,201,552.45	
	SECURITAS AB-B SHS	41,010	94.920	3,892,669.20	
	VOLVO CAR AB-B	38,628	42.610	1,645,939.08	
	ELECTROLUX AB-B	11,555	126.300	1,459,396.50	
	EVOLUTION AB	13,101	1,327.000	17,385,027.00	
	HENNES & MAURITZ AB-B SHS	52,210	150.340	7,849,251.40	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	45,427	305.600	13,882,491.20	
	GETINGE AB-B SHS	13,151	257.400	3,385,067.40	
	SWEDISH ORPHAN BIOVITRUM AB	13,513	261.200	3,529,595.60	
NORDEA BANK ABP	229,567	113.500	26,055,854.50		
SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	108,374	109.150	11,829,022.10		
SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	97,603	90.480	8,831,119.44		
SWEDBANK AB - A SHARES	63,538	177.050	11,249,402.90		

	EQT AB	23,194	213.600	4,954,238.40	
	INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	7,211	299.100	2,156,810.10	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	10,642	299.000	3,181,958.00	
	INVESTOR AB-A SHS	37,586	215.700	8,107,300.20	
	INVESTOR AB-B SHS	131,141	210.600	27,618,294.60	
	KINNEVIK AB - B	12,465	163.750	2,041,143.75	
	LUNDBERGS AB-B SHS	6,081	482.600	2,934,690.60	
	ERICSSON LM-B SHS	183,318	61.010	11,184,231.18	
	HEXAGON AB-B SHS	135,861	116.900	15,882,150.90	
	TELE2 AB-B SHS	38,424	105.200	4,042,204.80	
	TELIA CO AB	187,675	26.620	4,995,908.50	
	EMBRACER GROUP AB	30,012	44.095	1,323,379.14	
	FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	31,938	45.790	1,462,441.02	
	SAGAX AB-B	14,721	244.700	3,602,228.70	
	スウェーデン・クローナ小計	2,515,111		369,134,593.88 (4,758,144,915)	
ユーロ	ENI SPA	175,361	13.666	2,396,483.42	
	GALP ENERGIA SGPS SA	32,353	10.875	351,838.87	
	NESTE OYJ	28,878	45.710	1,320,013.38	
	OMV AG	10,043	44.380	445,708.34	
	REPSOL SA	96,457	13.840	1,334,964.88	
	TENARIS SA	31,142	13.260	412,942.92	
	TOTALENERGIES SE	171,943	58.460	10,051,787.78	
	AIR LIQUIDE SA	35,636	158.980	5,665,411.28	
	AKZO NOBEL N.V.	12,475	73.460	916,413.50	
	ARCELORMITTAL	37,054	26.805	993,232.47	
	ARKEMA	5,145	89.000	457,905.00	
	BASF SE	64,323	49.425	3,179,164.27	
	COVESTRO AG	11,797	36.620	432,006.14	
	CRH PLC	49,499	44.220	2,188,845.78	
	EVONIK INDUSTRIES AG	17,669	19.220	339,598.18	
	HEIDELBERGCEMENT AG	10,008	67.220	672,737.76	
	KONINKLIJKE DSM NV	12,174	114.050	1,388,444.70	
	OCI NV	6,000	30.370	182,220.00	
	SMURFIT KAPPA GROUP PLC	17,189	34.280	589,238.92	
	SOLVAY SA	4,802	106.700	512,373.40	
	STORA ENSO OYJ-R SHS	39,228	11.490	450,729.72	
	SYMRISE AG	9,721	103.050	1,001,749.05	
	UMICORE	16,912	30.010	507,529.12	
	UPM-KYMMENE OYJ	38,447	30.160	1,159,561.52	
	VOESTALPINE AG	7,613	31.200	237,525.60	
	ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	13,416	29.920	401,406.72	
	AIRBUS SE	40,988	126.240	5,174,325.12	
	ALSTOM	25,574	23.890	610,962.86	

BOUYGUES SA	17,123	31.760	543,826.48	
BRENTAG SE	9,920	69.120	685,670.40	
CNH INDUSTRIAL NV	68,766	13.215	908,742.69	
COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN	34,454	50.600	1,743,372.40	
DAIMLER TRUCK HOLDING AG	29,358	29.830	875,749.14	
DASSAULT AVIATION SA	1,720	185.100	318,372.00	
EIFFAGE	4,989	102.300	510,374.70	
FERROVIAL SA	32,177	27.140	873,283.78	
GEA GROUP AG	10,467	41.900	438,567.30	
IMCD NV	3,214	142.700	458,637.80	
KINGSPAN GROUP PLC	11,262	57.220	644,411.64	
KNORR-BREMSE AG	3,881	60.320	234,101.92	
KONE OYJ-B	24,225	47.970	1,162,073.25	
LEGRAND SA	19,539	81.360	1,589,693.04	
METSO OUTOTEC OYJ	50,483	10.405	525,275.61	
MTU AERO ENGINES AG	3,854	229.600	884,878.40	
PRYSMIAN SPA	17,186	37.250	640,178.50	
RATIONAL AG	350	641.500	224,525.00	
RHEINMETALL AG	2,899	263.100	762,726.90	
SAFRAN SA	23,990	137.460	3,297,665.40	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	37,574	147.680	5,548,928.32	
SIEMENS AG-REG	52,620	144.820	7,620,428.40	
SIEMENS ENERGY AG	31,878	21.390	681,870.42	
THALES SA	7,074	140.850	996,372.90	
VINCI SA	36,202	108.460	3,926,468.92	
WARTSILA OYJ ABP	26,753	8.658	231,627.47	
BUREAU VERITAS SA	17,817	26.200	466,805.40	
RANDSTAD NV	8,946	51.700	462,508.20	
TELEPERFORMANCE	4,299	215.000	924,285.00	
WOLTERS KLUWER	18,802	120.700	2,269,401.40	
ADP	1,346	134.700	181,306.20	
AENA SME SA	5,640	150.850	850,794.00	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	50,885	9.566	486,765.91	
DEUTSCHE POST AG-REG	69,811	42.380	2,958,590.18	
GETLINK SE	30,428	15.000	456,420.00	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	22,804	102.680	2,341,514.72	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF	3,679	96.600	355,391.40	
CONTINENTAL AG	8,078	65.700	530,724.60	
DR ING HC F PORSCHE AG	7,000	118.600	830,200.00	
FERRARI NV	8,992	252.100	2,266,883.20	
MERCEDES-BENZ GROUP AG	55,881	69.340	3,874,788.54	
MICHELIN (CGDE)	45,659	28.870	1,318,175.33	
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF	10,089	52.600	530,681.40	
RENAULT SA	14,764	37.040	546,858.56	

STELLANTIS NV	149,423	16.796	2,509,708.70	
VALEO	14,444	18.540	267,791.76	
VOLKSWAGEN AG	1,960	154.050	301,938.00	
VOLKSWAGEN AG-PREF	11,844	125.520	1,486,658.88	
ADIDAS AG	12,090	163.440	1,975,989.60	
HERMES INTERNATIONAL	2,137	1,887.400	4,033,373.80	
KERING	5,266	554.100	2,917,890.60	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	19,127	836.600	16,001,648.20	
MONCLER SPA	15,710	62.980	989,415.80	
PUMA SE	6,459	54.000	348,786.00	
SEB SA	1,127	102.300	115,292.10	
ACCOR SA	10,451	30.270	316,351.77	
AMADEUS IT GROUP SA	29,928	60.240	1,802,862.72	
DELIVERY HERO SE	13,293	30.945	411,351.88	
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC-DI	12,030	168.450	2,026,453.50	
JUST EAT TAKEAWAY	12,903	14.796	190,912.78	
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	5,785	38.460	222,491.10	
SODEXO SA	6,960	99.100	689,736.00	
D'IETEREN GROUP	1,858	173.000	321,434.00	
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL	78,719	30.410	2,393,844.79	
PROSUS NV	55,136	64.870	3,576,672.32	
ZALANDO SE	17,418	36.070	628,267.26	
CARREFOUR SA	35,990	18.940	681,650.60	
HELLOFRESH SE	9,790	23.650	231,533.50	
JERONIMO MARTINS	21,241	21.560	457,955.96	
KESKO OYJ-B SHS	20,250	20.000	405,000.00	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	71,069	32.225	2,290,198.52	
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	60,855	58.640	3,568,537.20	
DANONE	45,570	58.940	2,685,895.80	
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	35,407	11.480	406,472.36	
HEINEKEN HOLDING NV	7,962	85.900	683,935.80	
HEINEKEN NV	18,666	100.750	1,880,599.50	
JDE PEET'S NV	6,660	26.760	178,221.60	
KERRY GROUP PLC-A	9,894	97.600	965,654.40	
PERNOD RICARD SA	14,736	209.400	3,085,718.40	
REMY COINTREAU	1,273	166.200	211,572.60	
BEIERSDORF AG	6,813	120.900	823,691.70	
HENKEL AG & CO KGAA	5,974	68.640	410,055.36	
HENKEL AG & CO KGAA VOR-PREF	13,009	74.140	964,487.26	
L'OREAL	16,700	412.150	6,882,905.00	
AMPLIFON SPA	7,567	32.370	244,943.79	
BIOMERIEUX	2,791	98.760	275,639.16	
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	2,161	127.100	274,663.10	
DIASORIN SPA	1,313	99.180	130,223.34	

ESSILORLUXOTTICA	19,585	170.880	3,346,684.80	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	13,613	40.290	548,467.77	
FRESENIUS SE & CO KGAA	31,227	25.270	789,106.29	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	61,140	17.080	1,044,271.20	
SIEMENS HEALTHINEERS AG	19,203	54.500	1,046,563.50	
ARGENX SE	3,754	343.400	1,289,123.60	
BAYER AG-REG	68,041	60.090	4,088,583.69	
EUROFINS SCIENTIFIC	9,270	61.740	572,329.80	
GRIFOLS SA	15,169	9.462	143,529.07	
IPSEN	3,380	105.800	357,604.00	
MERCK KGAA	8,996	160.500	1,443,858.00	
ORION OYJ-CLASS B	6,261	43.030	269,410.83	
QIAGEN N.V.	15,665	42.390	664,039.35	
RECORDATI INDUSTRIA CHIMICA	8,068	39.910	321,993.88	
SANOFI	78,739	101.840	8,018,779.76	
SARTORIUS AG-VORZUG	1,682	395.700	665,567.40	
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	2,207	286.900	633,188.30	
UCB SA	8,758	86.480	757,391.84	
ABN AMRO BANK NV-CVA	28,787	14.790	425,759.73	
AIB GROUP PLC	70,110	3.694	258,986.34	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	420,232	6.598	2,772,690.73	
BANCO SANTANDER SA	1,160,000	3.482	4,039,120.00	
BANK OF IRELAND GROUP PLC	75,242	9.358	704,114.63	
BNP PARIBAS	77,135	57.070	4,402,094.45	
CAIXABANK SA	290,777	3.497	1,016,847.16	
COMMERZBANK AG	73,561	9.720	715,012.92	
CREDIT AGRICOLE SA	90,899	10.706	973,164.69	
ERSTE GROUP BANK AG	24,737	31.210	772,041.77	
FINECOBANK SPA	43,093	14.410	620,970.13	
ING GROEP NV	254,105	11.528	2,929,322.44	
INTESA SANPAOLO	1,163,000	2.395	2,785,385.00	
KBC GROUP NV	17,643	64.460	1,137,267.78	
MEDIOBANCA SPA	47,708	9.454	451,031.43	
SOCIETE GENERALE SA	55,196	21.650	1,194,993.40	
UNICREDIT SPA	127,961	18.840	2,410,785.24	
ADYEN NV	1,553	1,445.200	2,244,395.60	
AMUNDI SA	3,955	58.600	231,763.00	
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	146,020	9.596	1,401,207.92	
DEUTSCHE BOERSE AG	12,983	182.950	2,375,239.85	
EDENRED	16,785	56.800	953,388.00	
EURAZEO SE	1,792	66.550	119,257.60	
EURONEXT NV	5,502	72.200	397,244.40	
EXOR NV	8,669	76.640	664,392.16	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT NV	6,879	79.200	544,816.80	

NEXI SPA	30,853	7.356	226,954.66	
SOFINA	804	209.600	168,518.40	
WENDEL	1,082	97.250	105,224.50	
WORLDLINE SA	16,677	37.100	618,716.70	
AEGON NV	127,748	4.109	524,916.53	
AGEAS	11,247	40.330	453,591.51	
ALLIANZ SE-REG	28,239	218.400	6,167,397.60	
ASSICURAZIONI GENERALI	72,382	18.840	1,363,676.88	
AXA SA	132,535	29.150	3,863,395.25	
HANNOVER RUECK SE	3,598	183.850	661,492.30	
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	9,828	331.700	3,259,947.60	
NN GROUP NV	16,917	34.270	579,745.59	
POSTE ITALIANE SPA	34,720	9.290	322,548.80	
SAMPO OYJ-A SHS	33,064	44.500	1,471,348.00	
BECHTLE AG	4,305	42.480	182,876.40	
CAPGEMINI SE	11,555	171.000	1,975,905.00	
DASSAULT SYSTEMES SE	46,266	38.055	1,760,652.63	
NEMETSCHEK SE	3,011	64.760	194,992.36	
SAP SE	71,964	116.620	8,392,441.68	
NOKIA OYJ	379,853	4.501	1,709,718.35	
ASM INTERNATIONAL NV	3,170	357.650	1,133,750.50	
ASML HOLDING NV	27,834	603.400	16,795,035.60	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	93,057	35.560	3,309,106.92	
STMICROELECTRONICS NV	48,663	45.630	2,220,492.69	
CELLNEX TELECOM SA	41,167	37.670	1,550,760.89	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	225,304	22.400	5,046,809.60	
ELISA OYJ	10,160	54.780	556,564.80	
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	28,190	12.375	348,851.25	
KONINKLIJKE KPN NV	222,179	3.319	737,412.10	
ORANGE	127,798	11.422	1,459,708.75	
TELECOM ITALIA SPA	696,355	0.307	213,780.98	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	79,654	2.949	234,899.64	
TELEFONICA SA	357,425	4.060	1,451,145.50	
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	5,269	14.800	77,981.20	
ACCIONA SA	1,810	178.600	323,266.00	
CORP ACCIONA ENERGIAS RENOVA	4,317	34.640	149,540.88	
E.ON SE	164,322	11.885	1,952,966.97	
EDP RENOVAVEIS SA	17,764	20.750	368,603.00	
EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	195,232	5.060	987,873.92	
ELIA GROUP SA/NV	2,111	126.300	266,619.30	
ENAGAS SA	14,471	18.370	265,832.27	
ENDESA SA	25,535	20.430	521,680.05	
ENEL SPA	566,643	5.992	3,395,324.85	
ENGIE	117,899	15.260	1,799,138.74	

FORTUM OYJ	24,312	14.730	358,115.76	
IBERDROLA SA	427,172	11.765	5,025,678.58	
NATURGY ENERGY GROUP SA	10,603	28.620	303,457.86	
RED ELECTRICA CORPORACION SA	23,632	16.640	393,236.48	
RWE AG	44,264	41.000	1,814,824.00	
SNAM SPA	133,867	5.154	689,950.51	
TERNA-RETE ELETTRICA NAZIONA	101,686	7.924	805,759.86	
VEOLIA ENVIRONNEMENT	48,732	29.230	1,424,436.36	
VERBUND AG	4,503	81.100	365,193.30	
BOLLORE SE	69,288	5.750	398,406.00	
PUBLICIS GROUPE	15,558	72.120	1,122,042.96	
SCOUT24 SE	4,671	53.820	251,393.22	
UNIVERSAL MUSIC GROUP NV	49,395	21.880	1,080,762.60	
VIVENDI SE	57,161	9.452	540,285.77	
AROUNDTOWN SA	73,508	1.255	92,252.54	
LEG IMMOBILIEN SE	4,538	52.600	238,698.80	
VONOVIA SE	52,313	18.460	965,697.98	
ユーロ小計	12,725,746		330,206,650.00 (48,421,503,156)	
合計	77,277,220		452,167,668,517 (452,167,668,517)	

(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	601銘柄	68.5%	71.9%
カナダ・ドル	株式	85銘柄	3.5%	3.7%
オーストラリア・ドル	株式	49銘柄	2.1%	2.2%
香港・ドル	株式	27銘柄	0.7%	0.8%
シンガポール・ドル	株式	16銘柄	0.3%	0.4%
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	78銘柄	4.5%	4.7%
イスラエル・シケル	株式	11銘柄	0.1%	0.1%
スイス・フラン	株式	43銘柄	3.1%	3.2%
デンマーク・クローネ	株式	16銘柄	0.9%	1.0%
ノルウェー・クローネ	株式	12銘柄	0.2%	0.2%
スウェーデン・クローナ	株式	45銘柄	1.0%	1.1%
ユーロ	株式	221銘柄	10.2%	10.7%

(b) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	アメリカ・ドル	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	11,189.00	1,359,687.28	
		AMERICAN HOMES 4 RENT- A	20,093.00	650,611.34	
		AMERICAN TOWER CORP	32,161.00	6,794,332.86	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	35,166.00	674,483.88	

	AVALONBAY COMMUNITIES INC	10,245.00	1,742,572.05	
	BOSTON PROPERTIES INC	9,604.00	495,374.32	
	CAMDEN PROPERTY TRUST	7,861.00	816,836.51	
	CROWN CASTLE INC	30,695.00	4,105,456.25	
	DIGITAL REALTY TRUST INC	20,462.00	1,898,873.60	
	EQUINIX INC	6,342.00	4,509,415.68	
	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	11,186.00	738,611.58	
	EQUITY RESIDENTIAL	26,128.00	1,562,715.68	
	ESSEX PROPERTY TRUST INC	4,379.00	924,056.58	
	EXTRA SPACE STORAGE INC	9,883.00	1,615,079.86	
	GAMING AND LEISURE PROPERTIE	17,613.00	900,024.30	
	HEALTHCARE REALTY TRUST INC	22,843.00	451,377.68	
	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	36,377.00	783,196.81	
	HOST HOTELS & RESORTS INC	46,189.00	744,104.79	
	INVITATION HOMES INC	44,730.00	1,429,570.80	
	IRON MOUNTAIN INC	19,659.00	1,064,534.85	
	KIMCO REALTY CORP	44,824.00	850,311.28	
	MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	48,792.00	419,611.20	
	MID-AMERICA APARTMENT COMM	7,866.00	1,173,213.90	
	PROLOGIS INC	63,644.00	7,816,119.64	
	PUBLIC STORAGE	11,097.00	3,475,025.55	
	REALTY INCOME CORP	42,018.00	2,601,754.56	
	REGENCY CENTERS CORP	9,608.00	576,383.92	
	SBA COMMUNICATIONS CORP	7,141.00	1,868,585.47	
	SIMON PROPERTY GROUP INC	22,292.00	2,441,196.92	
	SUN COMMUNITIES INC	8,247.00	1,153,590.36	
	UDR INC	20,610.00	832,850.10	
	VENTAS INC	28,342.00	1,255,267.18	
	VICI PROPERTIES INC	68,586.00	2,249,620.80	
	WELLTOWER INC	31,795.00	2,372,860.85	
	WEYERHAEUSER CO	54,126.00	1,655,173.08	
	WP CAREY INC	13,861.00	1,007,556.09	
	アメリカ・ドル小計	905,654.00	65,010,037.60 (8,667,138,213)	
カナダ・ドル	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	8,170.00	389,463.90	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	7,441.00	160,576.78	
	カナダ・ドル小計	15,611.00	550,040.68 (54,564,035)	
オーストラリア・ドル	APA GROUP	75,718.00	791,253.10	
	DEXUS/AU	79,604.00	607,378.52	
	GOODMAN GROUP	119,422.00	2,292,902.40	
	GPT GROUP	121,221.00	517,613.67	
	LENDLEASE GROUP	36,263.00	285,027.18	
	MIRVAC GROUP	251,619.00	558,594.18	

	SCENTRE GROUP	350,311.00	973,864.58	
	STOCKLAND	193,824.00	810,184.32	
	TRANSURBAN GROUP	210,600.00	3,106,350.00	
	VICINITY CENTRES	241,241.00	474,038.56	
	オーストラリア・ドル小計	1,679,823.00	10,417,206.51 (929,527,337)	
香港・ドル	HKT TRUST AND HKT LTD-SS	276,000.00	2,936,640.00	
	LINK REIT	189,400.00	9,773,040.00	
	香港・ドル小計	465,400.00	12,709,680.00 (215,937,463)	
シンガポール・ドル	CAPITALAND ASCENDAS REIT	219,000.00	621,960.00	
	CAPITALAND INTEGRATED COMMER	408,716.00	821,519.16	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	208,100.00	364,175.00	
	MAPLETREE PAN ASIA COM TRUST	112,400.00	203,444.00	
	シンガポール・ドル小計	948,216.00	2,011,098.16 (201,934,366)	
イギリス・ポンド	BRITISH LAND CO PLC	49,008.00	192,307.39	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	59,857.00	384,281.94	
	SEGRO PLC	78,831.00	611,728.56	
	イギリス・ポンド小計	187,696.00	1,188,317.89 (197,878,695)	
ユーロ	COVIVIO	2,388.00	130,146.00	
	GECINA SA	3,082.00	298,491.70	
	KLEPIERRE	13,600.00	288,592.00	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	8,942.00	443,702.04	
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	9,893.00	276,410.42	
	ユーロ小計	37,905.00	1,437,342.16 (210,771,854)	
投資証券合計			10,477,751,964 (10,477,751,964)	
合 計			10,477,751,964 (10,477,751,964)	

(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	1.8%	82.7%
カナダ・ドル	投資証券 2銘柄	0.0%	0.5%
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 2銘柄	0.0%	2.1%
シンガポール・ドル	投資証券 4銘柄	0.0%	1.9%
イギリス・ポンド	投資証券 3銘柄	0.0%	1.9%
ユーロ	投資証券 5銘柄	0.0%	2.0%

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

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)	(2023年4月13日現在)
資産の部		
流動資産		
預金	-	114,564,335
金銭信託	14,004,575	30,022,959
コール・ローン	537,206,904	672,588,966
国債証券	155,013,648,989	152,733,216,558
未収入金	87,233,725	-
未収利息	1,052,104,210	1,108,363,241
前払費用	55,878,885	88,603,740
流動資産合計	156,760,077,288	154,747,359,799
資産合計	156,760,077,288	154,747,359,799
負債の部		
流動負債		
未払解約金	202,299,339	378,339,764
その他未払費用	1,344	2,618
流動負債合計	202,300,683	378,342,382
負債合計	202,300,683	378,342,382
純資産の部		
元本等		
元本	78,998,924,437	77,797,645,540
剰余金		
剰余金又は欠損金 ()	77,558,852,168	76,571,371,877
元本等合計	156,557,776,605	154,369,017,417
純資産合計	156,557,776,605	154,369,017,417
負債純資産合計	156,760,077,288	154,747,359,799

(2) 注記表

(重要な会計方針の注記)

項 目	自 2022年4月14日 至 2023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>

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

(重要な会計上の見積りに関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

項目	(2022年4月13日現在)	(2023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	78,998,924,437口	77,797,645,540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 1.9842円 (1万口当たりの純資産額19,842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 2022年4月14日 至 2023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	(1) 金融商品の内容 1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、国債証券を組み入れております。 2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。 当計算期間については、為替予約取引を行っております。 3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 (2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。

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

・金融商品の時価等に関する事項

項目	(2023年4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） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

自 2022年4月14日 至 2023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)

(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

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
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

(2023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	78,998,924,437円
同期中における追加設定元本額	11,564,686,333円
同期中における一部解約元本額	12,765,965,230円
2023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	26,287,705,385円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	925,109,815円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	2,309,569,115円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	1,286,981,811円
SMAM・グローバルバランスファンド(機動的資産配分型)	164,754,130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)	6,338,663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)	30,114,267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)	104,058,978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)	273,427,860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)	198,862,879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)	315,911,452円
三井住友・DC年金バランスゼロ(債券型)	23,966,215円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	75,140,503円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	108,814,008円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	69,026,297円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2050	29,892,971円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	88,271,146円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	67,071,279円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	179,229,608円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	53,838,460円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	27,132,651円
三井住友・DCつみたてN I S A・世界分散ファンド	191,199,178円
三井住友D S・外国債券インデックス年金ファンド	778,625,678円
三井住友D S・年金バランス30(債券重点型)	37,417,494円
三井住友D S・年金バランス50(標準型)	116,572,869円
三井住友D S・年金バランス70(株式重点型)	77,324,190円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2060	3,752,407円
日興F W S・先進国債インデックス(為替ヘッジなし)	940,190,221円
三井住友D S・先進国債インデックス・ファンド	140,015,831円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2035	27,622円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2040	32,834円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2045	40,651円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2055	47,947円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2065	47,947円
三井住友D S・FW専用ポートフォリオ・レベル1(保守型)	46,616円
三井住友D S・FW専用ポートフォリオ・レベル2(安定型)	54,445円
三井住友D S・FW専用ポートフォリオ・レベル3(安定成長型)	59,419円
三井住友D S・FW専用ポートフォリオ・レベル4(成長型)	62,438円
三井住友D S・FW専用ポートフォリオ・レベル5(積極成長型)	64,457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>	4,382,791,179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>	28,611,877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>	5,408,178,776円
S M A M・バランスファンドV A 3 7 . 5<適格機関投資家専用>	3,924,633,021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>	9,149,265,401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>	29,825,111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>	71,393,142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>	619,025,027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>	110,475,622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>	939,572,337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>	1,260,343,854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>	1,323,429,747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>	4,054,334,071円
S M A M・バランスV A株4 0 T<適格機関投資家限定>	604,716円
S M A M・外国債券パッシブファンドV A<適格機関投資家限定>	6,974,187,776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)	328,718,309円

SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	117,681,971円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>	67,375,516円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>	30,693,061円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用>	11,644,067円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>	79,129,938円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	363,615,745円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A2<適格機関投資家専用>	86,101,828円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A2<適格機関投資家専用>	37,643,421円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A2<適格機関投資家専用>	5,511,845円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L2<適格機関投資家専用>	872,542,732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>	531,620,745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>	723,066,850円
SMAM・世界バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	371,159,278円
SMAM・世界バランスファンドVA2<適格機関投資家限定>	250,326,030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>	103,128,240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>	107,613,363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>	137,472,367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>	385,128,840円
合 計	77,797,645,540円

(3) 附属明細表

有価証券明細表

(a) 株式

該当事項はありません。

(b) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカ・ドル	T 0.25 05/31/25	4,400,000.00	4,072,024.00	
		T 0.25 06/30/25	2,900,000.00	2,680,615.00	
		T 0.25 07/31/25	300,000.00	276,375.00	
		T 0.25 09/30/25	2,000,000.00	1,836,360.00	
		T 0.25 10/31/25	1,000,000.00	914,490.00	
		T 0.375 04/30/25	3,000,000.00	2,790,330.00	
		T 0.375 07/31/27	2,500,000.00	2,185,675.00	
		T 0.375 09/15/24	3,000,000.00	2,839,140.00	
		T 0.375 09/30/27	4,800,000.00	4,179,264.00	
		T 0.375 11/30/25	2,000,000.00	1,830,500.00	
		T 0.375 12/31/25	3,000,000.00	2,744,100.00	
		T 0.5 03/31/25	1,600,000.00	1,496,048.00	
		T 0.5 04/30/27	1,200,000.00	1,062,348.00	
		T 0.5 05/31/27	2,500,000.00	2,208,250.00	
		T 0.5 06/30/27	4,000,000.00	3,525,840.00	
		T 0.5 10/31/27	1,000,000.00	873,670.00	
		T 0.625 03/31/27	2,400,000.00	2,140,992.00	

T 0.625 05/15/30	5,000,000.00	4,128,600.00	
T 0.625 07/31/26	3,600,000.00	3,262,068.00	
T 0.625 08/15/30	7,000,000.00	5,755,680.00	
T 0.625 10/15/24	4,400,000.00	4,169,000.00	
T 0.625 11/30/27	3,400,000.00	2,982,616.00	
T 0.625 12/31/27	7,200,000.00	6,304,320.00	
T 0.75 01/31/28	5,900,000.00	5,187,457.00	
T 0.75 11/15/24	5,200,000.00	4,924,764.00	
T 0.875 11/15/30	7,000,000.00	5,846,750.00	
T 1 07/31/28	5,900,000.00	5,192,767.00	
T 1 12/15/24	4,500,000.00	4,272,255.00	
T 1.125 01/15/25	2,000,000.00	1,899,320.00	
T 1.125 02/15/31	8,500,000.00	7,214,375.00	
T 1.125 02/28/25	1,500,000.00	1,421,625.00	
T 1.125 02/28/27	2,000,000.00	1,825,580.00	
T 1.125 05/15/40	2,800,000.00	1,885,996.00	
T 1.125 08/15/40	3,100,000.00	2,071,544.00	
T 1.125 08/31/28	3,500,000.00	3,095,085.00	
T 1.25 05/15/50	5,100,000.00	2,988,345.00	
T 1.25 05/31/28	3,000,000.00	2,685,270.00	
T 1.25 06/30/28	3,000,000.00	2,680,770.00	
T 1.25 08/15/31	5,200,000.00	4,397,744.00	
T 1.25 09/30/28	4,500,000.00	3,998,565.00	
T 1.25 11/30/26	4,200,000.00	3,861,858.00	
T 1.25 12/31/26	2,300,000.00	2,112,389.00	
T 1.375 01/31/25	1,900,000.00	1,811,973.00	
T 1.375 08/15/50	4,500,000.00	2,721,870.00	
T 1.375 08/31/26	7,100,000.00	6,584,824.00	
T 1.375 10/31/28	6,000,000.00	5,361,660.00	
T 1.375 11/15/31	4,900,000.00	4,168,528.00	
T 1.375 11/15/40	3,500,000.00	2,437,050.00	
T 1.375 12/31/28	2,500,000.00	2,230,500.00	
T 1.5 01/31/27	4,400,000.00	4,072,728.00	
T 1.5 02/15/25	3,000,000.00	2,863,650.00	
T 1.5 02/15/30	2,100,000.00	1,855,980.00	
T 1.5 09/30/24	3,000,000.00	2,883,210.00	
T 1.5 10/31/24	5,500,000.00	5,276,645.00	
T 1.5 11/30/24	800,000.00	766,576.00	
T 1.5 11/30/28	2,300,000.00	2,067,079.00	
T 1.625 02/15/26	2,900,000.00	2,736,121.00	
T 1.625 05/15/26	12,450,000.00	11,702,253.00	
T 1.625 05/15/31	5,500,000.00	4,820,750.00	
T 1.625 08/15/29	4,950,000.00	4,447,228.50	
T 1.625 09/30/26	3,900,000.00	3,646,422.00	

T 1.625 11/15/50	3,200,000.00	2,066,912.00	
T 1.625 11/30/26	200,000.00	186,550.00	
T 1.75 01/31/29	4,300,000.00	3,909,431.00	
T 1.75 03/15/25	1,500,000.00	1,437,555.00	
T 1.75 06/30/24	6,200,000.00	6,003,584.00	
T 1.75 07/31/24	850,000.00	821,771.50	
T 1.75 08/15/41	4,400,000.00	3,221,240.00	
T 1.75 11/15/29	1,300,000.00	1,176,474.00	
T 1.75 12/31/24	4,000,000.00	3,843,720.00	
T 1.75 12/31/26	3,500,000.00	3,275,020.00	
T 1.875 02/15/32	5,300,000.00	4,687,691.00	
T 1.875 02/15/41	3,300,000.00	2,497,143.00	
T 1.875 02/15/51	5,800,000.00	3,989,414.00	
T 1.875 02/28/27	3,400,000.00	3,188,826.00	
T 1.875 02/28/29	2,800,000.00	2,561,496.00	
T 1.875 08/31/24	3,800,000.00	3,676,766.00	
T 1.875 11/15/51	3,300,000.00	2,263,437.00	
T 2 02/15/25	3,500,000.00	3,372,145.00	
T 2 02/15/50	2,800,000.00	1,999,844.00	
T 2 04/30/24	2,000,000.00	1,947,040.00	
T 2 05/31/24	3,300,000.00	3,209,118.00	
T 2 06/30/24	4,100,000.00	3,981,961.00	
T 2 08/15/25	3,300,000.00	3,164,238.00	
T 2 08/15/51	2,900,000.00	2,054,621.00	
T 2 11/15/26	5,000,000.00	4,725,550.00	
T 2 11/15/41	3,800,000.00	2,897,424.00	
T 2.125 03/31/24	6,500,000.00	6,343,610.00	
T 2.125 05/15/25	600,000.00	578,010.00	
T 2.125 07/31/24	3,500,000.00	3,401,405.00	
T 2.125 09/30/24	4,000,000.00	3,880,000.00	
T 2.125 11/30/24	2,600,000.00	2,516,852.00	
T 2.25 02/15/27	4,400,000.00	4,189,152.00	
T 2.25 02/15/52	1,700,000.00	1,277,023.00	
T 2.25 03/31/26	8,200,000.00	7,867,982.00	
T 2.25 04/30/24	3,800,000.00	3,708,572.00	
T 2.25 05/15/41	3,000,000.00	2,407,590.00	
T 2.25 08/15/27	4,200,000.00	3,983,658.00	
T 2.25 08/15/46	2,450,000.00	1,867,488.00	
T 2.25 08/15/49	3,500,000.00	2,652,930.00	
T 2.25 10/31/24	800,000.00	776,280.00	
T 2.25 11/15/24	5,100,000.00	4,946,898.00	
T 2.25 11/15/25	4,000,000.00	3,848,720.00	
T 2.25 11/15/27	4,400,000.00	4,163,544.00	
T 2.25 12/31/24	3,900,000.00	3,778,710.00	

T 2.375 02/15/42	2,800,000.00	2,274,048.00	
T 2.375 03/31/29	5,000,000.00	4,700,550.00	
T 2.375 05/15/27	3,000,000.00	2,865,810.00	
T 2.375 05/15/29	2,400,000.00	2,255,664.00	
T 2.375 05/15/51	3,900,000.00	3,016,143.00	
T 2.375 08/15/24	5,600,000.00	5,456,472.00	
T 2.375 11/15/49	1,900,000.00	1,479,321.00	
T 2.5 01/31/25	3,400,000.00	3,307,010.00	
T 2.5 02/15/45	1,400,000.00	1,129,212.00	
T 2.5 02/15/46	1,000,000.00	802,200.00	
T 2.5 02/28/26	2,100,000.00	2,029,230.00	
T 2.5 03/31/27	3,000,000.00	2,879,940.00	
T 2.5 05/15/24	2,200,000.00	2,153,162.00	
T 2.5 05/15/46	1,600,000.00	1,282,832.00	
T 2.625 01/31/26	2,200,000.00	2,134,110.00	
T 2.625 02/15/29	1,800,000.00	1,718,010.00	
T 2.625 03/31/25	1,000,000.00	974,880.00	
T 2.625 04/15/25	4,500,000.00	4,382,550.00	
T 2.625 05/31/27	4,800,000.00	4,626,000.00	
T 2.625 07/31/29	1,100,000.00	1,047,288.00	
T 2.625 12/31/25	1,400,000.00	1,359,008.00	
T 2.75 02/15/28	5,300,000.00	5,122,980.00	
T 2.75 02/28/25	2,000,000.00	1,954,020.00	
T 2.75 04/30/27	2,700,000.00	2,615,193.00	
T 2.75 05/15/25	3,000,000.00	2,927,550.00	
T 2.75 05/31/29	1,400,000.00	1,343,314.00	
T 2.75 06/30/25	900,000.00	878,076.00	
T 2.75 08/15/32	4,200,000.00	3,979,500.00	
T 2.75 08/15/42	2,000,000.00	1,720,500.00	
T 2.75 08/15/47	1,800,000.00	1,509,912.00	
T 2.75 08/31/25	3,400,000.00	3,314,796.00	
T 2.75 11/15/42	300,000.00	257,283.00	
T 2.75 11/15/47	1,500,000.00	1,258,905.00	
T 2.875 04/30/25	400,000.00	391,328.00	
T 2.875 04/30/29	3,500,000.00	3,383,240.00	
T 2.875 05/15/28	4,200,000.00	4,076,184.00	
T 2.875 05/15/32	5,700,000.00	5,462,937.00	
T 2.875 05/15/43	1,200,000.00	1,048,428.00	
T 2.875 05/15/49	1,400,000.00	1,206,968.00	
T 2.875 05/15/52	3,200,000.00	2,757,408.00	
T 2.875 05/31/25	3,100,000.00	3,032,823.00	
T 2.875 06/15/25	2,000,000.00	1,956,820.00	
T 2.875 08/15/28	4,500,000.00	4,363,290.00	
T 2.875 08/15/45	800,000.00	688,936.00	

T 2.875 11/15/46	900,000.00	774,117.00	
T 2.875 11/30/25	2,500,000.00	2,443,150.00	
T 3 02/15/47	2,500,000.00	2,195,825.00	
T 3 02/15/48	2,400,000.00	2,110,440.00	
T 3 02/15/49	3,300,000.00	2,910,930.00	
T 3 05/15/42	800,000.00	718,232.00	
T 3 05/15/45	900,000.00	791,694.00	
T 3 05/15/47	1,800,000.00	1,580,436.00	
T 3 07/15/25	2,000,000.00	1,961,660.00	
T 3 08/15/48	900,000.00	792,117.00	
T 3 08/15/52	3,000,000.00	2,653,590.00	
T 3 09/30/25	1,000,000.00	980,410.00	
T 3 10/31/25	2,600,000.00	2,549,248.00	
T 3 11/15/44	1,000,000.00	881,930.00	
T 3 11/15/45	800,000.00	703,512.00	
T 3.125 02/15/42	1,000,000.00	917,360.00	
T 3.125 02/15/43	2,300,000.00	2,091,022.00	
T 3.125 05/15/48	2,400,000.00	2,159,856.00	
T 3.125 08/15/25	3,000,000.00	2,949,840.00	
T 3.125 08/15/44	1,300,000.00	1,172,691.00	
T 3.125 11/15/28	2,900,000.00	2,846,176.00	
T 3.125 11/15/41	1,000,000.00	920,070.00	
T 3.25 05/15/42	2,200,000.00	2,048,904.00	
T 3.25 06/30/29	3,000,000.00	2,960,850.00	
T 3.375 05/15/44	500,000.00	470,005.00	
T 3.375 08/15/42	3,000,000.00	2,843,670.00	
T 3.375 11/15/48	3,100,000.00	2,921,378.00	
T 3.5 01/31/28	1,000,000.00	1,000,190.00	
T 3.5 01/31/30	2,500,000.00	2,507,225.00	
T 3.5 02/15/33	3,700,000.00	3,729,193.00	
T 3.5 02/15/39	200,000.00	199,636.00	
T 3.625 02/15/44	600,000.00	586,746.00	
T 3.625 02/15/53	100,000.00	99,875.00	
T 3.625 08/15/43	1,000,000.00	981,130.00	
T 3.75 08/15/41	1,100,000.00	1,109,042.00	
T 3.75 11/15/43	700,000.00	698,831.00	
T 3.875 01/15/26	5,300,000.00	5,314,045.00	
T 3.875 02/15/43	2,600,000.00	2,646,696.00	
T 3.875 08/15/40	500,000.00	517,820.00	
T 3.875 09/30/29	3,500,000.00	3,580,570.00	
T 3.875 12/31/29	1,500,000.00	1,537,440.00	
T 4 02/15/26	2,000,000.00	2,013,200.00	
T 4 02/28/30	1,500,000.00	1,550,385.00	
T 4 10/31/29	1,600,000.00	1,649,392.00	

T 4 11/15/42	2,000,000.00	2,073,740.00	
T 4 11/15/52	3,500,000.00	3,741,710.00	
T 4.125 01/31/25	3,500,000.00	3,501,680.00	
T 4.125 10/31/27	3,500,000.00	3,585,925.00	
T 4.125 11/15/32	4,600,000.00	4,864,500.00	
T 4.25 05/15/39	100,000.00	108,929.00	
T 4.25 10/15/25	2,000,000.00	2,019,800.00	
T 4.25 11/15/40	600,000.00	650,610.00	
T 4.25 12/31/24	1,500,000.00	1,502,595.00	
T 4.375 05/15/40	900,000.00	992,124.00	
T 4.375 05/15/41	300,000.00	329,664.00	
T 4.375 11/15/39	300,000.00	330,918.00	
T 4.5 05/15/38	2,000,000.00	2,238,460.00	
T 4.5 08/15/39	300,000.00	336,321.00	
T 4.5 11/15/25	3,800,000.00	3,863,650.00	
T 4.625 02/15/40	1,000,000.00	1,136,190.00	
T 4.625 02/28/25	3,800,000.00	3,840,204.00	
T 4.75 02/15/41	900,000.00	1,035,819.00	
T 5.25 11/15/28	500,000.00	544,355.00	
T 5.375 02/15/31	320,000.00	363,260.80	
T 6 02/15/26	1,000,000.00	1,061,560.00	
T-BOND 15/11/2027	1,000,000.00	1,110,350.00	
アメリカ・ドル小計	620,620,000.00	567,049,931.80 (75,599,096,908)	
カナダ・ドル			
CAN 0.5 09/01/25	2,700,000.00	2,511,756.00	
CAN 1 06/01/27	1,100,000.00	1,014,002.00	
CAN 1.25 03/01/27	400,000.00	372,192.00	
CAN 1.25 06/01/30	5,500,000.00	4,936,690.00	
CAN 1.5 04/01/25	700,000.00	670,908.00	
CAN 1.5 06/01/26	3,200,000.00	3,036,576.00	
CAN 1.5 09/01/24	2,200,000.00	2,126,894.00	
CAN 1.5 12/01/31	2,300,000.00	2,062,203.00	
CAN 1.75 12/01/53	1,000,000.00	750,820.00	
CAN 2 06/01/28	700,000.00	669,620.00	
CAN 2.25 06/01/25	500,000.00	486,585.00	
CAN 2.25 06/01/29	1,100,000.00	1,061,709.00	
CAN 2.25 12/01/29	600,000.00	577,800.00	
CAN 2.5 06/01/24	2,100,000.00	2,062,557.00	
CAN 2.5 12/01/32	2,300,000.00	2,226,791.00	
CAN 2.75 06/01/33	200,000.00	197,462.00	
CAN 2.75 12/01/48	1,300,000.00	1,230,658.00	
CAN 3 10/01/25	900,000.00	888,417.00	
CAN 3.5 12/01/45	1,200,000.00	1,280,196.00	
CAN 4 06/01/41	1,300,000.00	1,462,786.00	

	CAN 5 06/01/37	600,000.00	734,286.00	
	CAN 5.75 06/01/29	250,000.00	289,727.50	
	CAN 5.75 06/01/33	400,000.00	498,856.00	
	CANADA 2.75 12/01/64	700,000.00	655,690.00	
	カナダ・ドル小計	33,250,000.00	31,805,181.50 (3,155,074,005)	
オーストラ リア・ドル	ACGB 0.25 11/21/25	800,000.00	747,672.00	
	ACGB 0.5 09/21/26	100,000.00	92,151.00	
	ACGB 1.5 06/21/31	4,400,000.00	3,867,996.00	
	ACGB 1.75 06/21/51	500,000.00	327,425.00	
	ACGB 1.75 11/21/32	1,400,000.00	1,228,990.00	
	ACGB 2.25 05/21/28	1,300,000.00	1,254,994.00	
	ACGB 2.5 05/21/30	2,600,000.00	2,497,404.00	
	ACGB 2.75 04/21/24	2,500,000.00	2,489,325.00	
	ACGB 2.75 06/21/35	800,000.00	750,568.00	
	ACGB 2.75 11/21/27	1,300,000.00	1,287,949.00	
	ACGB 2.75 11/21/28	200,000.00	197,294.00	
	ACGB 2.75 11/21/29	1,800,000.00	1,763,766.00	
	ACGB 3 03/21/47	1,200,000.00	1,060,788.00	
	ACGB 3 11/21/33	1,000,000.00	976,260.00	
	ACGB 3.25 04/21/25	1,300,000.00	1,308,463.00	
	ACGB 3.25 04/21/29	800,000.00	808,912.00	
	ACGB 3.25 06/21/39	2,000,000.00	1,916,980.00	
	ACGB 3.75 04/21/37	1,200,000.00	1,235,616.00	
	ACGB 4.25 04/21/26	2,150,000.00	2,233,076.00	
	ACGB 4.5 04/21/33	900,000.00	996,228.00	
	オーストラリア・ドル小計	28,250,000.00	27,041,857.00 (2,412,944,900)	
シンガポ ール・ドル	SIGB 1.25 11/01/26	600,000.00	567,600.00	
	SIGB 1.625 07/01/31	1,000,000.00	912,300.00	
	SIGB 2.25 08/01/36	1,000,000.00	948,500.00	
	SIGB 2.625 05/01/28	800,000.00	793,040.00	
	SIGB 2.75 03/01/46	800,000.00	827,200.00	
	SIGB 2.75 04/01/42	700,000.00	717,759.00	
	SIGB 2.875 09/01/30	200,000.00	200,600.00	
	SIGB 3 09/01/24	500,000.00	499,090.00	
	SIGB 3.375 09/01/33	300,000.00	316,500.00	
	SIGB 3.5 03/01/27	1,100,000.00	1,125,960.00	
	シンガポール・ドル小計	7,000,000.00	6,908,549.00 (693,687,405)	
ニュージ ーランド・ド ル	NZGB 1.75 05/15/41	500,000.00	345,615.00	
	NZGB 2 05/15/32	800,000.00	678,832.00	
	NZGB 2.75 04/15/25	1,100,000.00	1,062,765.00	
	NZGB 2.75 05/15/51	500,000.00	384,545.00	

	NZGB 3 04/20/29	1,000,000.00	945,770.00	
	NZGB 4.5 04/15/27	1,100,000.00	1,115,356.00	
	ニュージーランド・ドル小計	5,000,000.00	4,532,883.00 (375,458,699)	
イギリス・ ポンド	UK TSY GILT	400,000.00	271,616.00	
	UKT 0.125 01/30/26	1,300,000.00	1,185,340.00	
	UKT 0.125 01/31/28	700,000.00	598,325.00	
	UKT 0.25 01/31/25	700,000.00	655,193.00	
	UKT 0.25 07/31/31	1,300,000.00	999,284.00	
	UKT 0.375 10/22/26	1,200,000.00	1,072,596.00	
	UKT 0.375 10/22/30	1,800,000.00	1,436,166.00	
	UKT 0.5 01/31/29	1,800,000.00	1,515,312.00	
	UKT 0.5 10/22/61	900,000.00	325,107.00	
	UKT 0.625 06/07/25	900,000.00	847,125.00	
	UKT 0.625 07/31/35	2,100,000.00	1,465,254.00	
	UKT 0.875 10/22/29	500,000.00	426,820.00	
	UKT 1 01/31/32	1,500,000.00	1,217,325.00	
	UKT 1 04/22/24	600,000.00	581,394.00	
	UKT 1.125 10/22/73	300,000.00	134,250.00	
	UKT 1.25 07/22/27	200,000.00	182,858.00	
	UKT 1.25 07/31/51	500,000.00	278,135.00	
	UKT 1.25 10/22/41	600,000.00	393,246.00	
	UKT 1.5 07/22/26	1,100,000.00	1,033,373.00	
	UKT 1.5 07/22/47	2,000,000.00	1,254,620.00	
	UKT 1.625 10/22/28	300,000.00	273,624.00	
	UKT 1.625 10/22/54	500,000.00	300,725.00	
	UKT 1.75 01/22/49	1,250,000.00	819,725.00	
	UKT 1.75 09/07/37	100,000.00	77,385.00	
	UKT 2 09/07/25	1,100,000.00	1,059,355.00	
	UKT 2.5 07/22/65	1,600,000.00	1,206,880.00	
	UKT 2.75 09/07/24	900,000.00	884,160.00	
	UKT 3.25 01/22/44	1,600,000.00	1,450,000.00	
	UKT 3.25 01/31/33	1,000,000.00	974,530.00	
	UKT 3.5 01/22/45	1,250,000.00	1,175,050.00	
	UKT 3.5 07/22/68	1,300,000.00	1,258,218.00	
	UKT 3.5 10/22/25	200,000.00	198,154.00	
	UKT 3.75 01/29/38	900,000.00	890,892.00	
UKT 3.75 07/22/52	1,200,000.00	1,177,344.00		
UKT 4 01/22/60	1,300,000.00	1,372,449.00		
UKT 4.125 01/29/27	1,300,000.00	1,318,070.00		
UKT 4.25 03/07/36	900,000.00	950,868.00		
UKT 4.25 06/07/32	500,000.00	531,555.00		
UKT 4.25 09/07/39	600,000.00	628,296.00		
UKT 4.25 12/07/27	900,000.00	931,815.00		

	UKT 4.25 12/07/40	600,000.00	629,304.00	
	UKT 4.25 12/07/46	1,500,000.00	1,578,285.00	
	UKT 4.25 12/07/49	900,000.00	953,559.00	
	UKT 4.25 12/07/55	1,700,000.00	1,837,462.00	
	UKT 4.5 09/07/34	1,100,000.00	1,191,289.00	
	UKT 4.5 12/07/42	1,050,000.00	1,138,924.50	
	UKT 4.75 12/07/30	1,150,000.00	1,251,338.00	
	UKT 4.75 12/07/38	1,000,000.00	1,109,600.00	
	UKT 5 03/07/25	1,300,000.00	1,327,898.00	
	UKT 6 12/07/28	650,000.00	734,643.00	
	イギリス・ポンド小計	50,050,000.00	45,104,736.50 (7,510,840,722)	
イスラエル・シュケル	ILGOV 0.4 10/31/24	1,800,000.00	1,698,300.00	
	ILGOV 0.5 04/30/25	4,600,000.00	4,281,496.00	
	ILGOV 1 03/31/30	700,000.00	582,974.00	
	ILGOV 2.25 09/28/28	500,000.00	463,290.00	
	ILGOV 3.75 03/31/47	3,700,000.00	3,544,785.00	
	ILGOV 6.25 10/30/26	2,600,000.00	2,801,682.00	
	イスラエル・シュケル小計	13,900,000.00	13,372,527.00 (485,167,315)	
デンマーク・クローネ	DGB 0 11/15/31	500,000.00	401,865.00	
	DGB 0.25 11/15/52	1,800,000.00	943,578.00	
	DGB 0.5 11/15/27	8,000,000.00	7,270,800.00	
	DGB 0.5 11/15/29	5,400,000.00	4,722,462.00	
	DGB 1.75 11/15/25	2,400,000.00	2,336,064.00	
	DGB 4.5 11/15/39	8,000,000.00	9,890,720.00	
	デンマーク・クローネ小計	26,100,000.00	25,565,489.00 (503,128,824)	
ノルウェー・クローネ	NGB 1.375 08/19/30	6,200,000.00	5,564,128.00	
	NGB 1.5 02/19/26	3,000,000.00	2,881,770.00	
	NGB 1.75 02/17/27	200,000.00	191,632.00	
	NGB 1.75 03/13/25	1,200,000.00	1,169,628.00	
	NGB 1.75 09/06/29	5,000,000.00	4,662,900.00	
	NGB 2 04/26/28	5,900,000.00	5,652,790.00	
	ノルウェー・クローネ小計	21,500,000.00	20,122,848.00 (256,767,539)	
スウェーデン・クローナ	SGB 0.125 05/12/31	500,000.00	418,125.00	
	SGB 0.75 05/12/28	3,700,000.00	3,400,300.00	
	SGB 0.75 11/12/29	3,700,000.00	3,333,626.00	
	SGB 1 11/12/26	6,200,000.00	5,859,248.00	
	SGB 2.5 05/12/25	5,000,000.00	4,956,400.00	
	SGB 3.5 03/30/39	5,300,000.00	6,028,326.00	
	スウェーデン・クローナ小計	24,400,000.00	23,996,025.00 (309,308,761)	
	MBONO 10 12/05/24	32,000,000.00	31,676,160.00	

メキシコ・ペソ	MBONO 5 03/06/25	12,000,000.00	10,893,360.00	
	MBONO 5.75 03/05/26	19,000,000.00	17,161,180.00	
	MBONO 7.5 05/26/33	3,000,000.00	2,743,560.00	
	MBONO 7.5 06/03/27	16,000,000.00	15,129,600.00	
	MBONO 7.75 05/29/31	27,000,000.00	25,393,500.00	
	MBONO 7.75 11/23/34	18,000,000.00	16,719,120.00	
	MBONO 8 11/07/47	5,000,000.00	4,552,650.00	
	MBONO 8.5 05/31/29	20,000,000.00	19,669,000.00	
	MBONO 8.5 11/18/38	40,000,000.00	38,539,600.00	
メキシコ・ペソ小計		192,000,000.00	182,477,730.00 (1,349,130,849)	
オフショア・人民元	CGB 2.18 08/25/25	39,000,000.00	38,737,920.00	
	CGB 2.24 05/25/25	31,000,000.00	30,869,800.00	
	CGB 2.26 02/24/25	18,000,000.00	17,954,100.00	
	CGB 2.46 02/15/26	15,000,000.00	14,987,250.00	
	CGB 2.47 09/02/24	26,000,000.00	26,044,200.00	
	CGB 2.48 04/15/27	9,000,000.00	8,951,130.00	
	CGB 2.5 07/25/27	16,000,000.00	15,894,080.00	
	CGB 2.62 09/25/29	23,000,000.00	22,740,790.00	
	CGB 2.64 01/15/28	9,000,000.00	8,987,760.00	
	CGB 2.69 08/12/26	51,000,000.00	51,196,860.00	
	CGB 2.8 03/24/29	26,000,000.00	26,018,200.00	
	CGB 2.8 11/15/32	21,000,000.00	20,889,750.00	
	CGB 2.91 10/14/28	21,000,000.00	21,191,100.00	
	CGB 3.02 05/27/31	43,000,000.00	43,621,350.00	
	CGB 3.12 10/25/52	2,000,000.00	1,971,260.00	
CGB 3.72 04/12/51	38,000,000.00	41,404,420.00		
オフショア・人民元小計		388,000,000.00	391,459,970.00 (7,582,462,181)	
マレーシア・リンギット	MGS 3.478 06/14/24	700,000.00	702,884.00	
	MGS 3.502 05/31/27	5,100,000.00	5,087,301.00	
	MGS 3.757 05/22/40	1,400,000.00	1,321,096.00	
	MGS 3.882 03/14/25	1,500,000.00	1,520,085.00	
	MGS 3.9 11/30/26	1,300,000.00	1,319,383.00	
	MGS 3.955 09/15/25	3,200,000.00	3,245,696.00	
	MGS 4.498 04/15/30	6,400,000.00	6,704,512.00	
	MGS 4.504 04/30/29	700,000.00	728,532.00	
	MGS 4.736 03/15/46	6,700,000.00	7,130,676.00	
マレーシア・リンギット小計		27,000,000.00	27,760,165.00 (840,500,068)	
ポーランド・ズロチ	POLGB 0.25 10/25/26	7,000,000.00	5,733,980.00	
	POLGB 0.75 04/25/25	1,800,000.00	1,621,260.00	
	POLGB 1.25 10/25/30	7,800,000.00	5,580,510.00	
	POLGB 2.25 10/25/24	8,000,000.00	7,558,000.00	

	POLGB 2.75 04/25/28	2,200,000.00	1,887,732.00	
	ポーランド・ズロチ小計	26,800,000.00	22,381,482.00 (705,276,308)	
ユーロ	BGB 0 10/22/31	2,000,000.00	1,563,800.00	
	BGB 0.1 06/22/30	200,000.00	165,198.00	
	BGB 0.35 06/22/32	300,000.00	237,474.00	
	BGB 0.4 06/22/40	300,000.00	186,474.00	
	BGB 0.5 10/22/24	1,100,000.00	1,061,104.00	
	BGB 0.65 06/22/71	400,000.00	166,216.00	
	BGB 0.8 06/22/25	700,000.00	671,076.00	
	BGB 0.8 06/22/27	800,000.00	740,128.00	
	BGB 0.8 06/22/28	1,600,000.00	1,456,416.00	
	BGB 0.9 06/22/29	900,000.00	807,696.00	
	BGB 1 06/22/26	1,800,000.00	1,706,364.00	
	BGB 1 06/22/31	1,300,000.00	1,123,330.00	
	BGB 1.25 04/22/33	1,100,000.00	938,575.00	
	BGB 1.45 06/22/37	400,000.00	320,356.00	
	BGB 1.6 06/22/47	650,000.00	462,572.50	
	BGB 1.7 06/22/50	1,100,000.00	778,536.00	
	BGB 1.9 06/22/38	1,000,000.00	840,080.00	
	BGB 2.15 06/22/66	500,000.00	373,830.00	
	BGB 2.25 06/22/57	500,000.00	390,270.00	
	BGB 2.6 06/22/24	400,000.00	398,072.00	
	BGB 3 06/22/34	200,000.00	197,794.00	
	BGB 3.75 06/22/45	600,000.00	635,094.00	
	BGB 4 03/28/32	300,000.00	324,438.00	
	BGB 4.25 03/28/41	1,000,000.00	1,122,880.00	
	BGB 4.5 03/28/26	700,000.00	734,748.00	
	BGB 5 03/28/35	1,000,000.00	1,178,410.00	
	BGB 5.5 03/28/28	1,000,000.00	1,130,040.00	
	BTPS	2,400,000.00	2,297,520.00	
	BTPS 0 12/15/24	1,300,000.00	1,231,321.00	
	BTPS 0.35 02/01/25	2,400,000.00	2,276,352.00	
	BTPS 0.45 02/15/29	2,400,000.00	1,992,120.00	
	BTPS 0.5 02/01/26	1,000,000.00	922,420.00	
	BTPS 0.85 01/15/27	1,700,000.00	1,544,705.00	
	BTPS 0.9 04/01/31	2,000,000.00	1,588,400.00	
	BTPS 0.95 06/01/32	2,100,000.00	1,609,398.00	
	BTPS 0.95 08/01/30	1,800,000.00	1,465,614.00	
	BTPS 0.95 09/15/27	800,000.00	715,904.00	
	BTPS 0.95 12/01/31	2,600,000.00	2,026,986.00	
	BTPS 1.1 04/01/27	3,000,000.00	2,737,290.00	
	BTPS 1.25 12/01/26	800,000.00	740,392.00	
	BTPS 1.45 03/01/36	400,000.00	288,724.00	

BTPS 1.45 05/15/25	700,000.00	674,191.00	
BTPS 1.45 11/15/24	1,800,000.00	1,749,474.00	
BTPS 1.5 06/01/25	1,900,000.00	1,828,484.00	
BTPS 1.6 06/01/26	1,200,000.00	1,135,224.00	
BTPS 1.65 12/01/30	2,200,000.00	1,872,992.00	
BTPS 1.7 09/01/51	1,500,000.00	869,550.00	
BTPS 1.85 05/15/24	700,000.00	689,206.00	
BTPS 1.85 07/01/25	1,000,000.00	968,910.00	
BTPS 2 02/01/28	2,000,000.00	1,861,640.00	
BTPS 2 12/01/25	1,300,000.00	1,254,201.00	
BTPS 2.05 08/01/27	1,500,000.00	1,412,685.00	
BTPS 2.1 07/15/26	1,000,000.00	959,330.00	
BTPS 2.2 06/01/27	900,000.00	855,261.00	
BTPS 2.25 09/01/36	500,000.00	396,465.00	
BTPS 2.45 09/01/33	600,000.00	513,144.00	
BTPS 2.45 09/01/50	900,000.00	622,440.00	
BTPS 2.5 11/15/25	1,200,000.00	1,173,984.00	
BTPS 2.5 12/01/24	1,300,000.00	1,283,971.00	
BTPS 2.65 12/01/27	400,000.00	384,368.00	
BTPS 2.7 03/01/47	1,550,000.00	1,166,313.00	
BTPS 2.8 03/01/67	1,000,000.00	690,460.00	
BTPS 2.8 06/15/29	1,000,000.00	946,440.00	
BTPS 2.8 12/01/28	1,600,000.00	1,530,288.00	
BTPS 2.95 09/01/38	600,000.00	504,540.00	
BTPS 3 08/01/29	3,100,000.00	2,971,629.00	
BTPS 3.1 03/01/40	500,000.00	420,760.00	
BTPS 3.25 09/01/46	1,600,000.00	1,330,640.00	
BTPS 3.35 03/01/35	850,000.00	772,318.50	
BTPS 3.45 03/01/48	1,000,000.00	853,770.00	
BTPS 3.5 03/01/30	1,000,000.00	981,500.00	
BTPS 3.75 09/01/24	2,300,000.00	2,313,064.00	
BTPS 3.85 09/01/49	1,500,000.00	1,357,725.00	
BTPS 3.85 12/15/29	300,000.00	299,796.00	
BTPS 4 02/01/37	2,600,000.00	2,511,834.00	
BTPS 4 04/30/35	700,000.00	678,139.00	
BTPS 4.5 03/01/26	1,300,000.00	1,337,934.00	
BTPS 4.75 09/01/28	2,000,000.00	2,107,620.00	
BTPS 4.75 09/01/44	900,000.00	931,491.00	
BTPS 5 03/01/25	1,000,000.00	1,030,110.00	
BTPS 5 08/01/34	2,070,000.00	2,203,452.90	
BTPS 5 08/01/39	1,800,000.00	1,911,132.00	
BTPS 5 09/01/40	1,700,000.00	1,811,248.00	
BTPS 5.75 02/01/33	1,700,000.00	1,915,475.00	
BTPS 6 05/01/31	2,200,000.00	2,516,272.00	

BTPS 6.5 11/01/27	1,700,000.00	1,911,480.00	
BTPS 7.25 11/01/26	400,000.00	450,276.00	
DBR 0 02/15/30	800,000.00	684,744.00	
DBR 0 02/15/32	3,200,000.00	2,617,120.00	
DBR 0 05/15/35	3,600,000.00	2,697,372.00	
DBR 0 08/15/29	2,500,000.00	2,162,025.00	
DBR 0 08/15/30	5,100,000.00	4,319,547.00	
DBR 0 08/15/31	2,300,000.00	1,906,884.00	
DBR 0 08/15/50	3,000,000.00	1,594,770.00	
DBR 0 08/15/50	700,000.00	373,345.00	
DBR 0 11/15/27	1,300,000.00	1,167,647.00	
DBR 0.25 02/15/27	2,300,000.00	2,119,933.00	
DBR 0.25 02/15/29	1,800,000.00	1,598,652.00	
DBR 0.25 08/15/28	1,500,000.00	1,344,690.00	
DBR 0.5 02/15/25	2,500,000.00	2,399,500.00	
DBR 0.5 02/15/26	3,400,000.00	3,211,402.00	
DBR 0.5 02/15/28	2,100,000.00	1,923,831.00	
DBR 0.5 08/15/27	2,300,000.00	2,123,958.00	
DBR 1 05/15/38	1,000,000.00	814,130.00	
DBR 1 08/15/24	1,300,000.00	1,268,566.00	
DBR 1 08/15/25	1,300,000.00	1,251,445.00	
DBR 1.25 08/15/48	1,650,000.00	1,301,536.50	
DBR 1.5 05/15/24	1,200,000.00	1,182,192.00	
DBR 1.8 08/15/53	200,000.00	173,250.00	
DBR 2.1 11/15/29	700,000.00	689,318.00	
DBR 2.3 02/15/33	200,000.00	198,996.00	
DBR 2.5 07/04/44	1,900,000.00	1,915,960.00	
DBR 2.5 08/15/46	2,700,000.00	2,740,581.00	
DBR 3.25 07/04/42	700,000.00	780,500.00	
DBR 4 01/04/37	1,300,000.00	1,532,999.00	
DBR 4.25 07/04/39	700,000.00	863,394.00	
DBR 4.75 07/04/28	1,600,000.00	1,786,688.00	
DBR 4.75 07/04/34	600,000.00	738,114.00	
DBR 4.75 07/04/40	1,450,000.00	1,906,068.50	
DBR 5.5 01/04/31	900,000.00	1,100,628.00	
DBR 5.625 01/04/28	1,000,000.00	1,143,580.00	
DBR 6.25 01/04/30	500,000.00	621,595.00	
DBR 6.5 07/04/27	1,000,000.00	1,161,680.00	
FRTR 0 02/25/25	3,000,000.00	2,843,970.00	
FRTR 0 02/25/26	3,800,000.00	3,514,924.00	
FRTR 0 02/25/27	1,100,000.00	992,079.00	
FRTR 0 03/25/25	1,900,000.00	1,797,609.00	
FRTR 0 05/25/32	1,900,000.00	1,472,823.00	
FRTR 0 11/25/29	4,500,000.00	3,770,280.00	

FRTR 0 11/25/30	3,900,000.00	3,170,076.00	
FRTR 0 11/25/31	3,000,000.00	2,366,010.00	
FRTR 0.25 11/25/26	2,900,000.00	2,657,096.00	
FRTR 0.5 05/25/25	1,300,000.00	1,238,055.00	
FRTR 0.5 05/25/26	3,500,000.00	3,268,930.00	
FRTR 0.5 05/25/29	2,300,000.00	2,017,445.00	
FRTR 0.5 05/25/40	1,300,000.00	841,724.00	
FRTR 0.5 05/25/72	100,000.00	38,676.00	
FRTR 0.5 06/25/44	1,200,000.00	709,296.00	
FRTR 0.75 02/25/28	2,000,000.00	1,822,360.00	
FRTR 0.75 05/25/28	3,300,000.00	2,995,806.00	
FRTR 0.75 05/25/52	3,000,000.00	1,618,200.00	
FRTR 0.75 11/25/28	2,600,000.00	2,338,752.00	
FRTR 1 05/25/27	2,200,000.00	2,054,844.00	
FRTR 1 11/25/25	1,300,000.00	1,242,696.00	
FRTR 1.25 05/25/34	1,200,000.00	1,002,156.00	
FRTR 1.25 05/25/36	3,700,000.00	2,969,546.00	
FRTR 1.25 05/25/38	200,000.00	154,394.00	
FRTR 1.5 05/25/31	3,050,000.00	2,780,807.00	
FRTR 1.5 05/25/50	2,400,000.00	1,654,656.00	
FRTR 1.75 05/25/66	800,000.00	540,048.00	
FRTR 1.75 06/25/39	2,700,000.00	2,234,979.00	
FRTR 1.75 11/25/24	2,600,000.00	2,550,782.00	
FRTR 2 05/25/48	2,000,000.00	1,574,540.00	
FRTR 2 11/25/32	4,000,000.00	3,711,040.00	
FRTR 2.25 05/25/24	1,700,000.00	1,684,309.00	
FRTR 2.5 05/25/30	3,100,000.00	3,058,770.00	
FRTR 2.75 10/25/27	3,850,000.00	3,859,163.00	
FRTR 3.25 05/25/45	900,000.00	900,189.00	
FRTR 3.5 04/25/26	1,800,000.00	1,839,060.00	
FRTR 4 04/25/55	1,370,000.00	1,559,498.40	
FRTR 4 04/25/60	1,400,000.00	1,609,006.00	
FRTR 4 10/25/38	2,000,000.00	2,200,560.00	
FRTR 4.5 04/25/41	2,100,000.00	2,464,770.00	
FRTR 4.75 04/25/35	800,000.00	933,984.00	
FRTR 5.5 04/25/29	1,650,000.00	1,900,602.00	
FRTR 5.75 10/25/32	400,000.00	495,928.00	
FRTR 6 10/25/25	2,100,000.00	2,261,532.00	
IRISH 0 10/18/31	500,000.00	396,720.00	
IRISH 0.9 05/15/28	500,000.00	458,610.00	
IRISH 1 05/15/26	800,000.00	761,080.00	
IRISH 1.1 05/15/29	500,000.00	458,490.00	
IRISH 1.3 05/15/33	800,000.00	693,880.00	
IRISH 1.35 03/18/31	500,000.00	452,880.00	

IRISH 1.5 05/15/50	500,000.00	345,950.00	
IRISH 1.7 05/15/37	300,000.00	253,281.00	
IRISH 2 02/18/45	1,100,000.00	887,700.00	
IRISH 2.4 05/15/30	600,000.00	593,334.00	
IRISH 5.4 03/13/25	800,000.00	840,512.00	
NETHER 0 01/15/27	1,300,000.00	1,178,060.00	
NETHER 0 07/15/30	2,600,000.00	2,157,012.00	
NETHER 0.25 07/15/25	1,100,000.00	1,040,666.00	
NETHER 0.25 07/15/29	1,000,000.00	865,120.00	
NETHER 0.5 01/15/40	1,700,000.00	1,188,096.00	
NETHER 0.5 07/15/26	1,700,000.00	1,585,879.00	
NETHER 0.5 07/15/32	200,000.00	164,892.00	
NETHER 0.75 07/15/27	400,000.00	370,136.00	
NETHER 0.75 07/15/28	1,500,000.00	1,364,895.00	
NETHER 2 07/15/24	500,000.00	494,540.00	
NETHER 2.5 01/15/33	600,000.00	590,544.00	
NETHER 2.75 01/15/47	2,000,000.00	2,014,360.00	
NETHER 3.75 01/15/42	1,300,000.00	1,482,767.00	
NETHER 4 01/15/37	700,000.00	796,376.00	
NETHER 5.5 01/15/28	700,000.00	788,137.00	
OBL 0 04/05/24	1,300,000.00	1,263,691.00	
OBL 0 04/11/25	2,800,000.00	2,653,588.00	
OBL 0 04/16/27	4,200,000.00	3,816,414.00	
OBL 0 10/09/26	1,600,000.00	1,469,504.00	
OBL 0 10/10/25	2,600,000.00	2,438,046.00	
OBL 0 10/18/24	1,500,000.00	1,437,750.00	
OBL 2.2 04/13/28	300,000.00	297,447.00	
RAGB 0 02/20/30	900,000.00	740,511.00	
RAGB 0 02/20/31	1,400,000.00	1,116,444.00	
RAGB 0 04/20/25	300,000.00	283,248.00	
RAGB 0.5 02/20/29	550,000.00	481,926.50	
RAGB 0.5 04/20/27	700,000.00	640,605.00	
RAGB 0.75 02/20/28	900,000.00	819,351.00	
RAGB 0.75 03/20/51	900,000.00	515,070.00	
RAGB 0.75 10/20/26	1,300,000.00	1,215,812.00	
RAGB 0.85 06/30/20	150,000.00	62,394.00	
RAGB 0.9 02/20/32	500,000.00	420,570.00	
RAGB 1.2 10/20/25	1,000,000.00	961,000.00	
RAGB 1.5 02/20/47	700,000.00	514,990.00	
RAGB 1.5 11/02/86	200,000.00	119,684.00	
RAGB 1.65 10/21/24	800,000.00	784,424.00	
RAGB 2.4 05/23/34	900,000.00	846,828.00	
RAGB 3.15 06/20/44	500,000.00	506,355.00	
RAGB 3.8 01/26/62	700,000.00	811,146.00	

RAGB 4.15 03/15/37	300,000.00	333,822.00	
RAGB 4.85 03/15/26	200,000.00	211,720.00	
RAGB 6.25 07/15/27	1,000,000.00	1,137,540.00	
RFGB 0 09/15/30	400,000.00	324,872.00	
RFGB 0.25 09/15/40	500,000.00	309,720.00	
RFGB 0.5 04/15/26	700,000.00	657,230.00	
RFGB 0.5 09/15/28	400,000.00	355,108.00	
RFGB 0.5 09/15/29	800,000.00	693,144.00	
RFGB 0.75 04/15/31	500,000.00	424,980.00	
RFGB 1.375 04/15/47	500,000.00	367,415.00	
RFGB 2 04/15/24	900,000.00	890,640.00	
RFGB 2.625 07/04/42	800,000.00	750,264.00	
RFGB 2.75 07/04/28	200,000.00	200,246.00	
RFGB 4 07/04/25	300,000.00	307,506.00	
SPGB 0 01/31/25	500,000.00	474,405.00	
SPGB 0 05/31/25	2,600,000.00	2,440,334.00	
SPGB 0.25 07/30/24	1,400,000.00	1,350,300.00	
SPGB 0.5 04/30/30	600,000.00	501,216.00	
SPGB 0.5 10/31/31	1,400,000.00	1,116,584.00	
SPGB 0.7 04/30/32	2,200,000.00	1,759,076.00	
SPGB 0.8 07/30/27	1,700,000.00	1,551,335.00	
SPGB 0.85 07/30/37	800,000.00	550,224.00	
SPGB 1 10/31/50	300,000.00	157,974.00	
SPGB 1.2 10/31/40	1,700,000.00	1,142,910.00	
SPGB 1.25 10/31/30	3,000,000.00	2,616,420.00	
SPGB 1.3 10/31/26	3,100,000.00	2,931,918.00	
SPGB 1.4 04/30/28	400,000.00	369,644.00	
SPGB 1.4 07/30/28	2,200,000.00	2,025,034.00	
SPGB 1.45 04/30/29	2,100,000.00	1,913,919.00	
SPGB 1.45 10/31/27	1,800,000.00	1,682,334.00	
SPGB 1.45 10/31/71	400,000.00	190,320.00	
SPGB 1.5 04/30/27	1,500,000.00	1,416,015.00	
SPGB 1.6 04/30/25	1,400,000.00	1,362,942.00	
SPGB 1.85 07/30/35	2,000,000.00	1,667,720.00	
SPGB 1.95 04/30/26	2,000,000.00	1,942,600.00	
SPGB 1.95 07/30/30	1,700,000.00	1,567,842.00	
SPGB 2.15 10/31/25	1,600,000.00	1,571,808.00	
SPGB 2.35 07/30/33	700,000.00	637,476.00	
SPGB 2.55 10/31/32	700,000.00	655,249.00	
SPGB 2.7 10/31/48	750,000.00	613,747.50	
SPGB 2.75 10/31/24	2,100,000.00	2,090,907.00	
SPGB 2.9 10/31/46	1,700,000.00	1,465,842.00	
SPGB 3.45 07/30/66	1,300,000.00	1,170,962.00	
SPGB 3.8 04/30/24	1,400,000.00	1,409,660.00	

	SPGB 4.2 01/31/37	1,050,000.00	1,113,441.00	
	SPGB 4.65 07/30/25	800,000.00	829,776.00	
	SPGB 4.7 07/30/41	1,500,000.00	1,679,595.00	
	SPGB 4.9 07/30/40	1,400,000.00	1,602,902.00	
	SPGB 5.15 10/31/28	1,500,000.00	1,655,595.00	
	SPGB 5.15 10/31/44	1,400,000.00	1,672,846.00	
	SPGB 5.75 07/30/32	1,000,000.00	1,196,400.00	
	SPGB 5.9 07/30/26	500,000.00	544,985.00	
	SPGB 6 01/31/29	1,900,000.00	2,194,215.00	
	ユーロ小計	377,840,000.00	347,479,351.30 (50,954,372,075)	
国債証券合計			152,733,216,558 (152,733,216,558)	
合 計			152,733,216,558 (152,733,216,558)	

(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	215銘柄	49.0%	49.5%
カナダ・ドル	国債証券	24銘柄	2.0%	2.1%
オーストラリア・ドル	国債証券	20銘柄	1.6%	1.6%
シンガポール・ドル	国債証券	10銘柄	0.4%	0.5%
ニュージーランド・ドル	国債証券	6銘柄	0.2%	0.2%
イギリス・ポンド	国債証券	50銘柄	4.9%	4.9%
イスラエル・シケル	国債証券	6銘柄	0.3%	0.3%
デンマーク・クローネ	国債証券	6銘柄	0.3%	0.3%
ノルウェー・クローネ	国債証券	6銘柄	0.2%	0.2%
スウェーデン・クローナ	国債証券	6銘柄	0.2%	0.2%
メキシコ・ペソ	国債証券	10銘柄	0.9%	0.9%
オフショア・人民元	国債証券	16銘柄	4.9%	5.0%
マレーシア・リンギット	国債証券	9銘柄	0.5%	0.6%
ポーランド・ズロチ	国債証券	5銘柄	0.5%	0.5%
ユーロ	国債証券	270銘柄	33.0%	33.4%

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

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)

	(2022年4月13日現在)	(2023年4月13日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	11,627,715	20,984,008
コール・ローン	446,032,013	470,093,974
国債証券	300,054,000	274,025,890

特殊債券	1,196,252,766	1,248,494,187
未収利息	1,138,662	1,796,508
前払費用	237,925	165,363
流動資産合計	1,955,343,081	2,015,559,930
資産合計	1,955,343,081	2,015,559,930
負債の部		
流動負債		
未払解約金	4,684,078	11,230,000
その他未払費用	1,766	1,970
流動負債合計	4,685,844	11,231,970
負債合計	4,685,844	11,231,970
純資産の部		
元本等		
元本	1,935,317,393	1,989,263,317
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	15,339,844	15,064,643
元本等合計	1,950,657,237	2,004,327,960
純資産合計	1,950,657,237	2,004,327,960
負債純資産合計	1,955,343,081	2,015,559,930

(2) 注記表

(重要な会計方針の注記)

項目	自 2022年4月14日 至 2023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	(2022年4月13日現在)	(2023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	1,935,317,393口	1,989,263,317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 1.0076円 (1万口当たりの純資産額10,076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 2022年4月14日 至 2023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 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>

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

・金融商品の時価等に関する事項

項目	(2023年4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、特殊債券) 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定(デリバティブ取引) デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。

(デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

自 2022年4月14日 至 2023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)

(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	
SMAM・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
SMAM・マネーインカムファンド<適格機関投資家限定>	858,040,993円
SMAM・FGマネーファンドVA<適格機関投資家限定>	579,816,519円
合計	1,935,317,393円

(2023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	1,935,317,393円
同期中における追加設定元本額	938,745,932円
同期中における一部解約元本額	884,800,008円
2023年4月13日現在の元本の内訳	
SMAM・グローバルバランスファンド(機動的資産配分型)	171,629,556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)	94,363,204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)	212,524,739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)	137,225,742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)	49,707,035円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2040(4資産タイプ)	36,162,259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)	57,429,415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>	797,231,328円
SMAM・FGマネーファンドVA<適格機関投資家限定>	432,593,527円
合計	1,989,263,317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	3 2 9 10年国債	100,000,000	100,173,000	
	3 3 2 10年国債	173,000,000	173,852,890	
	国債証券 小計		274,025,890	
特殊債券	2 政保新関西空港	118,000,000	118,225,498	
	2 3 政保政策投資C	200,000,000	201,274,200	
	1 8 9 政保道路機構	200,000,000	200,039,200	
	1 9 0 政保道路機構	127,000,000	127,115,189	
	1 9 5 政保道路機構	100,000,000	100,290,600	
	2 0 0 政保道路機構	100,000,000	100,387,700	
	2 0 2 政保道路機構	100,000,000	100,408,800	
	5 0 政保地方公共団	300,000,000	300,753,000	
	特殊債券 小計		1,248,494,187	
合計			1,522,520,077	

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16期中間計算期間(2023年4月14日から2023年10月13日まで)の中間財務諸表について、PwC Japan有限責任監査法人により中間監査を受けております。

【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)】

(1)【中間貸借対照表】

(単位:円)

	第15期 (2023年4月13日現在)	第16期中間計算期間 (2023年10月13日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	654,615	185,933
コール・ローン	14,665,005	15,612,446
親投資信託受益証券	2,142,326,971	2,322,203,776
未収入金	2,000,000	1,880,000
流動資産合計	2,159,646,591	2,339,882,155
資産合計	2,159,646,591	2,339,882,155
負債の部		
流動負債		
未払解約金	77,251	2,761,840
未払受託者報酬	342,259	375,096
未払委託者報酬	6,389,670	7,002,494
その他未払費用	57,017	62,491
流動負債合計	6,866,197	10,201,921
負債合計	6,866,197	10,201,921
純資産の部		
元本等		
元本	1,430,756,019	1,476,211,881
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金()	722,024,375	853,468,353
(分配準備積立金)	213,242,407	201,726,639
元本等合計	2,152,780,394	2,329,680,234
純資産合計	2,152,780,394	2,329,680,234
負債純資産合計	2,159,646,591	2,339,882,155

（ 2 ） 【 中間損益及び剰余金計算書 】

（ 単位：円 ）

	第15期中間計算期間 自 2022年 4月14日 至 2022年10月13日	第16期中間計算期間 自 2023年 4月14日 至 2023年10月13日
営業収益		
受取利息	71	141
有価証券売買等損益	59,590,922	112,486,805
営業収益合計	59,590,851	112,486,946
営業費用		
支払利息	2,879	5,004
受託者報酬	337,683	375,096
委託者報酬	6,304,123	7,002,494
その他費用	56,384	62,671
営業費用合計	6,701,069	7,445,265
営業利益又は営業損失（ ）	66,291,920	105,041,681
経常利益又は経常損失（ ）	66,291,920	105,041,681
中間純利益又は中間純損失（ ）	66,291,920	105,041,681
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（ ）	2,960,988	4,686,365
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	711,522,641	722,024,375
剰余金増加額又は欠損金減少額	70,533,330	71,855,747
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	70,533,330	71,855,747
剰余金減少額又は欠損金増加額	76,645,790	40,767,085
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	76,645,790	40,767,085
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（ ）	642,079,249	853,468,353

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針の注記)

項 目	第16期中間計算期間 自 2023年4月14日 至 2023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15期 (2023年4月13日現在)	第16期中間計算期間 (2023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	1,430,756,019口	1,476,211,881口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.5046円 (1万口当たりの純資産額15,046円)	1口当たり純資産額 1.5781円 (1万口当たりの純資産額15,781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16期中間計算期間 (2023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>

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

(デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

項 目	第15期 (2023年4月13日現在)	第16期中間計算期間 (2023年10月13日現在)
期首元本額	1,390,422,023円	1,430,756,019円
期中追加設定元本額	264,851,982円	125,900,230円
期中一部解約元本額	224,517,986円	80,444,368円

(参考)

SMAM・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)

	(2023年4月13日現在)	(2023年10月13日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	155,442,581	39,661,177
コール・ローン	3,482,300,514	3,330,280,192
株式	226,980,178,810	270,479,851,360
派生商品評価勘定	101,813,200	17,152,600
未収入金	1,487,700	-
未収配当金	2,733,543,848	2,534,975,634
差入委託証拠金	253,500,000	165,600,000
流動資産合計	233,708,266,653	276,567,520,963
資産合計	233,708,266,653	276,567,520,963
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	6,668,900	75,128,900
前受金	92,256,000	13,500,000
未払金	-	472,200
未払解約金	125,377,224	1,753,732,756
その他未払費用	8,232	15,264
流動負債合計	224,310,356	1,842,849,120

負債合計	224,310,356	1,842,849,120
純資産の部		
元本等		
元本	66,834,421,601	67,632,944,773
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	166,649,534,696	207,091,727,070
元本等合計	233,483,956,297	274,724,671,843
純資産合計	233,483,956,297	274,724,671,843
負債純資産合計	233,708,266,653	276,567,520,963

(2) 注記表

(重要な会計方針の注記)

項 目	自 2023年4月14日 至 2023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</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算期間末日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場によっております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

項 目	(2023年4月13日現在)	(2023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	66,834,421,601口	67,632,944,773口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 3.4935円 (1万口当たりの純資産額34,935円)	1口当たり純資産額 4.0620円 (1万口当たりの純資産額40,620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	(2023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） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。

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

(デリバティブ取引に関する注記)

(2023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 0506月	6,372,225,700	-	6,467,370,000	95,144,300
	小計	6,372,225,700	-	6,467,370,000	95,144,300
合計		6,372,225,700	-	6,467,370,000	95,144,300

(2023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 0512月	4,277,041,300	-	4,219,065,000	57,976,300
	小計	4,277,041,300	-	4,219,065,000	57,976,300
合計		4,277,041,300	-	4,219,065,000	57,976,300

(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)

(2023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	63,097,233,521円
同期中における追加設定元本額	11,385,515,013円
同期中における一部解約元本額	7,648,326,933円
2023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	9,570,680,227円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	1,059,937,184円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	4,638,997,735円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	3,648,030,008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)	149,688,598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)	4,175,044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)	20,105,492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)	65,174,904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)	171,116,447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)	156,280,073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)	274,275,931円
国内株式指数ファンド(T O P I X)	1,340,401,706円
三井住友・DCつみたてN I S A・日本株インデックスファンド	23,642,030,750円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	224,604,200円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	287,321,128円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	179,357,049円
イオン・バランス戦略ファンド	48,802,794円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2050	47,275,620円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	211,812,693円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	195,201,725円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	724,047,688円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	403,895,409円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	461,567,788円
三井住友・DCつみたてN I S A・世界分散ファンド	54,207,734円
三井住友D S・国内株式インデックス年金ファンド	912,956,383円
三井住友D S・年金バランス30(債券重点型)	42,315,625円
三井住友D S・年金バランス50(標準型)	230,367,140円
三井住友D S・年金バランス70(株式重点型)	220,965,270円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2060	5,943,129円
日興F W S・日本株インデックス	1,539,161,603円
三井住友D S・T O P I Xインデックス・ファンド	31,182,740円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2035	48,532円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2040	55,404円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2045	65,862円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2055	75,722円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2065	75,722円
三井住友D S・FW専用ポートフォリオ・レベル1(保守型)	36,977円
三井住友D S・FW専用ポートフォリオ・レベル2(安定型)	53,380円
三井住友D S・FW専用ポートフォリオ・レベル3(安定成長型)	64,358円
三井住友D S・FW専用ポートフォリオ・レベル4(成長型)	74,521円
三井住友D S・FW専用ポートフォリオ・レベル5(積極成長型)	84,740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)	2,338,416,776円

バランスファンドVA(安定運用型) < 適格機関投資家限定 >	11,374,364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 >	65,084,989円
SMAM・バランスファンドVA25 < 適格機関投資家専用 >	1,278,636,021円
SMAM・バランスファンドVA37.5 < 適格機関投資家専用 >	1,365,230,760円
SMAM・バランスファンドVA50 < 適格機関投資家専用 >	5,221,333,717円
SMAM・バランスファンドVL30 < 適格機関投資家限定 >	35,485,948円
SMAM・バランスファンドVL50 < 適格機関投資家限定 >	128,454,719円
SMAM・バランスファンドVA75 < 適格機関投資家専用 >	627,326,286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 >	42,743,164円
SMAM・インデックス・バランスVA25 < 適格機関投資家専用 >	227,367,598円
SMAM・インデックス・バランスVA50 < 適格機関投資家専用 >	724,446,785円
SMAM・バランスファンドVA40 < 適格機関投資家専用 >	505,694,664円
SMAM・バランスファンドVA35 < 適格機関投資家専用 >	1,525,907,370円
SMAM・バランスVA株40T < 適格機関投資家限定 >	352,709円
SMAM・グローバルバランス40VA < 適格機関投資家限定 >	33,786,896円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A < 適格機関投資家専用 >	37,753,776円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A < 適格機関投資家専用 >	29,039,696円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A < 適格機関投資家専用 >	15,809,789円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L < 適格機関投資家専用 >	88,713,894円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L < 適格機関投資家専用 >	217,333,061円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A2 < 適格機関投資家専用 >	47,877,088円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A2 < 適格機関投資家専用 >	35,298,082円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A2 < 適格機関投資家専用 >	7,431,986円
SMAM・アセットバランスファンドVA30L2 < 適格機関投資家専用 >	38,679,568円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L2 < 適格機関投資家専用 >	489,268,886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)	158,733,909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 >	182,201,631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 >	78,463,864円
SMAM・世界バランスファンドVA < 適格機関投資家限定 >	79,070,264円
SMAM・世界バランスファンドVA2 < 適格機関投資家限定 >	38,854,455円
SMAM・年金Wリスクコントロールファンド < 適格機関投資家限定 >	51,538,394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 >	37,247,656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 >	48,176,456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 >	442,012,325円
SMDAM・日米3資産バランスオープン < 適格機関投資家限定 >	16,759,020円
合計	66,834,421,601円

(2023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	66,834,421,601円
同期中における追加設定元本額	6,122,609,408円
同期中における一部解約元本額	5,324,086,236円

2023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	9,641,417,015円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	997,075,699円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	4,494,702,633円

三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	3,637,000,373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)	138,871,633円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2020(4資産タイプ)	3,566,971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)	15,678,498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)	55,174,571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)	155,707,163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)	145,018,019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)	267,715,598円
国内株式指数ファンド(T O P I X)	1,416,261,485円
三井住友・DCつみたてN I S A・日本株インデックスファンド	25,698,826,744円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	214,908,297円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	272,243,563円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	162,404,948円
イオン・バランス戦略ファンド	86,894,192円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2050	48,930,294円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	209,849,850円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	193,882,331円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	757,262,289円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	434,724,522円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	502,027,687円
三井住友・DCつみたてN I S A・世界分散ファンド	54,599,239円
三井住友D S・国内株式インデックス年金ファンド	1,116,537,770円
三井住友D S・年金バランス30(債券重点型)	39,578,765円
三井住友D S・年金バランス50(標準型)	234,475,208円
三井住友D S・年金バランス70(株式重点型)	239,581,882円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2060	5,640,538円
日興F W S・日本株インデックス	1,759,384,877円
三井住友D S・T O P I Xインデックス・ファンド	58,705,881円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2035	374,363円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2040	307,610円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2045	129,644円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2055	86,723円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2065	89,365円
三井住友D S・FW専用ポートフォリオ・レベル1(保守型)	486,020円
三井住友D S・FW専用ポートフォリオ・レベル2(安定型)	7,066,116円
三井住友D S・FW専用ポートフォリオ・レベル3(安定成長型)	25,805,952円
三井住友D S・FW専用ポートフォリオ・レベル4(成長型)	13,530,651円
三井住友D S・FW専用ポートフォリオ・レベル5(積極成長型)	5,942,206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)	2,428,455,057円
バランスファンドV A(安定運用型) <適格機関投資家限定>	9,133,331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>	50,064,321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>	1,007,110,184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>	1,180,654,038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>	4,552,064,730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>	29,416,152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>	112,870,377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>	590,581,984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>	36,747,614円

SMAM・インデックス・バランスVA25<適格機関投資家専用>	201,101,365円
SMAM・インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用>	648,284,955円
SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用>	416,834,842円
SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>	1,289,551,079円
SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定>	314,855円
SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	27,021,199円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>	30,809,683円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>	26,636,479円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用>	14,740,890円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>	70,523,025円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	177,147,933円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A2<適格機関投資家専用>	37,992,956円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A2<適格機関投資家専用>	33,340,590円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A2<適格機関投資家専用>	6,832,341円
SMAM・アセットバランスファンドVA30L2<適格機関投資家専用>	31,790,234円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L2<適格機関投資家専用>	419,590,878円
SMAM・国内株式インデックスファンド・VA(適格機関投資家専用)	149,795,773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>	159,779,160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>	65,272,266円
SMAM・世界バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	52,101,715円
SMAM・世界バランスファンドVA2<適格機関投資家限定>	31,518,773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>	52,669,232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>	31,177,254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>	49,877,598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>	444,960,882円
SMDAM・日米3資産バランスオープン<適格機関投資家限定>	17,621,175円
SMDAM・年金Wリスクコントロールファンド(リスク3%)<適格機関投資家限定>	36,092,668円
合計	67,632,944,773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)

	(2023年4月13日現在)	(2023年10月13日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	18,040,734	7,615,140
コール・ローン	404,157,328	639,430,117
国債証券	94,923,942,650	100,591,806,480
地方債証券	9,394,088,900	9,928,503,000
特殊債券	8,916,392,687	9,372,643,283
社債券	6,569,523,900	6,357,206,000
未収入金	28,219,500	690,000,000
未収利息	190,297,685	191,576,183
前払費用	6,082,219	6,476,504
流動資産合計	120,450,745,603	127,785,256,707
資産合計	120,450,745,603	127,785,256,707

負債の部		
流動負債		
未払金	-	27,064,200
未払解約金	70,410,000	123,000,000
その他未払費用	1,880	3,526
流動負債合計	70,411,880	150,067,726
負債合計	70,411,880	150,067,726
純資産の部		
元本等		
元本	97,440,897,328	105,642,633,733
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	22,939,436,395	21,992,555,248
元本等合計	120,380,333,723	127,635,188,981
純資産合計	120,380,333,723	127,635,188,981
負債純資産合計	120,450,745,603	127,785,256,707

(2) 注記表

(重要な会計方針の注記)

項 目	自 2023年4月14日 至 2023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、地方債証券、特殊債券、社債券は個別法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

項 目	(2023年4月13日現在)	(2023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	97,440,897,328口	105,642,633,733口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.2354円 (1万口当たりの純資産額12,354円)	1口当たり純資産額 1.2082円 (1万口当たりの純資産額12,082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	(2023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>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。</p>

(デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

(2023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	106,340,184,500円
同期中における追加設定元本額	23,003,419,591円
同期中における一部解約元本額	31,902,706,763円
2023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)	8,066,562,266円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	12,893,291,980円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	3,067,494,543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)	728,176,754円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2020(4資産タイプ)	41,660,405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)	199,069,008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)	551,312,023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)	955,391,122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)	504,847,368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)	643,501,192円
三井住友・DC年金バランスゼロ(債券型)	142,561,825円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	1,320,949,723円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	681,405,675円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	197,981,789円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2050	69,731,154円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	2,228,903,724円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	763,783,268円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	1,153,723,242円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	259,384,894円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	43,469,971円
三井住友・DCつみたてN I S A・世界分散ファンド	228,473,492円
三井住友D S・年金バランス30(債券重点型)	320,065,463円
三井住友D S・年金バランス50(標準型)	645,050,541円

三井住友D S・年金バランス70（株式重点型）	185,890,643円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2060	8,692,626円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2035	363,085円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2040	298,337円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2045	201,623円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2055	109,828円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2065	109,828円
三井住友D S・FW専用ポートフォリオ・レベル1（保守型）	215,601円
三井住友D S・FW専用ポートフォリオ・レベル2（安定型）	144,709円
三井住友D S・FW専用ポートフォリオ・レベル3（安定成長型）	97,059円
三井住友D S・FW専用ポートフォリオ・レベル4（成長型）	54,198円
三井住友D S・FW専用ポートフォリオ・レベル5（積極成長型）	12,947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>	1,148,582,155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>	9,696,497,158円
S M A M・バランスファンドV A 3 7 . 5<適格機関投資家専用>	5,706,550,972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>	14,439,786,152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>	291,755,610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>	466,061,460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>	242,428,375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>	116,608,704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>	1,681,190,812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>	1,969,539,677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>	2,120,208,354円
S M A M・バランスファンドV A 3 5<適格機関投資家専用>	7,472,345,986円
S M A M・バランスV A 株4 0 T<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・V A S（適格機関投資家専用）	1,041,143,136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>	369,354,331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>	475,881,321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>	162,026,305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>	44,327,528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>	1,232,890,521円
S M A M・アセットバランスファンドV A 2 5 L<適格機関投資家専用>	1,957,126,760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>	598,143,282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>	204,865,104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>	20,783,621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>	250,396,742円
S M A M・アセットバランスファンドV A 2 5 L 2<適格機関投資家専用>	4,609,020,015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>	1,071,394,428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>	1,022,405,764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>	1,305,795,760円
S M A M・マルチアセット・ダイナミックアロケーション・ストラテジー・ファンド < 適格機関投資家限定 >	1,819,843,422円
合 計	97,440,897,328円

(2023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

97,440,897,328円

同期中における追加設定元本額

20,193,106,840円

同期中における一部解約元本額	11,991,370,435円
2023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)	9,046,545,873円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	14,519,391,722円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	3,703,403,875円
SMAM・グローバルバランスファンド(機動的資産配分型)	804,542,860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)	42,303,196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)	190,289,826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)	596,793,204円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2035(4資産タイプ)	1,164,822,196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)	643,527,949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)	782,677,277円
三井住友・DC年金バランスゼロ(債券型)	142,463,376円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	1,141,863,032円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	564,028,434円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	145,647,211円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050	87,070,882円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	4,556,901,826円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	1,467,175,869円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	2,415,315,659円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	566,285,774円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	55,630,531円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	279,180,524円
三井住友DS・年金バランス30(債券重点型)	365,888,568円
三井住友DS・年金バランス50(標準型)	783,421,974円
三井住友DS・年金バランス70(株式重点型)	243,357,244円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	10,158,930円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2035	3,647,272円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2040	2,283,248円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2045	545,014円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2055	153,959円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2065	160,528円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル1(保守型)	3,452,032円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル2(安定型)	22,994,650円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル3(安定成長型)	46,949,779円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル4(成長型)	12,094,309円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル5(積極成長型)	1,141,310円
SMAM・年金グローバル債券ファンド<適格機関投資家限定>	1,083,104,237円
SMAM・バランスファンドVA25<適格機関投資家専用>	9,130,670,167円
SMAM・バランスファンドVA37.5<適格機関投資家専用>	5,718,899,833円
SMAM・バランスファンドVA50<適格機関投資家専用>	14,593,246,424円
SMAM・バランスファンドVL30<適格機関投資家限定>	299,776,143円
SMAM・バランスファンドVL50<適格機関投資家限定>	486,840,988円
SMAM・バランスファンドVA75<適格機関投資家専用>	264,798,022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>	116,608,704円
SMAM・インデックス・バランスVA25<適格機関投資家専用>	1,721,293,475円
SMAM・インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用>	2,106,894,689円

SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用>	2,122,286,668円
SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>	7,510,664,499円
SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定>	1,001,996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)	995,355,303円
SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	369,730,067円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>	457,855,411円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>	171,339,049円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用>	47,446,788円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>	1,164,327,263円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	1,977,869,635円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A2<適格機関投資家専用>	586,083,214円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A2<適格機関投資家専用>	208,632,864円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A2<適格機関投資家専用>	21,745,950円
SMAM・アセットバランスファンドVA30L2<適格機関投資家専用>	253,537,044円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L2<適格機関投資家専用>	4,606,971,580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>	1,254,078,403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>	788,530,373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>	1,258,193,023円
SMAM・マルチアセット・ダイナミックアロケーション・ストラテジー・ファンド<適格機関投資家限定>	1,721,803,647円
SMDAM・年金Wリスクコントロールファンド(リスク3%)<適格機関投資家限定>	190,938,361円
合計	105,642,633,733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)

	(2023年4月13日現在)	(2023年10月13日現在)
資産の部		
流動資産		
預金	5,775,149,329	4,502,524,732
金銭信託	118,672,156	37,490,562
コール・ローン	2,658,551,523	3,148,017,431
株式	452,167,668,517	568,302,531,439
投資証券	10,477,751,964	11,684,167,965
派生商品評価勘定	356,501,053	57,915,553
未収入金	31,924,259	-
未収配当金	579,126,829	503,688,390
差入委託証拠金	2,499,768,060	2,138,035,384
流動資産合計	474,665,113,690	590,374,371,456
資産合計	474,665,113,690	590,374,371,456
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	14,936,060	87,462,294
未払金	34,451,469	-
未払解約金	243,648,981	1,242,672,351
その他未払費用	3,236	6,112
流動負債合計	293,039,746	1,330,140,757

負債合計	293,039,746	1,330,140,757
純資産の部		
元本等		
元本	76,203,741,596	80,892,668,718
剰余金		
剰余金又は欠損金()	398,168,332,348	508,151,561,981
元本等合計	474,372,073,944	589,044,230,699
純資産合計	474,372,073,944	589,044,230,699
負債純資産合計	474,665,113,690	590,374,371,456

(2) 注記表

(重要な会計方針の注記)

項目	自 2023年4月14日 至 2023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. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	<p>外貨建資産等の会計処理 「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

項目	(2023年4月13日現在)	(2023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	76,203,741,596口	80,892,668,718口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 6.2250円 (1万口当たりの純資産額62,250円)	1口当たり純資産額 7.2818円 (1万口当たりの純資産額72,818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	(2023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。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。

(デリバティブ取引に関する注記)

(2023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 JUN23	8,422,894,626	-	8,676,492,264	253,597,638
	SPI 200 FUTURES JUN23	429,254,300	-	443,294,640	14,040,340
	FTSE 100 IDX FUT JUN23	517,570,803	-	533,896,424	16,325,621
	EURO STOXX 50 JUN23	1,765,092,482	-	1,827,225,317	62,132,835
	小計	11,134,812,211	-	11,480,908,645	346,096,434
合計		11,134,812,211	-	11,480,908,645	346,096,434

(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	1,894,133,620	-	1,888,571,564	5,562,056
	オーストラリア・ドル	26,798,601	-	26,846,942	48,341
	シンガポール・ドル	25,095,675	-	25,091,250	4,425
	イギリス・ポンド	117,333,317	-	117,504,875	171,558
	スイス・フラン	91,414,226	-	91,802,689	388,463

市場取引以 外の取引	ユーロ	264,150,969	-	265,028,030	877,061
	小計	2,418,926,408	-	2,414,845,350	4,081,058
	売建				
	アメリカ・ドル	215,817,534	-	215,821,422	3,888
	カナダ・ドル	45,192,192	-	45,112,112	80,080
	スウェーデン・クロー ナ	35,874,966	-	36,398,818	523,852
	ユーロ	43,382,825	-	43,385,548	2,723
	小計	340,267,517	-	340,717,900	450,383
	合 計	2,759,193,925	-	2,755,563,250	4,531,441

(2023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 DEC23	7,103,200,583	-	7,060,730,828	42,469,755
	SPI 200 FUTURES DEC23	287,316,092	-	287,005,688	310,404
	FTSE 100 IDX FUT DEC23	391,722,115	-	392,941,437	1,219,322
	EURO STOXX 50 DEC23	1,279,592,101	-	1,279,248,538	343,563
	小計	9,061,830,891	-	9,019,926,491	41,904,400
	合 計	9,061,830,891	-	9,019,926,491	41,904,400

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価の算定方法については以下のように評価しております。

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

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

2)株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

(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	1,532,544,400	-	1,544,635,808	12,091,408
	カナダ・ドル	34,996,768	-	35,046,912	50,144
	オーストラリア・ド ル	36,062,349	-	35,718,186	344,163

	イギリス・ポンド	84,566,116	-	84,537,225	28,891
	スイス・フラン	51,588,127	-	51,870,256	282,129
	ユーロ	171,491,321	-	171,798,355	307,034
	小計	1,911,249,081	-	1,923,606,742	12,357,661
	合計	1,911,249,081	-	1,923,606,742	12,357,661

(注) 1. 時価の算定方法

為替予約取引の時価の算定方法については以下のように評価しております。

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

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

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

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

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

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

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

(その他の注記)

(2023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	63,653,360,828円
同期中における追加設定元本額	22,909,073,594円
同期中における一部解約元本額	10,358,692,826円
2023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	38,145,564,153円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	298,898,252円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	1,140,482,332円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	835,411,248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)	35,335,134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)	1,016,278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)	5,550,898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)	17,828,630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)	52,498,611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)	60,451,799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)	112,145,937円
外国株式指数ファンド	987,579,804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	19,632,434,294円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	98,647,755円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	137,664,681円

アセットアロケーション・ファンド(成長型)	85,754,219円
イオン・バランス戦略ファンド	27,378,779円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2050	24,361,752円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	145,060,261円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	131,273,820円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	485,411,437円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	261,652,436円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	302,698,472円
三井住友・DCつみたてN I S A・世界分散ファンド	60,821,912円
三井住友D S・外国株式インデックス年金ファンド	1,973,496,097円
三井住友D S・年金バランス30(債券重点型)	12,262,423円
三井住友D S・年金バランス50(標準型)	55,814,025円
三井住友D S・年金バランス70(株式重点型)	50,069,070円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2060	3,075,948円
S M B C・DCインデックスファンド(M S C Iコクサイ)	627,241,642円
日興F W S・先進国株インデックス(為替ヘッジあり)	319,863,372円
日興F W S・先進国株インデックス(為替ヘッジなし)	1,791,228,980円
三井住友D S・先進国株式インデックス・ファンド	71,441,453円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2035	22,505円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2040	27,108円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2045	33,586円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2055	39,724円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2065	39,724円
三井住友D S・FW専用ポートフォリオ・レベル1(保守型)	10,556円
三井住友D S・FW専用ポートフォリオ・レベル2(安定型)	15,546円
三井住友D S・FW専用ポートフォリオ・レベル3(安定成長型)	18,945円
三井住友D S・FW専用ポートフォリオ・レベル4(成長型)	21,986円
三井住友D S・FW専用ポートフォリオ・レベル5(積極成長型)	25,027円
S M A M・外国株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	415,792,476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>	3,187,817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>	18,661,339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>	485,243,320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>	677,661,461円
S M A M・バランスファンドV A 5 0 <適格機関投資家専用>	2,951,776,006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>	9,822,476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>	47,808,223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>	402,126,462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>	35,766,460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>	84,832,561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>	411,687,872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>	285,500,776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>	651,589,743円
S M A M・バランスV A株40T <適格機関投資家限定>	195,290円
三井住友・外国株式インデックスファンド・V A S(適格機関投資家専用)	184,667,496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>	56,631,240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>	7,051,860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>	6,575,296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>	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>	16,578,047円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	51,140,413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>	103,245,103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>	44,957,268円
SMAM・世界バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	245,130,060円
SMAM・世界バランスファンドVA2<適格機関投資家限定>	68,183,758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>	678,535,453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>	21,466,696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>	14,979,993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>	19,482,776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>	208,960,218円
合計	76,203,741,596円

(2023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	76,203,741,596円
同期中における追加設定元本額	8,806,147,772円
同期中における一部解約元本額	4,117,220,650円

2023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	40,402,232,037円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	286,886,057円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	1,111,290,634円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	829,182,022円
SMAM・グローバルバランスファンド(機動的資産配分型)	32,285,346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)	866,919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)	4,357,225円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2030(4資産タイプ)	13,925,642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)	44,441,512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)	53,252,316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)	111,144,211円
外国株式指数ファンド	1,022,688,100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	21,563,892,219円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	78,314,948円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	113,813,214円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	69,639,206円
イオン・バランス戦略ファンド	32,789,222円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050	25,493,749円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	145,796,674円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	131,643,781円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	508,267,721円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	302,371,241円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	407,468,365円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	62,443,467円
三井住友DS・外国株式インデックス年金ファンド	2,267,844,308円
三井住友DS・年金バランス30(債券重点型)	11,249,068円
三井住友DS・年金バランス50(標準型)	56,740,693円

三井住友D S ・年金バランス70(株式重点型)	54,503,220円
三井住友D S ・DCターゲットイヤーファンド2060	2,970,436円
S M B C ・DCインデックスファンド(M S C Iコクサイ)	979,991,170円
日興F W S ・先進国株インデックス(為替ヘッジあり)	239,435,563円
日興F W S ・先進国株インデックス(為替ヘッジなし)	2,192,556,349円
三井住友D S ・先進国株式インデックス・ファンド	107,457,832円
三井住友D S ・DCターゲットイヤーファンド2035	169,959円
三井住友D S ・DCターゲットイヤーファンド2040	147,876円
三井住友D S ・DCターゲットイヤーファンド2045	64,837円
三井住友D S ・DCターゲットイヤーファンド2055	45,172円
三井住友D S ・DCターゲットイヤーファンド2065	47,405円
三井住友D S ・FW専用ポートフォリオ・レベル1(保守型)	140,758円
三井住友D S ・FW専用ポートフォリオ・レベル2(安定型)	2,045,767円
三井住友D S ・FW専用ポートフォリオ・レベル3(安定成長型)	7,582,121円
三井住友D S ・FW専用ポートフォリオ・レベル4(成長型)	3,987,339円
三井住友D S ・FW専用ポートフォリオ・レベル5(積極成長型)	1,756,868円
S M A M ・外国株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	346,289,809円
バランスファンドV A (安定運用型) <適格機関投資家限定>	2,563,876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>	14,085,258円
S M A M ・バランスファンドV A 25 <適格機関投資家専用>	379,906,266円
S M A M ・バランスファンドV A 37.5 <適格機関投資家専用>	594,621,192円
S M A M ・バランスファンドV A 50 <適格機関投資家専用>	2,595,793,226円
S M A M ・バランスファンドV L 30 <適格機関投資家限定>	8,325,935円
S M A M ・バランスファンドV L 50 <適格機関投資家限定>	41,243,434円
S M A M ・バランスファンドV A 75 <適格機関投資家専用>	382,756,601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>	31,123,233円
S M A M ・インデックス・バランスV A 25 <適格機関投資家専用>	74,041,043円
S M A M ・インデックス・バランスV A 50 <適格機関投資家専用>	370,804,055円
S M A M ・バランスファンドV A 40 <適格機関投資家専用>	238,548,831円
S M A M ・バランスファンドV A 35 <適格機関投資家専用>	553,570,005円
S M A M ・バランスV A 株40 T <適格機関投資家限定>	179,149円
三井住友・外国株式インデックスファンド・V A S (適格機関投資家専用)	173,586,043円
S M A M ・グローバルバランス40 V A <適格機関投資家限定>	46,578,616円
S M A M ・アセットバランスファンドV A 20 A <適格機関投資家専用>	5,806,213円
S M A M ・アセットバランスファンドV A 35 A <適格機関投資家専用>	5,839,402円
S M A M ・アセットバランスファンドV A 50 A <適格機関投資家専用>	3,468,121円
S M A M ・アセットバランスファンドV A 20 L <適格機関投資家専用>	13,196,684円
S M A M ・アセットバランスファンドV A 25 L <適格機関投資家専用>	42,818,359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>	88,244,496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>	38,344,500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>	159,921,068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>	55,985,552円
S M A M ・外国株式インデックスファンドS A <適格機関投資家限定>	1,190,235,646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>	26,347,184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>	15,789,389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>	25,485,675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>	74,191,873円

SMDAM・年金Wリスクコントロールファンド(リスク3%)<適格機関投資家限定>	9,755,415円
合計	80,892,668,718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)

	(2023年4月13日現在)	(2023年10月13日現在)
資産の部		
流動資産		
預金	114,564,335	172,410,200
金銭信託	30,022,959	17,205,662
コール・ローン	672,588,966	1,444,729,583
国債証券	152,733,216,558	165,579,771,333
派生商品評価勘定	-	318,906
未収入金	-	712,415,343
未収利息	1,108,363,241	1,281,595,082
前払費用	88,603,740	120,005,696
流動資産合計	154,747,359,799	169,328,451,805
資産合計	154,747,359,799	169,328,451,805
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	-	2,762,469
未払金	-	114,603,471
未払解約金	378,339,764	1,791,114,417
その他未払費用	2,618	6,210
流動負債合計	378,342,382	1,908,486,567
負債合計	378,342,382	1,908,486,567
純資産の部		
元本等		
元本	77,797,645,540	79,615,635,734
剰余金		
剰余金又は欠損金()	76,571,371,877	87,804,329,504
元本等合計	154,369,017,417	167,419,965,238
純資産合計	154,369,017,417	167,419,965,238
負債純資産合計	154,747,359,799	169,328,451,805

(2) 注記表

(重要な会計方針の注記)

項目	自 2023年4月14日 至 2023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</p> <p>金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券</p> <p>直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。</p>
3. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	<p>外貨建資産等の会計処理</p> <p>「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。</p>

（貸借対照表に関する注記）

項目	（2023年4月13日現在）	（2023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	77,797,645,540口	79,615,635,734口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.9842円 （1万口当たりの純資産額19,842円）	1口当たり純資産額 2.1029円 （1万口当たりの純資産額21,029円）

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

項目	（2023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）</p> <p>「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引）</p> <p>デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。

（デリバティブ取引に関する注記）

（2023年4月13日現在）

該当事項はありません。

（2023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		
市場取引以 外の取引	為替予約取引 売建				
	アメリカ・ドル	350,221,717	-	352,646,352	2,424,635
	オーストラリア・ドル	26,189,708	-	25,968,920	220,788
	イギリス・ポンド	50,499,481	-	50,401,363	98,118
	オフショア・人民元	41,475,027	-	41,804,251	329,224
	ユーロ	246,259,288	-	246,267,898	8,610
	小計	714,645,221	-	717,088,784	2,443,563
合 計		714,645,221	-	717,088,784	2,443,563

（注）１．時価の算定方法

為替予約取引の時価の算定方法については以下のように評価しております。

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

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

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

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

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

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

２．ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

（その他の注記）

（2023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	78,998,924,437円
同期中における追加設定元本額	11,564,686,333円
同期中における一部解約元本額	12,765,965,230円
2023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	26,287,705,385円
三井住友・DC年金バランス30（債券重点型）	925,109,815円
三井住友・DC年金バランス50（標準型）	2,309,569,115円
三井住友・DC年金バランス70（株式重点型）	1,286,981,811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）	164,754,130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）	6,338,663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)	30,114,267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)	104,058,978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)	273,427,860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)	198,862,879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)	315,911,452円
三井住友・DC年金バランスゼロ(債券型)	23,966,215円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	75,140,503円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	108,814,008円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	69,026,297円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2050	29,892,971円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	88,271,146円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	67,071,279円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	179,229,608円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	53,838,460円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	27,132,651円
三井住友・DCつみたてN I S A・世界分散ファンド	191,199,178円
三井住友D S・外国債券インデックス年金ファンド	778,625,678円
三井住友D S・年金バランス30(債券重点型)	37,417,494円
三井住友D S・年金バランス50(標準型)	116,572,869円
三井住友D S・年金バランス70(株式重点型)	77,324,190円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2060	3,752,407円
日興F W S・先進国債インデックス(為替ヘッジなし)	940,190,221円
三井住友D S・先進国債インデックス・ファンド	140,015,831円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2035	27,622円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2040	32,834円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2045	40,651円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2055	47,947円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2065	47,947円
三井住友D S・FW専用ポートフォリオ・レベル1(保守型)	46,616円
三井住友D S・FW専用ポートフォリオ・レベル2(安定型)	54,445円
三井住友D S・FW専用ポートフォリオ・レベル3(安定成長型)	59,419円
三井住友D S・FW専用ポートフォリオ・レベル4(成長型)	62,438円
三井住友D S・FW専用ポートフォリオ・レベル5(積極成長型)	64,457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>	4,382,791,179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>	28,611,877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>	5,408,178,776円
S M A M・バランスファンドV A 3 7 . 5<適格機関投資家専用>	3,924,633,021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>	9,149,265,401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>	29,825,111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>	71,393,142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>	619,025,027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>	110,475,622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>	939,572,337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>	1,260,343,854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>	1,323,429,747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>	4,054,334,071円
S M A M・バランスV A株4 0 T<適格機関投資家限定>	604,716円
S M A M・外国債券パッシブファンドV A<適格機関投資家限定>	6,974,187,776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)	328,718,309円
S M A M ・ グローバルバランス40 V A < 適格機関投資家限定 >	117,681,971円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 20 A < 適格機関投資家専用 >	67,375,516円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 35 A < 適格機関投資家専用 >	30,693,061円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 50 A < 適格機関投資家専用 >	11,644,067円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 20 L < 適格機関投資家専用 >	79,129,938円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 25 L < 適格機関投資家専用 >	363,615,745円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 20 A 2 < 適格機関投資家専用 >	86,101,828円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 35 A 2 < 適格機関投資家専用 >	37,643,421円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 50 A 2 < 適格機関投資家専用 >	5,511,845円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 25 L 2 < 適格機関投資家専用 >	872,542,732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 >	531,620,745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 >	723,066,850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 >	371,159,278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 >	250,326,030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 >	103,128,240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 >	107,613,363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 >	137,472,367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 >	385,128,840円
合 計	77,797,645,540円

(2023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	77,797,645,540円
同期中における追加設定元本額	7,649,657,157円
同期中における一部解約元本額	5,831,666,963円
2023年10月13日現在の元本の内訳	
三井住友・D C 外国債券インデックスファンドS	26,631,308,126円
三井住友・D C 年金バランス30(債券重点型)	965,383,860円
三井住友・D C 年金バランス50(標準型)	2,324,512,042円
三井住友・D C 年金バランス70(株式重点型)	1,434,134,017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)	165,530,061円
三井住友・D C ターゲットイヤーファンド2020(4資産タイプ)	5,977,634円
三井住友・D C ターゲットイヤーファンド2025(4資産タイプ)	25,661,980円
三井住友・D C ターゲットイヤーファンド2030(4資産タイプ)	95,963,095円
三井住友・D C ターゲットイヤーファンド2035(4資産タイプ)	291,804,708円
三井住友・D C ターゲットイヤーファンド2040(4資産タイプ)	215,142,774円
三井住友・D C ターゲットイヤーファンド2045(4資産タイプ)	346,610,550円
三井住友・D C 年金バランスゼロ(債券型)	21,880,029円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	32,793,126円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	68,539,484円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	47,067,226円
三井住友D S ・ D C ターゲットイヤーファンド2050	34,526,455円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	347,122,558円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	222,720,370円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	626,178,836円

三井住友・資産最適化ファンド(4 やや成長型)	193,501,261円
三井住友・資産最適化ファンド(5 成長重視型)	97,465,698円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	214,068,665円
三井住友DS・外国債券インデックス年金ファンド	914,942,106円
三井住友DS・年金バランス30(債券重点型)	38,608,159円
三井住友DS・年金バランス50(標準型)	128,689,033円
三井住友DS・年金バランス70(株式重点型)	93,462,960円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	4,027,321円
日興FWS・先進国債インデックス(為替ヘッジなし)	2,622,937,930円
三井住友DS・先進国債インデックス・ファンド	255,028,596円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2035	234,000円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2040	201,592円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2045	86,944円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2055	60,809円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2065	63,195円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル1(保守型)	678,863円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル2(安定型)	7,825,239円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル3(安定成長型)	25,935,662円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル4(成長型)	12,566,958円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル5(積極成長型)	5,080,047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>	4,780,807,820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>	24,742,199円
SMAM・バランスファンドVA25<適格機関投資家専用>	4,606,523,629円
SMAM・バランスファンドVA37.5<適格機関投資家専用>	3,749,416,226円
SMAM・バランスファンドVA50<適格機関投資家専用>	8,846,269,365円
SMAM・バランスファンドVL30<適格機関投資家限定>	28,565,773円
SMAM・バランスファンドVL50<適格機関投資家限定>	70,919,769円
SMAM・バランスファンドVA75<適格機関投資家専用>	650,211,181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>	105,409,785円
SMAM・インデックス・バランスVA25<適格機関投資家専用>	891,341,019円
SMAM・インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用>	1,260,343,854円
SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用>	1,228,760,430円
SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>	3,774,742,508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>	6,534,915,068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)	316,285,438円
SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	106,571,859円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>	61,223,425円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>	29,749,375円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用>	11,741,981円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>	69,435,156円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	345,813,274円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A2<適格機関投資家専用>	75,950,618円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A2<適格機関投資家専用>	37,643,421円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A2<適格機関投資家専用>	5,511,845円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L2<適格機関投資家専用>	817,838,016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>	489,884,162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>	664,034,415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>	267,012,255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>	224,503,156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>	119,206,614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>	64,688,469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>	101,979,254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>	653,794,739円
S M D A M ・年金Wリスクコントロールファンド(リスク3%)<適格機関投資家限定>	80,872,951円
合 計	79,615,635,734円

マネーインカム・マザーファンド

(1) 貸借対照表

(単位:円)

	(2023年4月13日現在)	(2023年10月13日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	20,984,008	9,549,887
コール・ローン	470,093,974	801,887,441
国債証券	274,025,890	293,883,280
特殊債券	1,248,494,187	1,303,462,800
未収利息	1,796,508	1,383,689
前払費用	165,363	327,482
流動資産合計	2,015,559,930	2,410,494,579
資産合計	2,015,559,930	2,410,494,579
負債の部		
流動負債		
未払金	-	200,468,000
未払解約金	11,230,000	16,933,965
その他未払費用	1,970	2,637
流動負債合計	11,231,970	217,404,602
負債合計	11,231,970	217,404,602
純資産の部		
元本等		
元本	1,989,263,317	2,176,869,362
剰余金		
剰余金又は欠損金()	15,064,643	16,220,615
元本等合計	2,004,327,960	2,193,089,977
純資産合計	2,004,327,960	2,193,089,977
負債純資産合計	2,015,559,930	2,410,494,579

(2) 注記表

(重要な会計方針の注記)

項 目	自 2023年4月14日 至 2023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、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>(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	(2023年4月13日現在)	(2023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	1,989,263,317口	2,176,869,362口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.0076円 (1万口当たりの純資産額10,076円)	1口当たり純資産額 1.0075円 (1万口当たりの純資産額10,075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	(2023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、特殊債券) 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定(デリバティブ取引) デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する 事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。

(デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

(2023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	1,935,317,393円
同期中における追加設定元本額	938,745,932円
同期中における一部解約元本額	884,800,008円

2023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)	171,629,556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)	94,363,204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)	212,524,739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)	137,225,742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)	49,707,035円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2040(4資産タイプ)	36,162,259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)	57,429,415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>	797,231,328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>	432,593,527円
合 計	1,989,263,317円

(2023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	1,989,263,317円
同期中における追加設定元本額	777,461,829円
同期中における一部解約元本額	589,855,784円

2023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)	201,359,726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)	95,171,159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)	256,618,087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)	191,963,932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)	58,123,415円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2040(4資産タイプ)	42,861,384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)	66,510,343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>	750,931,449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>	512,933,355円
合 計	2,176,869,362円

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

SMAM・グローバルバランスファンド（機動的資産配分型）

2023年10月31日現在

資産総額	2,296,161,353円
負債総額	1,204,427円
純資産総額（ - ）	2,294,956,926円
発行済口数	1,480,602,436口
1口当たり純資産額（ / ） （1万口当たり純資産額）	1.5500円 (15,500円)

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

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

イ 名義書換

該当事項はありません。

ロ 受益者名簿

作成しません。

ハ 受益者に対する特典

ありません。

ニ 受益権の譲渡および譲渡制限等

(イ) 受益権の譲渡

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

(ロ) 受益権の譲渡制限および譲渡の対抗要件

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

ホ 受益権の再分割

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

ヘ 償還金

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

ト 質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

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

第三部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

イ 資本金の額および株式数

	2023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。

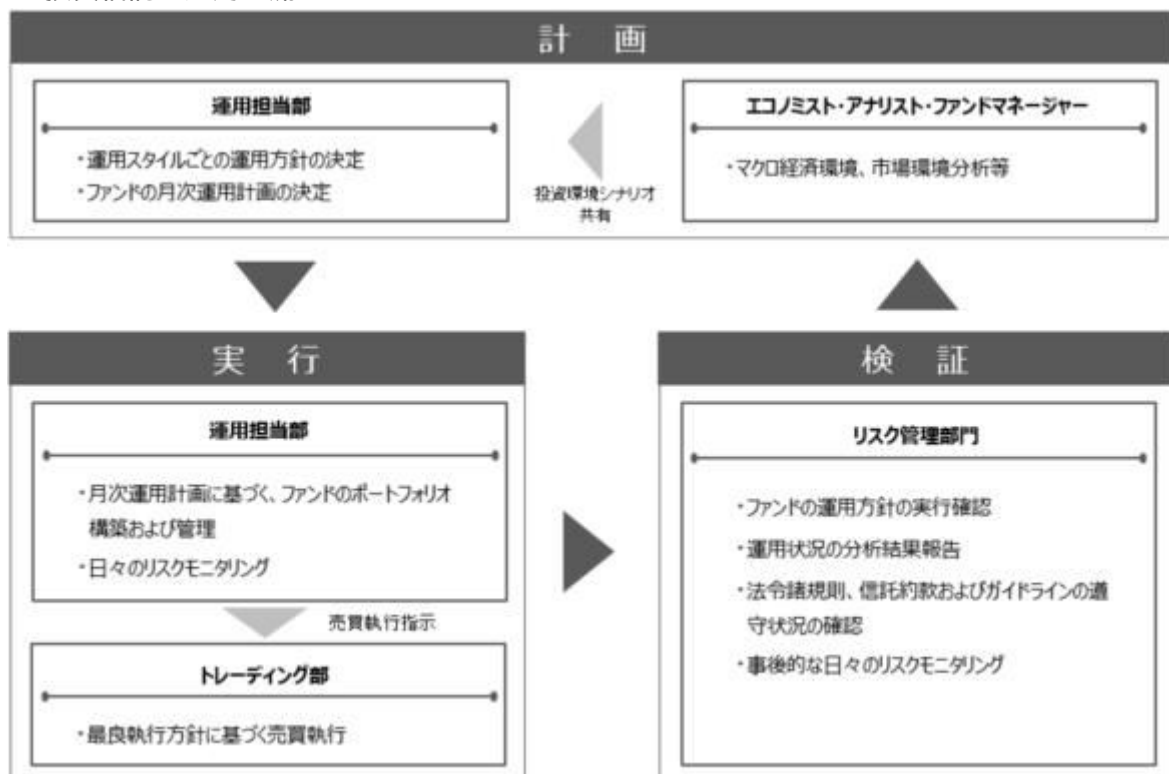
取締役の任期は、選任後1年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会の終結の時までとし、補欠または増員によって選任された取締役の任期は、他の現任取締役の任期の満了する時までとします。

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。

2023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	695	10,733,058
単位型株式投資信託	96	554,272
追加型公社債投資信託	1	24,785
単位型公社債投資信託	164	254,556
合計	956	11,566,673

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(2023年4月1日から2023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38期(2022年4月1日から2023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39期中間会計期間(2023年4月1日から2023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 (2022年3月31日)	当事業年度 (2023年3月31日)
資産の部		
流動資産		
現金及び預金	49,008,279	37,742,400
金銭の信託	-	12,645,575
顧客分別金信託	300,041	300,046
前払費用	475,266	546,900
未収入金	103,809	437,880
未収委託者報酬	12,125,117	11,563,662
未収運用受託報酬	2,437,063	2,138,030
未収投資助言報酬	388,639	344,586
未収収益	36,700	35,477
その他の流動資産	18,458	8,423

流動資産合計		64,893,375	65,762,982
固定資産			
有形固定資産	1		
建物		1,433,442	1,361,305
器具備品		653,985	559,057
土地		710	710
リース資産		7,357	4,114
建設仮勘定		5,500	81,240
有形固定資産合計		2,100,996	2,006,427
無形固定資産			
ソフトウェア		2,766,476	2,414,295
ソフトウェア仮勘定		100,616	508,956
のれん		3,349,950	3,045,409
顧客関連資産		13,558,615	11,445,340
電話加入権		12,716	12,706
商標権		42	36
無形固定資産合計		19,788,417	17,426,744
投資その他の資産			
投資有価証券		14,212,354	9,222,276
関係会社株式		11,246,398	11,850,598
長期差入保証金		1,414,646	1,388,987
長期前払費用		77,936	80,207
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		27,021,065	22,611,799
固定資産合計		48,910,479	42,044,971
資産合計		113,803,855	107,807,953

(単位：千円)

	前事業年度 (2022年3月31日)	当事業年度 (2023年3月31日)
負債の部		
流動負債		
リース債務	3,567	2,564
顧客からの預り金	6,045	11,094
その他の預り金	196,515	128,069
未払金		
未払収益分配金	1,969	2,013
未払償還金	152	1,312
未払手数料	5,545,582	5,194,011
その他未払金	48,893	259,542
未払費用	7,379,404	6,370,986
未払消費税等	1,133,332	406,770
未払法人税等	2,455,291	333,009
賞与引当金	2,100,323	1,801,492
資産除去債務	7,192	13,940
その他の流動負債	40,396	73,657
流動負債合計	18,918,667	14,598,465
固定負債		
リース債務	4,525	1,960
繰延税金負債	1,279,409	550,493
退職給付引当金	5,084,506	5,027,832
その他の固定負債	4,620	-
固定負債合計	6,373,062	5,580,287
負債合計	25,291,730	20,178,752

純資産の部

株主資本

資本金	2,000,000	2,000,000
資本剰余金		
資本準備金	8,628,984	8,628,984
その他資本剰余金	73,466,962	73,466,962
資本剰余金合計	82,095,946	82,095,946
利益剰余金		
利益準備金	284,245	284,245
その他利益剰余金		
繰越利益剰余金	3,834,794	3,391,568
利益剰余金合計	4,119,040	3,675,814
株主資本計	88,214,986	87,771,760
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	297,138	142,558
評価・換算差額等合計	297,138	142,558
純資産合計	88,512,124	87,629,201
負債・純資産合計	113,803,855	107,807,953

(2) 【損益計算書】

(単位：千円)

	前事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	当事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	66,139,024	61,471,271
運用受託報酬	9,652,634	8,978,419
投資助言報酬	1,256,334	1,273,386
その他営業収益		
サービス支助手数料	199,046	208,222
その他	32,936	22,995
営業収益計	77,279,976	71,954,296
営業費用		
支払手数料	30,522,133	28,036,456
広告宣伝費	330,161	294,588
調査費		
調査費	3,196,921	3,749,357
委託調査費	12,192,048	11,455,987
営業雑経費		
通信費	67,600	61,068
印刷費	494,834	452,951
協会費	34,433	38,701
諸会費	30,488	33,447
情報機器関連費	4,767,504	5,067,617
販売促進費	31,930	29,621
その他	181,301	197,696
営業費用合計	51,849,358	49,417,495
一般管理費		
給料		
役員報酬	263,893	219,872
給料・手当	8,664,828	7,807,797
賞与	991,916	1,042,472
賞与引当金繰入額	2,100,323	1,798,492

交際費	12,301	27,713
寄付金	29,273	25,518
事務委託費	1,422,189	1,727,189
旅費交通費	16,863	99,733
租税公課	476,729	352,030
不動産賃借料	1,289,256	1,268,303
退職給付費用	632,559	624,551
固定資産減価償却費	3,133,951	3,247,869
のれん償却費	304,540	304,540
諸経費	256,994	200,758
一般管理費合計	19,595,622	18,746,845
営業利益	5,834,995	3,789,956

(単位：千円)

	前事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	当事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)
営業外収益		
受取配当金	7,666	1,755
受取利息	1,836	1,373
時効成立分配金・償還金	43,406	521
原稿・講演料	2,587	2,281
投資有価証券償還益	383,608	119,033
投資有価証券売却益	911,268	25,848
為替差益	4,673	5,816
雑収入	81,640	91,814
営業外収益合計	1,436,686	248,443
営業外費用		
金銭の信託運用損	-	454,339
投資有価証券償還損	146,219	83,598
投資有価証券売却損	81,384	152,691
雑損失	2,866	-
営業外費用合計	230,470	690,629
経常利益	7,041,212	3,347,770
特別損失		
固定資産除却損	1 83,651	13,203
システム統合関連費用	2 375,636	-
早期退職費用	3 260,075	126,832
支払補償費	4 -	30,075
その他特別損失	67,000	-
特別損失合計	786,362	170,111
税引前当期純利益	6,254,849	3,177,659
法人税、住民税及び事業税	3,101,482	1,622,064
法人税等調整額	965,673	541,433
法人税等合計	2,135,809	1,080,631
当期純利益	4,119,040	2,097,028

(3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度（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		
					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

当事業年度（自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）

（単位：千円）

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

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

[注記事項]

(重要な会計方針)

1. 重要な資産の評価基準及び評価方法

(1) 有価証券

子会社株式
移動平均法による原価法

その他有価証券

市場価格のない株式等以外

決算日の市場価格等に基づく時価法

（評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定）

市場価格のない株式等

移動平均法による原価法

(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

(3) リース資産

所有権移転外ファイナンス・リース取引に係るリース資産

リース期間を耐用年数とし、残存価額を零とする定額法を採用しております。

3. 引当金の計上基準

(1) 貸倒引当金

債権の貸倒れによる損失に備えるため一般債権については貸倒実績率により、貸倒懸念債権等の特定の債権については個別に回収可能性を検討し、回収不能見込額を計上しております。

(2) 賞与引当金

従業員賞与の支給に充てるため、将来の支給見込額のうち、当事業年度の負担額を計上しております。

(3)退職給付引当金

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

退職給付見込額の期間帰属方法

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

数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法

過去勤務費用については、その発生時において一時に費用処理しております。

数理計算上の差異については、その発生時において一時に費用処理しております。

4. 収益及び費用の計上基準

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

(1)委託者報酬

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

(2)運用受託報酬

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

(3)投資助言報酬

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

(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。）等を当事業年度の期首から適用し、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。これによる当事業年度の財務諸表に与える影響はありません。なお、時価算定会計基準適用指針27-3項に定める経過的な取扱いに従って、前事業年度に係る「金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項」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 (2022年3月31日)	当事業年度 (2023年3月31日)
建物	210,548千円	301,463千円
器具備品	1,309,352千円	1,499,284千円
リース資産	6,073千円	7,493千円

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 (2022年3月31日)	当事業年度 (2023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 (2022年3月31日)	当事業年度 (2023年3月31日)
Sumitomo Mitsui DS Asset Management (USA) Inc.	57,356千円	12,514千円

(損益計算書関係)

1 固定資産除却損

	前事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	当事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)
建物	- 千円	2,482千円
器具備品	0千円	4,273千円
リース資産	- 千円	532千円
ソフトウェア	83,651千円	5,915千円

2 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。

3 早期退職費用

早期希望退職の募集等の実施に関連して発生する費用であります。

4 支払補償費

受益者や販売会社に生じた損失の補償に伴い発生する費用であります。

(株主資本等変動計算書関係)

前事業年度(自 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.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

当事業年度(自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)

1.発行済株式数に関する事項

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

2.剰余金の配当に関する事項

配当金支払額等

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

基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生が翌事業年度になるもの

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

(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 (2022年3月31日)	当事業年度 (2023年3月31日)
1年以内	1,166,952	1,161,545
1年超	2,323,090	1,161,545
合計	3,490,042	2,323,090

(金融商品関係)

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

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

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

また、資金調達は行っていません。

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

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

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

営業債務である未払手数料は、すべて1年以内の支払期日であります。

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

信用リスクの管理

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

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

市場リスクの管理

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

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

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

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

前事業年度（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)金銭の信託	-	-	-
(2)投資有価証券 その他有価証券	14,172,545	14,172,545	-
資産計	14,172,545	14,172,545	-

当事業年度（2023年3月31日）

（単位：千円）

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

(注1)市場価格のない金融商品の貸借対照表計上額

(単位：千円)

区分	前事業年度 (2022年3月31日)	当事業年度 (2023年3月31日)
其他有価証券 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	11,850,598
合計	11,246,398	11,850,598

3. 金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項

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

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

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

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

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

時価で貸借対照表に計上している金融商品

(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	-	12,645,575	-	12,645,575
(2)投資有価証券 其他有価証券	-	9,182,466	-	9,182,466
資産計	-	21,828,042	-	21,828,042

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 其他有価証券

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

(有価証券関係)

1. 子会社株式

前事業年度（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。

当事業年度（2023年3月31日）

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

2. 其他有価証券

前事業年度（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	9,299,062	8,672,725	626,337
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	4,873,482	5,039,817	166,335
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。

当事業年度(2023年3月31日)

(単位:千円)

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

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

3. 事業年度中に売却したその他有価証券

前事業年度(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

当事業年度(自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)

(単位:千円)

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

(単位:千円)

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

(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 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	当事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)
退職給付債務の期首残高	5,258,448	5,084,506
勤務費用	454,611	429,188
利息費用	1,013	6,502
数理計算上の差異の発生額	34,553	12,781
退職給付の支払額	595,013	479,583
過去勤務費用の発生額	-	-
退職給付債務の期末残高	5,084,506	5,027,832

(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 (2022年3月31日)	当事業年度 (2023年3月31日)
非積立型制度の退職給付債務	5,084,506	5,027,832
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	5,084,506	5,027,832

(3)退職給付費用及びその内訳項目の金額

	前事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	当事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)
勤務費用	454,611	429,188
利息費用	1,013	6,502
数理計算上の差異の費用処理額	34,553	12,781
その他	211,487	201,641
確定給付制度に係る退職給付費用	632,559	624,551

(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 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	当事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)
割引率	0.130%	0.230%

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237,296千円、当事業年度241,556千円であります。

(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 (2022年3月31日)	当事業年度 (2023年3月31日)
繰延税金資産		
退職給付引当金	1,556,876	1,539,522
賞与引当金	643,119	551,617
調査費	279,809	473,972
未払金	284,070	211,439
未払事業税	139,522	39,995
ソフトウェア償却	107,998	105,506
子会社株式評価損	114,876	114,876
その他有価証券評価差額金	93,946	120,350
その他	28,056	21,158
繰延税金資産小計	3,248,274	3,178,439
評価性引当額	189,102	193,662
繰延税金資産合計	3,059,171	2,984,776
繰延税金負債		
無形固定資産	4,151,648	3,504,563
資産除去債務	825	3,201
その他有価証券評価差額金	186,107	27,506
繰延税金負債合計	4,338,581	3,535,270
繰延税金資産（負債）の純額	1,279,409	550,493

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 (2022年3月31日)	当事業年度 (2023年3月31日)
法定実効税率	30.6%	30.6%
(調整)		
交際費等永久に損金に算入されない項目	1.6	3.0
のれん償却費	1.4	2.9
所得税額控除による税額控除	-	1.3

その他	0.3	1.2
税効果会計適用後の法人税等の負担率	34.1	34.0

(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 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。

当事業年度(自 2022年4月1日 至2023年3月31日)

1.セグメント情報

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

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

2.関連情報

(1)製品及びサービスごとの情報

(単位：千円)

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

(2)地域ごとの情報

営業収益

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

有形固定資産

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

(3) 主要な顧客ごとの情報

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

3. 報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

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

4. 報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

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

5. 報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

該当事項はありません。

(関連当事者情報)

前事業年度(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）

当事業年度(自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)

1. 関連当事者との取引

(1) 兄弟会社等

(単位：千円)

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

(注) 取引条件及び取引条件の決定方針等

投信の販売委託については、一般取引条件を基に、協議の上決定しております。

2. 親会社に関する注記

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

(1株当たり情報)

	前事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	当事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)
1株当たり純資産額	2,613.28円	2,587.21円
1株当たり当期純利益	121.61円	61.91円

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

2. 1株当たり当期純利益の算定上の基礎は、次のとおりであります。

	前事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	当事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)
1株当たり当期純利益		
当期純利益(千円)	4,119,040	2,097,028
普通株主に帰属しない金額(千円)	-	-
普通株式に係る当期純利益(千円)	4,119,040	2,097,028
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39期中間会計期間 (2023年9月30日)	
資産の部	
流動資産	
現金及び預金	71,777,366
金銭の信託	12,836,073
顧客分別金信託	300,049
前払費用	544,624
未収委託者報酬	13,133,566
未収運用受託報酬	2,879,922
未収投資助言報酬	463,644
未収収益	67,881
その他	193,812
流動資産合計	102,196,941
固定資産	
有形固定資産	1
無形固定資産	1,897,269
のれん	2,893,139
顧客関連資産	10,388,702
その他	2,893,330
無形固定資産合計	16,175,172
投資その他の資産	
投資有価証券	9,623,355
関係会社株式	1,927,221
繰延税金資産	128,142
その他	1,543,634
貸倒引当金	20,750
投資その他の資産合計	13,201,604
固定資産合計	31,274,046
資産合計	133,470,988
負債の部	
流動負債	
リース債務	2,070
顧客からの預り金	11,882
その他の預り金	161,963
未払金	6,019,407
未払費用	6,744,050
未払法人税等	3,908,872
前受収益	21,118

賞与引当金		2,110,575
資産除去債務		13,940
その他	2	623,468
流動負債合計		19,617,350
固定負債		
リース債務		1,172
退職給付引当金		5,235,679
固定負債合計		5,236,852
負債合計		24,854,202
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		24,226,602
利益剰余金合計		24,510,847
株主資本合計		108,606,793
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金		9,992
評価・換算差額等合計		9,992
純資産合計		108,616,786
負債純資産合計		133,470,988

(2) 中間損益計算書

(単位：千円)

		第39期中間会計期間 (自 2023年4月1日 至 2023年9月30日)
営業収益		
委託者報酬		33,390,366
運用受託報酬		4,611,539
投資助言報酬		646,058
その他の営業収益		137,072
営業収益計		38,785,036
営業費用		26,393,207
一般管理費	1	10,162,729
営業利益		2,229,099
営業外収益	2	11,280,120
営業外費用	3	51,894
経常利益		13,457,325
特別利益	4	14,096,622
特別損失	5	358
税引前中間純利益		27,553,589
法人税、住民税及び事業税		5,843,255
法人税等調整額		716,591
法人税等合計		5,126,663

中間純利益

22,426,926

(3)中間株主資本等変動計算書

第39期中間会計期間（自 2023年4月1日 至 2023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	3,391,568
当中間期変動額						
剰余金の配当						1,591,892
中間純利益						22,426,926
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	-	-	-	-	-	20,835,033
当中間期末残高	2,000,000	8,628,984	73,466,962	82,095,946	284,245	24,226,602

	株主資本		評価・換算差額等		純資産合計
	利益剰余金	株主資本合計	その他有価証券 評価差額金	評価・換算 差額等合計	
	利益剰余金 合計				
当期首残高	3,675,814	87,771,760	142,558	142,558	87,629,201
当中間期変動額					
剰余金の配当	1,591,892	1,591,892			1,591,892
中間純利益	22,426,926	22,426,926			22,426,926
株主資本以外の 項目の当中間期 変動額（純額）			152,551	152,551	152,551
当中間期変動額合計	20,835,033	20,835,033	152,551	152,551	20,987,584
当中間期末残高	24,510,847	108,606,793	9,992	9,992	108,616,786

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

(3)リース資産

所有権移転外ファイナンス・リース取引に係るリース資産

リース期間を耐用年数とし、残存価額を零とする定額法を採用しております。

3. 引当金の計上基準

(1)貸倒引当金

債権の貸倒れによる損失に備えるため一般債権については貸倒実績率により、貸倒懸念債権等の特定の債権については個別に回収可能性を検討し、回収不能見込額を計上しております。

(2)賞与引当金

従業員賞与の支給に充てるため、将来の支給見込額のうち当中間会計期間の負担額を計上しております。

(3)退職給付引当金

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

退職給付見込額の期間帰属方法

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

数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法

過去勤務費用については、その発生時において一時に費用処理しております。

数理計算上の差異については、その発生時において一時に費用処理しております。

4. 収益及び費用の計上基準

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

(1)委託者報酬

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

(2)運用受託報酬

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

(3)投資助言報酬

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

(中間貸借対照表関係)

第39期中間会計期間 (2023年9月30日)	
1.有形固定資産の減価償却累計額	1,963,152千円
2.消費税等の取扱い	
仮払消費税等及び仮受消費税等は、相殺のうえ、金額的重要性が乏しいため、流動負債のその他に含めて表示しております。	

3. 当社は、運転資金の効率的な調達を行うため取引銀行1行と当座借越契約を締結しております。

当中間会計期間末における当座借越契約に係る借入金未実行残高等は次のとおりであります。

当座借越極度額の総額	10,000,000千円
借入実行残高	-
差引額	10,000,000千円

（中間損益計算書関係）

第39期中間会計期間 （自 2023年4月1日 至 2023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	155,138千円
無形固定資産	1,475,775千円
2. 営業外収益のうち主要なもの	
受取配当金	11,020,394千円
投資有価証券売却益	2,513千円
金銭の信託運用益	190,497千円
3. 営業外費用のうち主要なもの	
為替差損	1,978千円
投資有価証券償還損	883千円
投資有価証券売却損	48,575千円
4. 特別利益のうち主要なもの	
子会社株式売却益	14,096,622千円
5. 特別損失のうち主要なもの	
固定資産除却損	358千円

（中間株主資本等変動計算書関係）

第39期中間会計期間（自 2023年4月1日 至 2023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
2023年6月28日 定時株主総会	普通株式	1,591,892	47.00	2023年 3月31日	2023年 6月29日

（リース取引関係）

第39期中間会計期間 （自 2023年4月1日 至 2023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	580,772千円
合計	1,742,317千円

（金融商品関係）

1. 金融商品の時価等に関する事項

第39期中間会計期間（2023年9月30日）

2023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	12,836,073	12,836,073	-
(2)投資有価証券 その他有価証券	9,582,998	9,582,998	-
資産計	22,419,071	22,419,071	-

(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	40,356
合計	40,356
子会社株式 非上場株式	1,927,221
合計	1,927,221

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

2. 金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項

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

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

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

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

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

時価で中間貸借対照表に計上している金融商品

(単位：千円)

区分	時価			合計
	レベル1	レベル2	レベル3	
(1)金銭の信託	-	12,836,073	-	12,836,073
(2)投資有価証券 その他有価証券	-	9,582,998	-	9,582,998
資産計	-	22,419,071	-	22,419,071

(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39期中間会計期間（2023年9月30日）

1. 子会社株式

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

2. その他有価証券

(単位：千円)

区分	中間貸借対照表計上額	取得原価	差額
(1)中間貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの 投資信託等	3,341,749	3,156,408	185,340
小計	3,341,749	3,156,408	185,340

(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	6,241,249	6,403,283	162,034
小計	6,241,249	6,403,283	162,034
合計	9,582,998	9,559,692	23,306

(注)非上場株式等（中間貸借対照表計上額 40,356千円）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39期中間会計期間（自 2023年4月1日 至 2023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39期中間会計期間（自 2023年4月1日 至 2023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	33,390,366	4,611,539	646,058	137,072	38,785,036

(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39期中間会計期間 (自 2023年4月1日 至 2023年9月30日)	
1株当たり純資産額	3,206円86銭
1株当たり中間純利益	662円14銭
なお、潜在株式調整後1株当たり中間純利益については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。	

4【利害関係人との取引制限】

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

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

5【その他】

- イ 定款の変更、その他の重要事項
 - (イ) 定款の変更
該当ありません。
 - (ロ) その他の重要事項
該当ありません。
- ロ 訴訟事件その他会社に重要な影響を与えることが予想される事実
該当ありません。

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

イ 受託会社

- (イ) 名称 三井住友信託銀行株式会社
- (ロ) 資本金の額 342,037百万円(2023年3月末現在)
- (ハ) 事業の内容 銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

〔参考情報：再信託受託会社の概要〕

- ・ 名称 株式会社日本カストディ銀行
- ・ 資本金の額 51,000百万円(2023年3月末現在)
- ・ 事業の内容 銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

ロ 販売会社

名称	資本金の額（百万円） 2023年3月末現在	事業の内容
auカブコム証券株式会社	7,196	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
株式会社SBI証券	48,323	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
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	19,495	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
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。

楽天証券株式会社の資本金の額は、2022年12月末現在です。
住友生命保険相互会社の資本金の額の箇所には、基金および基金償却積立金の合計額を記載しております。

2【関係業務の概要】

イ 受託会社

信託契約の受託会社であり、信託財産の保管・管理・計算等を行います。

ロ 販売会社

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

3【資本関係】

（持株比率5%以上を記載しています。）

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

第3【その他】

1 目論見書の表紙から本文の前までおよび裏表紙の記載について

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

（2）委託会社の金融商品取引業者登録番号を記載することがあります。

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

（4）請求目論見書の入手方法および投資信託約款が請求目論見書に掲載されている旨を記載することがあります。

（5）目論見書の使用開始日を記載することがあります。

（6）投資信託の財産は受託会社において信託法に基づき分別管理されている旨を記載することがあります。

（7）請求目論見書は投資者の請求により販売会社から交付される旨および当該請求を行った場合にはその旨の記録をしておくべきである旨を記載することがあります。

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

（9）当ファンドのロゴおよび委託会社のロゴを記載することがあります。

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

- (11) 写真、イラスト、図案およびキャッチコピーを採用することがあります。また、ファンドの管理番号等を記載することがあります。
- 2 目論見書は電子媒体等として使用される他、インターネット等に掲載されることがあります。
 - 3 当ファンドの投資信託約款の全文を請求目論見書に掲載することがあります。
 - 4 目論見書は、目論見書の別称として「投資信託説明書(交付目論見書)」または「投資信託説明書(請求目論見書)」と称して使用することがあります。
 - 5 評価機関等から当ファンドに対する評価を取得し、使用することがあります。
 - 6 有価証券届出書を個別に提出している複数のファンドの実質的な投資対象資産に共通性がある場合には、当該複数のファンドを一つの投資信託説明書(交付目論見書)で説明することがあります。また、有価証券届出書を個別に提出している複数のファンドにかかる投資信託説明書(交付目論見書)および投資信託説明書(請求目論見書)を一体のものとして使用することがあります。

独立監査人の監査報告書

2023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 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2023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

2023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

PwCあらた有限責任監査法人

東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士 山口 健志

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士 榊原 康太

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているSMAAM・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2023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、SMAAM・グローバルバランスファンド（機動的資産配分型）の2023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。

その他の事項

ファンドの2022年4月13日をもって終了した前計算期間の財務諸表は、前任監査人によって監査されている。前任監査人は、当該財務諸表に対して2022年6月28日付けで無限定適正意見を表明している。

その他の記載内容

その他の記載内容は、有価証券報告書及び有価証券届出書（訂正有価証券届出書を含む。）に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。経営者の責任は、その他の記載内容を作成し開示することにある。

当監査法人の財務諸表に対する監査意見の対象にはその他の記載内容は含まれておらず、当監査法人はその他の記載内容に対して意見を表明するものではない。

財務諸表監査における当監査法人の責任は、その他の記載内容を通読し、通読の過程において、その他の記載内容と財務諸表又は当監査法人が監査の過程で得た知識との間に重要な相違があるかどうか検討すること、また、そのような重要な相違以外にその他の記載内容に重要な誤りの兆候があるかどうか注意を払うことにある。

当監査法人は、実施した作業に基づき、その他の記載内容に重要な誤りがあると判断した場合には、その事実を報告することが求められている。

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

財務諸表に対する経営者の責任

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

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

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

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

利害関係

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

以 上

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

独立監査人の中間監査報告書

2023年11月17日

三井住友DSアセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 佐藤 栄 裕指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 深井 康 治**中間監査意見**

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている三井住友DSアセットマネジメント株式会社の2023年4月1日から2024年3月31日までの第39期事業年度の中間会計期間（2023年4月1日から2023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2023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（2023年4月1日から2023年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

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

中間財務諸表に対する経営者並びに監査役及び監査役会の責任

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

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

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。

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

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

利害関係

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

以 上

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

2. 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

2023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

PwC Japan有限責任監査法人

東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士 山口 健志

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士 榊原 康太

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）の2023年4月14日から2023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、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）の2023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（2023年4月14日から2023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。

その他の事項

ファンドの2023年4月13日をもって終了した前計算期間の中間計算期間（2022年4月14日から2022年10月13日まで）に係る中間財務諸表は、前任監査人によって中間監査が実施されている。前任監査人は、当該中間財務諸表に対して2022年12月20日付けで有用な情報を表示している旨の意見を表明している。

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。

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

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

利害関係

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

以 上

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