投資信託説明書
（請求目論見書）
使用開始日：2024年12月13日

三井住友・資産最適化ファンド

（１安定重視型）／（２やや安定型）／（３バランス型）／（４やや成長型）／（５成長重視型）

追加型投信／内外／資産複合

三井住友・資産最適化ファンド（１安定重視型）、三井住友・資産最適化ファンド（２やや安定型）、三井住友・資産最適化ファンド（３バランス型）、三井住友・資産最適化ファンド（４やや成長型）および三井住友・資産最適化ファンド（５成長重視型）の募集については、委託会社は、金融商品取引法（昭和23年法律第25号）第５条の規定により有価証券届出書を2024年12月12日に関東財務局長に提出しており、2024年12月13日にその届出の効力が生じております。

発行者名	三井住友ＤＳアセットマネジメント株式会社
代表者の役職氏名	代表取締役社長　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
有価証券届出書の写しを縦覧に供する場所	該当事項はありません。

三井住友DSアセットマネジメント

本書は、金融商品取引法（昭和23年法律第25号）第13条の規定に基づく目論見書です。

１．本書は、金融商品取引法第13条第２項第２号に定める内容を記載した目論見書です。

２．運用による損益はすべて投資家の皆さまに帰属いたします。したがって、預貯金とは異なり、投資元本が保証されているものではなく、一定の投資成果を保証するものでもありません。

３．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。

４．投資信託は、預金保険、貯金保険または保険契約者保護機構の保護の対象ではありません。また、登録金融機関は、投資者保護基金には加入しておりません。

５．税制に関する本書の記載内容は、税法の改正等により将来変更されることがあります。

第一部【証券情報】

（1）【ファンドの名称】

三井住友・資産最適化ファンド（１安定重視型）
三井住友・資産最適化ファンド（２やや安定型）
三井住友・資産最適化ファンド（３バランス型）
三井住友・資産最適化ファンド（４やや成長型）
三井住友・資産最適化ファンド（５成長重視型）
以下、上記５ファンドを総称して「当ファンド」ということがあり、それぞれを「各ファンド」ということがあります。
また、「三井住友・資産最適化ファンド（１安定重視型）」を「１安定重視型」、「三井住友・資産最適化ファンド（２やや安定型）」を「２やや安定型」、「三井住友・資産最適化ファンド（３バランス型）」を「３バランス型」、「三井住友・資産最適化ファンド（４やや成長型）」を「４やや成長型」、「三井住友・資産最適化ファンド（５成長重視型）」を「５成長重視型」という略称でいうことがあります。

（2）【内国投資信託受益証券の形態等】

追加型証券投資信託の受益権です。
＊ファンドの受益権は、社債、株式等の振替に関する法律（以下「社振法」といいます。）の規定の適用を受け、受益権の帰属は、後述の「(11) 振替機関に関する事項」に記載の振替機関および当該振替機関の下位の口座管理機関（社振法第２条に規定する「口座管理機関」をいい、振替機関を含め、以下「振替機関等」といいます。）の振替口座簿に記載または記録されることにより定まります（以下、振替口座簿に記載または記録されることにより定まる受益権を「振替受益権」といいます。）。委託会社である三井住友ＤＳアセットマネジメント株式会社は、やむを得ない事情等がある場合を除き、当該振替受益権を表示する受益証券を発行しません。
当初元本は１口当たり１円です。委託会社の依頼により、信用格付業者から提供され、もしくは閲覧に供された信用格付または信用格付業者から提供され、もしくは閲覧に供される予定の信用格付はありません。

（3）【発行（売出）価額の総額】

各ファンド１兆円を上限とします。

（4）【発行（売出）価格】

取得申込受付日の翌営業日の基準価額となります。
ただし、累積投資契約に基づく収益分配金の再投資の場合は、各計算期末の基準価額となります。
※「基準価額」とは、信託財産の純資産総額を計算日における受益権口数で除した価額をいいます（基準価額は、便宜上１万口単位で表示される場合があります。）。
基準価額は、組入有価証券の値動き等により日々変動します。
基準価額は、販売会社または委託会社にお問い合わせいただけるほか、原則として翌日付の日本経済新聞朝刊の証券欄「オープン基準価格」の紙面に、「１安定重視型」は「最適安定重視」、「２やや安定型」は「最適やや安定」、「３バランス型」は「最適バランス」、「４やや成長型」は「最適やや成長」、「５成長重視型」は「最適成長重視」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。

（5）【申込手数料】

ありません。

（6）【申込単位】

お申込単位の詳細は、お申込みの販売会社にお問い合わせください。

（7）【申込期間】

2024年12月13日から2025年6月12日まで
申込期間は、上記期間満了前に有価証券届出書を提出することにより更新されます。

（8）【申込取扱場所】

販売会社において申込みを取り扱います。
販売会社によっては一部のファンドのみの取扱いとなる場合があります。詳しくは販売会社にお問い合わせください。
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　スイッチング

販売会社によっては、「スイッチング」（ある投資信託の換金による手取額をもって、他の投資信託を買い付けること）による当ファンドの取得申込みを取り扱う場合があります。

ニ　お申込不可日

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

・ニューヨークの取引所の休業日

・ニューヨークの銀行の休業日

ホ　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。

ヘ　振替受益権について

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

（参考：投資信託振替制度）

・ファンドの受益権の発生、消滅、移転をコンピュータシステムにて管理するもので、ファンドの設定、解約、償還等がコンピュータシステム上の帳簿（「振替口座簿」といいます。）への記載・記録によって行われます。

・受益証券は発行されませんので、盗難や紛失のリスクが削減されます（原則として受益証券を保有することはできません。）。

・ファンドの設定、解約等における決済リスクが削減されます。

・振替口座簿に記録されますので、受益権の所在が明確になります。

第二部【ファンド情報】

第１【ファンドの状況】

１【ファンドの性格】

（1）【ファンドの目的及び基本的性格】

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

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

ハ　当ファンドが該当する商品分類、属性区分は次の通りです。

≪商品分類表≫

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

（注）当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

≪属性区分表≫

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

その他資産 (投資信託証券(資産複合(株式、債券、不動産投信)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		アフリカ 中近東(中東) エマージング		

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

※属性区分の「為替ヘッジ」は、対円での為替変動リスクに対するヘッジの有無を記載しています。
※商品分類および属性区分は、一般社団法人投資信託協会「商品分類に関する指針」に基づき記載しています。
※商品分類および属性区分の用語の定義については下記をご覧ください。なお、一般社団法人投資信託協会のホームページ（https://www.toushin.or.jp/）でもご覧頂けます。

一般社団法人投資信託協会「商品分類に関する指針」

≪商品分類表定義≫

1．単位型投信・追加型投信の区分
（1）単位型投信…　当初、募集された資金が一つの単位として信託され、その後の追加設定は一切行われないファンドをいう。
（2）追加型投信…　一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行われ従来の信託財産とともに運用されるファンドをいう。

2．投資対象地域による区分
（1）国内…　目論見書または投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に国内の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
（2）海外…　目論見書または投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に海外の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
（3）内外…　目論見書または投資信託約款において、国内および海外の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいう。

3．投資対象資産（収益の源泉）による区分
（1）株式…　目論見書または投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に株式を源泉とする旨の記載があるものをいう。
（2）債券…　目論見書または投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に債券を源泉とする旨の記載があるものをいう。
（3）不動産投信（リート）…
目論見書または投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に不動産投資信託の受益証券および不動産投資法人の投資証券を源泉とする旨の記載があるものをいう。

（4）その他資産…　目論見書または投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に上記（1）から（3）に掲げる資産以外の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。なお、その他資産と併記して具体的な収益の源泉となる資産の名称記載も可とする。

（5）資産複合…　目論見書または投資信託約款において、上記（1）から（4）に掲げる資産のうち複数の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいう。

4．独立した区分

（1）MMF（マネー・マネージメント・ファンド）…

「MRF及びMMFの運営に関する規則」に定めるMMFをいう。

（2）MRF（マネー・リザーブ・ファンド）…

「MRF及びMMFの運営に関する規則」に定めるMRFをいう。

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

5.補足分類

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

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

≪属性区分表定義≫

1．投資対象資産による属性区分

（1）株式

①一般…　次の大型株、中小型株属性にあてはまらないすべてのものをいう。

②大型株…　目論見書または投資信託約款において、主として大型株に投資する旨の記載があるものをいう。

③中小型株…　目論見書または投資信託約款において、主として中小型株に投資する旨の記載があるものをいう。

（2）債券

①一般…　次の公債、社債、その他債券属性にあてはまらないすべてのものをいう。

②公債…　目論見書または投資信託約款において、日本国または各国の政府の発行する国債（地方債、政府保証債、政府機関債、国際機関債を含む。以下同じ。）に主として投資する旨の記載があるものをいう。

③社債…　目論見書または投資信託約款において、企業等が発行する社債に主として投資する旨の記載があるものをいう。

④その他債券…　目論見書または投資信託約款において、公債または社債以外の債券に主として投資する旨の記載があるものをいう。

⑤格付等クレジットによる属性…

目論見書または投資信託約款において、上記①から④の「発行体」による区分のほか、特にクレジットに対して明確な記載があるものについては、上記①から④に掲げる区分に加え「高格付債」「低格付債」等を併記することも可とする。

（3）不動産投信…　これ以上の詳細な分類は行わないものとする。

（4）その他資産…　組み入れている資産を記載するものとする。

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

①資産配分固定型…　目論見書または投資信託約款において、複数資産を投資対象とし、組入比率については固定的とする旨の記載があるものをいう。なお、組み合わせている資産を列挙するものとする。

②資産配分変更型…　目論見書または投資信託約款において、複数資産を投資対象とし、組入比率については、機動的な変更を行う旨の記載があるものもしくは固定的とする旨の記載がないものをいう。なお、組み合わせている資産を列挙するものとする。

2．決算頻度による属性区分

①年１回…　目論見書または投資信託約款において、年１回決算する旨の記載があるものをいう。

②年２回…　目論見書または投資信託約款において、年２回決算する旨の記載があるものをいう。

③年４回…　目論見書または投資信託約款において、年４回決算する旨の記載があるものをいう。

④年６回（隔月）…　目論見書または投資信託約款において、年６回決算する旨の記載があるものをいう。

⑤年 12 回（毎月）…　目論見書または投資信託約款において、年 12 回（毎月）決算する旨の記載があるものをいう。

⑥日々…　目論見書または投資信託約款において、日々決算する旨の記載があるものをいう。

⑦その他…　上記属性にあてはまらないすべてのものをいう。

3．投資対象地域による属性区分（重複使用可能）

①グローバル…　目論見書または投資信託約款において、組入資産による投資収益が世界の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。なお、「世界の資産」の中に「日本」を含むか含まないかを明確に記載するものとする。

②日本…　目論見書または投資信託約款において、組入資産による投資収益が日本の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。

③北米…　目論見書または投資信託約款において、組入資産による投資収益が北米地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。

④欧州…　目論見書または投資信託約款において、組入資産による投資収益が欧州地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。

⑤アジア…　目論見書または投資信託約款において、組入資産による投資収益が日本を除くアジア地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。

⑥オセアニア…　目論見書または投資信託約款において、組入資産による投資収益がオセアニア地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。

⑦中南米…　目論見書または投資信託約款において、組入資産による投資収益が中南米地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。

⑧アフリカ…　目論見書または投資信託約款において、組入資産による投資収益がアフリカ地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。

⑨中近東（中東）…　目論見書または投資信託約款において、組入資産による投資収益が中近東地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。

⑩エマージング…　目論見書または投資信託約款において、組入資産による投資収益がエマージング地域（新興成長国（地域））の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。

4．投資形態による属性区分

①ファミリーファンド…　目論見書または投資信託約款において、親投資信託（ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除く。）を投資対象として投資するものをいう。

②ファンド・オブ・ファンズ…　「投資信託等の運用に関する規則」第２条に規定するファンド・オブ・ファンズをいう。

5．為替ヘッジによる属性区分

①為替ヘッジあり…　目論見書または投資信託約款において、為替のフルヘッジまたは一部の資産に為替のヘッジを行う旨の記載があるものをいう。

②為替ヘッジなし…　目論見書または投資信託約款において、為替のヘッジを行わない旨の記載があるものまたは為替のヘッジを行う旨の記載がないものをいう。

6．インデックスファンドにおける対象インデックスによる属性区分

①日経225

②ＴＯＰＩＸ

③その他の指数…上記指数にあてはまらないすべてのものをいう。

7．特殊型

①ブル・ベア型…　目論見書または投資信託約款において、派生商品をヘッジ目的以外に用い、積極的に投資を行うとともに各種指数・資産等への連動もしくは逆連動（一定倍の連動もしくは逆連動を含む。）を目指す旨の記載があるものをいう。

②条件付運用型…　目論見書または投資信託約款において、仕組債への投資またはその他特殊な仕組みを用いることにより、目標とする投資成果（基準価額、償還価額、収益分配金等）や信託終了日等が、明示的な指標等の値により定められる一定の条件によって決定される旨の記載があるものをいう。

③ロング・ショート型／絶対収益追求型…
目論見書または投資信託約款において、特定の市場に左右されにくい収益の追求を目指す旨もしくはロング・ショート戦略により収益の追求を目指す旨の記載があるものをいう。

④その他型…　目論見書または投資信託約款において、上記①から③に掲げる属性のいずれにも該当しない特殊な仕組みあるいは運用手法の記載があるものをいう。

（2）【ファンドの沿革】

2017年9月14日	信託契約締結、設定、運用開始
2023年12月13日	信託期間を2037年9月15日までから無期限に変更

（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ＤＳアセットマネジメント株式会社」
証券投資信託契約に基づき、信託財産の運用指図、投資信託説明書（目論見書）および運用報告書の作成等を行います。

（ロ）受託会社　「三井住友信託銀行株式会社」
証券投資信託契約に基づき、信託財産の保管・管理・計算等を行います。なお、信託事務の一部につき、株式会社日本カストディ銀行に委託することがあります。また、外国における資産の保管は、その業務を行うに充分な能力を有すると認められる外国の金融機関が行う場合があります。

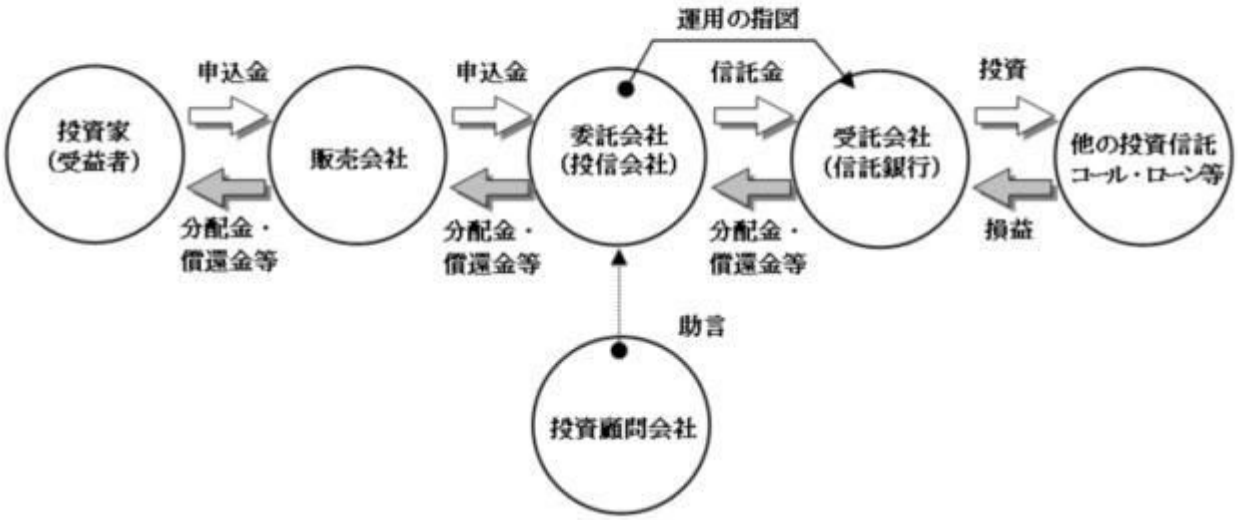
（ハ）販売会社
委託会社との間で締結される販売契約（名称の如何を問いません。）に基づき、当ファンドの募集・販売の取扱い、投資信託説明書（目論見書）の提供、受益者からの一部解約実行請求の受付け、受益者への収益分配金、一部解約金および償還金の支払事務等を行います。

〔参考情報：投資顧問会社〕

以下の法人は当ファンドの関係法人には該当しませんが、当ファンドの運用に関し助言等を行う投資顧問会社であり、間接的に当ファンドの運用に関与します。

イボットソン・アソシエイツ・ジャパン株式会社
各ファンドの基本資産配分に関する投資助言等を行います。

運営の仕組み



ロ　委託会社の概況

（イ）資本金の額

20億円（2024年9月30日現在）

（ロ）会社の沿革

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

（ハ）大株主の状況

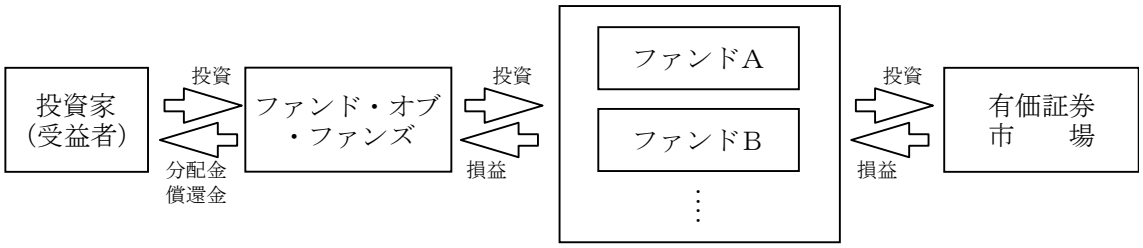
(2024年9月30日現在)

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

ハ　ファンドの運用形態（ファンド・オブ・ファンズによる運用）

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

〔ファンド・オブ・ファンズによる運用〕



2【投資方針】

（1）【投資方針】

イ　基本方針

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

ロ　投資態度

（イ）主として、投資信託証券への投資を通じて、世界各国の債券、株式および不動産投資信託（リート）等に分散投資することにより、長期的な視点の基に各ファンド以下の運用を行います。

（１安定重視型）安定的な収益の確保と信託財産の安定的な成長を目指して運用を行います。

（２やや安定型）安定的な収益の確保と信託財産の成長を目指して運用を行います。

（３バランス型）信託財産の成長と安定的な収益の確保の両方をバランスよく目指す運用を行います。

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

（５成長重視型）信託財産の成長を目指して積極的な運用を行います。

（ⅰ）主として、国内株式、先進国株式（除く日本）、新興国株式、国内リート、外国リート、国内債券、先進国債券（除く日本）、為替ヘッジ付き先進国債券（除く日本）、新興国債券に投資します。

（ⅱ）投資対象とする投資信託証券は、継続的にモニタリングを行い必要な場合は追加・入替えも行います。

（ロ）イボットソン・アソシエイツ・ジャパン株式会社の助言に基づき、基本資産配分比率を決定します。

（ⅰ）基本資産配分比率は、各資産の期待収益率やリスク（標準偏差）および資産間の相関係数等を推計・最適化して算出します。

（ハ）実質組入外貨建資産については、投資信託証券内で対円での為替ヘッジを行っている場合を除き、原則として対円での為替ヘッジを行いません。

（ニ）投資信託証券の組入比率は、原則として高位を保ちます。

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

ファンドの特色

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

□ インデックスファンドや上場投資信託証券（ETF）への投資を通じて、以下の資産等に投資します。

債券	■ 国内債券 ■ 先進国債券（除く日本） ■ 先進国債券（除く日本）（為替ヘッジあり） ■ 新興国債券
株式	■ 国内株式 ■ 先進国株式（除く日本） ■ 新興国株式
リート	■ 国内リート ■ 外国リート

2 イボットソン・アソシエイツ・ジャパンの助言に基づき、基本資産配分比率を決定します。

□ イボットソン・アソシエイツ・ジャパンは、各資産の期待収益率やリスク（標準偏差）および資産間の相関係数等を推計・最適化して基本資産配分比率を算出し、助言します。

3 目標リスク水準の異なる5つのファンドからお選びいただけます。

目標リスク水準とは
目標リスク水準は各ファンドのリスク（標準偏差）の目安を表示したものです。
一般にリスクの数値が大きいほどリターン（収益）の振れ幅が大きくなる傾向があります。

1安定重視型	安定的な収益の確保と信託財産の安定的な成長を目指して運用を行います。
2やや安定型	安定的な収益の確保と信託財産の成長を目指して運用を行います。
3バランス型	信託財産の成長と安定的な収益の確保の両方をバランスよく目指す運用を行います。
4やや成長型	信託財産の成長と安定的な収益の確保を目指して積極的な運用を行います。
5成長重視型	信託財産の成長を目指して積極的な運用を行います。

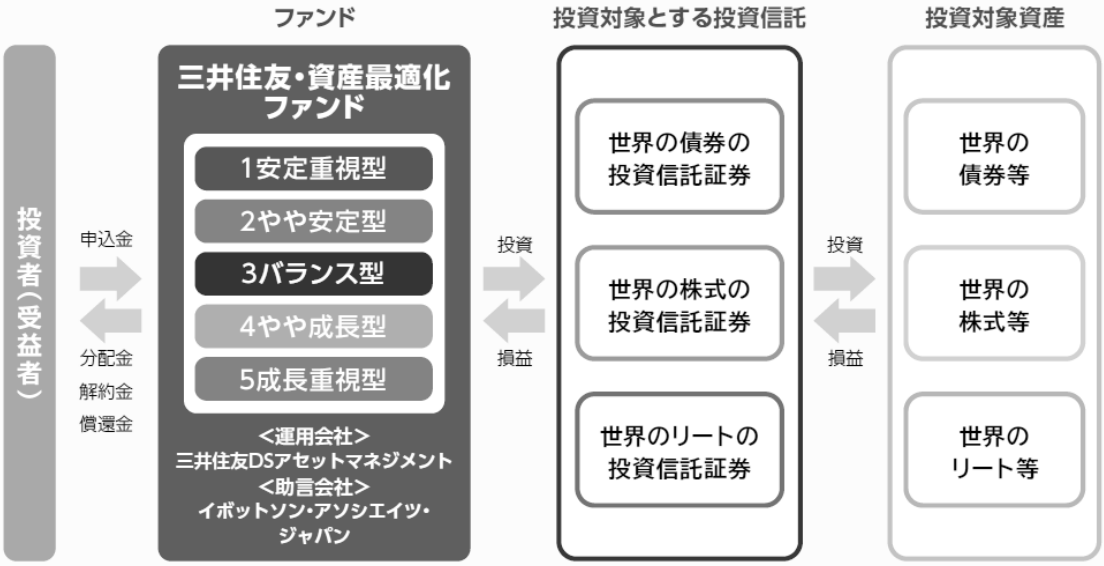
□ 各ファンド間でスイッチングが可能です。ただし、販売会社によっては、スイッチングを行わない場合があります。また、一部のファンドのみの取扱いとなる場合があります。

4 実質組入外貨建資産については、投資信託証券内で対円での為替ヘッジを行っている場合を除き、原則として対円での為替ヘッジは行いません。

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

ファンドのしくみ

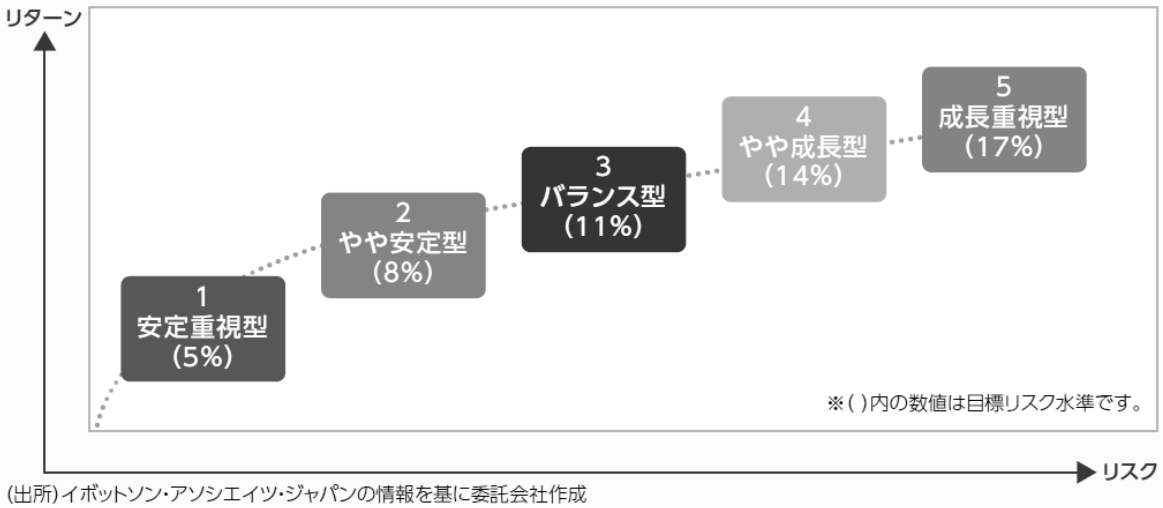
□ファンド・オブ・ファンズ方式で運用を行います。



ライフプランに合わせて5つのファンドから選択

■投資者の皆さまそれぞれのライフプランやリスク許容度に合わせて、目標リスク水準が異なる5つのファンドからお選びいただけます。

［ 5つのファンドの目標リスク水準とリスク・リターン特性のイメージ ］

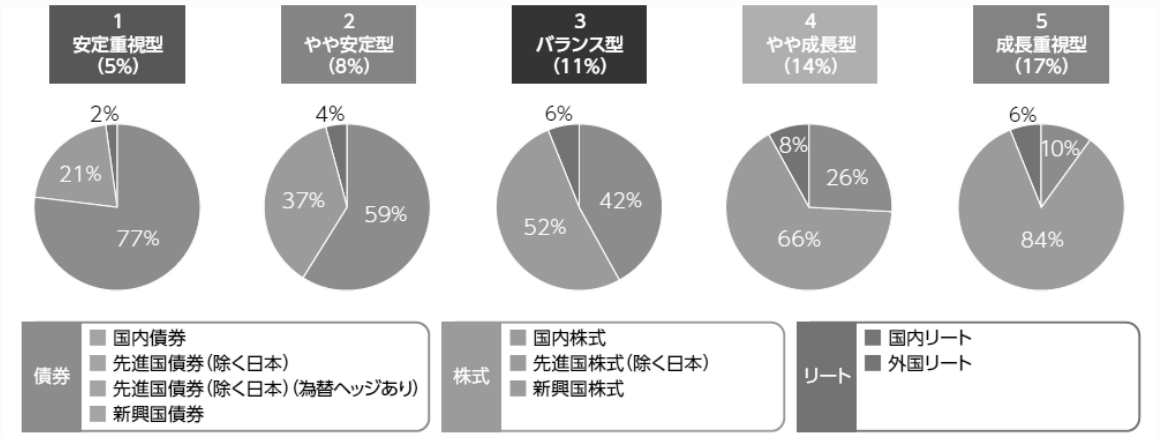


(出所)イボットソン・アソシエイツ・ジャパンの情報を基に委託会社作成

※上記はイメージであり、実際とは異なる場合があります。
※目標リスク水準は2024年9月末現在のものであり、今後変更される場合があります。

ポートフォリオの基本資産配分イメージ

■目標リスク水準に応じて、基本資産配分比率は各ファンドで異なります。

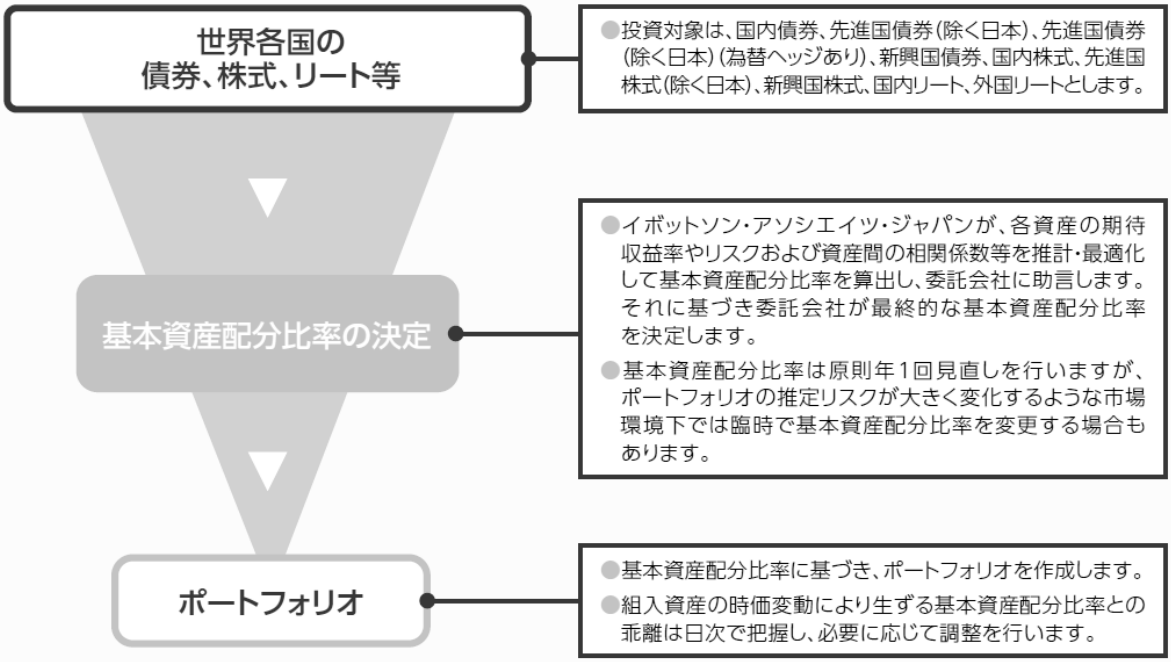


※( )内の数値は目標リスク水準です。
※円グラフ内の数値は基本資産配分比率です。
(出所)イボットソン・アソシエイツ・ジャパンの情報を基に委託会社作成

※基本資産配分比率は2024年9月末現在のものであり、今後変更される場合があります。

運用プロセス

■世界各国の債券、株式およびリート等を投資対象とし、イボットソン・アソシエイツ・ジャパンからの助言に基づき基本資産配分比率を決定し、ポートフォリオを構築します。



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

イボットソン・アソシエイツ・ジャパン株式会社について

ibbotson
a Morningstar company

■イボットソン・アソシエイツ・ジャパン株式会社は、米国のモーニングスター・グループの日本法人です。

■1977年にロジャー・G・イボットソン(現イェール大学経営大学院教授)が金融経済学の研究成果を投資実務に役立たせるという理念に基づき、米国Ibbotson Associates, Inc.(現Morningstar Investment Management LLC)を設立しました。

■イボットソン・アソシエイツ・ジャパン株式会社は、世界の資本市場の長期的なリスクとリターンの調査研究に基づき、中立的な観点から投資判断に役立つ情報とポートフォリオ構築ツールを提供しています。

(出所)イボットソン・アソシエイツ・ジャパンの情報を基に委託会社作成

(2)【投資対象】

イ　投資対象とする資産の種類

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

１．有価証券

２．約束手形

３．金銭債権

（ロ）特定資産以外の資産で、以下に掲げる資産

１．為替手形

ロ　投資対象とする有価証券

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

１．コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等

２．外国または外国の者の発行する本邦通貨表示の証券で、前号の性質を有するもの

３．国債証券、地方債証券、特別の法律により法人の発行する債券および社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券の新株引受権証券および短期社債等を除きます。）

なお、第３号の証券にかかる運用の指図は買い現先取引（売戻条件付の買入れ）および債券貸借取引（現金担保付債券借入れ）に限り行うことができるものとします。

ハ　投資対象とする金融商品

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

１．預金

２．指定金銭信託（金融商品取引法第２条第１項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）

３．コール・ローン

４．手形割引市場において売買される手形

〔参考情報：投資対象とする投資信託の概要〕

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

●すべての投資信託に投資するとは限りません。また、投資対象とする投資信託は、今後、追加・入替等が行われることがあります。

▶債券

国内債券

ファンド名	国内債券パッシブ・マザーファンド
形態	国内籍親投資信託
運用会社	三井住友DSアセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	●NOMURA−BPI（総合）をベンチマークとし、ベンチマークの動きに連動する投資成果を目指します。 ●日本の公社債および短期金融資産を主要投資対象とします。
信託財産留保額	追加設定時、一部解約時にそれぞれ0.03%

先進国債券（除く日本）…為替ヘッジなし

ファンド名	外国債券パッシブ・マザーファンド
形態	国内籍親投資信託
運用会社	三井住友DSアセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	●ＦＴＳＥ世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）をベンチマークとし、ベンチマークの動きに連動する投資成果を目指します。 ●ベンチマーク採用国の国債を主要投資対象とします。 ●保有する外貨建て資産については、原則として対円での為替ヘッジを行いません。
信託財産留保額	追加設定時、一部解約時にそれぞれ0.1%

為替ヘッジ付き先進国債券（除く日本）…為替ヘッジあり

ファンド名	ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド
形態	国内籍親投資信託
運用会社	三井住友DSアセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	●ＦＴＳＥ世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ換算ベース）をベンチマークとし、ベンチマークの動きに連動する投資成果を目指します。 ●ベンチマーク採用国の国債を主要投資対象とします。 ●保有する外貨建て資産については、対円での為替のフルヘッジを原則とします。
信託財産留保額	追加設定時、一部解約時にそれぞれ0.1%

新興国債券…為替ヘッジなし*1

ファンド名	iシェアーズ J.P.モルガン・米ドル建てエマージング・マーケット債券 ETF
形態	米国籍外国投資信託（米ドル建て）
運用会社	ブラックロック・ファンド・アドバイザーズ
運用の基本方針	●J.P.モルガンEMBIグローバル・コア・インデックスをベンチマークとし、インデックスの構成銘柄の債券を主要投資対象とします。 ●ベンチマークのパフォーマンスへの連動を目指します。
管理費用*2	年0.39%
購入の可否*3	日本において一般投資者の購入が可能です。

*1 新興国債券への基本資産配分比率は10%を上限とします。

*2 管理費用とはETFの運用管理費用およびその他費用をETFの平均純資産総額で除したもので、本書の数値はETFの直近の目論見書等で開示されているものです。

*3 外国籍のETFは、海外の上場有価証券を取り次ぐことのできる証券会社を通じて、日本国内の一般の投資者が、直接、購入することができるものがあります。
直接購入される際は、売買委託手数料（証券会社ごとに異なります。）がかかります。また、円貨と外貨を交換する際に、証券会社が別途定める手数料がかかります。

▶株式

国内株式

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

先進国株式(除く日本)…為替ヘッジなし

ファンド名	外国株式インデックス・マザーファンド
形態	国内籍親投資信託
運用会社	三井住友DSアセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	●主として世界各国の株式に投資し、MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円換算ベース)の動きに連動する投資成果を目指します。 ●外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行いません。
信託財産留保額	追加設定時、一部解約時にそれぞれ0.15%

新興国株式…為替ヘッジなし

ファンド名	エマージング株式インデックス・マザーファンド
形態	国内籍親投資信託
運用会社	三井住友DSアセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	●主として新興国の株式(預託証書(DR)、株式の値動きに連動する有価証券を含みます。)、新興国の株式指数を対象とした先物取引および新興国の株式等を主要投資対象とする上場投資信託証券に投資し、MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円換算ベース)の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。 ●外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行いません。
信託財産留保額	追加設定時、一部解約時にそれぞれ0.15%

▶リート

国内リート

ファンド名	Jリート・インデックス・マザーファンド
形態	国内籍親投資信託
運用会社	三井住友DSアセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	●東証REIT指数(配当込み)をベンチマークとし、ベンチマークの動きに連動する投資成果を目指します。 ●日本の取引所に上場(上場予定を含みます。)している不動産投資信託(REIT)を主要投資対象とします。
信託財産留保額	追加設定時、一部解約時にそれぞれ0.15%

外国リート…為替ヘッジなし

ファンド名	外国リート・インデックス・マザーファンド
形態	国内籍親投資信託
運用会社	三井住友DSアセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	●S&P先進国REIT指数(除く日本、配当込み、円換算ベース)をベンチマークとし、ベンチマークの動きに連動する投資成果を目指します。 ●日本を除く世界各国の不動産投資信託(REIT)などを主要投資対象とします。 ●外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行いません。
信託財産留保額	追加設定時、一部解約時にそれぞれ0.15%

指数の著作権など

●NOMURA−BPIは野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社、FTSE世界国債インデックスはFTSE Fixed Income LLC、J.P.モルガンEMBIグローバル・コア・インデックスはJ.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシー、TOPIX(東証株価指数)および東証REIT指数は株式会社JPX総研、MSCIコクサイ・インデックスおよびMSCIエマージング・マーケット・インデックスはMSCI Inc.、S&P先進国REIT指数はS&P Dow Jones Indices LLCが、それぞれ公表している指数です。

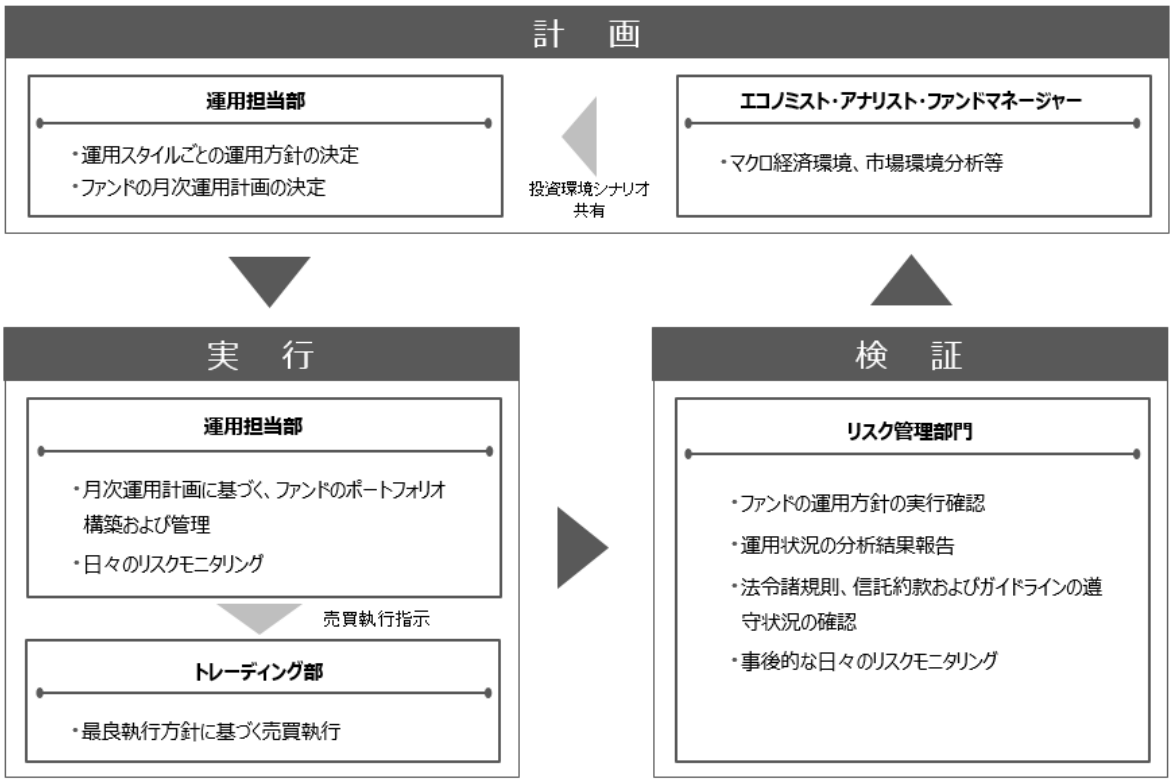
●各インデックスに関する著作権、知的所有権、その他一切の権利は、指数を公表および許諾する各社に帰属します。また、当該各社は当ファンドの取引および運用成果等に関して一切責任を負いません。

●投資対象とする投資信託においてデリバティブ取引を行う場合は、価格変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。

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

（3）【運用体制】

イ　ファンドの運用体制



※リスク管理部門の人員数は、約 40 名です。
※ファンドの運用体制は、委託会社の組織変更等により、変更されることがあります。
※他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）の組入れは、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上、選定しています。また、定性・定量面における評価を継続的に実施するとともに、投資対象としての適格性を定期的に判断します。

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

（4）【分配方針】

年１回（原則として毎年９月 15 日。ただし、休業日の場合は翌営業日）決算を行い、原則として以下の方針に基づき分配金額を決定します。

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

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

（5）【投資制限】

Ⅰ　ファンドの信託約款に基づく投資制限

イ　投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。

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

ハ　外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。

ニ　投資信託証券を組み入れる場合において、一般社団法人投資信託協会規則に定めるエクスポージャーがルックスルーできる場合に該当しないときは、当該投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。

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

ヘ　公社債の借入れの指図

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

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

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

（ニ）借入れにかかる品借料は、信託財産中から支弁します。

ト　特別の場合の外貨建有価証券への投資制限

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

チ　外国為替予約取引の指図

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

リ　資金の借入れ

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

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

1．一部解約金の支払資金の手当てのために行った有価証券等の売却等による受取りの確定している資金の額の範囲内

2．一部解約金支払日の前営業日において確定した当該支払日における支払資金の不足額の範囲内

3．借入れ指図を行う日における信託財産の純資産総額の 10%以内

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

（ニ）借入金の利息は、信託財産中から支弁します。

Ⅱ　法令に基づく投資制限

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

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

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

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

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

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

３【投資リスク】

イ　ファンドのもつリスクの特性

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

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

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

当ファンドの主要なリスクは以下の通りです。

（イ）株式市場リスク

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

（ロ）債券市場リスク

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

（ハ）不動産投資信託（リート）に関するリスク

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

（ニ）信用リスク

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

（ホ）為替変動リスク

ファンドは外貨建資産の一部について、原則として対円での為替ヘッジを行います。

為替ヘッジが行われていない部分については為替変動の影響を受けます。ファンドが保有する外貨建資産の価格が現地通貨ベースで上昇する場合であっても、当該現地通貨が対円で下落する（円高となる）場合、円ベースでの評価額が下落し、基準価額が下落することがあります。

為替ヘッジが行われている部分については為替変動の影響を受けますが、原則として対円での為替ヘッジを行うため、その影響は限定的と考えられます。ただし、完全に為替変動リスクを回避することはできません。対円での為替ヘッジ比率は、資産配分の調整に伴い変動します。なお、円金利がヘッジ対象通貨の金利よりも低い場合、その金利差相当分のヘッジコストがかかることにご留意ください。また、需給要因等によっては金利差相当分以上にヘッジコストがかかる場合があります。

（ヘ）カントリーリスク

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

特に投資先が新興国の場合、その証券市場は先進国の証券市場に比べ、より運用上の制約が大きいことが想定されます。また、先進国に比べ、一般に市場規模が小さいため、有価証券の需給変動の影響

を受けやすく、価格形成が偏ったり、変動性が大きくなる傾向が考えられます。

（ト）流動性リスク

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

ロ　その他の留意点

（イ）投資信託に関する留意点

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

・ファンドのお申込みに関しては、クーリング・オフ制度の適用はありません。

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

これにより、基準価額にマイナスの影響を及ぼす可能性、換金申込みの受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、定期的にリスク管理会議へ報告します。

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

（参考情報）投資リスクの定量的比較

ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移

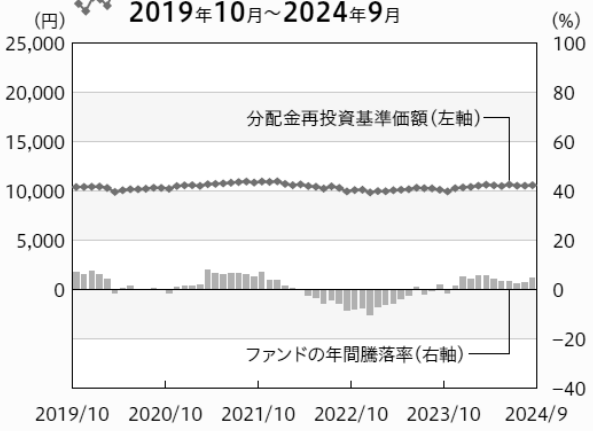
各月末におけるファンドの1年間の騰落率と分配金再投資基準価額の推移を表示したものです。

ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較

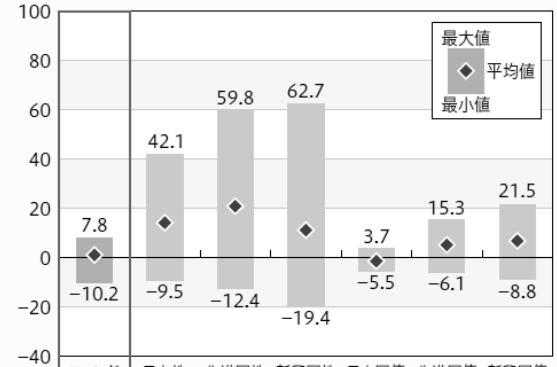
ファンドおよび他の代表的な資産クラスについて、各月末における1年間の騰落率の平均・最大・最小を比較したものです。

□1安定重視型

年間騰落率：2019年10月～2024年9月
分配金再投資基準価額：2019年10月～2024年9月



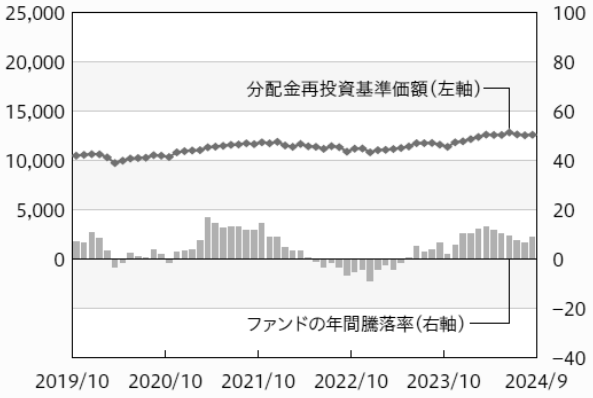
ファンド：2019年10月～2024年9月
他の資産クラス：2019年10月～2024年9月



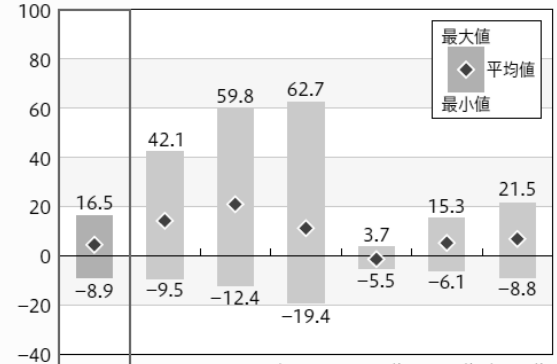
	ファンド	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
◆平均値	1.0%	14.1%	20.9%	11.1%	−1.5%	5.2%	6.8%

□2やや安定型

年間騰落率：2019年10月～2024年9月
分配金再投資基準価額：2019年10月～2024年9月



ファンド：2019年10月～2024年9月
他の資産クラス：2019年10月～2024年9月



	ファンド	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
◆平均値	4.4%	14.1%	20.9%	11.1%	−1.5%	5.2%	6.8%

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

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

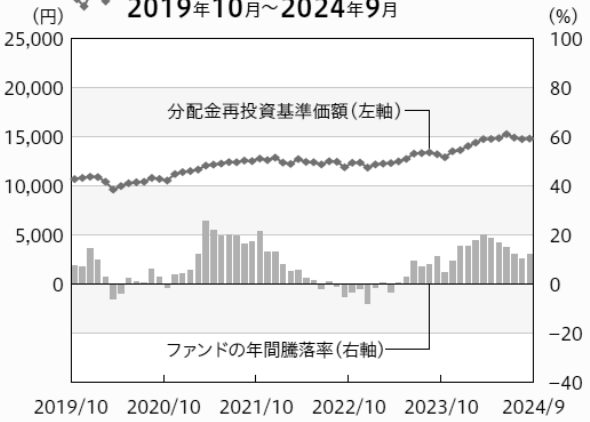
ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移

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

3バランス型

年間騰落率：
2019年10月～2024年9月

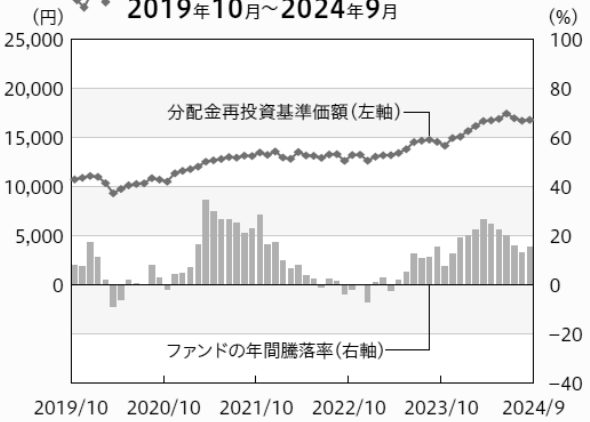
分配金再投資基準価額：
2019年10月～2024年9月



4やや成長型

年間騰落率：
2019年10月～2024年9月

分配金再投資基準価額：
2019年10月～2024年9月



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

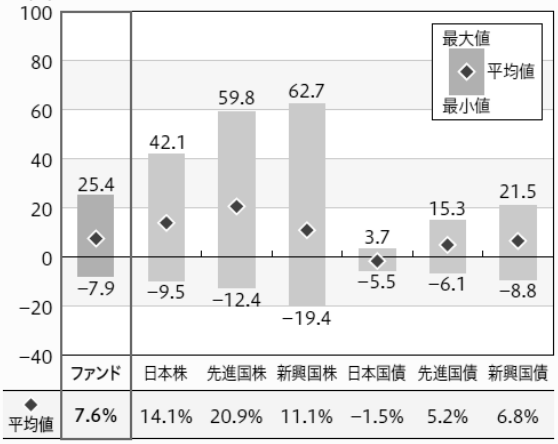
ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較

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。

3バランス型

ファンド：
2019年10月～2024年9月

他の資産クラス：
2019年10月～2024年9月

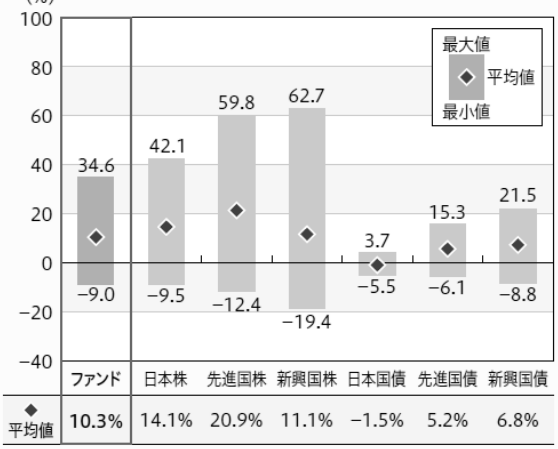


	ファンド	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
◆平均値	7.6%	14.1%	20.9%	11.1%	−1.5%	5.2%	6.8%

4やや成長型

ファンド：
2019年10月～2024年9月

他の資産クラス：
2019年10月～2024年9月



	ファンド	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
◆平均値	10.3%	14.1%	20.9%	11.1%	−1.5%	5.2%	6.8%

※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は異なります。
※すべての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。

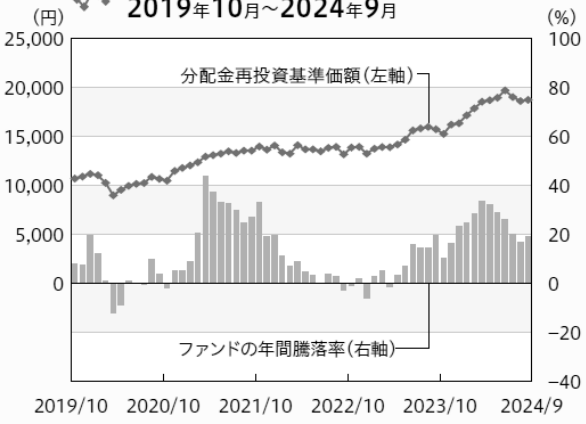
ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移

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

5成長重視型

年間騰落率：
2019年10月～2024年9月

分配金再投資基準価額：
2019年10月～2024年9月



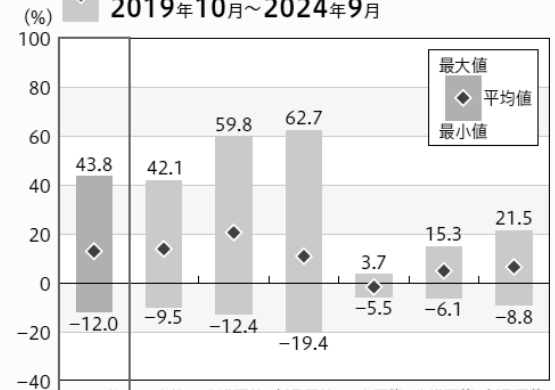
※年間騰落率、分配金再投資基準価額は、分配金（税引前）を分配時に再投資したものと仮定して計算したものです。
※分配実績がない場合は、分配金再投資基準価額は基準価額と同じです。

ファンド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：
2019年10月～2024年9月

他の資産クラス：
2019年10月～2024年9月



	ファンド	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
◆平均値	12.9%	14.1%	20.9%	11.1%	−1.5%	5.2%	6.8%

※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は異なります。
※すべての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。

各資産クラスの指数

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

<table>
<tr><td rowspan="5"></td><td rowspan="4">ファンド</td><td colspan="3">純資産総額に年0.968%（税抜き0.88%）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）＞</td></tr>
<tr><td>支払先</td><td>料率</td><td>役務の内容</td></tr>
<tr><td>委託会社</td><td>年0.39%</td><td>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</td></tr>
<tr><td>販売会社</td><td>年0.46%</td><td>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</td></tr>
<tr><td>受託会社</td><td>年0.03%</td><td>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</td></tr>
<tr><td colspan="3">※上記の配分には別途消費税等相当額がかかります。
※委託会社の配分には、ファンドの運用に関して、助言を行う投資顧問会社に支払う投資顧問報酬が含まれています。</td></tr>
<tr><td></td><td>投資対象とする投資信託</td><td colspan="3">年0.39%程度（最大）*
※管理費用は、今後変更される場合があります。</td></tr>
<tr><td colspan="2">実質的な負担</td><td colspan="3">ファンドの純資産総額に対して年1.007%（最大）（税抜き0.919%）程度*
※実質的な負担は、基本資産配分比率の見直しおよび実際の組入状況等により変動します。
※ETFの基本資産配分比率を上限の10%と仮定して算出した試算値です。</td></tr>
</table>

＊投資対象とする投資信託の運用管理費用は、2024 年 9 月末現在で知り得る情報に基づくものであり、今後、変更される場合があります。

（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、外国における資産の保管等に要する費用、およびマザーファンドの購入・換金に伴う信託財産留保額等（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、その時々の取引内容等により金額が決定し、実務上、その発生もしくは請求のつど、信託財産の費用として認識され、その時点の信託財産で負担することとなるものがあります。したがって、あらかじめ、その金額、上限額等を具体的に記載することはできません。

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

（5）【課税上の取扱い】

イ　個別元本について

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

（ロ）受益者が同一ファンドの受益権を複数回取得した場合、個別元本は、当該受益者が追加信託を行うつど当該受益者の受益権口数で加重平均することにより算出されます。ただし、同一ファンドを複数の販売会社で取得する場合については、各販売会社毎に個別元本の算出が行われます。また、同一販売会社であっても同一受益者の顧客口座が複数存在する場合や、「分配金受取りコース」と「分配金自動再投資コース」を併用するファンドの場合には、別々に個別元本の算出が行われることがあります。

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

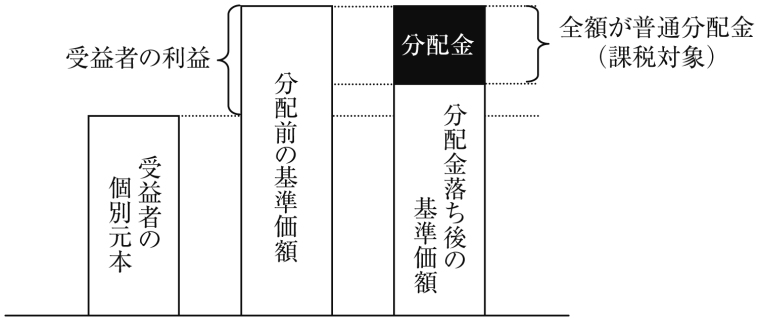
ロ　一部解約時および償還時の課税について

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

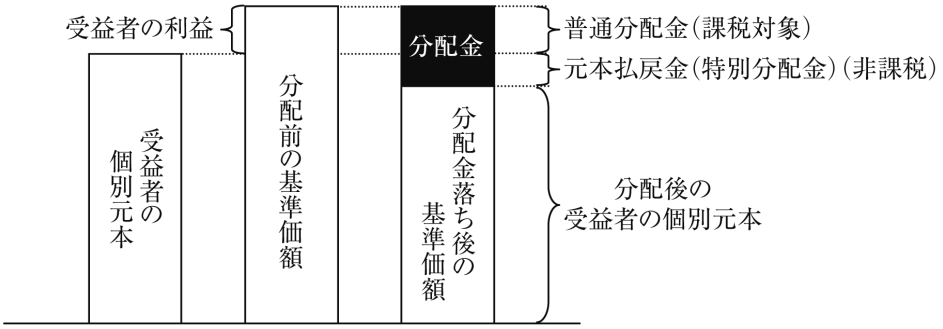
ハ　収益分配金の課税について

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

①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。



②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①、②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。

ニ　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

ⅰ．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。

ⅱ．一部解約時および償還時

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

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

（ロ）法人の受益者に対する課税

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

当ファンドは、課税上は株式投資信託として取り扱われます。

なお、当ファンドは、配当控除および益金不算入制度の適用はありません。

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

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

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

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

※当ファンドは、ＮＩＳＡの「成長投資枠（特定非課税管理勘定）」の対象ですが、販売会社により取扱いが

異なる場合があります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

※少額投資非課税制度「愛称：ＮＩＳＡ（ニーサ）」をご利用の場合

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

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

※上記「(5)課税上の取扱い」ほか税制に関する本書の記載は、2024 年 9 月末現在の情報をもとに作成しています。税法の改正等により、変更されることがあります。

(参考情報) 総経費率

直近の運用報告書の対象期間(2023年9月16日～2024年9月17日)における当ファンドの総経費率(年率換算)は以下の通りです。
投資対象とする上場投資信託(ETF)(以下、投資先ファンド)の費用は、その他費用に含めています。なお、当ファンドの費用と投資先ファンドの費用の対象期間は、異なる場合があります。

	総経費率(①+②)	①運用管理費用の比率	②その他費用の比率
1安定重視型	1.00%	0.97%	0.03%
2やや安定型	1.01%	0.97%	0.04%
3バランス型	1.01%	0.97%	0.05%
4やや成長型	1.02%	0.97%	0.05%
5成長重視型	1.02%	0.97%	0.06%

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

５【運用状況】

（１）【投資状況】

三井住友・資産最適化ファンド（１安定重視型）

2024年9月30日現在

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（％）
投資証券	アメリカ	115,884,373	0.89
親投資信託受益証券	日本	12,855,308,143	98.27
現金・預金・その他の資産（負債控除後）	－	110,536,862	0.84
合計（純資産総額）		13,081,729,378	100.00

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

三井住友・資産最適化ファンド（２やや安定型）

2024年9月30日現在

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（％）
投資証券	アメリカ	131,511,630	1.86
親投資信託受益証券	日本	6,873,134,842	97.30
現金・預金・その他の資産（負債控除後）	－	59,152,061	0.84
合計（純資産総額）		7,063,798,533	100.00

三井住友・資産最適化ファンド（３バランス型）

2024年9月30日現在

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（％）
投資証券	アメリカ	589,848,929	2.84
親投資信託受益証券	日本	20,044,442,022	96.40
現金・預金・その他の資産（負債控除後）	－	158,778,755	0.76
合計（純資産総額）		20,793,069,706	100.00

三井住友・資産最適化ファンド（４やや成長型）

2024年9月30日現在

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（％）
投資証券	アメリカ	366,107,151	3.61

親投資信託受益証券	日本	9,689,658,523	95.54
現金・預金・その他の資産（負債控除後）	－	86,292,195	0.85
合計（純資産総額）		10,142,057,869	100.00

三井住友・資産最適化ファンド（５成長重視型）

2024年9月30日現在

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（％）
投資証券	アメリカ	503,499,003	4.57
親投資信託受益証券	日本	10,426,868,621	94.64
現金・預金・その他の資産（負債控除後）	－	86,893,803	0.79
合計（純資産総額）		11,017,261,427	100.00

（２）【投資資産】

①【投資有価証券の主要銘柄】

三井住友・資産最適化ファンド（１安定重視型）

イ　主要投資銘柄

2024年9月30日現在

国／地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価（円）	帳簿価額（円）	評価額単価（円）	評価額（円）	投資比率（％）
日本	親投資信託受益証券	国内債券パッシブ・マザーファンド	3,853,106,111	1.2031	4,635,639,599	1.1996	4,622,186,090	35.33
日本	親投資信託受益証券	ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド	3,430,125,113	1.2449	4,270,301,044	1.2376	4,245,122,839	32.45
日本	親投資信託受益証券	外国株式インデックス・マザーファンド	159,719,275	8.8166	1,408,181,773	9.1343	1,458,923,773	11.15
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）	224,432,897	4.5620	1,023,869,332	4.7669	1,069,849,176	8.18
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	402,427,093	2.2274	896,370,431	2.2578	908,599,890	6.95
日本	親投資信託受益証券	エマージング株式インデックス・マザーファンド	129,079,159	1.9871	256,489,332	2.1820	281,650,724	2.15
日本	親投資信託受益証券	外国リート・インデックス・マザーファンド	38,740,973	3.6007	139,494,621	3.6203	140,253,944	1.07

日本	親投資信託受益証券	Ｊリート・インデックス・マザーファンド	49,971,547	2.6176	130,805,857	2.5759	128,721,707	0.98
アメリカ	投資証券	ｉシェアーズ Ｊ．Ｐ．モルガン・米ドル建てエマージング・マーケット債券ＥＴＦ	8,691	13,362.38	116,132,467	13,333.84	115,884,373	0.89

以上が、当ファンドが保有する有価証券のすべてです。

ロ　種類別投資比率

2024年9月30日現在

種類	投資比率（%）
投資証券	0.89
親投資信託受益証券	98.27
合　計	99.16

三井住友・資産最適化ファンド（２やや安定型）

イ　主要投資銘柄

2024年9月30日現在

国／地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価（円）	帳簿価額（円）	評価額単価（円）	評価額（円）	投資比率（%）
日本	親投資信託受益証券	ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド	1,575,561,595	1.2450	1,961,550,268	1.2376	1,949,915,029	27.60
日本	親投資信託受益証券	国内債券パッシブ・マザーファンド	1,156,907,623	1.2031	1,391,872,977	1.1996	1,387,826,384	19.65
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	147,413,953	8.8161	1,299,622,336	9.1343	1,346,523,270	19.06
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）	224,864,591	4.5629	1,026,043,318	4.7669	1,071,907,018	15.17
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	275,487,165	2.2276	613,664,807	2.2578	621,994,921	8.81
日本	親投資信託受益証券	エマージング株式インデックス・マザーファンド	100,737,280	1.9871	200,177,034	2.1820	219,808,744	3.11
日本	親投資信託受益証券	外国リート・インデックス・マザーファンド	38,588,464	3.6007	138,945,482	3.6203	139,701,816	1.98
日本	親投資信託受益証券	Ｊリート・インデックス・マザーファンド	52,586,537	2.6178	137,661,036	2.5759	135,457,660	1.92

アメリカ	投資証券	ｉシェアーズ Ｊ．Ｐ．モルガン・米ドル建てエマージング・マーケット債券ＥＴＦ	9,863	13,362.38	131,793,179	13,333.84	131,511,630	1.86

以上が、当ファンドが保有する有価証券のすべてです。

ロ　種類別投資比率

2024年9月30日現在

種類	投資比率（%）
投資証券	1.86
親投資信託受益証券	97.30
合　計	99.16

三井住友・資産最適化ファンド（３バランス型）

イ　主要投資銘柄

2024年9月30日現在

国／地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価（円）	帳簿価額（円）	評価額単価（円）	評価額（円）	投資比率（%）
日本	親投資信託受益証券	外国株式インデックス・マザーファンド	589,741,929	8.8161	5,199,224,645	9.1343	5,386,879,702	25.91
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）	917,238,653	4.5625	4,184,895,361	4.7669	4,372,384,934	21.03
日本	親投資信託受益証券	ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド	2,645,755,220	1.2450	3,293,965,249	1.2376	3,274,386,660	15.75
日本	親投資信託受益証券	国内債券パッシブ・マザーファンド	2,399,387,825	1.2031	2,886,703,492	1.1996	2,878,305,634	13.84
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	809,474,737	2.2277	1,803,290,405	2.2578	1,827,632,061	8.79
日本	親投資信託受益証券	エマージング株式インデックス・マザーファンド	495,929,929	1.9871	985,457,994	2.1820	1,082,119,105	5.20
日本	親投資信託受益証券	Ｊリート・インデックス・マザーファンド	239,482,273	2.6178	626,916,694	2.5759	616,882,387	2.97
日本	親投資信託受益証券	外国リート・インデックス・マザーファンド	167,348,435	3.6007	602,571,509	3.6203	605,851,539	2.91
アメリカ	投資証券	ｉシェアーズ Ｊ．Ｐ．モルガン・米ドル建てエ	44,237	13,362.38	591,111,719	13,333.84	589,848,929	2.84

		マージング・マーケット債券ＥＴＦ						

以上が、当ファンドが保有する有価証券のすべてです。

ロ　種類別投資比率

2024年9月30日現在

種類	投資比率（%）
投資証券	2.84
親投資信託受益証券	96.40
合　計	99.24

三井住友・資産最適化ファンド（４やや成長型）

イ　主要投資銘柄

2024年9月30日現在

国／地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価（円）	帳簿価額（円）	評価額単価（円）	評価額（円）	投資比率（%）
日本	親投資信託受益証券	外国株式インデックス・マザーファンド	365,105,216	8.8161	3,218,801,907	9.1343	3,334,980,574	32.88
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）	549,517,478	4.5610	2,506,361,413	4.7669	2,619,494,865	25.83
日本	親投資信託受益証券	ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド	727,492,531	1.2450	905,728,201	1.2376	900,344,756	8.88
日本	親投資信託受益証券	エマージング株式インデックス・マザーファンド	343,107,308	1.9871	681,782,863	2.1820	748,660,146	7.38
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	579,427,388	1.2031	697,100,765	1.1996	695,081,094	6.85
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	263,743,667	2.2276	587,518,269	2.2578	595,480,451	5.87
日本	親投資信託受益証券	外国リート・インデックス・マザーファンド	111,137,146	3.6007	400,171,522	3.6203	402,349,809	3.97
日本	親投資信託受益証券	Ｊリート・インデックス・マザーファンド	152,671,621	2.6178	399,663,769	2.5759	393,266,828	3.88
アメリカ	投資証券	ｉシェアーズ Ｊ．Ｐ．モルガン・米ドル建てエマージング・マーケット債券ＥＴＦ	27,457	13,362.38	366,890,939	13,333.84	366,107,151	3.61

以上が、当ファンドが保有する有価証券のすべてです。

ロ　種類別投資比率

2024年9月30日現在

種類	投資比率（%）
投資証券	3.61
親投資信託受益証券	95.54
合　計	99.15

三井住友・資産最適化ファンド（５成長重視型）

イ　主要投資銘柄

2024年9月30日現在

国／地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価（円）	帳簿価額（円）	評価額単価（円）	評価額（円）	投資比率（%）
日本	親投資信託受益証券	外国株式インデックス・マザーファンド	523,878,358	8.8163	4,618,669,172	9.1343	4,785,262,085	43.43
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）	685,908,368	4.5624	3,129,366,459	4.7669	3,269,656,599	29.68
日本	親投資信託受益証券	エマージング株式インデックス・マザーファンド	528,563,853	1.9870	1,050,282,003	2.1820	1,153,326,327	10.47
アメリカ	投資証券	ｉシェアーズ Ｊ．Ｐ．モルガン・米ドル建てエマージング・マーケット債券ＥＴＦ	37,761	13,362.38	504,576,929	13,333.84	503,499,003	4.57
日本	親投資信託受益証券	外国リート・インデックス・マザーファンド	93,626,730	3.6007	337,121,767	3.6203	338,956,850	3.08
日本	親投資信託受益証券	Ｊリート・インデックス・マザーファンド	127,306,138	2.6178	333,262,008	2.5759	327,927,880	2.98
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	143,088,978	2.2271	318,673,462	2.2578	323,066,294	2.93
日本	親投資信託受益証券	ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド	97,175,055	1.2450	120,982,943	1.2376	120,263,848	1.09
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	90,370,739	1.2031	108,725,036	1.1996	108,408,738	0.98

以上が、当ファンドが保有する有価証券のすべてです。

ロ　種類別投資比率

2024年9月30日現在

種類	投資比率（%）
投資証券	4.57
親投資信託受益証券	94.64
合　計	99.21

②【投資不動産物件】

三井住友・資産最適化ファンド（１安定重視型）

該当事項はありません。

三井住友・資産最適化ファンド（２やや安定型）

該当事項はありません。

三井住友・資産最適化ファンド（３バランス型）

該当事項はありません。

三井住友・資産最適化ファンド（４やや成長型）

該当事項はありません。

三井住友・資産最適化ファンド（５成長重視型）

該当事項はありません。

③【その他投資資産の主要なもの】

三井住友・資産最適化ファンド（１安定重視型）

該当事項はありません。

三井住友・資産最適化ファンド（２やや安定型）

該当事項はありません。

三井住友・資産最適化ファンド（３バランス型）

該当事項はありません。

三井住友・資産最適化ファンド（４やや成長型）

該当事項はありません。

三井住友・資産最適化ファンド（５成長重視型）

該当事項はありません。

（３）【運用実績】

①【純資産の推移】

三井住友・資産最適化ファンド（１安定重視型）

年月日	純資産総額（円）		１万口当たりの純資産額（円）	
	（分配落）	（分配付）	（分配落）	（分配付）
第１期　（2018年 9月 18日）	188,363,034	188,363,034	9,891	9,891
第２期　（2019年 9月 17日）	1,356,985,451	1,356,985,451	10,327	10,327
第３期　（2020年 9月 15日）	3,201,120,313	3,201,120,313	10,352	10,352
第４期　（2021年 9月 15日）	6,014,936,981	6,014,936,981	10,987	10,987
第５期　（2022年 9月 15日）	7,936,728,790	7,936,728,790	10,277	10,277
第６期　（2023年 9月 15日）	10,436,090,722	10,436,090,722	10,277	10,277
第７期　（2024年 9月 17日）	12,849,987,395	12,849,987,395	10,526	10,526
2023年 9月末日	10,420,958,617	－	10,137	－
10月末日	10,450,654,600	－	9,962	－
11月末日	10,943,882,559	－	10,286	－
12月末日	11,194,951,609	－	10,370	－
2024年 1月末日	11,506,577,439	－	10,436	－
2月末日	11,705,061,854	－	10,542	－
3月末日	11,953,111,482	－	10,649	－
4月末日	12,030,399,519	－	10,580	－
5月末日	12,083,365,826	－	10,519	－
6月末日	12,519,698,831	－	10,666	－
7月末日	12,532,291,298	－	10,555	－
8月末日	12,840,411,587	－	10,555	－
9月末日	13,081,729,378	－	10,600	－

三井住友・資産最適化ファンド（２やや安定型）

年月日	純資産総額	１万口当たりの

	（円）		純資産額（円）	
	（分配落）	（分配付）	（分配落）	（分配付）
第1期　（2018年 9月18日）	95,425,714	95,425,714	10,023	10,023
第2期　（2019年 9月17日）	680,523,123	680,523,123	10,310	10,310
第3期　（2020年 9月15日）	1,423,870,207	1,423,870,207	10,504	10,504
第4期　（2021年 9月15日）	2,948,746,361	2,948,746,361	11,770	11,770
第5期　（2022年 9月15日）	3,963,474,003	3,963,474,003	11,317	11,317
第6期　（2023年 9月15日）	5,248,052,720	5,248,052,720	11,802	11,802
第7期　（2024年 9月17日）	6,888,491,904	6,888,491,904	12,399	12,399
2023年 9月末日	5,229,878,730	－	11,587	－
10月末日	5,284,921,784	－	11,354	－
11月末日	5,604,943,719	－	11,818	－
12月末日	5,786,853,523	－	11,923	－
2024年 1月末日	5,975,029,896	－	12,147	－
2月末日	6,197,286,799	－	12,364	－
3月末日	6,475,823,430	－	12,592	－
4月末日	6,536,850,147	－	12,559	－
5月末日	6,642,357,682	－	12,559	－
6月末日	6,894,384,242	－	12,825	－
7月末日	6,947,399,774	－	12,612	－
8月末日	6,942,505,722	－	12,532	－
9月末日	7,063,798,533	－	12,583	－

三井住友・資産最適化ファンド（３バランス型）

年月日	純資産総額（円）		１万口当たりの純資産額（円）	
	（分配落）	（分配付）	（分配落）	（分配付）
第1期　（2018年 9月18日）	294,119,586	294,119,586	10,265	10,265
第2期　（2019年 9月17日）	1,355,636,779	1,355,636,779	10,443	10,443
第3期　（2020年 9月15日）	3,340,276,783	3,340,276,783	10,752	10,752
第4期　（2021年 9月15日）	7,103,911,189	7,103,911,189	12,649	12,649
第5期　（2022年 9月15日）	10,302,370,297	10,302,370,297	12,461	12,461
第6期　（2023年 9月15日）	14,715,183,751	14,715,183,751	13,483	13,483
第7期　（2024年 9月17日）	20,158,543,951	20,158,543,951	14,461	14,461
2023年 9月末日	14,618,376,219	－	13,185	－
10月末日	14,675,290,940	－	12,880	－
11月末日	15,680,235,845	－	13,498	－
12月末日	16,029,713,267	－	13,621	－
2024年 1月末日	16,810,959,885	－	14,021	－
2月末日	17,584,159,151	－	14,374	－
3月末日	18,457,673,206	－	14,742	－

4月末日	18,722,693,692	－	14,760	－
5月末日	19,214,412,344	－	14,830	－
6月末日	20,194,317,002	－	15,237	－
7月末日	20,218,263,626	－	14,897	－
8月末日	20,400,571,367	－	14,729	－
9月末日	20,793,069,706	－	14,790	－

三井住友・資産最適化ファンド（４やや成長型）

年月日	純資産総額（円）		１万口当たりの純資産額（円）	
	（分配落）	（分配付）	（分配落）	（分配付）
第1期　（2018年 9月 18日）	198,459,464	198,459,464	10,365	10,365
第2期　（2019年 9月 17日）	635,299,500	635,299,500	10,455	10,455
第3期　（2020年 9月 15日）	1,407,129,947	1,407,129,947	10,813	10,813
第4期　（2021年 9月 15日）	2,920,936,967	2,920,936,967	13,299	13,299
第5期　（2022年 9月 15日）	4,630,827,047	4,630,827,047	13,380	13,380
第6期　（2023年 9月 15日）	6,893,523,523	6,893,523,523	14,948	14,948
第7期　（2024年 9月 17日）	9,822,086,304	9,822,086,304	16,320	16,320
2023年 9月末日	6,819,468,088	－	14,567	－
10月末日	6,806,324,877	－	14,182	－
11月末日	7,250,096,420	－	14,954	－
12月末日	7,452,493,974	－	15,095	－
2024年 1月末日	7,993,986,824	－	15,676	－
2月末日	8,505,764,873	－	16,173	－
3月末日	8,919,497,449	－	16,691	－
4月末日	9,130,159,671	－	16,758	－
5月末日	9,367,771,499	－	16,903	－
6月末日	9,892,345,657	－	17,453	－
7月末日	9,860,442,520	－	16,982	－
8月末日	9,960,899,532	－	16,725	－
9月末日	10,142,057,869	－	16,806	－

三井住友・資産最適化ファンド（５成長重視型）

年月日	純資産総額（円）		１万口当たりの純資産額（円）	
	（分配落）	（分配付）	（分配落）	（分配付）
第1期　（2018年 9月 18日）	475,256,788	475,256,788	10,445	10,445
第2期　（2019年 9月 17日）	758,503,160	758,503,160	10,399	10,399
第3期　（2020年 9月 15日）	1,374,244,182	1,374,244,182	10,821	10,821
第4期　（2021年 9月 15日）	2,928,938,274	2,928,938,274	13,753	13,753

第5期　（2022年 9月15日）	4,578,888,251	4,578,888,251	14,067	14,067
第6期　（2023年 9月15日）	6,908,100,522	6,908,100,522	16,214	16,214
第7期　（2024年 9月17日）	10,529,858,478	10,529,858,478	18,060	18,060
2023年 9月末日	6,814,714,435	－	15,750	－
10月末日	6,802,646,406	－	15,283	－
11月末日	7,351,232,125	－	16,225	－
12月末日	7,515,599,607	－	16,371	－
2024年 1月末日	8,189,485,359	－	17,183	－
2月末日	8,779,729,375	－	17,889	－
3月末日	9,346,476,347	－	18,568	－
4月末日	9,666,384,841	－	18,721	－
5月末日	10,069,392,204	－	18,975	－
6月末日	10,727,913,749	－	19,725	－
7月末日	10,748,285,934	－	19,038	－
8月末日	10,793,896,652	－	18,644	－
9月末日	11,017,261,427	－	18,763	－

②【分配の推移】

三井住友・資産最適化ファンド（1安定重視型）

	計算期間	1万口当たり分配金（円）
第1期	2017年 9月14日～2018年 9月18日	0
第2期	2018年 9月19日～2019年 9月17日	0
第3期	2019年 9月18日～2020年 9月15日	0
第4期	2020年 9月16日～2021年 9月15日	0
第5期	2021年 9月16日～2022年 9月15日	0
第6期	2022年 9月16日～2023年 9月15日	0
第7期	2023年 9月16日～2024年 9月17日	0

三井住友・資産最適化ファンド（2やや安定型）

	計算期間	1万口当たり分配金（円）
第1期	2017年 9月14日～2018年 9月18日	0
第2期	2018年 9月19日～2019年 9月17日	0
第3期	2019年 9月18日～2020年 9月15日	0
第4期	2020年 9月16日～2021年 9月15日	0
第5期	2021年 9月16日～2022年 9月15日	0
第6期	2022年 9月16日～2023年 9月15日	0
第7期	2023年 9月16日～2024年 9月17日	0

三井住友・資産最適化ファンド（３バランス型）

	計算期間	１万口当たり分配金（円）
第１期	2017 年 9 月 14 日～2018 年 9 月 18 日	0
第２期	2018 年 9 月 19 日～2019 年 9 月 17 日	0
第３期	2019 年 9 月 18 日～2020 年 9 月 15 日	0
第４期	2020 年 9 月 16 日～2021 年 9 月 15 日	0
第５期	2021 年 9 月 16 日～2022 年 9 月 15 日	0
第６期	2022 年 9 月 16 日～2023 年 9 月 15 日	0
第７期	2023 年 9 月 16 日～2024 年 9 月 17 日	0

三井住友・資産最適化ファンド（４やや成長型）

	計算期間	１万口当たり分配金（円）
第１期	2017 年 9 月 14 日～2018 年 9 月 18 日	0
第２期	2018 年 9 月 19 日～2019 年 9 月 17 日	0
第３期	2019 年 9 月 18 日～2020 年 9 月 15 日	0
第４期	2020 年 9 月 16 日～2021 年 9 月 15 日	0
第５期	2021 年 9 月 16 日～2022 年 9 月 15 日	0
第６期	2022 年 9 月 16 日～2023 年 9 月 15 日	0
第７期	2023 年 9 月 16 日～2024 年 9 月 17 日	0

三井住友・資産最適化ファンド（５成長重視型）

	計算期間	１万口当たり分配金（円）
第１期	2017 年 9 月 14 日～2018 年 9 月 18 日	0
第２期	2018 年 9 月 19 日～2019 年 9 月 17 日	0
第３期	2019 年 9 月 18 日～2020 年 9 月 15 日	0
第４期	2020 年 9 月 16 日～2021 年 9 月 15 日	0
第５期	2021 年 9 月 16 日～2022 年 9 月 15 日	0
第６期	2022 年 9 月 16 日～2023 年 9 月 15 日	0
第７期	2023 年 9 月 16 日～2024 年 9 月 17 日	0

③【収益率の推移】

三井住友・資産最適化ファンド（１安定重視型）

	収益率（%）
第１期	△1.1
第２期	4.4
第３期	0.2
第４期	6.1
第５期	△6.5

第６期	0.0
第７期	2.4

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

三井住友・資産最適化ファンド（２やや安定型）

	収益率（％）
第１期	0.2
第２期	2.9
第３期	1.9
第４期	12.1
第５期	△3.8
第６期	4.3
第７期	5.1

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

三井住友・資産最適化ファンド（３バランス型）

	収益率（％）
第１期	2.7
第２期	1.7
第３期	3.0
第４期	17.6
第５期	△1.5
第６期	8.2
第７期	7.3

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

三井住友・資産最適化ファンド（４やや成長型）

	収益率（％）
第１期	3.7
第２期	0.9
第３期	3.4
第４期	23.0
第５期	0.6
第６期	11.7
第７期	9.2

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

配落基準価額で除したものをいいます。

三井住友・資産最適化ファンド（５成長重視型）

	収益率（％）
第１期	4.5
第２期	△0.4
第３期	4.1
第４期	27.1
第５期	2.3
第６期	15.3
第７期	11.4

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

（４）【設定及び解約の実績】

三井住友・資産最適化ファンド（１安定重視型）

	設定口数（口）	解約口数（口）
第１期	197,260,985	6,814,601
第２期	1,242,016,819	118,444,252
第３期	2,142,530,997	364,184,551
第４期	3,074,461,766	692,313,957
第５期	3,272,525,772	1,024,474,042
第６期	3,585,355,935	1,152,978,488
第７期	3,763,691,049	1,710,844,062

（注）本邦外における設定および解約の実績はありません。

三井住友・資産最適化ファンド（２やや安定型）

	設定口数（口）	解約口数（口）
第１期	235,257,377	140,052,522
第２期	593,034,885	28,199,968
第３期	853,822,366	158,356,618
第４期	1,391,060,134	241,319,938
第５期	1,327,482,394	330,475,830
第６期	1,371,817,336	427,265,280
第７期	1,652,333,710	543,610,418

（注）本邦外における設定および解約の実績はありません。

三井住友・資産最適化ファンド（３バランス型）

	設定口数（口）	解約口数（口）
第１期	426,008,460	139,473,752
第２期	1,111,549,352	100,006,600
第３期	2,085,818,899	277,142,914
第４期	2,996,875,916	487,585,479
第５期	3,415,030,451	763,606,832
第６期	3,603,123,946	956,915,168
第７期	4,235,031,216	1,208,617,793

（注）本邦外における設定および解約の実績はありません。

三井住友・資産最適化ファンド（４やや成長型）

	設定口数（口）	解約口数（口）
第１期	411,158,724	219,693,175
第２期	485,641,046	69,477,173
第３期	839,231,080	145,565,103
第４期	1,186,838,860	291,846,934
第５期	1,638,627,128	373,806,038
第６期	1,655,293,434	504,703,539
第７期	1,970,467,183	563,673,748

（注）本邦外における設定および解約の実績はありません。

三井住友・資産最適化ファンド（５成長重視型）

	設定口数（口）	解約口数（口）
第１期	762,271,388	307,261,790
第２期	481,502,084	207,078,502
第３期	843,783,098	303,192,666
第４期	1,274,331,650	414,699,900
第５期	1,564,567,682	439,177,712
第６期	1,671,376,606	665,761,266
第７期	2,248,982,809	679,089,448

（注）本邦外における設定および解約の実績はありません。

(参考)

（１）投資状況

国内株式インデックス・マザーファンド（Ｂ号）

2024年9月30日現在

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	日本	330,222,231,790	98.10

現金・預金・その他の資産（負債控除後）	－	6,399,065,345	1.90
合計（純資産総額）		336,621,297,135	100.00

その他以下の取引を行っております。

種類	買建／売建	国／地域	時価合計（円）	投資比率（%）
株価指数先物取引	買建	日本	6,751,125,000	2.01
合計	買建	－	6,751,125,000	2.01

外国株式インデックス・マザーファンド

2024年9月30日現在

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（%）
株式	アメリカ	574,646,178,220	70.29
	イギリス	30,074,991,615	3.68
	カナダ	26,603,480,190	3.25
	スイス	24,123,837,879	2.95
	フランス	22,772,730,348	2.79
	ドイツ	19,281,269,558	2.36
	アイルランド	14,863,601,322	1.82
	オーストラリア	14,464,614,522	1.77
	オランダ	14,424,841,812	1.76
	デンマーク	7,237,063,213	0.89
	スウェーデン	7,234,878,162	0.89
	スペイン	5,871,515,702	0.72
	イタリア	4,655,647,420	0.57
	香港	3,249,827,334	0.40
	シンガポール	2,383,233,064	0.29
	フィンランド	2,204,089,920	0.27
	ジャージィー	1,885,689,618	0.23
	ベルギー	1,705,566,512	0.21
	イスラエル	1,634,889,732	0.20
	ノルウェー	1,211,490,599	0.15
	ケイマン諸島	1,185,924,146	0.15
	バミューダ	1,013,778,137	0.12
	オランダ領キュラソー	733,380,281	0.09
	ニュージーランド	563,367,654	0.07
	リベリア	549,098,618	0.07
	ルクセンブルグ	430,431,937	0.05
	オーストリア	404,488,351	0.05
	ポルトガル	345,844,919	0.04
	パナマ	224,438,657	0.03

	マン島	63,509,447	0.01
	小計	786,043,698,889	96.15
新株予約権証券	カナダ	-	0.00
投資証券	アメリカ	13,889,448,196	1.70
	オーストラリア	1,512,799,528	0.19
	フランス	313,089,319	0.04
	イギリス	269,690,142	0.03
	シンガポール	201,390,106	0.02
	香港	174,592,613	0.02
	ケイマン諸島	80,758,561	0.01
	ベルギー	54,476,867	0.01
	カナダ	46,644,373	0.01
	小計	16,542,889,705	2.02
現金・預金・その他の資産（負債控除後）	-	14,908,407,506	1.83
合計（純資産総額）		817,494,996,100	100.00

その他以下の取引を行っております。

種類	買建／売建	国／地域	時価合計（円）	投資比率（%）
株価指数先物取引	買建	イギリス	688,028,930	0.08
株価指数先物取引	買建	ドイツ	2,380,961,100	0.29
株価指数先物取引	買建	アメリカ	13,679,983,611	1.67
株価指数先物取引	買建	オーストラリア	448,258,882	0.05
合計	買建	-	17,197,232,523	2.10

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

エマージング株式インデックス・マザーファンド

2024年9月30日現在

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

	香港	370,695,864	0.71
	トルコ	311,213,232	0.60
	フィリピン	279,812,803	0.54
	ギリシャ	225,133,105	0.43
	チリ	198,248,124	0.38
	バミューダ	182,041,313	0.35
	アメリカ	161,708,124	0.31
	ハンガリー	112,465,208	0.22
	イギリス	66,889,819	0.13
	チェコ	59,653,561	0.11
	ルクセンブルグ	51,311,867	0.10
	コロンビア	44,868,185	0.09
	エジプト	33,445,131	0.06
	オランダ	28,250,531	0.05
	ペルー	13,179,208	0.03
	シンガポール	12,241,951	0.02
	小計	43,006,746,078	82.42
投資信託受益証券	香港	1,927,046,716	3.69
投資証券	アメリカ	3,115,635,130	5.97
	メキシコ	230,692,586	0.44
	ブラジル	76,238,043	0.15
	小計	3,422,565,759	6.56
現金・預金・その他の資産（負債控除後）	-	3,823,446,402	7.33
合計（純資産総額）		52,179,804,955	100.00

その他以下の取引を行っております。

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

種類	買建／売建	国／地域	時価合計（円）	投資比率（%）
為替予約取引	買建	-	124,524,700	0.24

Ｊリート・インデックス・マザーファンド

2024年9月30日現在

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

その他以下の取引を行っております。

種類	買建／	国／地域	時価合計（円）	投資比率

	売建			(%)
リート指数先物取引	買建	日本	34,350,000	0.22
合計	買建	-	34,350,000	0.22

外国リート・インデックス・マザーファンド

2024年9月30日現在

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

その他以下の取引を行っております。

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

国内債券パッシブ・マザーファンド

2024年9月30日現在

資産の種類	国／地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
国債証券	日本	106,859,210,390	78.10
地方債証券	日本	11,563,255,900	8.45
特殊債券	日本	10,123,577,021	7.40
社債券	日本	7,830,159,100	5.72
現金・預金・その他の資産（負債控除後）	-	440,487,612	0.33

合計（純資産総額）	136,816,690,023	100.00

外国債券パッシブ・マザーファンド

2024年9月30日現在

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

ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド

2024年9月30日現在

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（%）
国債証券	アメリカ	16,882,375,872	45.17
	中国	4,004,814,136	10.72
	フランス	2,800,080,919	7.49
	イタリア	2,553,103,044	6.83

	ドイツ	2,215,137,829	5.93
	イギリス	2,005,007,802	5.36
	スペイン	1,670,511,366	4.47
	カナダ	713,916,386	1.91
	ベルギー	592,327,712	1.58
	オランダ	494,534,258	1.32
	オーストラリア	490,328,357	1.31
	オーストリア	426,294,153	1.14
	シンガポール	340,839,968	0.91
	メキシコ	264,945,164	0.71
	ポーランド	190,957,013	0.51
	フィンランド	185,961,176	0.50
	アイルランド	173,339,247	0.46
	イスラエル	109,862,753	0.29
	ニュージーランド	102,180,289	0.27
	デンマーク	100,047,087	0.27
	ノルウェー	57,015,727	0.15
	スウェーデン	55,196,154	0.15
	小計	36,428,776,412	97.48
現金・預金・その他の資産（負債控除後）	-	943,314,125	2.52
合計（純資産総額）		37,372,090,537	100.00

その他以下の取引を行っております。

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

（2）投資資産

①投資有価証券の主要銘柄

国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

イ　主要投資銘柄（上位30銘柄）

2024年9月30日現在

国／地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿単価（円）	帳簿価額（円）	評価額単価（円）	評価額（円）	投資比率（%）
日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	4,715,300	2,807.51	13,238,231,495	2,542.50	11,988,650,250	3.56
日本	株式	ソニーグループ	電気機器	3,105,000	2,572.52	7,987,664,834	2,777.50	8,624,137,500	2.56
日本	株式	日立製作所	電気機器	2,152,600	2,125.99	4,576,399,368	3,781.00	8,138,980,600	2.42
日本	株式	三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	銀行業	5,316,700	1,270.59	6,755,323,444	1,453.50	7,727,823,450	2.30
日本	株式	キーエンス	電気機器	88,800	63,722.05	5,658,518,262	68,360.00	6,070,368,000	1.80
日本	株式	リクルートホー	サービス	656,400	5,647.63	3,707,104,346	8,705.00	5,713,962,000	1.70

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

ロ　種類別・業種別投資比率

2024年9月30日現在

種類	業種	投資比率（%）
株式（国内）	水産・農林業	0.08
	鉱業	0.26
	建設業	2.18
	食料品	3.21
	繊維製品	0.39
	パルプ・紙	0.15

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

外国株式インデックス・マザーファンド

イ　主要投資銘柄（上位30銘柄）

2024年9月30日現在

国／地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿単価（円）	帳簿価額（円）	評価額単価（円）	評価額（円）	投資比率（%）
アメリカ	株式	APPLE INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	1,243,373	27,118.54	33,718,463,618	32,512.47	40,425,123,258	4.94
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェ	602,701	54,735.07	32,988,879,290	61,091.29	36,819,784,346	4.50

			ア・サービス						
アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導体・半導体製造装置	2,099,584	7,603.32	15,963,808,148	17,327.42	36,380,377,992	4.45
アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	一般消費財・サービス流通・小売り	799,908	21,449.55	17,157,668,261	26,828.96	21,460,698,215	2.63
アメリカ	株式	META PLATFORMS INC-CLASS A	メディア・娯楽	187,256	49,743.50	9,314,769,454	80,979.29	15,163,858,452	1.85
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	501,072	19,644.20	9,843,156,472	23,400.58	11,725,377,175	1.43
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	431,512	19,805.97	8,546,511,576	23,591.84	10,180,162,795	1.25
アメリカ	株式	BROADCOM INC	半導体・半導体製造装置	378,262	14,197.03	5,370,198,765	24,648.04	9,323,418,306	1.14
アメリカ	株式	TESLA INC	自動車・自動車部品	245,643	34,063.29	8,367,409,226	37,175.46	9,131,890,489	1.12
アメリカ	株式	ELI LILLY & CO	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	68,957	88,209.79	6,082,682,739	125,286.97	8,639,413,362	1.06
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	金融サービス	113,330	52,371.36	5,935,246,342	65,294.69	7,399,847,569	0.91
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	245,020	22,674.97	5,555,820,509	30,044.67	7,361,543,818	0.90
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	78,512	76,041.86	5,970,198,667	83,047.45	6,520,221,433	0.80
アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORP	エネルギー	384,075	14,683.12	5,639,418,226	16,530.99	6,349,139,446	0.78
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	金融サービス	134,891	36,548.99	4,930,129,363	39,275.01	5,297,845,926	0.65

アメリカ	株式	MASTERCARD INC - A	金融サービス	71,169	59,197.96	4,213,059,544	70,457.24	5,014,371,114	0.61
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO/THE	家庭用品・パーソナル用品	202,313	21,769.50	4,404,252,135	24,770.79	5,011,453,140	0.61
アメリカ	株式	HOME DEPOT INC	一般消費財・サービス流通・小売り	85,029	45,076.23	3,832,786,896	57,024.92	4,848,771,659	0.59
アメリカ	株式	COSTCO WHOLESALE CORP	生活必需品流通・小売り	38,003	87,457.98	3,323,665,739	126,404.54	4,803,751,832	0.59
アメリカ	株式	JOHNSON & JOHNSON	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	205,298	21,772.94	4,469,940,803	23,036.62	4,729,372,423	0.58
デンマーク	株式	NOVO NORDISK A/S-B	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	275,286	15,167.97	4,175,529,007	17,029.17	4,687,892,092	0.57
アメリカ	株式	WALMART INC	生活必需品流通・小売り	379,538	7,622.75	2,893,124,875	11,387.00	4,321,798,978	0.53
アメリカ	株式	ABBVIE INC	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	150,635	20,368.42	3,068,197,247	27,802.38	4,188,011,014	0.51
オランダ	株式	ASML HOLDING NV	半導体・半導体製造装置	34,249	104,395.90	3,575,455,114	120,736.34	4,135,098,874	0.51
アメリカ	株式	NETFLIX INC	メディア・娯	36,998	70,160.48	2,595,797,570	100,960.07	3,735,320,503	0.46

			楽						
アメリカ	株式	COCA-COLA CO/THE	食品・飲料・タバコ	351,399	8,392.86	2,949,242,416	10,246.59	3,600,640,319	0.44
アメリカ	株式	MERCK & CO. INC.	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	216,057	14,860.62	3,210,740,672	16,226.97	3,505,951,256	0.43
アメリカ	株式	ORACLE CORP	ソフトウェア・サービス	142,145	16,769.98	2,383,768,978	24,084.26	3,423,457,166	0.42
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	596,414	4,432.75	2,643,751,449	5,623.56	3,353,971,106	0.41
アメリカ	株式	SALESFORCE INC	ソフトウェア・サービス	82,659	33,498.06	2,768,916,175	39,484.83	3,263,776,331	0.40

ロ　種類別・業種別投資比率

2024年9月30日現在

種類	業種	投資比率（%）
株式（外国）	エネルギー	3.99
	素材	3.69
	資本財	7.08
	商業・専門サービス	1.56
	運輸	1.52
	自動車・自動車部品	1.72
	耐久消費財・アパレル	1.33
	消費者サービス	1.89
	一般消費財・サービス流通・小売り	4.76
	生活必需品流通・小売り	1.75
	食品・飲料・タバコ	3.10
	家庭用品・パーソナル用品	1.58
	ヘルスケア機器・サービス	4.02
	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	7.66
	銀行	5.47
	金融サービス	6.67
	保険	3.10
	ソフトウェア・サービス	9.59
	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	6.43

	半導体・半導体製造装置	8.80
	電気通信サービス	1.18
	公益事業	2.73
	メディア・娯楽	6.22
	不動産管理・開発	0.30
新株予約権証券	－	0.00
投資証券	－	2.02
合　計		98.18

エマージング株式インデックス・マザーファンド

イ　主要投資銘柄（上位30銘柄）

2024年9月30日現在

国／地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿単価（円）	帳簿価額（円）	評価額単価（円）	評価額（円）	投資比率（%）
台湾	株式	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	半導体・半導体製造装置	1,002,000	2,718.01	2,723,449,404	4,513.60	4,522,627,200	8.67
ケイマン諸島	株式	TENCENT HOLDINGS LTD	メディア・娯楽	266,600	5,830.35	1,554,372,626	8,042.39	2,144,100,107	4.11
香港	投資信託受益証券	CHINAAMC ETF SERIES - CH-CNY	-	2,368,000	733.5089	1,736,949,012	813.7866	1,927,046,716	3.69
アメリカ	投資証券	ISHARES MSCI SAUDI ARABIA ETF	-	299,238	5,709.79	1,708,587,017	6,181.64	1,849,780,483	3.55
韓国	株式	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	194,488	7,970.36	1,550,139,718	7,023.48	1,365,982,578	2.62
ケイマン諸島	株式	ALIBABA GROUP HOLDING LTD	一般消費財・サービス流通・小売り	619,900	1,336.36	828,407,379	1,882.93	1,167,225,207	2.24
インド	株式	RELIANCE INDUSTRIES LTD	エネルギー	124,068	4,230.61	524,883,545	5,219.52	647,575,221	1.24
ケイマン諸島	株式	MEITUAN-CLASS B	消費者サービス	201,660	1,657.11	334,173,315	3,023.70	609,759,745	1.17
アメリカ	投資証券	ISHARES MSCI UAE ETF	-	256,688	2,111.97	542,117,056	2,202.32	565,310,117	1.08
ケイマン諸島	株式	PDD HOLDINGS INC	一般消費財・サービス流通・小売り	28,413	19,087.01	542,319,253	19,322.79	549,018,358	1.05
インド	株式	HDFC BANK	銀行	174,052	2,702.74	470,417,416	2,997.03	521,639,326	1.00

		LIMITED							
インド	株式	ICICI BANK LTD	銀行	212,839	1,648.20	350,802,114	2,234.29	475,543,197	0.91
韓国	株式	SK HYNIX INC	半導体・半導体製造装置	22,327	14,892.56	332,506,256	20,107.72	448,945,064	0.86
インド	株式	INFOSYS LTD	ソフトウェア・サービス	135,071	2,539.53	343,016,728	3,260.54	440,404,736	0.84
台湾	株式	HON HAI PRECISION INDUSTRY	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	509,800	483.13	246,300,629	862.10	439,497,356	0.84
中国	株式	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	銀行	3,933,000	84.23	331,266,434	110.04	432,772,767	0.83
アメリカ	投資証券	ISHARES MSCI QATAR ETF	－	141,785	2,477.84	351,320,744	2,624.80	372,157,934	0.71
台湾	株式	MEDIATEK INC	半導体・半導体製造装置	62,000	4,435.41	274,995,367	5,687.14	352,602,432	0.68
アメリカ	投資証券	ISHARES MSCI KUWAIT ETF	－	70,532	4,331.91	305,537,978	4,655.85	328,386,595	0.63
インド	株式	BHARTI AIRTEL LTD	電気通信サービス	105,011	1,882.10	197,641,544	2,966.17	311,480,057	0.60
ケイマン諸島	株式	JD.COM INC-CLASS A	一般消費財・サービス流通・小売り	101,685	1,941.07	197,378,065	2,792.24	283,928,924	0.54
インド	株式	TATA CONSULTANCY SVCS LTD	ソフトウェア・サービス	37,071	6,146.78	227,867,179	7,367.88	273,134,568	0.52
南アフリカ	株式	NASPERS LTD-N SHS	一般消費財・サービス流通・小売り	7,250	28,552.94	207,008,817	35,193.38	255,152,020	0.49
ケイマン諸島	株式	XIAOMI CORP-CLASS B	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	631,600	284.97	179,989,404	403.22	254,674,699	0.49
中国	株式	IND & COMM BK OF CHINA-H	銀行	2,850,000	70.53	201,003,749	86.52	246,589,695	0.47
中国	株式	PING AN INSURANCE GROUP CO-H	保険	269,500	659.37	177,698,881	892.78	240,604,749	0.46
ケイマン諸島	株式	NU HOLDINGS LTD/CAYMAN ISL-	銀行	120,588	2,139.52	258,000,763	1,979.67	238,723,855	0.46

		A							
ブラジル	株式	VALE SA	素材	139,888	1,894.33	264,993,656	1,678.69	234,828,273	0.45
インドネシア	株式	BANK CENTRAL ASIA TBK PT	銀行	2,231,900	85.48	190,784,632	101.18	225,812,482	0.43
中国	株式	BANK OF CHINA LTD-H	銀行	3,266,000	53.55	174,881,884	68.52	223,786,646	0.43

ロ　種類別・業種別投資比率

2024年9月30日現在

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

Ｊリート・インデックス・マザーファンド

イ　主要投資銘柄（上位30銘柄）

2024年9月30日現在

国／地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価（円）	帳簿価額（円）	評価額単価	評価額（円）	投資比率

						(円)		(%)
日本	投資証券	日本ビルファンド投資法人	8,994	129,877.89	1,168,121,702	131,800.00	1,185,409,200	7.58
日本	投資証券	ジャパンリアルエステイト投資法人	1,584	572,262.28	906,463,445	571,000.00	904,464,000	5.78
日本	投資証券	日本都市ファンド投資法人	7,775	93,599.25	727,734,162	96,600.00	751,065,000	4.80
日本	投資証券	野村不動産マスターファンド投資法人	4,949	152,291.81	753,692,190	142,900.00	707,212,100	4.52
日本	投資証券	ＧＬＰ投資法人	5,181	134,302.04	695,818,851	132,700.00	687,518,700	4.39
日本	投資証券	日本プロロジスリート投資法人	2,687	263,174.88	707,150,904	246,200.00	661,539,400	4.23
日本	投資証券	ＫＤＸ不動産投資法人	4,315	158,733.48	684,934,953	151,200.00	652,428,000	4.17
日本	投資証券	大和ハウスリート投資法人	2,314	240,614.62	556,782,221	235,500.00	544,947,000	3.48
日本	投資証券	インヴィンシブル投資法人	8,503	64,016.70	544,333,973	62,100.00	528,036,300	3.37
日本	投資証券	アドバンス・レジデンス投資法人	1,516	334,528.78	507,145,633	336,500.00	510,134,000	3.26
日本	投資証券	ユナイテッド・アーバン投資法人	3,452	145,103.06	500,895,776	138,100.00	476,721,200	3.05
日本	投資証券	オリックス不動産投資法人	3,076	155,377.90	477,942,414	153,600.00	472,473,600	3.02
日本	投資証券	ジャパン・ホテル・リート投資法人	5,673	73,240.27	415,492,069	71,500.00	405,619,500	2.59
日本	投資証券	日本プライムリアルティ投資法人	1,056	331,812.10	350,393,575	348,500.00	368,016,000	2.35
日本	投資証券	積水ハウス・リート投資法人	4,641	83,231.98	386,279,617	76,000.00	352,716,000	2.25
日本	投資証券	日本アコモデーションファンド投資法人	533	663,746.88	353,777,086	638,000.00	340,054,000	2.17
日本	投資証券	産業ファンド投資法人	2,828	124,637.78	352,475,650	119,600.00	338,228,800	2.16
日本	投資証券	日本ロジスティクスファンド投資法人	1,037	263,583.10	273,335,670	274,100.00	284,241,700	1.82
日本	投資証券	ラサールロジポート投資法人	1,970	148,836.19	293,207,293	143,300.00	282,301,000	1.80
日本	投資証券	三井不動産ロジスティクスパー	643	448,725.63	288,530,577	424,500.00	272,953,500	1.74

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

ロ　種類別投資比率

2024年9月30日現在

種類	投資比率（%）
投資証券	98.48
合　計	98.48

外国リート・インデックス・マザーファンド

イ　主要投資銘柄（上位30銘柄）

2024年9月30日現在

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

アメリカ	投資証券	DIGITAL REALTY TRUST INC	57,209	21,720.65	1,242,616,745	23,002.37	1,315,942,402	3.12
オーストラリア	投資証券	GOODMAN GROUP	327,936	3,230.56	1,059,415,647	3,547.37	1,163,309,967	2.76
アメリカ	投資証券	EXTRA SPACE STORAGE INC	39,489	25,453.16	1,005,119,847	25,296.04	998,915,240	2.37
アメリカ	投資証券	IRON MOUNTAIN INC	55,158	16,207.69	893,983,986	16,660.87	918,980,427	2.18
アメリカ	投資証券	VICI PROPERTIES INC	193,356	4,697.24	908,239,392	4,727.22	914,035,886	2.17
アメリカ	投資証券	AVALONBAY COMMUNITIES INC	26,464	31,681.22	838,411,818	32,147.08	850,740,269	2.02
アメリカ	投資証券	VENTAS INC	76,983	8,530.86	656,731,411	9,111.88	701,460,104	1.66
アメリカ	投資証券	EQUITY RESIDENTIAL	62,983	10,509.21	661,901,567	10,557.74	664,958,018	1.58
アメリカ	投資証券	INVITATION HOMES INC	106,155	5,160.46	547,808,259	4,995.55	530,302,610	1.26
アメリカ	投資証券	ESSEX PROPERTY TRUST INC	11,964	42,320.94	506,327,709	42,048.26	503,065,358	1.19
アメリカ	投資証券	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	28,835	17,298.88	498,813,089	17,273.18	498,072,277	1.18
アメリカ	投資証券	MID-AMERICA APARTMENT COMM	21,778	22,389.54	487,599,431	22,518.51	490,408,156	1.16
アメリカ	投資証券	SUN COMMUNITIES INC	22,244	18,984.52	422,291,602	19,408.43	431,721,014	1.02
イギリス	投資証券	SEGRO PLC	252,797	1,687.48	426,589,368	1,681.83	425,161,101	1.01
アメリカ	投資証券	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	128,507	3,205.72	411,956,920	3,225.70	414,524,772	0.98
アメリカ	投資証券	KIMCO REALTY CORP	125,918	3,317.46	417,727,798	3,277.08	412,643,460	0.98
アメリカ	投資証券	GAMING AND LEISURE PROPERTIE	51,127	7,245.39	370,434,903	7,243.55	370,340,853	0.88
アメリカ	投資証券	WP CAREY INC	40,778	8,588.21	350,209,896	8,954.88	365,162,104	0.87
アメリカ	投資証券	CAMDEN PROPERTY TRUST	20,335	17,527.96	356,431,115	17,657.13	359,057,703	0.85
アメリカ	投資証券	UDR INC	55,893	6,180.21	345,430,421	6,421.42	358,912,578	0.85
オーストラリア	投資証券	SCENTRE GROUP	960,992	333.71	320,690,141	362.34	348,204,976	0.83
アメリカ	投資証券	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	34,434	10,042.48	345,802,852	10,099.57	347,768,758	0.82
香港	投資証券	LINK REIT	474,400	648.04	307,432,293	732.04	347,281,910	0.82
アメリカ	投資証	HOST HOTELS &	130,084	2,484.93	323,249,543	2,587.69	336,617,703	0.80

	券	RESORTS INC						

ロ　種類別投資比率

2024年9月30日現在

種類	投資比率（%）
投資証券	98.48
合　計	98.48

国内債券パッシブ・マザーファンド

イ　主要投資銘柄（上位30銘柄）

2024年9月30日現在

国／地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価（円）	帳簿価額（円）	評価額単価（円）	評価額（円）	利率（%）	償還期限	投資比率（%）
日本	国債証券	１５０　５年国債	2,590,000,000	99.03	2,564,877,000	99.19	2,568,891,500	0.005	2026/12/20	1.88
日本	国債証券	４６１　２年国債	2,000,000,000	100.16	2,003,216,000	100.08	2,001,640,000	0.400	2026/06/01	1.46
日本	国債証券	３７５　１０年国債	1,710,000,000	101.74	1,739,792,500	102.24	1,748,372,400	1.100	2034/06/20	1.28
日本	国債証券	１５４　５年国債	1,220,000,000	98.91	1,206,641,000	99.16	1,209,788,600	0.100	2027/09/20	0.88
日本	国債証券	３６９　１０年国債	1,220,000,000	96.98	1,183,156,000	98.56	1,202,432,000	0.500	2032/12/20	0.88
日本	国債証券	１４８　５年国債	1,180,000,000	99.27	1,171,421,400	99.40	1,172,943,600	0.005	2026/06/20	0.86
日本	国債証券	１５６　５年国債	1,180,000,000	99.10	1,169,380,000	99.38	1,172,684,000	0.200	2027/12/20	0.86
日本	国債証券	３７０　１０年国債	1,190,000,000	96.62	1,149,778,000	98.28	1,169,567,700	0.500	2033/03/20	0.85
日本	国債証券	３６２　１０年国債	1,180,000,000	96.05	1,133,374,100	97.19	1,146,842,000	0.100	2031/03/20	0.84
日本	国債証券	３６６　１０年国債	1,180,000,000	95.42	1,125,930,800	97.00	1,144,635,400	0.200	2032/03/20	0.84
日本	国債証券	３６８　１０年国債	1,180,000,000	95.12	1,122,404,200	96.44	1,138,039,200	0.200	2032/09/20	0.83
日本	国債証券	３６１　１０年国債	1,160,000,000	96.34	1,117,544,000	97.38	1,129,619,600	0.100	2030/12/20	0.83
日本	国債証券	３６３　１０年国債	1,160,000,000	95.76	1,110,819,200	96.99	1,125,084,000	0.100	2031/06/20	0.82
日本	国債証券	３６５　１０年国債	1,160,000,000	94.96	1,101,581,600	96.51	1,119,469,600	0.100	2031/12/20	0.82
日本	国債証券	３７１　１０年国債	1,150,000,000	95.52	1,098,480,000	97.18	1,117,512,500	0.400	2033/06/20	0.82
日本	国債証券	３６７　１０年国債	1,150,000,000	95.09	1,093,535,000	96.73	1,112,372,000	0.200	2032/06/20	0.81
日本	国債証券	３５９　１０年国債	1,130,000,000	96.82	1,094,066,000	97.72	1,104,258,600	0.100	2030/06/20	0.81

日本	国債証券	３６４　１０年国債	1,120,000,000	95.48	1,069,343,200	96.75	1,083,622,400	0.100	2031/09/20	0.79
日本	国債証券	１４９　５年国債	1,090,000,000	99.16	1,080,844,000	99.28	1,082,108,400	0.005	2026/09/20	0.79
日本	国債証券	３７２　１０年国債	1,050,000,000	98.61	1,035,356,500	100.34	1,053,517,500	0.800	2033/09/20	0.77
日本	国債証券	３５７　１０年国債	1,050,000,000	97.31	1,021,755,000	97.97	1,028,632,500	0.100	2029/12/20	0.75
日本	国債証券	３７３　１０年国債	1,020,000,000	96.50	984,300,000	98.28	1,002,476,400	0.600	2033/12/20	0.73
日本	国債証券	３７４　１０年国債	1,000,000,000	97.71	977,141,600	99.78	997,800,000	0.800	2034/03/20	0.73
日本	国債証券	３５８　１０年国債	930,000,000	97.06	902,675,400	97.85	909,958,500	0.100	2030/03/20	0.67
日本	国債証券	１４７　２０年国債	840,000,000	105.61	887,090,400	107.14	900,009,600	1.600	2033/12/20	0.66
日本	国債証券	１５８　５年国債	880,000,000	98.59	867,595,000	98.96	870,821,600	0.100	2028/03/20	0.64
日本	国債証券	１７０　２０年国債	975,000,000	84.28	821,733,700	85.54	834,005,250	0.300	2039/09/20	0.61
日本	国債証券	１７２　５年国債	830,000,000	100.02	830,166,000	100.02	830,190,900	0.500	2029/06/20	0.61
日本	国債証券	３６０　１０年国債	850,000,000	96.57	820,863,000	97.57	829,328,000	0.100	2030/09/20	0.61
日本	国債証券	３４４　１０年国債	811,000,000	99.38	805,971,800	99.46	806,636,820	0.100	2026/09/20	0.59

ロ　種類別投資比率

2024年9月30日現在

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

外国債券パッシブ・マザーファンド

イ　主要投資銘柄（上位30銘柄）

2024年9月30日現在

国／地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価（円）	帳簿価額（円）	評価額単価（円）	評価額（円）	利率（%）	償還期限	投資比率（%）
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	11,450,000	13,418.76	1,536,448,128	13,822.40	1,582,664,959	1.625	2026/05/15	0.87
中国	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	76,000,000	2,061.60	1,566,817,157	2,068.80	1,572,285,640	2.040	2027/02/25	0.86

中国	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	72,000,000	2,056.34	1,480,561,276	2,081.49	1,498,675,982	2.390	2026/11/15	0.82
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,200,000	13,643.42	1,118,760,273	13,979.12	1,146,287,752	2.250	2026/03/31	0.63
中国	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	50,000,000	2,059.39	1,029,695,660	2,089.22	1,044,611,674	2.690	2026/08/12	0.57
中国	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	38,700,000	2,333.75	903,160,408	2,611.29	1,010,570,795	3.720	2051/04/12	0.56
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,800,000	14,221.21	824,830,247	14,355.50	832,618,880	4.250	2025/12/31	0.46
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,500,000	14,348.60	789,173,153	14,998.78	824,933,012	4.375	2034/05/15	0.45
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,600,000	14,475.25	810,613,910	14,730.88	824,929,159	4.125	2032/11/15	0.45
中国	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	38,000,000	2,037.76	774,348,230	2,095.05	796,119,271	2.400	2028/07/15	0.44
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,500,000	14,107.00	775,884,807	14,466.40	795,651,953	4.125	2027/02/15	0.44
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,700,000	13,194.67	752,096,466	13,537.51	771,638,201	2.875	2032/05/15	0.42
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,900,000	12,529.84	739,260,472	13,047.52	769,803,692	0.750	2028/01/31	0.42
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,500,000	13,664.11	751,526,260	13,925.60	765,907,734	3.375	2033/05/15	0.42
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,300,000	14,127.99	748,783,274	14,298.55	757,823,079	3.875	2026/01/15	0.42
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,100,000	13,936.82	710,777,844	14,566.17	742,874,538	4.000	2034/02/15	0.41
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,300,000	13,593.61	720,461,075	13,932.30	738,412,084	2.750	2028/02/15	0.41
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,600,000	12,497.72	699,872,558	13,025.68	729,438,221	0.625	2027/12/31	0.40
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,800,000	14,910.05	715,682,380	15,122.67	725,888,241	4.500	2033/11/15	0.40
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,000,000	14,276.85	713,842,685	14,503.79	725,189,720	4.000	2028/02/29	0.40
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,000,000	14,216.99	710,849,637	14,439.14	721,956,886	3.875	2033/08/15	0.40
中国	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	35,000,000	2,052.39	718,336,605	2,062.23	721,781,704	1.990	2026/03/15	0.40
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,900,000	14,244.50	697,980,275	14,418.16	706,489,664	4.000	2027/01/15	0.39
中国	国債証券	CHINA GOVERNMENT	32,400,000	2,103.76	681,618,594	2,176.27	705,110,119	3.020	2031/05/27	0.39

		BOND								
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,700,000	11,863.00	676,191,225	12,317.03	702,070,600	1.125	2031/02/15	0.39
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,800,000	14,402.90	691,339,017	14,585.15	700,087,224	4.625	2026/11/15	0.38
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,500,000	12,199.42	670,968,020	12,624.90	694,369,317	1.625	2031/05/15	0.38
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,000,000	13,203.81	660,190,478	13,599.74	679,987,129	2.375	2029/03/31	0.37
中国	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	32,000,000	2,045.49	654,555,977	2,117.71	677,665,881	2.600	2030/09/15	0.37
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,300,000	12,237.96	648,611,649	12,647.73	670,329,874	1.875	2032/02/15	0.37

ロ　種類別投資比率

2024年9月30日現在

種類	投資比率（%）
国債証券	98.26
合　計	98.26

ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド

イ　主要投資銘柄（上位30銘柄）

2024年9月30日現在

国／地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価（円）	帳簿価額（円）	評価額単価（円）	評価額（円）	利率（%）	償還期限	投資比率（%）
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2,010,000	13,495.41	271,257,679	13,615.30	273,667,533	0.750	2026/05/31	0.73
中国	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	10,500,000	2,132.08	223,868,405	2,130.73	223,726,708	2.670	2033/05/25	0.60
中国	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	10,800,000	2,058.90	222,361,550	2,062.23	222,721,211	1.990	2026/03/15	0.60
中国	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	10,400,000	2,059.98	214,238,365	2,068.80	215,154,877	2.040	2027/02/25	0.58
中国	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	10,200,000	2,095.74	213,765,663	2,103.37	214,544,005	2.480	2028/09/25	0.57
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,300,000	15,548.58	202,131,514	15,548.58	202,131,514	4.625	2054/05/15	0.54
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,300,000	14,490.38	188,374,911	14,566.17	189,360,176	4.000	2034/02/15	0.51
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,290,000	14,606.27	188,420,941	14,607.42	188,435,671	4.250	2054/02/15	0.50
アメリ	国債	US TREASURY	1,200,000	15,044.31	180,531,755	15,126.24	181,514,879	4.625	2031/04/30	0.49

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

ロ　種類別投資比率

2024年9月30日現在

種類	投資比率（%）
国債証券	97.48
合　計	97.48

②投資不動産物件

国内株式インデックス・マザーファンド（Ｂ号）

該当事項はありません。

外国株式インデックス・マザーファンド

該当事項はありません。

エマージング株式インデックス・マザーファンド

該当事項はありません。

Ｊリート・インデックス・マザーファンド

該当事項はありません。

外国リート・インデックス・マザーファンド

該当事項はありません。

国内債券パッシブ・マザーファンド

該当事項はありません。

外国債券パッシブ・マザーファンド

該当事項はありません。

ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド

該当事項はありません。

③その他投資資産の主要なもの

国内株式インデックス・マザーファンド（Ｂ号）

2024年9月30日現在

種類	国／地域	取引所等	名称	買建／売建	数量	通貨	簿価（円）	時価（円）	投資比率（%）
株価指数先物取引	日本	大阪取引所	ＴＯＰＩＸ先物　０６１２月　２０２４年１２月	買建	255	日本・円	6,732,100,500	6,751,125,000	2.01

（注）主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。

外国株式インデックス・マザーファンド

2024年9月30日現在

種類	国／地域	取引所等	名称	買建／売建	数量	通貨	帳簿価額	簿価（円）	評価額	時価（円）	投資比率（%）
株価指数先物取引	イギリス	ＩＣＥ－ＥＵ	ＦＴＳＥ１００ＩＤＸＦＵＴＤＥＣ２４ 2024年12月	買建	43	イギリス・ポンド	3,600,816.00	687,863,880	3,601,680.00	688,028,930	0.08
	ドイツ	ＥＵＲＥＸ	ＥＵＲＯＳＴＯＸＸ５０ＤＥＣ２４ 2024年12月	買建	293	ユーロ	14,459,053.50	2,305,206,899	14,934,210.00	2,380,961,100	0.29
	アメリカ	シカゴ商品取引所	Ｓ＆Ｐ５００ＥＭＩＮＩ ＦＵＴ ＤＥＣ２４ 2024年12月	買建	331	アメリカ・ドル	94,704,630.50	13,517,191,911	95,845,187.50	13,679,983,611	1.67
	オーストラリア	シドニー先物取引所	ＳＰＩ２００ＦＵＴＵＲＥＳＤＥＣ２４ 2024年12月	買建	22	オーストラリア・ドル	4,503,449.00	444,625,519	4,540,250.00	448,258,882	0.05

（注）主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。

2024年9月30日現在

種類	資産の名称	買建／売建	数量	簿価（円）	時価（円）	投資比率（%）
為替予約取引	アメリカ・ドル	買建	20,911,000.00	3,006,897,373	2,983,527,703	0.36
	ユーロ	買建	1,937,000.00	311,431,080	308,734,023	0.04
	イギリス・ポンド	買建	1,037,000.00	200,095,781	198,027,353	0.02
	カナダ・ドル	買建	1,424,000.00	151,694,719	150,286,605	0.02
	スイス・フラン	買建	705,000.00	120,212,604	119,636,465	0.01
	スウェーデン・クローナ	買建	3,357,000.00	47,511,621	47,521,692	0.01
	デンマーク・クローネ	買建	2,049,000.00	43,787,949	43,795,326	0.01
	オーストラリア・ドル	買建	400,000.00	39,482,320	39,487,080	0.00

（注）日本における対顧客先物相場の仲値で評価しております。

エマージング株式インデックス・マザーファンド

2024年9月30日現在

種類	国／	取引	名称	買建／	数量	通貨	帳簿価額	簿価	評価額	時価	投資

	地域	所等		売建				(円)		(円)	比率(%)
株価指数先物取引	アメリカ	ＩＣＥ－ＵＳ	ＭＳＣＩ ＥＭＧＭＫＴ ＤＥＣ２４ 2024年12月	買建	465	アメリカ・ドル	25,779,515.00	3,679,510,175	27,732,600.00	3,958,273,998	7.59

（注）主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。

2024年9月30日現在

種類	資産の名称	買建／売建	数量	簿価(円)	時価(円)	投資比率(%)
為替予約取引	アメリカ・ドル	買建	872,822.41	124,500,000	124,524,700	0.24

（注）日本における対顧客先物相場の仲値で評価しております。

Ｊリート・インデックス・マザーファンド

2024年9月30日現在

種類	国／地域	取引所等	名称	買建／売建	数量	通貨	簿価(円)	時価(円)	投資比率(%)
リート指数先物取引	日本	大阪取引所	ＴＲＥＩＴ先物 ０６１２月 ２０２４年１２月	買建	20	日本・円	35,002,400	34,350,000	0.22

（注）主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。

外国リート・インデックス・マザーファンド

2024年9月30日現在

種類	資産の名称	買建／売建	数量	簿価(円)	時価(円)	投資比率(%)
為替予約取引	アメリカ・ドル	買建	763,533.04	110,200,000	108,948,720	0.26
	オーストラリア・ドル	買建	71,806.48	7,200,000	7,087,680	0.02
	イギリス・ポンド	買建	33,339.13	6,500,000	6,366,950	0.02
	ユーロ	買建	34,470.66	5,600,000	5,494,509	0.01

（注）日本における対顧客先物相場の仲値で評価しております。

国内債券パッシブ・マザーファンド

該当事項はありません。

外国債券パッシブ・マザーファンド

該当事項はありません。

ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド

2024年9月30日現在

種類	資産の名称	買建／	数量	簿価	時価	投資

		売建		(円)	(円)	比率 (%)
為替予約取引	アメリカ・ドル	買建	230,000.00	33,402,971	32,813,870	0.09
	ユーロ	買建	140,000.00	22,491,831	22,313,200	0.06
	オーストラリア・ドル	買建	20,000.00	1,964,476	1,973,860	0.01
	メキシコ・ペソ	買建	270,000.00	1,978,322	1,954,341	0.01
	カナダ・ドル	買建	10,000.00	1,076,790	1,055,330	0.00
	デンマーク・クローネ	買建	10,000.00	215,469	213,740	0.00
	アメリカ・ドル	売建	118,110,000.00	17,116,557,245	16,850,635,590	△45.09
	ユーロ	売建	69,470,000.00	11,158,055,251	11,072,128,600	△29.63
	オフショア・人民元	売建	197,220,000.00	4,042,344,219	4,029,717,372	△10.78
	イギリス・ポンド	売建	10,570,000.00	2,013,352,923	2,018,320,360	△5.40
	カナダ・ドル	売建	6,880,000.00	740,241,648	726,067,040	△1.94
	オーストラリア・ドル	売建	5,000,000.00	491,624,572	493,465,000	△1.32
	シンガポール・ドル	売建	3,040,000.00	338,519,497	338,771,520	△0.91
	メキシコ・ペソ	売建	36,490,000.00	267,650,821	264,125,567	△0.71
	ポーランド・ズロチ	売建	5,130,000.00	192,422,075	191,114,559	△0.51
	イスラエル・シュケル	売建	2,910,000.00	116,330,735	111,339,219	△0.30
	ニュージーランド・ドル	売建	1,130,000.00	102,374,761	102,503,430	△0.27
	デンマーク・クローネ	売建	4,680,000.00	100,735,779	100,030,320	△0.27
	ノルウェー・クローネ	売建	4,230,000.00	57,914,153	57,506,850	△0.15
	スウェーデン・クローナ	売建	3,900,000.00	55,289,960	55,208,400	△0.15

(注) 日本における対顧客先物相場の仲値で評価しております。

≪参考情報≫

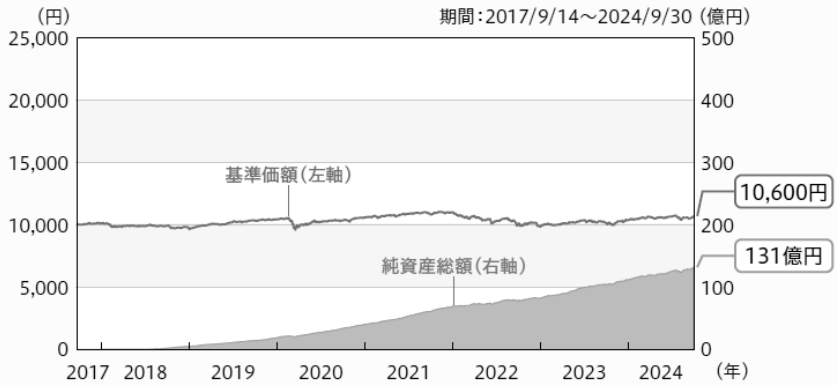
基準日:2024年9月30日

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

基準価額・純資産の推移

分配の推移

□1安定重視型

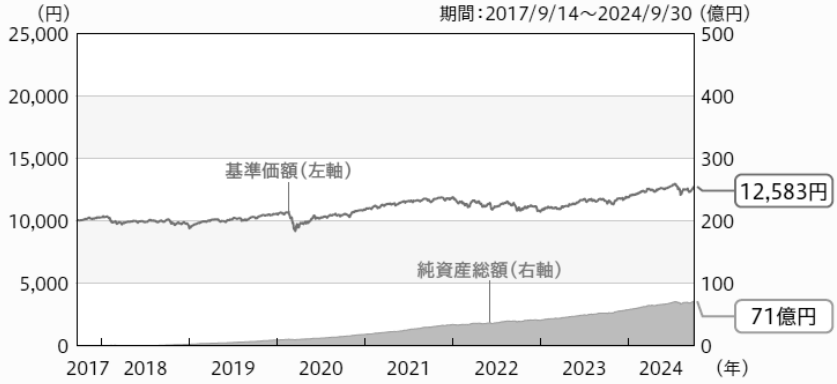


※基準価額は、1万口当たり、信託報酬控除後です。

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

※分配金は1万口当たり、税引前です。
※直近5計算期間を記載しています。

□2やや安定型

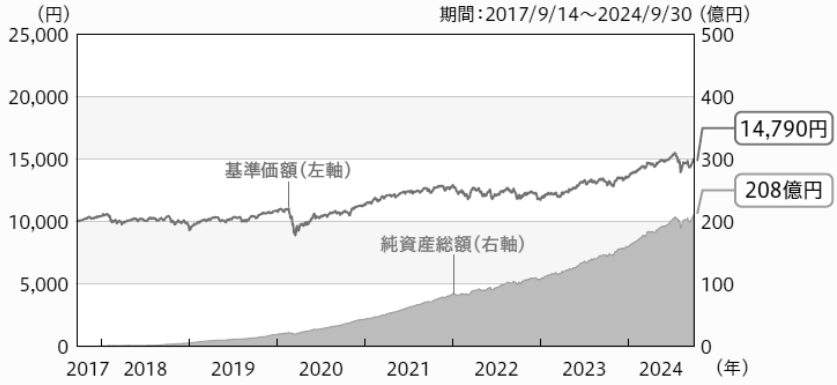


※基準価額は、1万口当たり、信託報酬控除後です。

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

※分配金は1万口当たり、税引前です。
※直近5計算期間を記載しています。

□3バランス型

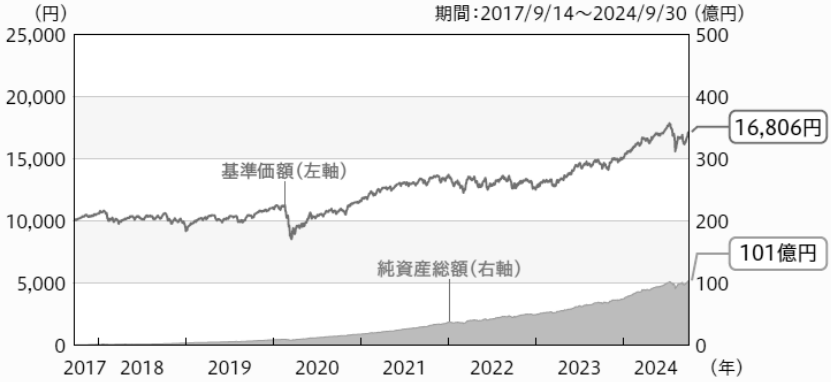


※基準価額は、1万口当たり、信託報酬控除後です。

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

※分配金は1万口当たり、税引前です。
※直近5計算期間を記載しています。

□4やや成長型

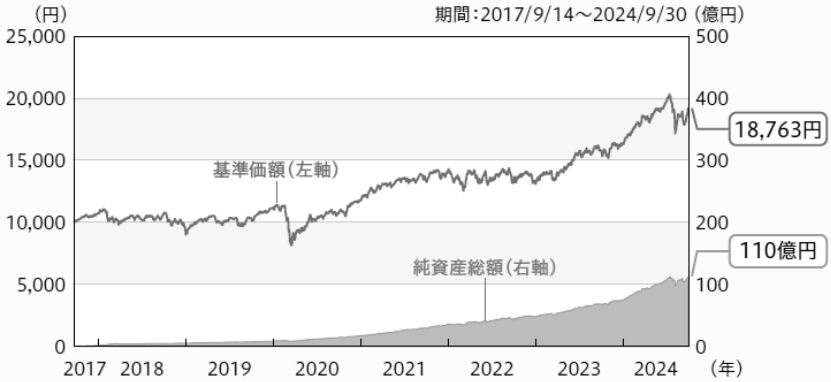


※基準価額は、1万口当たり、信託報酬控除後です。

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

※分配金は1万口当たり、税引前です。
※直近5計算期間を記載しています。

□5成長重視型



※基準価額は、1万口当たり、信託報酬控除後です。

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

※分配金は1万口当たり、税引前です。
※直近5計算期間を記載しています。

主要な資産の状況

■1安定重視型

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	98.27
投資証券	アメリカ	0.89
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		0.84
合計(純資産総額)		100.00

主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	比率(%)
日本	親投資信託受益証券	国内債券パッシブ・マザーファンド	35.33
日本	親投資信託受益証券	ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド	32.45
日本	親投資信託受益証券	外国株式インデックス・マザーファンド	11.15
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)	8.18
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	6.95
日本	親投資信託受益証券	エマージング株式インデックス・マザーファンド	2.15
日本	親投資信託受益証券	外国リート・インデックス・マザーファンド	1.07
日本	親投資信託受益証券	Jリート・インデックス・マザーファンド	0.98
アメリカ	投資証券	iシェアーズ　J.P.モルガン・米ドル建て エマージング・マーケット債券ETF	0.89

■2やや安定型

資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
親投資信託受益証券	日本	97.30
投資証券	アメリカ	1.86
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		0.84
合計(純資産総額)		100.00

主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	比率(%)
日本	親投資信託受益証券	ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド	27.60
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	19.65
日本	親投資信託受益証券	外国株式インデックス・マザーファンド	19.06
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)	15.17
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	8.81
日本	親投資信託受益証券	エマージング株式インデックス・マザーファンド	3.11
日本	親投資信託受益証券	外国リート・インデックス・マザーファンド	1.98
日本	親投資信託受益証券	Jリート・インデックス・マザーファンド	1.92
アメリカ	投資証券	iシェアーズ　J.P.モルガン・米ドル建て エマージング・マーケット債券ETF	1.86

■3バランス型

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	96.40
投資証券	アメリカ	2.84
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		0.76
合計(純資産総額)		100.00

主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	比率(%)
日本	親投資信託受益証券	外国株式インデックス・マザーファンド	25.91
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)	21.03
日本	親投資信託受益証券	ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド	15.75
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	13.84
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	8.79
日本	親投資信託受益証券	エマージング株式インデックス・マザーファンド	5.20
日本	親投資信託受益証券	Jリート・インデックス・マザーファンド	2.97
日本	親投資信託受益証券	外国リート・インデックス・マザーファンド	2.91
アメリカ	投資証券	iシェアーズ　J.P.モルガン・米ドル建て エマージング・マーケット債券ETF	2.84

※比率は、ファンドのそれぞれの純資産総額に対する時価の比率です。
※「主要投資銘柄(上位10銘柄)」は組入有価証券が10銘柄に満たない場合はすべてを記載しています。

■4やや成長型

資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
親投資信託受益証券	日本	95.54
投資証券	アメリカ	3.61
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		0.85
合計(純資産総額)		100.00

主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	比率(%)
日本	親投資信託受益証券	外国株式インデックス・マザーファンド	32.88
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)	25.83
日本	親投資信託受益証券	ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド	8.88
日本	親投資信託受益証券	エマージング株式インデックス・マザーファンド	7.38
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	6.85
日本	親投資信託受益証券	外国債券パッシブ・マザーファンド	5.87
日本	親投資信託受益証券	外国リート・インデックス・マザーファンド	3.97
日本	親投資信託受益証券	Jリート・インデックス・マザーファンド	3.88
アメリカ	投資証券	iシェアーズ　J.P.モルガン・米ドル建て エマージング・マーケット債券ETF	3.61

■5成長重視型

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	94.64
投資証券	アメリカ	4.57
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		0.79
合計(純資産総額)		100.00

主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	比率(%)
日本	親投資信託受益証券	外国株式インデックス・マザーファンド	43.43
日本	親投資信託受益証券	国内株式インデックス・マザーファンド(B号)	29.68
日本	親投資信託受益証券	エマージング株式インデックス・マザーファンド	10.47
アメリカ	投資証券	iシェアーズ　J.P.モルガン・米ドル建て エマージング・マーケット債券ETF	4.57
日本	親投資信託受益証券	外国リート・インデックス・マザーファンド	3.08
日本	親投資信託受益証券	Jリート・インデックス・マザーファンド	2.98
日本	親投資信託受益証券	外国債券パッシブ・マザーファンド	2.93
日本	親投資信託受益証券	ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド	1.09
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	0.98

※比率は、ファンドのそれぞれの純資産総額に対する時価の比率です。
※「主要投資銘柄(上位10銘柄)」は組入有価証券が10銘柄に満たない場合はすべてを記載しています。

■国内債券パッシブ・マザーファンド

主要投資銘柄（上位10銘柄）

国・地域	種類	銘柄名	利率（%）	償還期限	比率（%）
日本	国債証券	150　5年国債	0.005	2026/12/20	1.88
日本	国債証券	461　2年国債	0.400	2026/06/01	1.46
日本	国債証券	375　10年国債	1.100	2034/06/20	1.28
日本	国債証券	154　5年国債	0.100	2027/09/20	0.88
日本	国債証券	369　10年国債	0.500	2032/12/20	0.88
日本	国債証券	148　5年国債	0.005	2026/06/20	0.86
日本	国債証券	156　5年国債	0.200	2027/12/20	0.86
日本	国債証券	370　10年国債	0.500	2033/03/20	0.85
日本	国債証券	362　10年国債	0.100	2031/03/20	0.84
日本	国債証券	366　10年国債	0.200	2032/03/20	0.84

■外国債券パッシブ・マザーファンド

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	0.87
中国	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	2.040	2027/02/25	0.86
中国	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	2.390	2026/11/15	0.82
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.250	2026/03/31	0.63
中国	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	2.690	2026/08/12	0.57
中国	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	3.720	2051/04/12	0.56
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4.250	2025/12/31	0.46
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4.375	2034/05/15	0.45
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4.125	2032/11/15	0.45
中国	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	2.400	2028/07/15	0.44

■ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド

主要投資銘柄（上位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	0.750	2026/05/31	0.73
中国	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	2.670	2033/05/25	0.60
中国	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	1.990	2026/03/15	0.60
中国	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	2.040	2027/02/25	0.58
中国	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	2.480	2028/09/25	0.57
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4.625	2054/05/15	0.54
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4.000	2034/02/15	0.51
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4.250	2054/02/15	0.50
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4.625	2031/04/30	0.49
中国	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	1.620	2027/08/15	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。

■国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

主要投資銘柄（上位10銘柄）

国・地域	種類	銘柄名	業種	比率（%）
日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	3.56
日本	株式	ソニーグループ	電気機器	2.56
日本	株式	日立製作所	電気機器	2.42
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	2.30
日本	株式	キーエンス	電気機器	1.80
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	1.70
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	1.65
日本	株式	三菱商事	卸売業	1.58
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	1.44
日本	株式	信越化学工業	化学	1.42

■外国株式インデックス・マザーファンド

主要投資銘柄（上位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	4.94
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	4.50
アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導体・半導体製造装置	4.45
アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	一般消費財・サービス流通・小売り	2.63
アメリカ	株式	META PLATFORMS INC-CLASS A	メディア・娯楽	1.85
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	1.43
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	1.25
アメリカ	株式	BROADCOM INC	半導体・半導体製造装置	1.14
アメリカ	株式	TESLA INC	自動車・自動車部品	1.12
アメリカ	株式	ELI LILLY & CO	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	1.06

■エマージング株式インデックス・マザーファンド

主要投資銘柄（上位10銘柄）

国・地域	種類	銘柄名	業種	比率（%）
台湾	株式	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	半導体・半導体製造装置	8.67
ケイマン諸島	株式	TENCENT HOLDINGS LTD	メディア・娯楽	4.11
香港	投資信託受益証券	CHINAAMC ETF SERIES - CH-CNY	—	3.69
アメリカ	投資証券	ISHARES MSCI SAUDI ARABIA ETF	—	3.55
韓国	株式	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	2.62
ケイマン諸島	株式	ALIBABA GROUP HOLDING LTD	一般消費財・サービス流通・小売り	2.24
インド	株式	RELIANCE INDUSTRIES LTD	エネルギー	1.24
ケイマン諸島	株式	MEITUAN-CLASS B	消費者サービス	1.17
アメリカ	投資証券	ISHARES MSCI UAE ETF	—	1.08
ケイマン諸島	株式	PDD HOLDINGS INC	一般消費財・サービス流通・小売り	1.05

※比率は、マザーファンドのそれぞれの純資産総額に対する時価の比率です。

■Jリート・インデックス・マザーファンド

主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	比率(%)
日本	投資証券	日本ビルファンド投資法人	7.58
日本	投資証券	ジャパンリアルエステイト投資法人	5.78
日本	投資証券	日本都市ファンド投資法人	4.80
日本	投資証券	野村不動産マスターファンド投資法人	4.52
日本	投資証券	GLP投資法人	4.39
日本	投資証券	日本プロロジスリート投資法人	4.23
日本	投資証券	KDX不動産投資法人	4.17
日本	投資証券	大和ハウスリート投資法人	3.48
日本	投資証券	インヴィンシブル投資法人	3.37
日本	投資証券	アドバンス・レジデンス投資法人	3.26

■外国リート・インデックス・マザーファンド

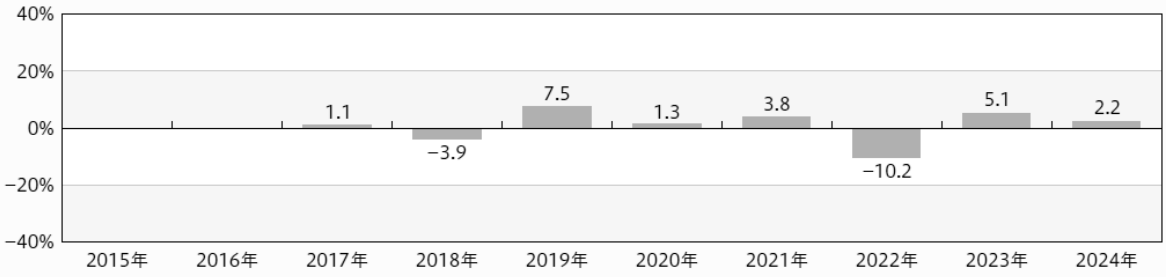
主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	比率(%)
アメリカ	投資証券	PROLOGIS INC	7.35
アメリカ	投資証券	EQUINIX INC	5.28
アメリカ	投資証券	WELLTOWER INC	4.66
アメリカ	投資証券	PUBLIC STORAGE	3.54
アメリカ	投資証券	REALTY INCOME CORP	3.46
アメリカ	投資証券	SIMON PROPERTY GROUP INC	3.26
アメリカ	投資証券	DIGITAL REALTY TRUST INC	3.12
オーストラリア	投資証券	GOODMAN GROUP	2.76
アメリカ	投資証券	EXTRA SPACE STORAGE INC	2.37
アメリカ	投資証券	IRON MOUNTAIN INC	2.18

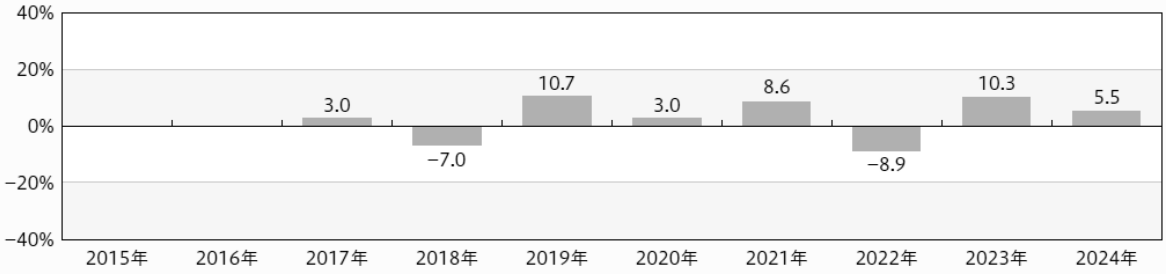
※比率は、マザーファンドのそれぞれの純資産総額に対する時価の比率です。

年間収益率の推移（暦年ベース）

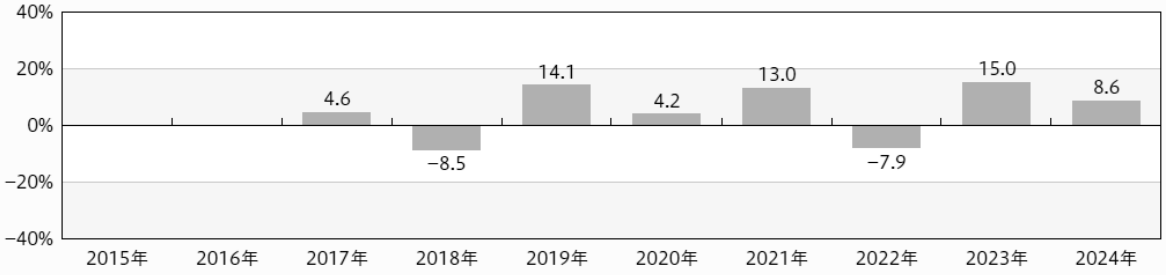
□1安定重視型



□2やや安定型

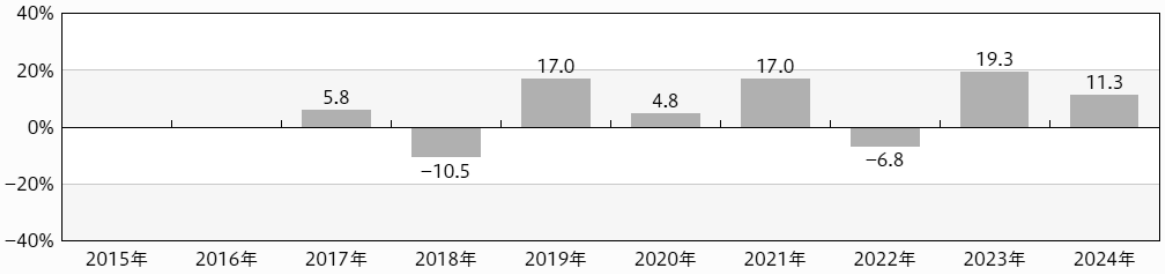


□3バランス型

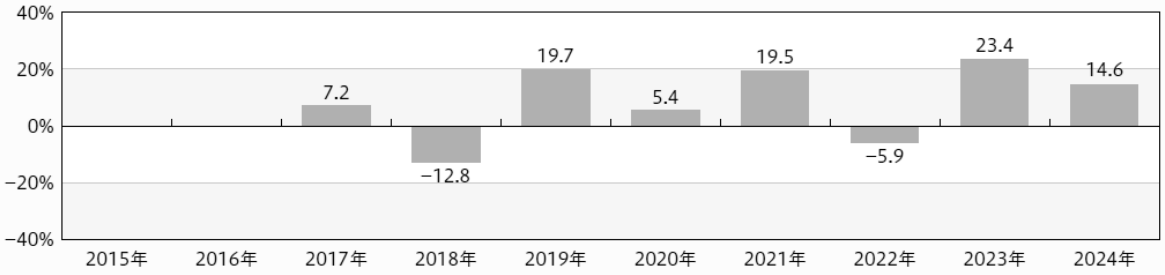


※収益率は、分配金（税引前）を分配時に再投資したものと仮定して計算しています。分配実績がない場合は、基準価額の騰落率です。
※ファンドが設定された年の収益率は、設定日から年末までの騰落率です。
※2024年の収益率は、年初から基準日までの騰落率です。
※ファンドにはベンチマークはありません。

■4やや成長型



■5成長重視型



※収益率は、分配金（税引前）を分配時に再投資したものと仮定して計算しています。分配実績がない場合は、基準価額の騰落率です。
※ファンドが設定された年の収益率は、設定日から年末までの騰落率です。
※2024年の収益率は、年初から基準日までの騰落率です。
※ファンドにはベンチマークはありません。

第２【管理及び運営】

１【申込（販売）手続等】

イ　申込方法

（イ）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。
販売会社によっては、「スイッチング」（ある投資信託の換金による手取額をもって、他の投資信託を買い付けること）による当ファンドの取得申込みを取り扱う場合があります。
お申込みの販売会社にお問い合わせください。

（ロ）原則として午後３時 30 分までに、取得申込みが行われ販売会社所定の事務手続きが完了したものを当日の申込受付分とします。なお、販売会社によっては対応が異なる場合がありますので、お申込みの販売会社にご確認ください。
また、取引所等における取引の停止、決済機能の停止、その他やむを得ない事情があるときは、取得申込みの受付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）申込不可日
上記にかかわらず、取得申込日が以下のいずれかに当たる場合には、ファンドの取得申込みはできません（また、該当日には、解約請求のお申込みもできません。）。
・ニューヨークの取引所の休業日
・ニューヨークの銀行の休業日

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

ロ　申込価額
取得申込受付日の翌営業日の基準価額となります。
ただし、累積投資契約に基づく収益分配金の再投資の場合は、各計算期末の基準価額となります。

ハ　申込手数料
ありません。

ニ　申込単位
お申込単位の詳細は、取扱いの販売会社にお問い合わせください。

ホ　照会先
手続き等のご不明な点についての委託会社に対する照会は下記においてできます。

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

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

ヘ　申込取扱場所・払込取扱場所

販売会社において申込み・払込みを取り扱います。

ト　払込期日

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

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

2【換金（解約）手続等】

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

お買付けの販売会社にお申し出ください。

ただし、以下のいずれかに当たる場合には、解約請求の受付けは行いません。

・ニューヨークの取引所の休業日

・ニューヨークの銀行の休業日

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

また、信託財産の資金管理を円滑に行うため、大口の換金申込みに制限を設ける場合があります。

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

一部解約金は、解約請求受付日から起算して６営業日目からお支払いします。

一部解約価額は、解約請求受付日の翌営業日の基準価額となります。

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

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

3【資産管理等の概要】

（1）【資産の評価】

イ　基準価額の算出方法

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

投資対象とする投資信託証券は、原則として、基準価額計算日に知りうる直近の純資産価格（基準価額）で評価します。また、上場されている場合は、その主たる取引所における最終相場で評価します。

投資対象とする親投資信託受益証券は、当該親投資信託受益証券の基準価額で評価します。

なお、外貨建資産の円換算については、原則として日本における計算日の対顧客電信売買相場の仲値に

よって計算するものとします。また、予約為替の評価は、原則として日本における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によるものとします。

<マザーファンドの主要投資対象の評価方法>

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

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

ロ 基準価額の算出頻度・照会方法

基準価額は、委託会社の営業日において日々算出されます。

基準価額は、販売会社または委託会社にお問い合わせいただけるほか、原則として翌日付の日本経済新聞朝刊の証券欄「オープン基準価格」の紙面に、「１安定重視型」は「最適安定重視」、「２やや安定型」は「最適やや安定」、「３バランス型」は「最適バランス」、「４やや成長型」は「最適やや成長」、「５成長重視型」は「最適成長重視」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】

2017 年 9 月 14 日から下記「（5）その他 イ　信託の終了」に記載された各事由が生じた場合における信託終了の日までとなります。

（4）【計算期間】

毎年 9 月 16 日から翌年 9 月 15 日までとすることを原則としますが、各計算期間終了日に該当する日（以下「該当日」といいます。）が休業日のとき、各計算期間終了日は、該当日の翌営業日とし、その翌日より次の計算期間が開始するものとします。なお、最終計算期間の終了日は、信託期間の終了日とします。

（5）【その他】

イ　信託の終了

（イ）信託契約の解約

ａ．委託会社は、当ファンドの信託契約を解約することが受益者にとって有利であると認めるとき、各ファンドにつき残存口数が 10 億口を下回ることとなったとき、その他やむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意の上、当ファンドの信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。

ｂ．委託会社は、上記ａの事項について、書面による決議（以下「書面決議」といいます。）を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに信託契約の解約の理由などの事項を定め、当該決議の日の２週間前までに、当ファンドの知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発します。

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、受託会社がその任務に違反して信託財産に著しい損害を与えたこと、その他重要な事由があるときは、委託会社または受益者は、裁判所に受託会社の解任を申し立てることができます。

ｂ．上記により受託会社が辞任し、または解任された場合は、委託会社は新受託会社を選任します。

ｃ．委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社は当ファンドの信託契約を解約し、信託を終了させます。

ロ　収益分配金、償還金の支払い

（イ）収益分配金

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

ハ　信託約款の変更等

（イ）委託会社は、当ファンドの信託約款を変更することが受益者の利益のため必要と認めるとき、監督官庁より変更の命令を受けたとき、その他やむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意の上、当ファンドの信託約款を変更すること、または当ファンドと他のファンドとの併合（投資信託及び投資法人に関する法律第16条第２号に規定する「委託者指図型投資信託の併合」をいいます。）を行うことができるものとし、あらかじめ、変更または併合しようとする旨および内容を監督官庁に届け出ます。

（ロ）委託会社は、上記（イ）の事項（変更についてはその内容が重大なものに該当する場合に限り、併合にあっては、その併合が受益者の利益に及ぼす影響が軽微なものに該当する場合を除きます。以下、合わせて「重大な信託約款の変更等」といいます。）について、書面決議を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに重大な信託約款の変更等の内容およびその理由などの事項を定め、当該決議の日の２週間前までに、当ファンドの知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発します。

（ハ）上記（ロ）の書面決議において、受益者（委託会社等を除きます。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行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。

（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にあっても、相手方となる他のファンドにおいて当該併合の書面決議が否決された場合は、併合を行うことはできません。

ニ　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。

ヘ　委託会社の事業の譲渡および承継に伴う取扱い

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

ト　公告

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

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

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

チ　運用にかかる報告書の開示方法

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

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

4【受益者の権利等】

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

受益者の有する主な権利は次の通りです。

イ　分配金請求権

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

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

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

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

ロ　償還金請求権

受益者は、持分に応じて償還金を請求する権利を有します。

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

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

ハ　一部解約実行請求権

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

ニ　書面決議における議決権

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

ホ　帳簿閲覧・謄写請求権

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

第３【ファンドの経理状況】

１．当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和 38 年大蔵省令第 59 号）ならびに同規則第 2 条の 2 の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成 12 年総理府令第 133 号）に基づいて作成しております。
なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

２．当ファンドは、金融商品取引法第 193 条の 2 第 1 項の規定に基づき、第 7 期（2023 年 9 月 16 日から 2024 年 9 月 17 日まで）の財務諸表について、PwC Japan 有限責任監査法人により監査を受けております。

独 立 監 査 人 の 監 査 報 告 書

2024年12月4日

三井住友DSアセットマネジメント株式会社

取 締 役 会 御 中

PwC Japan有限責任監査法人

東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員　　公認会計士　和田 渉

指定有限責任社員
業務執行社員　　公認会計士　榊原 康太

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている三井住友・資産最適化ファンド（1安定重視型）の2023年9月16日から2024年9月17日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三井住友・資産最適化ファンド（1安定重視型）の2024年9月17日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

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

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

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

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

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

財務諸表に対する経営者の責任

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

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

以　上

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

1【財務諸表】

【三井住友・資産最適化ファンド（1安定重視型)】

（1）【貸借対照表】

（単位：円）

	第6期 (2023年 9月15日現在)	第7期 (2024年 9月17日現在)
資産の部		
流動資産		
預金	9,556,244	18,185,201
金銭信託	5,785,640	1,653,096
コール・ローン	156,721,369	164,357,040
投資証券	205,066,890	114,537,710
親投資信託受益証券	10,126,803,515	12,624,151,989
未収入金	3,000,000	28,000,000
流動資産合計	10,506,933,658	12,950,885,036
資産合計	10,506,933,658	12,950,885,036
負債の部		
流動負債		
未払解約金	23,448,742	39,958,473
未払受託者報酬	1,604,721	2,063,353
未払委託者報酬	45,468,244	58,463,193
その他未払費用	321,229	412,622
流動負債合計	70,842,936	100,897,641
負債合計	70,842,936	100,897,641
純資産の部		
元本等		
元本	10,154,942,383	12,207,789,370
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	281,148,339	642,198,025
（分配準備積立金）	348,905,441	429,921,745
元本等合計	10,436,090,722	12,849,987,395
純資産合計	10,436,090,722	12,849,987,395
負債純資産合計	10,506,933,658	12,950,885,036

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第６期 自　2022年９月16日 至　2023年９月15日	第７期 自　2023年９月16日 至　2024年９月17日
営業収益		
受取配当金	8,192,557	9,384,260
受取利息	70,246	314,223
有価証券売買等損益	107,014,194	380,619,008
為替差損益	7,842,082	△4,333,627
営業収益合計	123,119,079	385,983,864
営業費用		
支払利息	67,245	16,602
受託者報酬	2,951,927	3,872,969
委託者報酬	83,640,671	109,736,840
その他費用	613,152	809,797
営業費用合計	87,272,995	114,436,208
営業利益又は営業損失（△）	35,846,084	271,547,656
経常利益又は経常損失（△）	35,846,084	271,547,656
当期純利益又は当期純損失（△）	35,846,084	271,547,656
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（△）	△11,182,891	29,170,558
期首剰余金又は期首欠損金（△）	214,163,854	281,148,339
剰余金増加額又は欠損金減少額	47,770,916	167,898,725
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	47,770,916	167,898,725
剰余金減少額又は欠損金増加額	27,815,406	49,226,137
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	27,815,406	49,226,137
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（△）	281,148,339	642,198,025

（３）【注記表】

（重要な会計方針の注記）

項　目	第７期 自 2023年９月16日 至 2024年９月17日
１．　有価証券の評価基準及び評価方法	投資証券、親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。 (1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。 (2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。 (3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。
２．　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	(1) 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。 (2) 計算期間の取扱い 当計算期間は当期末が休日のため、2023年９月16日から2024年９月17日までとなっております。

（重要な会計上の見積りに関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

項　目	第６期 （2023年９月15日現在）	第７期 （2024年９月17日現在）
１．　当計算期間の末日における受益権の総数	10,154,942,383口	12,207,789,370口
２．　１単位当たり純資産の額	１口当たり純資産額　1.0277円 （１万口当たりの純資産額10,277円）	１口当たり純資産額　1.0526円 （１万口当たりの純資産額10,526円）

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

項　目	第6期 自 2022年9月16日 至 2023年9月15日	第7期 自 2023年9月16日 至 2024年9月17日
分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益（80,249,179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（751,603,461円）、および分配準備積立金（268,656,262円）より、分配対象収益は1,100,508,902円（1万口当たり1,083.72円）でありますが、分配を行っておりません。	計算期間末における費用控除後の配当等収益（130,712,181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（1,027,068,972円）、および分配準備積立金（299,209,564円）より、分配対象収益は1,456,990,717円（1万口当たり1,193.49円）でありますが、分配を行っておりません。

（金融商品に関する注記）

Ⅰ．金融商品の状況に関する事項

項　目	第7期 自 2023年9月16日 至 2024年9月17日
1．　金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2．　金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	(1) 金融商品の内容 1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、投資証券、親投資信託受益証券を組み入れております。 2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。 当計算期間については、為替予約取引を行っております。 3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 (2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。
3．　金融商品に係るリスク管理体制	リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する会議をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。 また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限値、管理レベルおよび頻度等

	を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用部署に是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用部署は、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。なお、投資信託協会の流動性リスク管理規制に抵触する場合には、流動性リスクを管理する会議で審議の上、流動性リスクの管理責任者が対処方針を決定します。その後、決定した対処方針やその実施等について、リスク管理会議に報告を行う体制となっております。 なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する会議にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。

Ⅱ．金融商品の時価等に関する事項

項　目	第7期 (2024年9月17日現在)
1．　貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2．　時価の算定方法	(1) 有価証券（投資証券、親投資信託受益証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。
3．　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

第6期（自 2022年9月16日　至 2023年9月15日）

種　類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
投資証券	△380,727円
親投資信託受益証券	205,095,648円
合計	204,714,921円

第7期（自 2023年9月16日　至 2024年9月17日）

種　類	当計算期間の損益に含まれた評価差額

投資証券	11,022,067円
親投資信託受益証券	359,420,631円
合計	370,442,698円

(デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

第7期 自 2023年9月16日 至 2024年9月17日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。

(その他の注記)

項　目	第6期 (2023年9月15日現在)	第7期 (2024年9月17日現在)
期首元本額	7,722,564,936円	10,154,942,383円
期中追加設定元本額	3,585,355,935円	3,763,691,049円
期中一部解約元本額	1,152,978,488円	1,710,844,062円

(4)【附属明細表】

①有価証券明細表

(a)株式

該当事項はありません。

(b)株式以外の有価証券

種　類	通　貨	銘　柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	アメリカ・ドル	iシェアーズ　J．P．モルガン・米ドル建てエマージング・マーケット債券ETF	8,691.00	813,651.42	
	アメリカ・ドル小計		8,691.00	813,651.42 (114,537,710)	
投資証券合計				114,537,710 (114,537,710)	
親投資信託受益証券	日本・円	国内株式インデックス・マザーファンド(B号)	217,043,290	989,869,332	
		外国株式インデックス・マザーファンド	157,575,065	1,389,181,773	
		ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド	3,398,635,377	4,231,301,044	
		外国債券パッシブ・マザーファンド	394,400,984	878,370,431	

		国内債券パッシブ・マザーファンド	3,838,117,862	4,617,639,599	
		Ｊリート・インデックス・マザーファンド	48,821,857	127,805,857	
		外国リート・インデックス・マザーファンド	38,740,973	139,494,621	
		エマージング株式インデックス・マザーファンド	126,064,083	250,489,332	
	日本・円小計		8,219,399,491	12,624,151,989	
親投資信託受益証券合計				12,624,151,989 (-)	
合　計				12,738,689,699 (114,537,710)	

（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	1銘柄	0.9%	100.0%

②デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

独 立 監 査 人 の 監 査 報 告 書

2024年12月4日

三井住友DSアセットマネジメント株式会社

取 締 役 会 御 中

PwC Japan有限責任監査法人

東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員　　公認会計士　和田 渉

指定有限責任社員
業務執行社員　　公認会計士　榊原 康太

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている三井住友・資産最適化ファンド（２やや安定型）の2023年9月16日から2024年9月17日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三井住友・資産最適化ファンド（２やや安定型）の2024年9月17日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

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

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

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

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

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

財務諸表に対する経営者の責任

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

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

以　上

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

【三井住友・資産最適化ファンド（２やや安定型)】

（１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第６期 (2023年 9月15日現在)	第７期 (2024年 9月17日現在)
資産の部		
流動資産		
預金	7,320,089	14,111,144
金銭信託	2,690,057	880,596
コール・ローン	72,868,237	87,552,212
投資証券	154,666,233	129,983,366
親投資信託受益証券	5,039,377,757	6,698,550,681
未収入金	15,000,000	－
流動資産合計	5,291,922,373	6,931,077,999
資産合計	5,291,922,373	6,931,077,999
負債の部		
流動負債		
未払解約金	20,167,618	9,302,687
未払受託者報酬	802,503	1,126,927
未払委託者報酬	22,738,929	31,931,148
その他未払費用	160,603	225,333
流動負債合計	43,869,653	42,586,095
負債合計	43,869,653	42,586,095
純資産の部		
元本等		
元本	4,446,804,336	5,555,527,628
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	801,248,384	1,332,964,276
（分配準備積立金）	315,401,783	547,844,533
元本等合計	5,248,052,720	6,888,491,904
純資産合計	5,248,052,720	6,888,491,904
負債純資産合計	5,291,922,373	6,931,077,999

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第６期 自　2022年９月16日 至　2023年９月15日	第７期 自　2023年９月16日 至　2024年９月17日
営業収益		
受取配当金	6,190,644	7,354,683
受取利息	53,650	217,460
有価証券売買等損益	253,673,145	347,098,976
為替差損益	6,003,887	△5,659,876
営業収益合計	265,921,326	349,011,243
営業費用		
支払利息	31,593	7,846
受託者報酬	1,477,593	2,057,806
委託者報酬	41,867,699	58,307,336
その他費用	314,586	452,178
営業費用合計	43,691,471	60,825,166
営業利益又は営業損失（△）	222,229,855	288,186,077
経常利益又は経常損失（△）	222,229,855	288,186,077
当期純利益又は当期純損失（△）	222,229,855	288,186,077
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（△）	1,781,747	23,693,280
期首剰余金又は期首欠損金（△）	461,221,723	801,248,384
剰余金増加額又は欠損金減少額	174,470,925	367,161,838
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	174,470,925	367,161,838
剰余金減少額又は欠損金増加額	54,892,372	99,938,743
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	54,892,372	99,938,743
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（△）	801,248,384	1,332,964,276

（３）【注記表】

（重要な会計方針の注記）

項　目	第７期 自 2023年９月16日 至 2024年９月17日
１．　有価証券の評価基準及び評価方法	投資証券、親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。 (1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。 (2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。 (3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。
２．　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	(1) 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。 (2) 計算期間の取扱い 当計算期間は当期末が休日のため、2023年９月16日から2024年９月17日までとなっております。

（重要な会計上の見積りに関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

項　目	第６期 (2023年９月15日現在)	第７期 (2024年９月17日現在)
１．　当計算期間の末日における受益権の総数	4,446,804,336口	5,555,527,628口
２．　１単位当たり純資産の額	１口当たり純資産額　1.1802円 （１万口当たりの純資産額11,802円）	１口当たり純資産額　1.2399円 （１万口当たりの純資産額12,399円）

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

項　目	第6期 自 2022年9月16日 至 2023年9月15日	第7期 自 2023年9月16日 至 2024年9月17日
分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益（77,681,002円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（2,402,751円）、収益調整金（485,846,601円）、および分配準備積立金（235,318,030円）より、分配対象収益は801,248,384円（1万口当たり1,801.85円）でありますが、分配を行っておりません。	計算期間末における費用控除後の配当等収益（96,646,044円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（167,846,753円）、収益調整金（785,119,743円）、および分配準備積立金（283,351,736円）より、分配対象収益は1,332,964,276円（1万口当たり2,399.35円）でありますが、分配を行っておりません。

（金融商品に関する注記）

Ⅰ．金融商品の状況に関する事項

項　目	第7期 自 2023年9月16日 至 2024年9月17日
1．　金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2．　金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	(1) 金融商品の内容 1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、投資証券、親投資信託受益証券を組み入れております。 2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。 当計算期間については、為替予約取引を行っております。 3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 (2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。
3．　金融商品に係るリスク管理体制	リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する会議をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。 また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限値、管理レベルおよび頻度等

	を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用部署に是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用部署は、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。なお、投資信託協会の流動性リスク管理規制に抵触する場合には、流動性リスクを管理する会議で審議の上、流動性リスクの管理責任者が対処方針を決定します。その後、決定した対処方針やその実施等について、リスク管理会議に報告を行う体制となっております。 なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する会議にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。

Ⅱ．金融商品の時価等に関する事項

項　目	第7期 (2024年9月17日現在)
1．　貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2．　時価の算定方法	(1) 有価証券（投資証券、親投資信託受益証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。
3．　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

第6期（自 2022年9月16日　至 2023年9月15日）

種　類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
投資証券	△404,669円
親投資信託受益証券	275,293,105円
合計	274,888,436円

第7期（自 2023年9月16日　至 2024年9月17日）

種　類	当計算期間の損益に含まれた評価差額

投資証券	12,347,021円
親投資信託受益証券	331,664,872円
合計	344,011,893円

(デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

第7期 自 2023年9月16日 至 2024年9月17日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。

(その他の注記)

項　目	第6期 (2023年9月15日現在)	第7期 (2024年9月17日現在)
期首元本額	3,502,252,280円	4,446,804,336円
期中追加設定元本額	1,371,817,336円	1,652,333,710円
期中一部解約元本額	427,265,280円	543,610,418円

(4)【附属明細表】

①有価証券明細表

(a)株式

該当事項はありません。

(b)株式以外の有価証券

種　類	通　貨	銘　柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	アメリカ・ドル	iシェアーズ　J．P．モルガン・米ドル建てエマージング・マーケット債券ETF	9,863.00	923,374.06	
	アメリカ・ドル小計		9,863.00	923,374.06 (129,983,366)	
投資証券合計				129,983,366 (129,983,366)	
親投資信託受益証券	日本・円	国内株式インデックス・マザーファンド(B号)	217,081,439	990,043,318	
		外国株式インデックス・マザーファンド	145,828,305	1,285,622,336	
		ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド	1,573,946,740	1,959,563,691	
		外国債券パッシブ・マザーファンド	272,850,257	607,664,807	

		国内債券パッシブ・マザーファンド	1,152,749,545	1,386,872,977	
		Ｊリート・インデックス・マザーファンド	52,586,537	137,661,036	
		外国リート・インデックス・マザーファンド	38,588,464	138,945,482	
		エマージング株式インデックス・マザーファンド	96,717,179	192,177,034	
	日本・円小計		3,550,348,466	6,698,550,681	
親投資信託受益証券合計				6,698,550,681 (-)	
合　計				6,828,534,047 (129,983,366)	

（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	1銘柄	1.9%	100.0%

②デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

独 立 監 査 人 の 監 査 報 告 書

2024年12月4日

三井住友DSアセットマネジメント株式会社

取 締 役 会 御 中

PwC Japan有限責任監査法人

東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員　　公認会計士　和田 渉

指定有限責任社員
業務執行社員　　公認会計士　榊原 康太

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている三井住友・資産最適化ファンド（３バランス型）の2023年9月16日から2024年9月17日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三井住友・資産最適化ファンド（３バランス型）の2024年9月17日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

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

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

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

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

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

財務諸表に対する経営者の責任

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

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

以　上

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

【三井住友・資産最適化ファンド（３バランス型)】

（１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第６期 (2023年 9月15日現在)	第７期 (2024年 9月17日現在)
資産の部		
流動資産		
預金	26,119,836	25,917,554
金銭信託	6,661,277	2,372,036
コール・ローン	180,440,627	235,836,795
投資証券	564,037,125	582,994,442
親投資信託受益証券	14,003,527,217	19,414,065,618
流動資産合計	14,780,786,082	20,261,186,445
資産合計	14,780,786,082	20,261,186,445
負債の部		
流動負債		
未払解約金	1,366,130	6,389,601
未払受託者報酬	2,174,980	3,259,079
未払委託者報酬	61,625,838	92,342,051
その他未払費用	435,383	651,763
流動負債合計	65,602,331	102,642,494
負債合計	65,602,331	102,642,494
純資産の部		
元本等		
元本	10,913,676,279	13,940,089,702
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	3,801,507,472	6,218,454,249
（分配準備積立金）	1,700,099,921	2,589,438,084
元本等合計	14,715,183,751	20,158,543,951
純資産合計	14,715,183,751	20,158,543,951
負債純資産合計	14,780,786,082	20,261,186,445

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第６期 自　2022年９月16日 至　2023年９月15日	第７期 自　2023年９月16日 至　2024年９月17日
営業収益		
受取配当金	22,183,844	28,262,367
受取利息	188,952	660,785
有価証券売買等損益	1,163,208,582	1,298,516,917
為替差損益	21,673,698	△25,262,248
営業収益合計	1,207,255,076	1,302,177,821
営業費用		
支払利息	86,387	21,876
受託者報酬	3,956,698	5,868,151
委託者報酬	112,109,088	166,266,985
その他費用	845,252	1,281,466
営業費用合計	116,997,425	173,438,478
営業利益又は営業損失（△）	1,090,257,651	1,128,739,343
経常利益又は経常損失（△）	1,090,257,651	1,128,739,343
当期純利益又は当期純損失（△）	1,090,257,651	1,128,739,343
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（△）	14,376,767	80,277,882
期首剰余金又は期首欠損金（△）	2,034,902,796	3,801,507,472
剰余金増加額又は欠損金減少額	923,069,481	1,795,783,706
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	923,069,481	1,795,783,706
剰余金減少額又は欠損金増加額	232,345,689	427,298,390
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	232,345,689	427,298,390
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（△）	3,801,507,472	6,218,454,249

（３）【注記表】

（重要な会計方針の注記）

項　目	第７期 自 2023年９月16日 至 2024年９月17日
１．　有価証券の評価基準及び評価方法	投資証券、親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。 (1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。 (2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。 (3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。
２．　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	(1) 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。 (2) 計算期間の取扱い 当計算期間は当期末が休日のため、2023年９月16日から2024年９月17日までとなっております。

（重要な会計上の見積りに関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

項　目	第６期 （2023年９月15日現在）	第７期 （2024年９月17日現在）
１．　当計算期間の末日における受益権の総数	10,913,676,279口	13,940,089,702口
２．　１単位当たり純資産の額	１口当たり純資産額　1.3483円 （１万口当たりの純資産額13,483円）	１口当たり純資産額　1.4461円 （１万口当たりの純資産額14,461円）

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

項　目	第6期 自 2022年9月16日 至 2023年9月15日	第7期 自 2023年9月16日 至 2024年9月17日
分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益（245,228,201円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（657,885,929円）、収益調整金（2,101,407,551円）、および分配準備積立金（796,985,791円）より、分配対象収益は3,801,507,472円（１万口当たり3,483.25円）でありますが、分配を行っておりません。	計算期間末における費用控除後の配当等収益（319,120,494円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（729,340,967円）、収益調整金（3,629,016,165円）、および分配準備積立金（1,540,976,623円）より、分配対象収益は6,218,454,249円（１万口当たり4,460.84円）でありますが、分配を行っておりません。

（金融商品に関する注記）

Ⅰ．金融商品の状況に関する事項

項　目	第7期 自 2023年9月16日 至 2024年9月17日
１．　金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
２．　金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	(1) 金融商品の内容 1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、投資証券、親投資信託受益証券を組み入れております。 2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。 当計算期間については、為替予約取引を行っております。 3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 (2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。
３．　金融商品に係るリスク管理体制	リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する会議をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。 また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制につい

	ては、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限値、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用部署に是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用部署は、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。なお、投資信託協会の流動性リスク管理規制に抵触する場合には、流動性リスクを管理する会議で審議の上、流動性リスクの管理責任者が対処方針を決定します。その後、決定した対処方針やその実施等について、リスク管理会議に報告を行う体制となっております。 なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する会議にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。

Ⅱ．金融商品の時価等に関する事項

項　目	第7期 (2024年9月17日現在)
1．　貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2．　時価の算定方法	(1) 有価証券（投資証券、親投資信託受益証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。
3．　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

第6期（自 2022年9月16日　至 2023年9月15日）

種　類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
投資証券	△713,518円
親投資信託受益証券	1,202,300,271円
合計	1,201,586,753円

第7期（自 2023年9月16日　至 2024年9月17日）

種　類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
投資証券	52,628,626円
親投資信託受益証券	1,239,024,363円
合計	1,291,652,989円

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

第7期 自 2023年9月16日 至 2024年9月17日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。

（その他の注記）

項　目	第6期 （2023年9月15日現在）	第7期 （2024年9月17日現在）
期首元本額	8,267,467,501円	10,913,676,279円
期中追加設定元本額	3,603,123,946円	4,235,031,216円
期中一部解約元本額	956,915,168円	1,208,617,793円

（４）【附属明細表】

①有価証券明細表

(a)株式

該当事項はありません。

(b)株式以外の有価証券

種　類	通　貨	銘　柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	アメリカ・ドル	ｉシェアーズ　Ｊ．Ｐ．モルガン・米ドル建てエマージング・マーケット債券ＥＴＦ	44,237.00	4,141,467.94	
	アメリカ・ドル小計		44,237.00	4,141,467.94 (582,994,442)	
投資証券合計				582,994,442 (582,994,442)	
親投資信託受益証券	日本・円	国内株式インデックス・マザーファンド（Ｂ号）	899,181,126	4,100,895,361	
		外国株式インデックス・マザーファンド	585,211,507	5,159,224,645	
		ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド	2,650,606,842	3,300,005,518	

		外国債券パッシブ・マザーファンド	800,274,081	1,782,290,405	
		国内債券パッシブ・マザーファンド	2,399,387,825	2,886,703,492	
		Ｊリート・インデックス・マザーファンド	239,482,273	626,916,694	
		外国リート・インデックス・マザーファンド	167,348,435	602,571,509	
		エマージング株式インデックス・マザーファンド	480,854,552	955,457,994	
	日本・円小計		8,222,346,641	19,414,065,618	
親投資信託受益証券合計				19,414,065,618 (-)	
合　計				19,997,060,060 (582,994,442)	

（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	1銘柄	2.9%	100.0%

②デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

独 立 監 査 人 の 監 査 報 告 書

2024年12月4日

三井住友DSアセットマネジメント株式会社

取 締 役 会 御 中

PwC Japan有限責任監査法人

東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員　　公認会計士　和田 渉

指定有限責任社員
業務執行社員　　公認会計士　榊原 康太

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている三井住友・資産最適化ファンド（４やや成長型）の2023年9月16日から2024年9月17日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三井住友・資産最適化ファンド（４やや成長型）の2024年9月17日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

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

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

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

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

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

財務諸表に対する経営者の責任

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

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

以　上

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

【三井住友・資産最適化ファンド（４やや成長型)】

（１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第６期 (2023年 9月15日現在)	第７期 (2024年 9月17日現在)
資産の部		
流動資産		
預金	15,039,419	14,798,754
金銭信託	3,143,390	1,297,041
コール・ローン	85,148,125	128,956,737
投資証券	339,160,150	361,852,711
親投資信託受益証券	6,484,820,833	9,370,990,828
流動資産合計	6,927,311,917	9,877,896,071
資産合計	6,927,311,917	9,877,896,071
負債の部		
流動負債		
未払解約金	4,306,890	8,970,761
未払受託者報酬	998,198	1,585,930
未払委託者報酬	28,283,525	44,935,940
その他未払費用	199,781	317,136
流動負債合計	33,788,394	55,809,767
負債合計	33,788,394	55,809,767
純資産の部		
元本等		
元本	4,611,698,310	6,018,491,745
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	2,281,825,213	3,803,594,559
（分配準備積立金）	1,057,078,513	1,566,522,192
元本等合計	6,893,523,523	9,822,086,304
純資産合計	6,893,523,523	9,822,086,304
負債純資産合計	6,927,311,917	9,877,896,071

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第６期 自　2022年９月16日 至　2023年９月15日	第７期 自　2023年９月16日 至　2024年９月17日
営業収益		
受取配当金	12,668,632	16,921,310
受取利息	108,752	370,389
有価証券売買等損益	726,532,575	751,501,544
為替差損益	12,878,063	△16,308,390
営業収益合計	752,188,022	752,484,853
営業費用		
支払利息	38,877	9,823
受託者報酬	1,804,562	2,811,029
委託者報酬	51,131,595	79,648,724
その他費用	396,575	641,589
営業費用合計	53,371,609	83,111,165
営業利益又は営業損失（△）	698,816,413	669,373,688
経常利益又は経常損失（△）	698,816,413	669,373,688
当期純利益又は当期純損失（△）	698,816,413	669,373,688
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（△）	10,909,102	51,899,995
期首剰余金又は期首欠損金（△）	1,169,718,632	2,281,825,213
剰余金増加額又は欠損金減少額	592,721,442	1,188,137,012
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	592,721,442	1,188,137,012
剰余金減少額又は欠損金増加額	168,522,172	283,841,359
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	168,522,172	283,841,359
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（△）	2,281,825,213	3,803,594,559

（３）【注記表】

（重要な会計方針の注記）

項　目	第７期 自 2023年９月16日 至 2024年９月17日
１．　有価証券の評価基準及び評価方法	投資証券、親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。 (1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。 (2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。 (3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。
２．　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	(1) 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。 (2) 計算期間の取扱い 当計算期間は当期末が休日のため、2023年９月16日から2024年９月17日までとなっております。

（重要な会計上の見積りに関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

項　目	第６期 (2023年９月15日現在)	第７期 (2024年９月17日現在)
１．　当計算期間の末日における受益権の総数	4,611,698,310口	6,018,491,745口
２．　１単位当たり純資産の額	１口当たり純資産額　1.4948円 （１万口当たりの純資産額14,948円）	１口当たり純資産額　1.6320円 （１万口当たりの純資産額16,320円）

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

項　目	第6期 自 2022年9月16日 至 2023年9月15日	第7期 自 2023年9月16日 至 2024年9月17日
分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益（122,962,671円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（559,224,480円）、収益調整金（1,224,746,700円）、および分配準備積立金（374,891,362円）より、分配対象収益は2,281,825,213円（1万口当たり4,947.91円）でありますが、分配を行っておりません。	計算期間末における費用控除後の配当等収益（167,217,202円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（450,256,491円）、収益調整金（2,237,072,367円）、および分配準備積立金（949,048,499円）より、分配対象収益は3,803,594,559円（1万口当たり6,319.85円）でありますが、分配を行っておりません。

（金融商品に関する注記）

Ⅰ．金融商品の状況に関する事項

項　目	第7期 自 2023年9月16日 至 2024年9月17日
1．　金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2．　金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	(1) 金融商品の内容 1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、投資証券、親投資信託受益証券を組み入れております。 2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。 当計算期間については、為替予約取引を行っております。 3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 (2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。
3．　金融商品に係るリスク管理体制	リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する会議をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。 また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限値、管理レベルおよび頻度等

	を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用部署に是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用部署は、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。なお、投資信託協会の流動性リスク管理規制に抵触する場合には、流動性リスクを管理する会議で審議の上、流動性リスクの管理責任者が対処方針を決定します。その後、決定した対処方針やその実施等について、リスク管理会議に報告を行う体制となっております。 なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する会議にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。

Ⅱ．金融商品の時価等に関する事項

項　目	第7期 (2024年9月17日現在)
1．　貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2．　時価の算定方法	(1) 有価証券（投資証券、親投資信託受益証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。
3．　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

第6期（自　2022年9月16日　至　2023年9月15日）

種　類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
投資証券	△748,879円
親投資信託受益証券	718,339,102円
合計	717,590,223円

第7期（自　2023年9月16日　至　2024年9月17日）

種　類	当計算期間の損益に含まれた評価差額

投資証券	31,760,646円
親投資信託受益証券	704,047,650円
合計	735,808,296円

(デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

第7期 自 2023年9月16日 至 2024年9月17日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。

(その他の注記)

項　目	第6期 (2023年9月15日現在)	第7期 (2024年9月17日現在)
期首元本額	3,461,108,415円	4,611,698,310円
期中追加設定元本額	1,655,293,434円	1,970,467,183円
期中一部解約元本額	504,703,539円	563,673,748円

(4)【附属明細表】

①有価証券明細表

(a)株式

該当事項はありません。

(b)株式以外の有価証券

種　類	通　貨	銘　柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	アメリカ・ドル	iシェアーズ　J．P．モルガン・米ドル建てエマージング・マーケット債券ETF	27,457.00	2,570,524.34	
	アメリカ・ドル小計		27,457.00	2,570,524.34 (361,852,711)	
投資証券合計				361,852,711 (361,852,711)	
親投資信託受益証券	日本・円	国内株式インデックス・マザーファンド(B号)	548,021,447	2,499,361,413	
		外国株式インデックス・マザーファンド	363,159,021	3,201,609,929	
		ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド	730,726,946	909,755,047	
		外国債券パッシブ・マザーファンド	261,559,099	582,518,269	

		国内債券パッシブ・マザーファンド	582,772,045	701,133,047	
		Ｊリート・インデックス・マザーファンド	156,128,374	408,712,857	
		外国リート・インデックス・マザーファンド	112,510,735	405,117,403	
		エマージング株式インデックス・マザーファンド	333,559,569	662,782,863	
	日本・円小計		3,088,437,236	9,370,990,828	
親投資信託受益証券合計				9,370,990,828 (-)	
合　計				9,732,843,539 (361,852,711)	

（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	1銘柄	3.7%	100.0%

②デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

独 立 監 査 人 の 監 査 報 告 書

2024年12月4日

三井住友DSアセットマネジメント株式会社

取 締 役 会 御 中

PwC Japan有限責任監査法人

東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員　　公認会計士　和田 渉

指定有限責任社員
業務執行社員　　公認会計士　榊原 康太

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている三井住友・資産最適化ファンド（５成長重視型）の2023年9月16日から2024年9月17日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三井住友・資産最適化ファンド（５成長重視型）の2024年9月17日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

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

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

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

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

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

財務諸表に対する経営者の責任

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

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

以　上

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

【三井住友・資産最適化ファンド（５成長重視型)】

（１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第６期 (2023年 9月15日現在)	第７期 (2024年 9月17日現在)
資産の部		
流動資産		
預金	17,943,594	14,729,736
金銭信託	3,084,890	1,362,405
コール・ローン	83,563,489	135,455,490
投資証券	400,453,852	497,647,967
親投資信託受益証券	6,438,063,615	9,942,002,085
流動資産合計	6,943,109,440	10,591,197,683
資産合計	6,943,109,440	10,591,197,683
負債の部		
流動負債		
未払解約金	5,493,992	11,113,606
未払受託者報酬	999,328	1,700,593
未払委託者報酬	28,315,588	48,184,943
その他未払費用	200,010	340,063
流動負債合計	35,008,918	61,339,205
負債合計	35,008,918	61,339,205
純資産の部		
元本等		
元本	4,260,660,672	5,830,554,033
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	2,647,439,850	4,699,304,445
（分配準備積立金）	1,283,313,753	1,844,981,656
元本等合計	6,908,100,522	10,529,858,478
純資産合計	6,908,100,522	10,529,858,478
負債純資産合計	6,943,109,440	10,591,197,683

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第６期 自　2022年９月16日 至　2023年９月15日	第７期 自　2023年９月16日 至　2024年９月17日
営業収益		
受取配当金	15,106,077	21,225,231
受取利息	129,247	420,076
有価証券売買等損益	911,458,824	900,986,755
為替差損益	15,881,579	△23,710,890
営業収益合計	942,575,727	898,921,172
営業費用		
支払利息	39,418	9,965
受託者報酬	1,794,221	2,942,838
委託者報酬	50,838,894	83,383,071
その他費用	400,441	682,400
営業費用合計	53,072,974	87,018,274
営業利益又は営業損失（△）	889,502,753	811,902,898
経常利益又は経常損失（△）	889,502,753	811,902,898
当期純利益又は当期純損失（△）	889,502,753	811,902,898
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（△）	29,769,800	85,120,286
期首剰余金又は期首欠損金（△）	1,323,842,919	2,647,439,850
剰余金増加額又は欠損金減少額	732,348,188	1,757,649,739
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	732,348,188	1,757,649,739
剰余金減少額又は欠損金増加額	268,484,210	432,567,756
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	268,484,210	432,567,756
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（△）	2,647,439,850	4,699,304,445

（３）【注記表】

（重要な会計方針の注記）

項　目	第７期 自 2023年９月16日 至 2024年９月17日
１．　有価証券の評価基準及び評価方法	投資証券、親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。 (1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。 (2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。 (3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。
２．　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	(1) 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。 (2) 計算期間の取扱い 当計算期間は当期末が休日のため、2023年９月16日から2024年９月17日までとなっております。

（重要な会計上の見積りに関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

項　目	第６期 (2023年９月15日現在)	第７期 (2024年９月17日現在)
１．　当計算期間の末日における受益権の総数	4,260,660,672口	5,830,554,033口
２．　１単位当たり純資産の額	１口当たり純資産額　1.6214円 （１万口当たりの純資産額16,214円）	１口当たり純資産額　1.8060円 （１万口当たりの純資産額18,060円）

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

項　目	第6期 自 2022年9月16日 至 2023年9月15日	第7期 自 2023年9月16日 至 2024年9月17日
分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益（127,643,047円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（732,089,906円）、収益調整金（1,364,126,097円）、および分配準備積立金（423,580,800円）より、分配対象収益は2,647,439,850円（１万口当たり6,213.68円）でありますが、分配を行っておりません。	計算期間末における費用控除後の配当等収益（178,797,181円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（547,985,431円）、収益調整金（2,854,322,789円）、および分配準備積立金（1,118,199,044円）より、分配対象収益は4,699,304,445円（１万口当たり8,059.79円）でありますが、分配を行っておりません。

（金融商品に関する注記）

Ⅰ．金融商品の状況に関する事項

項　目	第7期 自 2023年9月16日 至 2024年9月17日
１．　金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
２．　金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	(1) 金融商品の内容 1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、投資証券、親投資信託受益証券を組み入れております。 2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。 当計算期間については、為替予約取引を行っております。 3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 (2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。
３．　金融商品に係るリスク管理体制	リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する会議をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。 また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制につい

	ては、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限値、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用部署に是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用部署は、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。なお、投資信託協会の流動性リスク管理規制に抵触する場合には、流動性リスクを管理する会議で審議の上、流動性リスクの管理責任者が対処方針を決定します。その後、決定した対処方針やその実施等について、リスク管理会議に報告を行う体制となっております。 なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する会議にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。

Ⅱ．金融商品の時価等に関する事項

項　目	第7期 (2024年9月17日現在)
1．　貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2．　時価の算定方法	(1) 有価証券（投資証券、親投資信託受益証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。
3．　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

第6期（自 2022年9月16日　至 2023年9月15日）

種　類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
投資証券	△957,550円
親投資信託受益証券	869,810,821円
合計	868,853,271円

第7期（自 2023年9月16日　至 2024年9月17日）

種　類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
投資証券	42,434,718円
親投資信託受益証券	839,444,107円
合計	881,878,825円

(デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

第7期 自 2023年9月16日 至 2024年9月17日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。

(その他の注記)

項　目	第6期 (2023年9月15日現在)	第7期 (2024年9月17日現在)
期首元本額	3,255,045,332円	4,260,660,672円
期中追加設定元本額	1,671,376,606円	2,248,982,809円
期中一部解約元本額	665,761,266円	679,089,448円

(4)【附属明細表】

①有価証券明細表

(a)株式

該当事項はありません。

(b)株式以外の有価証券

種　類	通　貨	銘　柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	アメリカ・ドル	iシェアーズ　J．P．モルガン・米ドル建てエマージング・マーケット債券ETF	37,761.00	3,535,184.82	
	アメリカ・ドル小計		37,761.00	3,535,184.82 (497,647,967)	
投資証券合計				497,647,967 (497,647,967)	
親投資信託受益証券	日本・円	国内株式インデックス・マザーファンド(B号)	676,073,072	3,083,366,459	
		外国株式インデックス・マザーファンド	522,081,349	4,602,669,172	
		ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド	97,175,055	120,982,943	

		外国債券パッシブ・マザーファンド	143,088,978	318,673,462	
		国内債券パッシブ・マザーファンド	90,370,739	108,725,036	
		Ｊリート・インデックス・マザーファンド	127,306,138	333,262,008	
		外国リート・インデックス・マザーファンド	94,715,195	341,041,002	
		エマージング株式インデックス・マザーファンド	520,021,139	1,033,282,003	
	日本・円小計		2,270,831,665	9,942,002,085	
親投資信託受益証券合計				9,942,002,085 (-)	
合　計				10,439,650,052 (497,647,967)	

（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	1銘柄	4.7%	100.0%

②デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

(参考)

「三井住友・資産最適化ファンド（１安定重視型)」、「三井住友・資産最適化ファンド（２やや安定型)」、「三井住友・資産最適化ファンド（３バランス型)」、「三井住友・資産最適化ファンド（４やや成長型)」および「三井住友・資産最適化ファンド（５成長重視型)」は、「国内株式インデックス・マザーファンド（Ｂ号)」、「外国株式インデックス・マザーファンド」、「エマージング株式インデックス・マザーファンド」、「Ｊリート・インデックス・マザーファンド」、「外国リート・インデックス・マザーファンド」、「国内債券パッシブ・マザーファンド」、「外国債券パッシブ・マザーファンド」および「ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド」受益証券を投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同マザーファンドの受益証券です。

なお、以下に記載した状況は、監査の対象外です。

国内株式インデックス・マザーファンド（Ｂ号）

（１）貸借対照表

（単位：円）

	（2024年9月17日現在）
資産の部	
流動資産	
金銭信託	55,444,781
コール・ローン	5,512,530,223
株式	315,066,198,890
派生商品評価勘定	1,422,300
未収配当金	126,246,669
前払金	52,455,000
差入委託証拠金	498,631,311
流動資産合計	321,312,929,174
資産合計	321,312,929,174
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	78,637,900
未払解約金	1,428,210
流動負債合計	80,066,110
負債合計	80,066,110
純資産の部	
元本等	
元本	70,434,529,577
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	250,798,333,487
元本等合計	321,232,863,064
純資産合計	321,232,863,064
負債純資産合計	321,312,929,174

（２）注記表

（重要な会計方針の注記）

項　目	自 2023年9月16日 至 2024年9月17日
１．　有価証券の評価基準及び評価方法	株式、新株予約権証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。 (1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。 (2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。 (3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。
２．　デリバティブの評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算期間末日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場によっております。

（重要な会計上の見積りに関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

項　目	(2024年9月17日現在)
１．　当計算期間の末日における受益権の総数	70,434,529,577口
２．　１単位当たり純資産の額	１口当たり純資産額　4.5607円 （１万口当たりの純資産額45,607円）

（金融商品に関する注記）

Ⅰ．金融商品の状況に関する事項

項　目	自 2023年9月16日 至 2024年9月17日
１．　金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
２．　金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	(1) 金融商品の内容 1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、株式、新株予約権証券を組み入れております。

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

Ⅱ．金融商品の時価等に関する事項

項　目	(2024年9月17日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券（株式） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。

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

(デリバティブ取引に関する注記)

(2024年9月17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	うち1年超	時 価	評価損益
市場取引	株価指数先物取引 買建				
	TOPIX 先物 0612 月	6,312,085,600	-	6,234,870,000	△77,215,600
	小計	6,312,085,600	-	6,234,870,000	△77,215,600
合 計		6,312,085,600	-	6,234,870,000	△77,215,600

(注) 1．時価の算定方法

株価指数先物取引の時価の算定方法については以下のように評価しております。

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

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

2)株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

2．ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

自 2023年9月16日 至 2024年9月17日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。

(その他の注記)

(2024年9月17日現在)	
開示対象ファンドの 期首における当該親投資信託の元本額	67,862,268,912円
同期中における追加設定元本額	11,888,038,162円
同期中における一部解約元本額	9,315,777,497円
2024年9月17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	9,727,786,024円

三井住友・ＤＣ年金バランス３０（債券重点型）	950,626,917 円
三井住友・ＤＣ年金バランス５０（標準型）	4,198,280,243 円
三井住友・ＤＣ年金バランス７０（株式重点型）	3,629,488,300 円
ＳＭＡＭ・グローバルバランスファンド（機動的資産配分型）	133,495,524 円
三井住友・ＤＣターゲットイヤーファンド２０２０（４資産タイプ）	3,042,957 円
三井住友・ＤＣターゲットイヤーファンド２０２５（４資産タイプ）	11,977,031 円
三井住友・ＤＣターゲットイヤーファンド２０３０（４資産タイプ）	42,887,777 円
三井住友・ＤＣターゲットイヤーファンド２０３５（４資産タイプ）	124,903,411 円
三井住友・ＤＣターゲットイヤーファンド２０４０（４資産タイプ）	124,228,530 円
三井住友・ＤＣターゲットイヤーファンド２０４５（４資産タイプ）	253,304,691 円
国内株式指数ファンド（ＴＯＰＩＸ）	1,591,991,652 円
三井住友・ＤＣつみたてＮＩＳＡ・日本株インデックスファンド	29,540,289,086 円
アセットアロケーション・ファンド（安定型）	105,178,908 円
アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）	151,619,140 円
アセットアロケーション・ファンド（成長型）	92,399,058 円
三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０５０	70,040,729 円
三井住友・資産最適化ファンド（１安定重視型）	217,043,290 円
三井住友・資産最適化ファンド（２やや安定型）	217,081,439 円
三井住友・資産最適化ファンド（３バランス型）	899,181,126 円
三井住友・資産最適化ファンド（４やや成長型）	548,021,447 円
三井住友・資産最適化ファンド（５成長重視型）	676,073,072 円
三井住友・ＤＣつみたてＮＩＳＡ・世界分散ファンド	66,541,957 円
三井住友ＤＳ・国内株式インデックス年金ファンド	1,492,724,486 円
三井住友ＤＳ・年金バランス３０（債券重点型）	42,130,422 円
三井住友ＤＳ・年金バランス５０（標準型）	254,742,952 円
三井住友ＤＳ・年金バランス７０（株式重点型）	291,224,732 円
三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０６０	9,795,302 円
日興ＦＷＳ・日本株インデックス	2,801,593,926 円
三井住友ＤＳ・ＴＯＰＩＸインデックス・ファンド	228,075,914 円
三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０３５	23,040,928 円
三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０４０	14,474,296 円
三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０４５	15,224,099 円
三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０５５	8,267,077 円
三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０６５	5,275,441 円
三井住友ＤＳ・ＦＷ専用ポートフォリオ・レベル１（保守型）	875,783 円
三井住友ＤＳ・ＦＷ専用ポートフォリオ・レベル２（安定型）	23,588,101 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）	114,775,649 円
三井住友ＤＳ・ＦＷ専用ポートフォリオ・レベル４（成長型）	123,701,189 円
三井住友ＤＳ・ＦＷ専用ポートフォリオ・レベル５（積極成長型）	47,814,523 円
ＳＭＡＭ・国内株式パッシブ・ファンド（適格機関投資家専用）	1,993,156,333 円
バランスファンドＶＡ（安定運用型）＜適格機関投資家限定＞	6,728,503 円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ安定成長型＜適格機関投資家限定＞	33,548,131 円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ２５＜適格機関投資家専用＞	696,968,941 円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ３７．５＜適格機関投資家専用＞	977,324,801 円

ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ５０＜適格機関投資家専用＞	3,842,256,121円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＬ３０＜適格機関投資家限定＞	23,860,855円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＬ５０＜適格機関投資家限定＞	91,834,407円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ７５＜適格機関投資家専用＞	561,545,046円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＬ国際分散型＜適格機関投資家限定＞	29,035,936円
ＳＭＡＭ・インデックス・バランスＶＡ２５＜適格機関投資家専用＞	155,287,022円
ＳＭＡＭ・インデックス・バランスＶＡ５０＜適格機関投資家専用＞	543,730,636円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ４０＜適格機関投資家専用＞	344,922,224円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ３５＜適格機関投資家専用＞	1,024,338,247円
ＳＭＡＭ・グローバルバランス４０ＶＡ＜適格機関投資家限定＞	22,216,667円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２０Ａ＜適格機関投資家専用＞	23,652,147円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ３５Ａ＜適格機関投資家専用＞	17,992,772円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ５０Ａ＜適格機関投資家専用＞	13,108,995円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２０Ｌ＜適格機関投資家専用＞	53,729,988円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２５Ｌ＜適格機関投資家専用＞	143,857,608円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２０Ａ２＜適格機関投資家専用＞	28,624,594円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ３５Ａ２＜適格機関投資家専用＞	28,432,856円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ５０Ａ２＜適格機関投資家専用＞	6,486,356円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ３０Ｌ２＜適格機関投資家専用＞	24,746,633円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２５Ｌ２＜適格機関投資家専用＞	324,341,423円
ＳＭＡＭ・国内株式インデックスファンド・ＶＡ（適格機関投資家専用）	147,428,669円
ＳＭＡＭ・グローバルバランスファンド（標準型）ＶＡ＜適格機関投資家限定＞	132,037,002円
ＳＭＡＭ・グローバルバランスファンド（債券重視型）ＶＡ＜適格機関投資家限定＞	53,003,126円
ＳＭＡＭ・世界バランスファンドＶＡ＜適格機関投資家限定＞	37,593,666円
ＳＭＡＭ・世界バランスファンドＶＡ２＜適格機関投資家限定＞	24,166,736円
ＳＭＡＭ・年金Ｗリスクコントロールファンド＜適格機関投資家限定＞	25,219,091円
ＳＭＡＭ・マルチアセットストラテジーファンド２０１６－０４＜適格機関投資家限定＞	15,386,731円
ＳＭＡＭ・マルチアセットストラテジー・オープン＜適格機関投資家限定＞	24,463,796円
ＳＭＡＭ・マルチアセット・ダイナミックアロケーション・ストラテジー・ファンドⅡ＜適格機関投資家限定＞	23,379,285円
ＳＭＤＡＭ・日米３資産バランスオープン＜適格機関投資家限定＞	10,117,443円
ＳＭＤＡＭ・年金Ｗリスクコントロールファンド（リスク３％）＜適格機関投資家限定＞	57,199,661円
合　計	70,434,529,577円

（３）附属明細表

①有価証券明細表

(a)株式

（単位：円）

銘　柄	株　数	評価額		備考
		単価	金額	
極洋	4,500	4,325.000	19,462,500	
ニッスイ	121,800	921.700	112,263,060	

マルハニチロ	18,000	3,088.000	55,584,000	
雪国まいたけ	12,000	1,011.000	12,132,000	
カネコ種苗	4,800	1,371.000	6,580,800	
サカタのタネ	13,600	3,355.000	45,628,000	
ホクト	10,100	1,808.000	18,260,800	
住石ホールディングス	15,900	977.000	15,534,300	
日鉄鉱業	4,800	4,155.000	19,944,000	
三井松島ホールディングス	7,500	4,600.000	34,500,000	
ＩＮＰＥＸ	370,800	1,849.000	685,609,200	
石油資源開発	13,800	5,260.000	72,588,000	
Ｋ＆Ｏエナジーグループ	5,800	3,250.000	18,850,000	
ショーボンドホールディングス	16,400	5,584.000	91,577,600	
ミライト・ワン	39,000	2,015.500	78,604,500	
タマホーム	7,900	3,920.000	30,968,000	
日本アクア	3,300	868.000	2,864,400	
安藤・間	68,700	1,119.000	76,875,300	
東急建設	36,300	719.000	26,099,700	
コムシスホールディングス	38,200	3,125.000	119,375,000	
ビーアールホールディングス	18,500	361.000	6,678,500	
高松コンストラクショングループ	8,800	2,977.000	26,197,600	
東建コーポレーション	3,200	11,650.000	37,280,000	
ヤマウラ	6,300	1,127.000	7,100,100	
オリエンタル白石	44,000	388.000	17,072,000	
大成建設	78,700	6,275.000	493,842,500	
大林組	307,300	1,807.000	555,291,100	
清水建設	244,000	999.700	243,926,800	
飛島建設	9,400	1,422.000	13,366,800	
長谷工コーポレーション	78,700	1,883.000	148,192,100	
松井建設	9,700	744.000	7,216,800	
錢高組	1,500	3,400.000	5,100,000	
鹿島建設	190,000	2,595.500	493,145,000	
不動テトラ	5,800	2,231.000	12,939,800	
鉄建建設	6,700	2,380.000	15,946,000	
西松建設	16,300	5,261.000	85,754,300	
三井住友建設	65,600	396.000	25,977,600	
大豊建設	3,800	3,515.000	13,357,000	
奥村組	13,400	4,370.000	58,558,000	
東鉄工業	10,900	3,395.000	37,005,500	
淺沼組	31,000	677.000	20,987,000	
戸田建設	116,800	985.600	115,118,080	
熊谷組	14,100	3,435.000	48,433,500	
北野建設	1,900	3,800.000	7,220,000	
矢作建設工業	11,500	1,575.000	18,112,500	
ピーエス・コンストラクション	10,900	1,004.000	10,943,600	

日本ハウスホールディングス	19,500	359.000	7,000,500	
新日本建設	11,500	1,591.000	18,296,500	
東亜道路工業	17,000	1,345.000	22,865,000	
日本道路	9,900	1,679.000	16,622,100	
東亜建設工業	26,800	917.000	24,575,600	
日本国土開発	24,300	495.000	12,028,500	
若築建設	3,200	3,255.000	10,416,000	
東洋建設	22,400	1,342.000	30,060,800	
五洋建設	119,400	595.000	71,043,000	
世紀東急工業	10,800	1,579.000	17,053,200	
福田組	3,100	5,400.000	16,740,000	
住友林業	74,500	6,420.000	478,290,000	
巴コーポレーション	11,300	915.000	10,339,500	
大和ハウス工業	237,300	4,573.000	1,085,172,900	
ライト工業	16,100	2,109.000	33,954,900	
積水ハウス	260,000	3,808.000	990,080,000	
日特建設	6,800	1,003.000	6,820,400	
北陸電気工事	5,600	1,174.000	6,574,400	
ユアテック	19,100	1,532.000	29,261,200	
日本リーテック	7,700	1,054.000	8,115,800	
四電工	3,500	3,880.000	13,580,000	
中電工	13,000	3,330.000	43,290,000	
関電工	53,300	2,213.000	117,952,900	
きんでん	59,700	3,286.000	196,174,200	
東京エネシス	8,700	1,088.000	9,465,600	
トーエネック	2,900	4,815.000	13,963,500	
住友電設	8,100	4,015.000	32,521,500	
日本電設工業	14,700	1,759.000	25,857,300	
エクシオグループ	82,100	1,545.500	126,885,550	
新日本空調	5,500	3,365.000	18,507,500	
九電工	18,600	6,530.000	121,458,000	
三機工業	17,600	2,230.000	39,248,000	
日揮ホールディングス	84,900	1,204.500	102,262,050	
中外炉工業	3,000	2,605.000	7,815,000	
ヤマト	7,000	957.000	6,699,000	
太平電業	5,500	5,120.000	28,160,000	
高砂熱学工業	22,900	5,130.000	117,477,000	
三晃金属工業	1,200	3,980.000	4,776,000	
朝日工業社	8,000	1,281.000	10,248,000	
明星工業	16,400	1,167.000	19,138,800	
大氣社	9,600	4,730.000	45,408,000	
ダイダン	11,200	2,942.000	32,950,400	
日比谷総合設備	6,400	3,300.000	21,120,000	
テスホールディングス	19,300	282.000	5,442,600	

インフロニア・ホールディングス	99,200	1,172.500	116,312,000	
東洋エンジニアリング	12,300	698.000	8,585,400	
レイズネクスト	12,800	1,603.000	20,518,400	
ニップン	24,500	2,216.000	54,292,000	
日清製粉グループ本社	79,700	1,858.000	148,082,600	
日東富士製粉	1,700	6,890.000	11,713,000	
昭和産業	7,200	2,888.000	20,793,600	
鳥越製粉	10,700	681.000	7,286,700	
中部飼料	12,100	1,485.000	17,968,500	
フィード・ワン	12,900	833.000	10,745,700	
日本甜菜製糖	5,200	2,777.000	14,440,400	
ＤＭ三井製糖ホールディングス	8,300	3,335.000	27,680,500	
ウェルネオシュガー	4,700	2,160.000	10,152,000	
森永製菓	35,700	2,895.500	103,369,350	
中村屋	3,100	3,230.000	10,013,000	
江崎グリコ	24,600	4,323.000	106,345,800	
井村屋グループ	4,600	2,529.000	11,633,400	
不二家	5,700	2,718.000	15,492,600	
山崎製パン	58,000	2,779.000	161,182,000	
モロゾフ	2,600	4,495.000	11,687,000	
亀田製菓	5,100	4,510.000	23,001,000	
寿スピリッツ	40,800	1,722.500	70,278,000	
カルビー	39,700	3,414.000	135,535,800	
森永乳業	30,100	3,450.000	103,845,000	
六甲バター	6,300	1,518.000	9,563,400	
ヤクルト本社	123,400	3,182.000	392,658,800	
明治ホールディングス	105,500	3,681.000	388,345,500	
雪印メグミルク	20,900	2,635.000	55,071,500	
プリマハム	10,700	2,342.000	25,059,400	
日本ハム	37,000	5,428.000	200,836,000	
丸大食品	8,400	1,782.000	14,968,800	
Ｓ　Ｆｏｏｄｓ	9,400	2,680.000	25,192,000	
柿安本店	3,100	2,661.000	8,249,100	
伊藤ハム米久ホールディングス	12,700	3,865.000	49,085,500	
サッポロホールディングス	28,500	7,655.000	218,167,500	
アサヒグループホールディングス	215,900	5,479.000	1,182,916,100	
キリンホールディングス	359,000	2,177.000	781,543,000	
宝ホールディングス	57,100	1,156.500	66,036,150	
オエノンホールディングス	28,500	396.000	11,286,000	
養命酒製造	2,800	2,253.000	6,308,400	
コカ・コーラ　ボトラーズジャパンホールディングス	62,500	2,085.500	130,343,750	
ライフドリンク　カンパニー	2,100	7,600.000	15,960,000	
サントリー食品インターナショナル	60,800	5,553.000	337,622,400	

ダイドーグループホールディングス	9,400	2,980.000	28,012,000	
伊藤園	29,000	3,266.000	94,714,000	
キーコーヒー	9,800	2,045.000	20,041,000	
日清オイリオグループ	11,600	5,370.000	62,292,000	
不二製油グループ本社	20,400	3,347.000	68,278,800	
かどや製油	1,800	3,660.000	6,588,000	
Ｊ－オイルミルズ	8,500	1,974.000	16,779,000	
キッコーマン	285,500	1,605.000	458,227,500	
味の素	202,000	5,346.000	1,079,892,000	
ブルドックソース	4,700	1,771.000	8,323,700	
キユーピー	46,700	3,579.000	167,139,300	
ハウス食品グループ本社	28,600	3,010.000	86,086,000	
カゴメ	36,900	3,116.000	114,980,400	
アリアケジャパン	8,800	5,060.000	44,528,000	
エバラ食品工業	2,800	2,755.000	7,714,000	
やまみ	900	4,775.000	4,297,500	
ニチレイ	39,500	4,461.000	176,209,500	
東洋水産	43,600	9,231.000	402,471,600	
イートアンドホールディングス	4,100	2,013.000	8,253,300	
ヨシムラ・フード・ホールディングス	5,000	1,632.000	8,160,000	
日清食品ホールディングス	91,000	3,957.000	360,087,000	
フジッコ	7,600	1,700.000	12,920,000	
ロック・フィールド	9,200	1,434.000	13,192,800	
日本たばこ産業	524,100	4,070.000	2,133,087,000	
ケンコーマヨネーズ	6,300	2,367.000	14,912,100	
わらべや日洋ホールディングス	6,200	2,329.000	14,439,800	
なとり	4,600	2,069.000	9,517,400	
ファーマフーズ	12,200	853.000	10,406,600	
ユーグレナ	55,500	458.000	25,419,000	
紀文食品	7,100	1,195.000	8,484,500	
ピックルスホールディングス	5,200	1,009.000	5,246,800	
ミヨシ油脂	5,200	1,577.000	8,200,400	
理研ビタミン	7,200	2,547.000	18,338,400	
片倉工業	9,000	2,015.000	18,135,000	
グンゼ	8,000	5,480.000	43,840,000	
東洋紡	47,000	970.000	45,590,000	
ユニチカ	30,500	285.000	8,692,500	
富士紡ホールディングス	3,600	4,350.000	15,660,000	
倉敷紡績	8,000	4,510.000	36,080,000	
シキボウ	5,700	1,016.000	5,791,200	
日本毛織	27,800	1,303.000	36,223,400	
ダイドーリミテッド	2,700	937.000	2,529,900	
帝国繊維	12,300	2,810.000	34,563,000	
帝人	83,300	1,372.500	114,329,250	

東レ	585,200	742.100	434,276,920	
ダイニック	3,300	752.000	2,481,600	
セーレン	16,000	2,683.000	42,928,000	
小松マテーレ	13,300	751.000	9,988,300	
ワコールホールディングス	17,700	4,372.000	77,384,400	
ホギメディカル	11,300	4,365.000	49,324,500	
ＴＳＩホールディングス	28,800	897.000	25,833,600	
ワールド	17,000	1,910.000	32,470,000	
三陽商会	5,700	2,338.000	13,326,600	
オンワードホールディングス	54,600	521.000	28,446,600	
ルックホールディングス	3,700	2,534.000	9,375,800	
ゴールドウイン	15,500	7,963.000	123,426,500	
特種東海製紙	4,400	3,675.000	16,170,000	
王子ホールディングス	363,800	570.500	207,547,900	
日本製紙	49,600	900.000	44,640,000	
北越コーポレーション	44,900	1,450.000	65,105,000	
大王製紙	40,200	860.000	34,572,000	
レンゴー	80,000	980.800	78,464,000	
トーモク	5,400	2,379.000	12,846,600	
ザ・パック	6,700	3,700.000	24,790,000	
北の達人コーポレーション	41,500	164.000	6,806,000	
クラレ	126,800	1,954.500	247,830,600	
旭化成	593,300	1,029.500	610,802,350	
レゾナック・ホールディングス	80,500	3,111.000	250,435,500	
住友化学	650,400	394.000	256,257,600	
住友精化	5,400	5,280.000	28,512,000	
日産化学	41,500	4,998.000	207,417,000	
ラサ工業	3,400	2,601.000	8,843,400	
クレハ	19,600	2,674.000	52,410,400	
多木化学	3,400	3,885.000	13,209,000	
テイカ	7,400	1,680.000	12,432,000	
石原産業	14,800	1,440.000	21,312,000	
日本曹達	10,100	4,830.000	48,783,000	
東ソー	119,000	1,837.500	218,662,500	
トクヤマ	29,000	2,680.000	77,720,000	
セントラル硝子	9,900	3,375.000	33,412,500	
東亞合成	41,100	1,576.500	64,794,150	
大阪ソーダ	6,200	9,000.000	55,800,000	
関東電化工業	16,800	938.000	15,758,400	
デンカ	34,800	2,160.000	75,168,000	
信越化学工業	786,700	5,638.000	4,435,414,600	
日本カーバイド工業	3,800	1,640.000	6,232,000	
堺化学工業	6,300	2,567.000	16,172,100	
第一稀元素化学工業	8,000	806.000	6,448,000	

エア・ウォーター	81,900	1,998.000	163,636,200	
日本酸素ホールディングス	85,300	5,200.000	443,560,000	
日本化学工業	3,000	2,631.000	7,893,000	
日本パーカライジング	39,000	1,205.000	46,995,000	
高圧ガス工業	12,600	880.000	11,088,000	
四国化成ホールディングス	11,000	1,923.000	21,153,000	
ステラ　ケミファ	4,800	4,170.000	20,016,000	
保土谷化学工業	2,700	4,620.000	12,474,000	
日本触媒	50,400	1,697.000	85,528,800	
大日精化工業	5,800	2,974.000	17,249,200	
カネカ	23,400	3,710.000	86,814,000	
三菱瓦斯化学	63,300	2,573.500	162,902,550	
三井化学	72,200	3,787.000	273,421,400	
東京応化工業	42,000	3,253.000	136,626,000	
大阪有機化学工業	7,700	2,946.000	22,684,200	
三菱ケミカルグループ	640,700	902.300	578,103,610	
ＫＨネオケム	13,300	1,979.000	26,320,700	
ダイセル	110,600	1,271.000	140,572,600	
住友ベークライト	24,400	3,633.000	88,645,200	
積水化学工業	174,000	2,162.500	376,275,000	
日本ゼオン	60,200	1,293.000	77,838,600	
アイカ工業	22,000	3,326.000	73,172,000	
ＵＢＥ	41,900	2,603.000	109,065,700	
積水樹脂	13,300	2,294.000	30,510,200	
旭有機材	5,900	3,840.000	22,656,000	
ニチバン	5,100	1,928.000	9,832,800	
リケンテクノス	18,200	993.000	18,072,600	
大倉工業	4,000	2,561.000	10,244,000	
積水化成品工業	8,700	399.000	3,471,300	
群栄化学工業	2,100	2,686.000	5,640,600	
ミライアル	2,700	1,400.000	3,780,000	
ダイキョーニシカワ	18,600	653.000	12,145,800	
森六ホールディングス	4,400	2,238.000	9,847,200	
恵和	6,300	1,006.000	6,337,800	
日本化薬	69,000	1,279.000	88,251,000	
カーリット	8,700	1,058.000	9,204,600	
日本精化	6,000	2,171.000	13,026,000	
扶桑化学工業	9,400	3,650.000	34,310,000	
トリケミカル研究所	10,800	3,315.000	35,802,000	
ＡＤＥＫＡ	30,000	2,866.500	85,995,000	
日油	81,000	2,207.000	178,767,000	
ハリマ化成グループ	5,800	848.000	4,918,400	
花王	213,800	6,946.000	1,485,054,800	
第一工業製薬	3,600	2,960.000	10,656,000	

石原ケミカル	4,000	2,232.000	8,928,000	
三洋化成工業	5,800	4,125.000	23,925,000	
大日本塗料	9,700	1,058.000	10,262,600	
日本ペイントホールディングス	393,800	860.700	338,943,660	
関西ペイント	78,000	2,647.000	206,466,000	
中国塗料	18,200	1,941.000	35,326,200	
日本特殊塗料	5,200	1,187.000	6,172,400	
藤倉化成	13,700	470.000	6,439,000	
太陽ホールディングス	15,300	3,590.000	54,927,000	
ＤＩＣ	33,200	3,034.000	100,728,800	
サカタインクス	21,500	1,552.000	33,368,000	
ａｒｔｉｅｎｃｅ	18,500	3,800.000	70,300,000	
富士フイルムホールディングス	488,900	3,822.000	1,868,575,800	
資生堂	183,800	3,338.000	613,524,400	
ライオン	112,300	1,539.000	172,829,700	
高砂香料工業	6,800	5,270.000	35,836,000	
マンダム	21,300	1,210.000	25,773,000	
ミルボン	14,200	2,962.000	42,060,400	
コーセー	18,000	8,000.000	144,000,000	
コタ	8,600	1,649.000	14,181,400	
ポーラ・オルビスホールディングス	47,200	1,440.500	67,991,600	
ノエビアホールディングス	8,200	5,340.000	43,788,000	
新日本製薬	5,000	1,803.000	9,015,000	
Ｉ－ｎｅ	3,200	1,834.000	5,868,800	
アクシージア	6,300	581.000	3,660,300	
エステー	6,700	1,492.000	9,996,400	
アグロ　カネショウ	4,400	1,280.000	5,632,000	
コニシ	25,100	1,261.000	31,651,100	
長谷川香料	18,400	2,963.000	54,519,200	
小林製薬	23,800	5,418.000	128,948,400	
荒川化学工業	7,700	1,204.000	9,270,800	
メック	7,600	3,620.000	27,512,000	
日本高純度化学	2,300	3,030.000	6,969,000	
タカラバイオ	25,600	1,019.000	26,086,400	
ＪＣＵ	9,700	3,390.000	32,883,000	
新田ゼラチン	6,000	888.000	5,328,000	
ＯＡＴアグリオ	3,300	1,859.000	6,134,700	
デクセリアルズ	21,700	5,828.000	126,467,600	
アース製薬	8,500	5,260.000	44,710,000	
北興化学工業	9,600	1,287.000	12,355,200	
大成ラミック	3,500	2,665.000	9,327,500	
クミアイ化学工業	34,600	787.000	27,230,200	
日本農薬	16,300	591.000	9,633,300	
アキレス	5,700	1,544.000	8,800,800	

有沢製作所	15,900	1,436.000	22,832,400	
日東電工	55,500	11,510.000	638,805,000	
レック	12,300	1,262.000	15,522,600	
三光合成	11,700	538.000	6,294,600	
きもと	21,600	234.000	5,054,400	
藤森工業	6,900	4,250.000	29,325,000	
前澤化成工業	6,000	1,733.000	10,398,000	
未来工業	3,300	3,340.000	11,022,000	
ＪＳＰ	6,000	1,918.000	11,508,000	
エフピコ	17,200	2,886.500	49,647,800	
天馬	6,100	2,520.000	15,372,000	
信越ポリマー	19,000	1,488.000	28,272,000	
東リ	18,200	372.000	6,770,400	
ニフコ	26,000	3,563.000	92,638,000	
バルカー	7,500	3,285.000	24,637,500	
ユニ・チャーム	183,400	5,080.000	931,672,000	
協和キリン	106,200	3,267.000	346,955,400	
武田薬品工業	777,400	4,209.000	3,272,076,600	
アステラス製薬	770,300	1,689.000	1,301,036,700	
塩野義製薬	106,800	6,355.000	678,714,000	
わかもと製薬	9,000	240.000	2,160,000	
日本新薬	23,000	3,340.000	76,820,000	
中外製薬	275,100	6,867.000	1,889,111,700	
科研製薬	14,400	3,923.000	56,491,200	
エーザイ	107,000	5,672.000	606,904,000	
ロート製薬	85,100	3,559.000	302,870,900	
小野薬品工業	179,100	1,908.500	341,812,350	
久光製薬	19,900	3,939.000	78,386,100	
持田製薬	11,300	3,220.000	36,386,000	
参天製薬	154,600	1,779.000	275,033,400	
扶桑薬品工業	4,500	2,171.000	9,769,500	
ツムラ	27,700	3,866.000	107,088,200	
キッセイ薬品工業	15,500	3,440.000	53,320,000	
生化学工業	19,000	791.000	15,029,000	
栄研化学	17,300	2,345.000	40,568,500	
鳥居薬品	5,300	3,725.000	19,742,500	
ＪＣＲファーマ	31,800	653.000	20,765,400	
東和薬品	14,500	2,927.000	42,441,500	
富士製薬工業	7,900	1,228.000	9,701,200	
ゼリア新薬工業	13,500	2,214.000	29,889,000	
ネクセラファーマ	40,500	1,265.000	51,232,500	
第一三共	765,000	4,968.000	3,800,520,000	
杏林製薬	21,900	1,506.000	32,981,400	
大幸薬品	24,400	397.000	9,686,800	

ダイト	8,000	2,214.000	17,712,000	
大塚ホールディングス	219,100	8,044.000	1,762,440,400	
ペプチドリーム	43,000	2,400.000	103,200,000	
セルソース	8,600	1,237.000	10,638,200	
あすか製薬ホールディングス	9,900	2,156.000	21,344,400	
サワイグループホールディングス	20,000	5,994.000	119,880,000	
日本コークス工業	95,100	96.000	9,129,600	
ニチレキ	11,800	2,569.000	30,314,200	
ユシロ化学工業	4,500	1,526.000	6,867,000	
富士石油	26,200	356.000	9,327,200	
出光興産	455,700	987.800	450,140,460	
ＥＮＥＯＳホールディングス	1,387,000	738.000	1,023,606,000	
コスモエネルギーホールディングス	26,100	7,581.000	197,864,100	
横浜ゴム	44,100	3,034.000	133,799,400	
ＴＯＹＯ　ＴＩＲＥ	49,700	1,963.500	97,585,950	
ブリヂストン	257,000	5,280.000	1,356,960,000	
住友ゴム工業	85,100	1,497.000	127,394,700	
藤倉コンポジット	7,100	1,211.000	8,598,100	
オカモト	4,100	5,210.000	21,361,000	
フコク	5,000	1,652.000	8,260,000	
ニッタ	9,100	3,610.000	32,851,000	
住友理工	14,000	1,448.000	20,272,000	
三ツ星ベルト	10,500	3,945.000	41,422,500	
バンドー化学	12,700	1,813.000	23,025,100	
日東紡績	11,200	5,540.000	62,048,000	
ＡＧＣ	85,400	4,321.000	369,013,400	
日本山村硝子	2,700	1,461.000	3,944,700	
日本電気硝子	35,000	3,222.000	112,770,000	
オハラ	5,300	1,375.000	7,287,500	
住友大阪セメント	14,600	3,864.000	56,414,400	
太平洋セメント	51,300	3,112.000	159,645,600	
日本ヒューム	8,400	1,269.000	10,659,600	
日本コンクリート工業	19,100	342.000	6,532,200	
三谷セキサン	4,000	5,620.000	22,480,000	
アジアパイルホールディングス	13,500	816.000	11,016,000	
東海カーボン	78,700	827.000	65,084,900	
日本カーボン	4,700	4,250.000	19,975,000	
東洋炭素	6,100	5,110.000	31,171,000	
ノリタケ	9,600	3,700.000	35,520,000	
ＴＯＴＯ	58,100	4,750.000	275,975,000	
日本碍子	100,700	1,828.500	184,129,950	
日本特殊陶業	72,900	3,926.000	286,205,400	
ダントーホールディングス	3,600	378.000	1,360,800	
ＭＡＲＵＷＡ	3,200	36,100.000	115,520,000	

品川リフラクトリーズ	10,700	1,659.000	17,751,300	
黒崎播磨	7,200	2,090.000	15,048,000	
ヨータイ	5,000	1,725.000	8,625,000	
東京窯業	10,700	406.000	4,344,200	
フジミインコーポレーテッド	23,800	2,217.000	52,764,600	
ニチアス	21,800	5,090.000	110,962,000	
ニチハ	10,900	3,480.000	37,932,000	
日本製鉄	420,200	2,998.000	1,259,759,600	
神戸製鋼所	179,900	1,657.500	298,184,250	
中山製鋼所	19,400	771.000	14,957,400	
合同製鐵	4,700	4,175.000	19,622,500	
ＪＦＥホールディングス	250,500	1,848.000	462,924,000	
東京製鐵	25,500	1,981.000	50,515,500	
共英製鋼	9,600	1,671.000	16,041,600	
大和工業	16,800	7,021.000	117,952,800	
東京鐵鋼	4,000	5,040.000	20,160,000	
大阪製鐵	5,300	3,340.000	17,702,000	
淀川製鋼所	9,800	5,440.000	53,312,000	
中部鋼鈑	6,500	2,329.000	15,138,500	
丸一鋼管	27,300	3,294.000	89,926,200	
モリ工業	2,000	5,330.000	10,660,000	
大同特殊鋼	56,000	1,359.000	76,104,000	
日本冶金工業	6,300	4,405.000	27,751,500	
山陽特殊製鋼	9,000	1,840.000	16,560,000	
愛知製鋼	5,100	3,480.000	17,748,000	
日本金属	3,600	653.000	2,350,800	
大平洋金属	8,100	1,310.000	10,611,000	
新日本電工	48,000	294.000	14,112,000	
栗本鐵工所	4,500	4,135.000	18,607,500	
三菱製鋼	6,400	1,302.000	8,332,800	
日本精線	7,300	1,074.000	7,840,200	
エンビプロ・ホールディングス	8,400	493.000	4,141,200	
新家工業	1,900	4,875.000	9,262,500	
大紀アルミニウム工業所	12,200	1,062.000	12,956,400	
日本軽金属ホールディングス	25,900	1,567.000	40,585,300	
三井金属鉱業	26,200	4,438.000	116,275,600	
三菱マテリアル	64,600	2,371.000	153,166,600	
住友金属鉱山	105,200	3,642.000	383,138,400	
ＤＯＷＡホールディングス	22,400	4,799.000	107,497,600	
古河機械金属	12,900	1,551.000	20,007,900	
大阪チタニウムテクノロジーズ	16,100	2,275.000	36,627,500	
東邦チタニウム	19,600	1,019.000	19,972,400	
ＵＡＣＪ	12,800	5,090.000	65,152,000	
ＣＫサンエツ	2,300	3,340.000	7,682,000	

古河電気工業	30,300	3,144.000	95,263,200	
住友電気工業	338,400	2,256.000	763,430,400	
フジクラ	106,800	4,136.000	441,724,800	
ＳＷＣＣ	10,400	5,130.000	53,352,000	
平河ヒューテック	6,300	1,431.000	9,015,300	
リョービ	9,700	1,918.000	18,604,600	
アーレスティ	7,100	583.000	4,139,300	
ＡＲＥホールディングス	34,300	1,788.000	61,328,400	
稲葉製作所	6,200	1,759.000	10,905,800	
宮地エンジニアリンググループ	5,200	4,135.000	21,502,000	
トーカロ	26,400	1,721.000	45,434,400	
アルファ	3,900	1,181.000	4,605,900	
ＳＵＭＣＯ	171,700	1,397.000	239,864,900	
川田テクノロジーズ	6,900	2,515.000	17,353,500	
ＲＳ　ＴＥＣＨＮＯＬＯＧＩＥＳ	6,500	3,475.000	22,587,500	
ジェイテックコーポレーション	1,600	1,543.000	2,468,800	
信和	7,900	764.000	6,035,600	
東洋製罐グループホールディングス	51,700	2,285.500	118,160,350	
ホッカンホールディングス	5,100	1,660.000	8,466,000	
横河ブリッジホールディングス	14,300	2,629.000	37,594,700	
駒井ハルテック	800	1,629.000	1,303,200	
三和ホールディングス	89,700	3,394.000	304,441,800	
文化シヤッター	24,300	1,631.000	39,633,300	
三協立山	11,300	727.000	8,215,100	
アルインコ	7,700	968.000	7,453,600	
ＬＩＸＩＬ	140,400	1,726.000	242,330,400	
ノーリツ	15,200	1,870.000	28,424,000	
長府製作所	9,600	2,005.000	19,248,000	
リンナイ	42,900	3,411.000	146,331,900	
日東精工	13,700	538.000	7,370,600	
岡部	16,300	743.000	12,110,900	
ジーテクト	10,800	1,544.000	16,675,200	
東プレ	15,300	1,742.000	26,652,600	
高周波熱錬	14,700	1,000.000	14,700,000	
東京製綱	5,800	1,045.000	6,061,000	
パイオラックス	12,000	2,296.000	27,552,000	
エイチワン	9,600	900.000	8,640,000	
日本発条	79,400	1,770.000	140,538,000	
中央発條	5,400	1,156.000	6,242,400	
立川ブラインド工業	4,400	1,262.000	5,552,800	
日本製鋼所	24,300	4,149.000	100,820,700	
三浦工業	37,100	3,437.000	127,512,700	
タクマ	29,500	1,541.000	45,459,500	
ツガミ	18,700	1,344.000	25,132,800	

オークマ	7,800	5,664.000	44,179,200	
芝浦機械	8,500	3,625.000	30,812,500	
アマダ	134,800	1,428.000	192,494,400	
アイダエンジニアリング	18,000	768.000	13,824,000	
ＦＵＪＩ	40,800	2,204.000	89,923,200	
牧野フライス製作所	9,500	5,540.000	52,630,000	
オーエスジー	38,500	1,932.500	74,401,250	
旭ダイヤモンド工業	21,200	832.000	17,638,400	
ＤＭＧ森精機	55,500	3,063.000	169,996,500	
ソディック	22,400	728.000	16,307,200	
ディスコ	42,600	33,710.000	1,436,046,000	
日東工器	4,300	2,301.000	9,894,300	
日進工具	7,100	748.000	5,310,800	
冨士ダイス	5,800	754.000	4,373,200	
豊和工業	5,500	814.000	4,477,000	
石川製作所	3,100	1,384.000	4,290,400	
リケンＮＰＲ	9,200	2,296.000	21,123,200	
島精機製作所	13,500	1,292.000	17,442,000	
オプトラン	14,500	1,686.000	24,447,000	
イワキ	6,100	2,654.000	16,189,400	
フリュー	9,200	1,058.000	9,733,600	
ヤマシンフィルタ	21,800	444.000	9,679,200	
日阪製作所	8,800	1,117.000	9,829,600	
やまびこ	13,900	2,238.000	31,108,200	
野村マイクロ・サイエンス	12,000	2,282.000	27,384,000	
平田機工	4,000	4,680.000	18,720,000	
ＰＥＧＡＳＵＳ	11,000	487.000	5,357,000	
マルマエ	4,300	1,521.000	6,540,300	
タツモ	6,400	2,514.000	16,089,600	
ナブテスコ	55,700	2,293.000	127,720,100	
三井海洋開発	11,200	2,736.000	30,643,200	
レオン自動機	9,900	1,348.000	13,345,200	
ＳＭＣ	26,500	58,630.000	1,553,695,000	
ホソカワミクロン	6,000	4,055.000	24,330,000	
ユニオンツール	3,800	5,620.000	21,356,000	
瑞光	7,300	1,230.000	8,979,000	
オイレス工業	11,100	2,011.000	22,322,100	
日精エー・エス・ビー機械	3,400	4,675.000	15,895,000	
サトーホールディングス	11,600	1,948.000	22,596,800	
技研製作所	8,100	1,731.000	14,021,100	
日本エアーテック	5,400	1,136.000	6,134,400	
日精樹脂工業	6,400	921.000	5,894,400	
ワイエイシイホールディングス	3,900	1,998.000	7,792,200	
小松製作所	414,500	3,661.000	1,517,484,500	

住友重機械工業	51,500	3,200.000	164,800,000	
日立建機	35,000	3,338.000	116,830,000	
日工	11,000	675.000	7,425,000	
巴工業	3,700	3,980.000	14,726,000	
井関農機	8,400	969.000	8,139,600	
ＴＯＷＡ	9,900	5,780.000	57,222,000	
ローツェ	46,000	1,805.000	83,030,000	
クボタ	462,400	1,921.500	888,501,600	
荏原実業	4,400	3,900.000	17,160,000	
三菱化工機	3,000	3,445.000	10,335,000	
月島ホールディングス	11,500	1,298.000	14,927,000	
帝国電機製作所	5,900	2,648.000	15,623,200	
新東工業	16,700	973.000	16,249,100	
澁谷工業	8,100	3,510.000	28,431,000	
アイチコーポレーション	12,200	1,152.000	14,054,400	
小森コーポレーション	21,300	1,121.000	23,877,300	
鶴見製作所	7,500	3,715.000	27,862,500	
酒井重工業	1,400	4,550.000	6,370,000	
荏原製作所	181,300	1,940.000	351,722,000	
酉島製作所	7,600	2,570.000	19,532,000	
北越工業	9,000	1,778.000	16,002,000	
ダイキン工業	105,600	17,505.000	1,848,528,000	
オルガノ	10,600	6,600.000	69,960,000	
トーヨーカネツ	2,900	3,950.000	11,455,000	
栗田工業	49,900	5,431.000	271,006,900	
椿本チエイン	11,800	5,670.000	66,906,000	
大同工業	6,300	789.000	4,970,700	
木村化工機	8,700	693.000	6,029,100	
アネスト岩田	13,200	1,283.000	16,935,600	
ダイフク	149,200	2,625.500	391,724,600	
サムコ	2,300	3,350.000	7,705,000	
加藤製作所	3,200	1,177.000	3,766,400	
タダノ	50,200	909.600	45,661,920	
フジテック	20,800	4,711.000	97,988,800	
ＣＫＤ	24,300	2,733.000	66,411,900	
平和	26,700	2,106.000	56,230,200	
理想科学工業	7,400	3,445.000	25,493,000	
ＳＡＮＫＹＯ	88,000	2,147.500	188,980,000	
日本金銭機械	10,800	911.000	9,838,800	
マースグループホールディングス	4,800	3,460.000	16,608,000	
フクシマガリレイ	5,900	5,340.000	31,506,000	
ダイコク電機	4,600	3,405.000	15,663,000	
竹内製作所	15,600	4,160.000	64,896,000	
アマノ	25,100	4,175.000	104,792,500	

ジャノメ	9,400	817.000	7,679,800	
マックス	12,000	3,465.000	41,580,000	
グローリー	20,700	2,562.000	53,033,400	
新晃工業	8,800	4,605.000	40,524,000	
大和冷機工業	13,500	1,460.000	19,710,000	
セガサミーホールディングス	79,100	2,900.000	229,390,000	
ＴＰＲ	10,000	2,203.000	22,030,000	
ツバキ・ナカシマ	19,300	676.000	13,046,800	
ホシザキ	58,200	4,704.000	273,772,800	
大豊工業	9,000	596.000	5,364,000	
日本精工	161,100	697.600	112,383,360	
ＮＴＮ	185,600	248.600	46,140,160	
ジェイテクト	77,000	1,049.500	80,811,500	
不二越	6,300	2,999.000	18,893,700	
日本トムソン	21,800	463.000	10,093,400	
ＴＨＫ	50,700	2,400.000	121,680,000	
ユーシン精機	7,900	631.000	4,984,900	
前澤給装工業	6,900	1,327.000	9,156,300	
イーグル工業	9,500	2,045.000	19,427,500	
前澤工業	4,900	1,212.000	5,938,800	
ＰＩＬＬＡＲ	7,900	3,920.000	30,968,000	
キッツ	29,500	1,012.000	29,854,000	
マキタ	101,000	4,630.000	467,630,000	
三井Ｅ＆Ｓ	43,700	1,105.000	48,288,500	
日立造船	77,500	953.000	73,857,500	
三菱重工業	1,546,700	1,825.500	2,823,500,850	
ＩＨＩ	66,800	6,754.000	451,167,200	
スター精密	15,300	1,856.000	28,396,800	
日清紡ホールディングス	65,000	903.300	58,714,500	
イビデン	46,300	4,370.000	202,331,000	
コニカミノルタ	197,300	402.700	79,452,710	
ブラザー工業	117,800	2,769.500	326,247,100	
ミネベアミツミ	153,900	2,576.500	396,523,350	
日立製作所	2,125,600	3,410.000	7,248,296,000	
三菱電機	969,400	2,302.500	2,232,043,500	
富士電機	53,800	7,807.000	420,016,600	
東洋電機製造	5,000	1,084.000	5,420,000	
安川電機	96,100	4,381.000	421,014,100	
シンフォニア　テクノロジー	10,000	4,590.000	45,900,000	
明電舎	16,400	3,070.000	50,348,000	
オリジン	3,500	1,187.000	4,154,500	
山洋電気	3,600	9,410.000	33,876,000	
デンヨー	6,900	2,399.000	16,553,100	
ＫＯＫＵＳＡＩ　ＥＬＥＣＴＲＩＣ	46,400	3,105.000	144,072,000	

ソシオネクスト	64,600	2,781.000	179,652,600	
東芝テック	11,400	3,350.000	38,190,000	
芝浦メカトロニクス	5,000	7,480.000	37,400,000	
マブチモーター	42,100	2,135.500	89,904,550	
ニデック	195,500	5,587.000	1,092,258,500	
トレックス・セミコンダクター	4,800	1,501.000	7,204,800	
東光高岳	5,300	1,727.000	9,153,100	
ダイヘン	8,300	6,310.000	52,373,000	
ヤーマン	17,100	823.000	14,073,300	
ＪＶＣケンウッド	69,900	1,316.000	91,988,400	
ミマキエンジニアリング	9,000	1,378.000	12,402,000	
Ｉ－ＰＥＸ	6,200	1,493.000	9,256,600	
大崎電気工業	21,000	727.000	15,267,000	
オムロン	67,700	5,980.000	404,846,000	
日東工業	11,400	3,005.000	34,257,000	
ＩＤＥＣ	12,700	2,538.000	32,232,600	
ジーエス・ユアサ　コーポレーション	34,200	2,881.000	98,530,200	
サクサ	1,700	2,291.000	3,894,700	
メルコホールディングス	3,300	3,805.000	12,556,500	
日本電気	116,200	13,305.000	1,546,041,000	
富士通	814,300	2,931.500	2,387,120,450	
沖電気工業	39,200	945.000	37,044,000	
電気興業	3,700	1,954.000	7,229,800	
サンケン電気	8,300	6,045.000	50,173,500	
アイホン	4,900	2,840.000	13,916,000	
ルネサスエレクトロニクス	674,200	2,023.500	1,364,243,700	
セイコーエプソン	113,200	2,565.500	290,414,600	
ワコム	64,900	632.000	41,016,800	
アルバック	19,400	7,198.000	139,641,200	
アクセル	4,400	1,331.000	5,856,400	
ＥＩＺＯ	6,300	4,335.000	27,310,500	
日本信号	19,000	947.000	17,993,000	
京三製作所	19,500	501.000	9,769,500	
能美防災	12,200	2,643.000	32,244,600	
ホーチキ	7,400	1,921.000	14,215,400	
エレコム	21,200	1,418.000	30,061,600	
パナソニック　ホールディングス	1,044,400	1,201.500	1,254,846,600	
シャープ	147,000	920.800	135,357,600	
アンリツ	62,200	1,074.500	66,833,900	
富士通ゼネラル	25,300	2,027.500	51,295,750	
ソニーグループ	613,400	12,805.000	7,854,587,000	
ＴＤＫ	140,100	8,514.000	1,192,811,400	
帝国通信工業	4,100	2,471.000	10,131,100	
タムラ製作所	36,200	587.000	21,249,400	

アルプスアルパイン	79,300	1,519.500	120,496,350	
日本電波工業	10,800	1,031.000	11,134,800	
鈴木	5,300	1,578.000	8,363,400	
メイコー	8,900	5,510.000	49,039,000	
日本トリム	2,200	3,660.000	8,052,000	
フォスター電機	8,200	1,652.000	13,546,400	
ＳＭＫ	2,500	2,265.000	5,662,500	
ヨコオ	7,500	1,477.000	11,077,500	
ホシデン	19,600	2,076.000	40,689,600	
ヒロセ電機	12,800	18,015.000	230,592,000	
日本航空電子工業	21,100	2,436.000	51,399,600	
ＴＯＡ	10,100	942.000	9,514,200	
マクセル	19,000	1,744.000	33,136,000	
古野電気	11,500	1,571.000	18,066,500	
スミダコーポレーション	11,500	878.000	10,097,000	
アイコム	3,600	2,591.000	9,327,600	
リオン	3,800	1,986.000	7,546,800	
横河電機	96,800	3,543.000	342,962,400	
新電元工業	3,400	2,317.000	7,877,800	
アズビル	60,200	4,626.000	278,485,200	
東亜ディーケーケー	5,600	847.000	4,743,200	
日本光電工業	73,800	2,063.000	152,249,400	
チノー	3,700	2,160.000	7,992,000	
日本電子材料	6,500	2,330.000	15,145,000	
堀場製作所	16,500	8,945.000	147,592,500	
アドバンテスト	251,000	6,016.000	1,510,016,000	
エスペック	7,100	2,364.000	16,784,400	
キーエンス	87,600	65,430.000	5,731,668,000	
日置電機	4,600	7,950.000	36,570,000	
シスメックス	227,100	2,821.000	640,649,100	
日本マイクロニクス	15,600	3,545.000	55,302,000	
メガチップス	6,800	5,060.000	34,408,000	
ＯＢＡＲＡ　ＧＲＯＵＰ	5,900	3,875.000	22,862,500	
コーセル	9,800	1,026.000	10,054,800	
イリソ電子工業	7,800	2,447.000	19,086,600	
オプテックスグループ	15,600	1,621.000	25,287,600	
千代田インテグレ	3,800	3,620.000	13,756,000	
レーザーテック	40,100	22,290.000	893,829,000	
スタンレー電気	56,000	2,743.000	153,608,000	
ウシオ電機	42,300	2,042.500	86,397,750	
日本セラミック	10,000	2,490.000	24,900,000	
遠藤照明	3,200	1,368.000	4,377,600	
山一電機	7,700	2,319.000	17,856,300	
図研	7,400	3,435.000	25,419,000	

日本電子	21,900	5,204.000	113,967,600	
カシオ計算機	63,200	1,141.500	72,142,800	
ファナック	423,900	3,778.000	1,601,494,200	
日本シイエムケイ	19,800	382.000	7,563,600	
エンプラス	2,600	5,850.000	15,210,000	
大真空	12,700	579.000	7,353,300	
ローム	158,900	1,497.000	237,873,300	
浜松ホトニクス	70,100	3,421.000	239,812,100	
三井ハイテック	38,800	811.000	31,466,800	
新光電気工業	29,100	5,542.000	161,272,200	
京セラ	544,100	1,668.000	907,558,800	
太陽誘電	42,700	2,789.500	119,111,650	
村田製作所	782,400	2,635.000	2,061,624,000	
双葉電子工業	17,400	500.000	8,700,000	
北陸電気工業	3,200	1,307.000	4,182,400	
ニチコン	21,200	937.000	19,864,400	
ＫＯＡ	12,700	1,121.000	14,236,700	
市光工業	15,900	408.000	6,487,200	
小糸製作所	91,100	1,962.000	178,738,200	
ミツバ	16,200	912.000	14,774,400	
ＳＣＲＥＥＮホールディングス	29,900	9,577.000	286,352,300	
キヤノン電子	9,100	2,179.000	19,828,900	
キヤノン	436,900	4,723.000	2,063,478,700	
リコー	219,500	1,505.000	330,347,500	
象印マホービン	32,000	1,666.000	53,312,000	
東京エレクトロン	185,300	22,440.000	4,158,132,000	
イノテック	6,500	1,426.000	9,269,000	
トヨタ紡織	35,700	1,817.000	64,866,900	
ユニプレス	15,100	1,076.000	16,247,600	
豊田自動織機	75,500	10,525.000	794,637,500	
モリタホールディングス	14,600	1,978.000	28,878,800	
三櫻工業	13,000	729.000	9,477,000	
デンソー	720,700	2,011.500	1,449,688,050	
東海理化電機製作所	25,100	1,921.000	48,217,100	
川崎重工業	72,100	4,933.000	355,669,300	
名村造船所	26,100	1,398.000	36,487,800	
日本車輌製造	3,300	2,086.000	6,883,800	
三菱ロジスネクスト	15,200	1,266.000	19,243,200	
日産自動車	1,149,100	382.700	439,760,570	
いすゞ自動車	247,700	1,988.500	492,551,450	
トヨタ自動車	4,655,300	2,406.000	11,200,651,800	
日野自動車	133,400	408.900	54,547,260	
三菱自動車工業	344,600	372.300	128,294,580	
武蔵精密工業	22,300	1,849.000	41,232,700	

日産車体	6,700	995.000	6,666,500	
新明和工業	25,900	1,262.000	32,685,800	
極東開発工業	14,300	2,554.000	36,522,200	
トピー工業	7,100	1,970.000	13,987,000	
ティラド	2,400	3,520.000	8,448,000	
タチエス	16,300	1,858.000	30,285,400	
ＮＯＫ	34,100	2,258.000	76,997,800	
フタバ産業	23,900	682.000	16,299,800	
カヤバ	7,900	4,640.000	36,656,000	
大同メタル工業	19,500	474.000	9,243,000	
プレス工業	36,200	571.000	20,670,200	
太平洋工業	18,400	1,356.000	24,950,400	
アイシン	63,000	4,662.000	293,706,000	
マツダ	283,700	1,037.000	294,196,900	
今仙電機製作所	6,300	577.000	3,635,100	
本田技研工業	2,072,600	1,457.000	3,019,778,200	
スズキ	643,200	1,507.000	969,302,400	
ＳＵＢＡＲＵ	270,900	2,340.000	633,906,000	
安永	4,400	597.000	2,626,800	
ヤマハ発動機	370,700	1,238.500	459,111,950	
エクセディ	13,800	3,100.000	42,780,000	
豊田合成	23,800	2,362.000	56,215,600	
愛三工業	14,000	1,398.000	19,572,000	
日本プラスト	10,500	368.000	3,864,000	
ヨロズ	9,500	1,073.000	10,193,500	
エフ・シー・シー	14,200	2,360.000	33,512,000	
シマノ	38,300	25,085.000	960,755,500	
テイ・エス　テック	32,200	1,735.000	55,867,000	
ジャムコ	7,900	1,257.000	9,930,300	
テルモ	488,300	2,621.500	1,280,078,450	
日機装	19,100	981.000	18,737,100	
日本エム・ディ・エム	6,000	731.000	4,386,000	
島津製作所	116,200	4,551.000	528,826,200	
長野計器	6,200	2,419.000	14,997,800	
ブイ・テクノロジー	4,700	2,444.000	11,486,800	
東京計器	6,700	2,729.000	18,284,300	
愛知時計電機	3,800	1,974.000	7,501,200	
インターアクション	5,500	1,162.000	6,391,000	
オーバル	7,300	381.000	2,781,300	
東京精密	18,000	7,032.000	126,576,000	
マニー	35,200	1,800.500	63,377,600	
ニコン	126,100	1,430.500	180,386,050	
トプコン	42,800	1,445.000	61,846,000	
オリンパス	501,800	2,544.000	1,276,579,200	

理研計器	12,700	3,945.000	50,101,500	
タムロン	12,000	4,360.000	52,320,000	
ＨＯＹＡ	172,400	19,170.000	3,304,908,000	
ノーリツ鋼機	8,200	4,040.000	33,128,000	
Ａ＆Ｄホロンホールディングス	12,500	2,089.000	26,112,500	
朝日インテック	106,900	2,596.000	277,512,400	
シチズン時計	78,600	900.000	70,740,000	
リズム	1,300	3,995.000	5,193,500	
メニコン	30,500	1,297.500	39,573,750	
松風	4,000	4,655.000	18,620,000	
セイコーグループ	12,400	3,715.000	46,066,000	
ニプロ	73,300	1,342.500	98,405,250	
パラマウントベッドホールディングス	18,900	2,483.000	46,928,700	
トランザクション	6,100	2,200.000	13,420,000	
ニホンフラッシュ	8,600	888.000	7,636,800	
前田工繊	15,200	1,680.000	25,536,000	
永大産業	17,800	221.000	3,933,800	
アートネイチャー	9,800	821.000	8,045,800	
フルヤ金属	8,300	3,755.000	31,166,500	
バンダイナムコホールディングス	235,400	3,221.000	758,223,400	
ＳＨＯＥＩ	24,400	2,199.000	53,655,600	
フランスベッドホールディングス	10,500	1,215.000	12,757,500	
パイロットコーポレーション	13,500	4,376.000	59,076,000	
萩原工業	6,300	1,429.000	9,002,700	
フジシールインターナショナル	17,400	2,314.000	40,263,600	
タカラトミー	39,600	3,853.000	152,578,800	
広済堂ホールディングス	29,800	506.000	15,078,800	
プロネクサス	7,800	1,250.000	9,750,000	
ＴＯＰＰＡＮホールディングス	104,700	4,237.000	443,613,900	
大日本印刷	90,900	5,031.000	457,317,900	
共同印刷	2,800	3,360.000	9,408,000	
ＮＩＳＳＨＡ	15,100	1,936.000	29,233,600	
ＴＡＫＡＲＡ　＆　ＣＯＭＰＡＮＹ	5,300	2,741.000	14,527,300	
アシックス	323,400	2,728.000	882,235,200	
ツツミ	3,200	2,192.000	7,014,400	
ローランド	6,500	3,650.000	23,725,000	
小松ウオール工業	3,300	2,972.000	9,807,600	
ヤマハ	54,000	3,514.000	189,756,000	
河合楽器製作所	2,900	2,778.000	8,056,200	
クリナップ	9,800	690.000	6,762,000	
ピジョン	55,700	1,524.000	84,886,800	
キングジム	8,800	843.000	7,418,400	
リンテック	17,100	3,240.000	55,404,000	
イトーキ	17,500	1,465.000	25,637,500	

任天堂	553,000	7,546.000	4,172,938,000	
三菱鉛筆	12,200	2,436.000	29,719,200	
タカラスタンダード	17,700	1,570.000	27,789,000	
コクヨ	43,200	2,493.500	107,719,200	
グローブライド	7,100	1,810.000	12,851,000	
オカムラ	25,600	2,001.000	51,225,600	
美津濃	8,600	8,940.000	76,884,000	
東京電力ホールディングス	790,500	633.200	500,544,600	
中部電力	321,900	1,688.000	543,367,200	
関西電力	338,000	2,344.000	792,272,000	
中国電力	151,400	965.200	146,131,280	
北陸電力	89,000	923.700	82,209,300	
東北電力	229,700	1,347.000	309,405,900	
四国電力	80,400	1,282.500	103,113,000	
九州電力	201,300	1,563.000	314,631,900	
北海道電力	84,300	955.900	80,582,370	
沖縄電力	22,300	1,060.000	23,638,000	
電源開発	72,100	2,365.000	170,516,500	
エフオン	9,900	370.000	3,663,000	
イーレックス	17,200	697.000	11,988,400	
レノバ	24,800	930.000	23,064,000	
東京瓦斯	170,800	3,364.000	574,571,200	
大阪瓦斯	174,800	3,336.000	583,132,800	
東邦瓦斯	38,200	4,096.000	156,467,200	
北海道瓦斯	5,100	3,060.000	15,606,000	
広島ガス	20,700	386.000	7,990,200	
西部ガスホールディングス	9,000	1,856.000	16,704,000	
静岡ガス	19,400	1,086.000	21,068,400	
メタウォーター	10,900	1,694.000	18,464,600	
ＳＢＳホールディングス	9,000	2,453.000	22,077,000	
東武鉄道	96,000	2,590.000	248,640,000	
相鉄ホールディングス	31,900	2,414.000	77,006,600	
東急	247,000	1,868.500	461,519,500	
京浜急行電鉄	109,200	1,175.500	128,364,600	
小田急電鉄	145,500	1,726.000	251,133,000	
京王電鉄	42,400	3,594.000	152,385,600	
京成電鉄	56,800	4,524.000	256,963,200	
富士急行	12,100	2,605.000	31,520,500	
東日本旅客鉄道	483,600	2,890.000	1,397,604,000	
西日本旅客鉄道	208,200	2,702.500	562,660,500	
東海旅客鉄道	337,900	3,341.000	1,128,923,900	
西武ホールディングス	106,700	3,839.000	409,621,300	
鴻池運輸	16,800	2,363.000	39,698,400	
西日本鉄道	23,400	2,271.500	53,153,100	

ハマキョウレックス	7,200	4,900.000	35,280,000	
サカイ引越センター	11,000	2,442.000	26,862,000	
近鉄グループホールディングス	87,500	3,537.000	309,487,500	
阪急阪神ホールディングス	117,000	4,500.000	526,500,000	
南海電気鉄道	39,500	2,358.500	93,160,750	
京阪ホールディングス	48,400	3,055.000	147,862,000	
神戸電鉄	3,000	2,605.000	7,815,000	
名古屋鉄道	90,700	1,715.000	155,550,500	
山陽電気鉄道	6,500	2,023.000	13,149,500	
ヤマトホールディングス	107,300	1,641.500	176,132,950	
山九	21,500	4,777.000	102,705,500	
丸全昭和運輸	5,900	4,950.000	29,205,000	
センコーグループホールディングス	46,900	1,231.000	57,733,900	
トナミホールディングス	2,000	5,660.000	11,320,000	
ニッコンホールディングス	27,200	3,755.000	102,136,000	
福山通運	9,800	3,745.000	36,701,000	
セイノーホールディングス	49,700	2,399.500	119,255,150	
神奈川中央交通	3,000	3,345.000	10,035,000	
ＡＺ－ＣＯＭ丸和ホールディングス	25,600	1,103.000	28,236,800	
九州旅客鉄道	61,900	4,143.000	256,451,700	
ＳＧホールディングス	147,900	1,553.000	229,688,700	
ＮＩＰＰＯＮ　ＥＸＰＲＥＳＳホールディングス	32,600	7,156.000	233,285,600	
日本郵船	226,100	4,836.000	1,093,419,600	
商船三井	189,100	4,802.000	908,058,200	
川崎汽船	210,400	1,998.500	420,484,400	
ＮＳユナイテッド海運	4,800	4,290.000	20,592,000	
明海グループ	7,400	713.000	5,276,200	
飯野海運	33,200	1,181.000	39,209,200	
乾汽船	12,600	1,138.000	14,338,800	
日本航空	213,700	2,453.000	524,206,100	
ＡＮＡホールディングス	238,500	3,031.000	722,893,500	
トランコム	2,600	7,330.000	19,058,000	
日新	6,700	4,250.000	28,475,000	
三菱倉庫	20,500	5,232.000	107,256,000	
三井倉庫ホールディングス	8,100	5,990.000	48,519,000	
住友倉庫	22,800	2,682.000	61,149,600	
澁澤倉庫	3,300	2,896.000	9,556,800	
東陽倉庫	3,700	1,321.000	4,887,700	
日本トランスシティ	17,900	894.000	16,002,600	
川西倉庫	5,200	1,120.000	5,824,000	
安田倉庫	6,600	1,639.000	10,817,400	
上組	40,100	3,271.000	131,167,100	
キムラユニティー	4,000	1,449.000	5,796,000	
キユーソー流通システム	6,700	1,881.000	12,602,700	

エーアイテイー	5,400	1,655.000	8,937,000	
内外トランスライン	3,500	2,730.000	9,555,000	
日本コンセプト	3,300	1,632.000	5,385,600	
ＮＥＣネッツエスアイ	33,900	2,656.000	90,038,400	
クロスキャット	7,100	1,134.000	8,051,400	
システナ	134,900	374.000	50,452,600	
デジタルアーツ	5,400	4,490.000	24,246,000	
日鉄ソリューションズ	30,600	3,670.000	112,302,000	
キューブシステム	3,500	1,027.000	3,594,500	
コア	3,300	1,866.000	6,157,800	
手間いらず	1,900	3,400.000	6,460,000	
ラクーンホールディングス	8,100	738.000	5,977,800	
ソリトンシステムズ	4,800	1,034.000	4,963,200	
ソフトクリエイトホールディングス	7,100	1,718.000	12,197,800	
ＴＩＳ	92,700	3,574.000	331,309,800	
グリー	30,500	436.000	13,298,000	
コーエーテクモホールディングス	55,000	1,630.500	89,677,500	
三菱総合研究所	3,900	4,040.000	15,756,000	
ファインデックス	7,900	853.000	6,738,700	
ブレインパッド	7,500	823.000	6,172,500	
ポールトゥウィンホールディングス	15,000	433.000	6,495,000	
ネクソン	193,100	2,697.000	520,790,700	
アイスタイル	29,900	516.000	15,428,400	
エムアップホールディングス	11,100	1,272.000	14,119,200	
エイチーム	6,700	622.000	4,167,400	
エニグモ	12,700	328.000	4,165,600	
コロプラ	32,000	560.000	17,920,000	
ブロードリーフ	43,900	645.000	28,315,500	
デジタルハーツホールディングス	5,700	817.000	4,656,900	
メディアドゥ	4,300	1,400.000	6,020,000	
じげん	25,500	578.000	14,739,000	
フィックスターズ	9,800	1,581.000	15,493,800	
ＣＡＲＴＡ　ＨＯＬＤＩＮＧＳ	4,600	1,361.000	6,260,600	
オプティム	8,500	585.000	4,972,500	
セレス	4,000	1,246.000	4,984,000	
ＳＨＩＦＴ	5,900	12,470.000	73,573,000	
ティーガイア	9,500	3,800.000	36,100,000	
セック	1,300	4,135.000	5,375,500	
テクマトリックス	16,800	2,377.000	39,933,600	
プロシップ	3,900	1,501.000	5,853,900	
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	22,800	3,003.000	68,468,400	
ＧＭＯペイメントゲートウェイ	20,100	9,117.000	183,251,700	
システムリサーチ	5,600	1,431.000	8,013,600	
インターネットイニシアティブ	41,900	3,018.000	126,454,200	

さくらインターネット	11,100	4,285.000	47,563,500	
GMOグローバルサイン・ホールディングス	2,700	2,785.000	7,519,500	
ＳＲＡホールディングス	4,200	4,200.000	17,640,000	
朝日ネット	5,600	645.000	3,612,000	
ｅＢＡＳＥ	12,200	615.000	7,503,000	
アバントグループ	10,700	2,193.000	23,465,100	
アドソル日進	3,500	1,723.000	6,030,500	
フリービット	4,600	1,235.000	5,681,000	
コムチュア	12,300	1,529.000	18,806,700	
アイル	5,400	2,778.000	15,001,200	
マークラインズ	5,000	2,902.000	14,510,000	
メディカル・データ・ビジョン	12,600	503.000	6,337,800	
テラスカイ	4,300	2,146.000	9,227,800	
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	4,700	2,004.000	9,418,800	
ネオジャパン	3,200	1,989.000	6,364,800	
ＰＲ　ＴＩＭＥＳ	2,200	1,740.000	3,828,000	
ラクス	41,700	2,251.000	93,866,700	
ダブルスタンダード	3,400	1,477.000	5,021,800	
オープンドア	6,300	697.000	4,391,100	
アカツキ	4,500	1,994.000	8,973,000	
ＵＢＩＣＯＭホールディングス	3,100	1,411.000	4,374,100	
カナミックネットワーク	12,200	534.000	6,514,800	
チェンジホールディングス	19,600	1,225.000	24,010,000	
シンクロ・フード	2,300	516.000	1,186,800	
オークネット	4,000	2,317.000	9,268,000	
セグエグループ	4,500	641.000	2,884,500	
マクロミル	17,000	785.000	13,345,000	
オロ	3,700	2,460.000	9,102,000	
ユーザーローカル	3,800	1,866.000	7,090,800	
マネーフォワード	21,600	5,764.000	124,502,400	
ＳＵＮ　ＡＳＴＥＲＩＳＫ	6,600	537.000	3,544,200	
プラスアルファ・コンサルティング	11,300	2,128.000	24,046,400	
電算システムホールディングス	4,200	2,610.000	10,962,000	
ＡＰＰＩＥＲ　ＧＲＯＵＰ	30,100	1,729.000	52,042,900	
ビジョナル	10,400	8,480.000	88,192,000	
プロトコーポレーション	9,900	1,440.000	14,256,000	
野村総合研究所	190,300	5,101.000	970,720,300	
日本システム技術	8,400	1,851.000	15,548,400	
インテージホールディングス	10,200	1,635.000	16,677,000	
東邦システムサイエンス	3,800	1,488.000	5,654,400	
シンプレクス・ホールディングス	13,500	2,364.000	31,914,000	
ＨＥＲＯＺ	4,100	1,033.000	4,235,300	
ラクスル	22,000	1,130.000	24,860,000	
メルカリ	43,000	2,497.500	107,392,500	

ＩＰＳ	2,900	2,199.000	6,377,100	
システムサポート	3,300	2,031.000	6,702,300	
イーソル	7,500	715.000	5,362,500	
ウイングアーク１ｓｔ	9,500	3,005.000	28,547,500	
サーバーワークス	2,100	2,751.000	5,777,100	
Ｓａｎｓａｎ	29,100	2,277.000	66,260,700	
ギフティ	8,000	1,082.000	8,656,000	
メドレー	11,900	3,305.000	39,329,500	
ベース	4,300	3,185.000	13,695,500	
ＪＭＤＣ	15,200	4,650.000	70,680,000	
フォーカスシステムズ	6,000	1,103.000	6,618,000	
クレスコ	14,000	1,310.000	18,340,000	
フジ・メディア・ホールディングス	83,500	1,685.500	140,739,250	
オービック	29,400	25,875.000	760,725,000	
ジャストシステム	12,600	3,545.000	44,667,000	
ＴＤＣソフト	16,800	1,190.000	19,992,000	
ＬＩＮＥヤフー	1,235,900	406.000	501,775,400	
トレンドマイクロ	46,200	8,865.000	409,563,000	
ＩＤホールディングス	5,900	1,375.000	8,112,500	
日本オラクル	16,600	13,895.000	230,657,000	
アルファシステムズ	2,500	2,836.000	7,090,000	
フューチャー	21,800	1,796.000	39,152,800	
ＣＡＣ　ＨＯＬＤＩＮＧＳ	4,300	1,752.000	7,533,600	
オービックビジネスコンサルタント	12,300	7,394.000	90,946,200	
アイティフォー	10,900	1,374.000	14,976,600	
東計電算	2,800	4,820.000	13,496,000	
大塚商会	99,300	3,542.000	351,720,600	
サイボウズ	12,700	1,690.000	21,463,000	
電通総研	10,000	5,470.000	54,700,000	
ＡＣＣＥＳＳ	10,400	1,719.000	17,877,600	
デジタルガレージ	14,300	2,850.000	40,755,000	
イーエムシステムズ	14,500	523.000	7,583,500	
ウェザーニューズ	2,700	5,720.000	15,444,000	
ＣＩＪ	23,400	424.000	9,921,600	
ビジネスエンジニアリング	1,900	3,980.000	7,562,000	
WOWOW	7,000	1,046.000	7,322,000	
スカラ	9,000	467.000	4,203,000	
ＡＮＹＣＯＬＯＲ	12,700	2,390.000	30,353,000	
ＩＭＡＧＩＣＡ　ＧＲＯＵＰ	8,700	479.000	4,167,300	
ネットワンシステムズ	34,800	3,612.000	125,697,600	
システムソフト	27,400	60.000	1,644,000	
アルゴグラフィックス	8,200	5,120.000	41,984,000	
マーベラス	14,200	581.000	8,250,200	
エイベックス	15,200	1,478.000	22,465,600	

ＢＩＰＲＯＧＹ	28,700	4,884.000	140,170,800	
都築電気	4,500	2,213.000	9,958,500	
ＴＢＳホールディングス	44,000	3,946.000	173,624,000	
日本テレビホールディングス	77,500	2,335.000	180,962,500	
朝日放送グループホールディングス	9,600	638.000	6,124,800	
テレビ朝日ホールディングス	20,800	1,971.000	40,996,800	
スカパーＪＳＡＴホールディングス	67,900	837.000	56,832,300	
テレビ東京ホールディングス	6,000	3,710.000	22,260,000	
日本ＢＳ放送	3,500	887.000	3,104,500	
ビジョン	13,400	1,302.000	17,446,800	
Ｕ－ＮＥＸＴ　ＨＯＬＤＩＮＧＳ	10,100	5,610.000	56,661,000	
日本通信	91,400	159.000	14,532,600	
日本電信電話	26,116,700	148.400	3,875,718,280	
ＫＤＤＩ	645,900	4,737.000	3,059,628,300	
ソフトバンク	1,404,200	1,988.500	2,792,251,700	
光通信	8,700	32,160.000	279,792,000	
エムティーアイ	7,400	1,139.000	8,428,600	
ＧＭＯインターネットグループ	31,700	2,397.500	76,000,750	
ファイバーゲート	5,000	1,046.000	5,230,000	
ＫＡＤＯＫＡＷＡ	46,500	2,989.000	138,988,500	
学研ホールディングス	14,600	994.000	14,512,400	
ゼンリン	14,500	858.000	12,441,000	
アイネット	5,600	1,515.000	8,484,000	
松竹	4,700	10,270.000	48,269,000	
東宝	48,800	5,845.000	285,236,000	
東映	14,500	4,515.000	65,467,500	
ＮＴＴデータグループ	230,300	2,465.000	567,689,500	
ピー・シー・エー	5,700	1,978.000	11,274,600	
ビジネスブレイン太田昭和	3,300	1,828.000	6,032,400	
ＤＴＳ	17,900	3,965.000	70,973,500	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	40,000	5,435.000	217,400,000	
シーイーシー	11,700	1,798.000	21,036,600	
カプコン	156,900	3,226.000	506,159,400	
アイ・エス・ビー	4,600	1,457.000	6,702,200	
ＳＣＳＫ	62,000	2,996.000	185,752,000	
ＮＳＷ	3,300	2,970.000	9,801,000	
アイネス	6,400	1,600.000	10,240,000	
ＴＫＣ	14,900	3,805.000	56,694,500	
富士ソフト	24,100	9,350.000	225,335,000	
ＮＳＤ	30,700	3,290.000	101,003,000	
コナミグループ	32,900	13,840.000	455,336,000	
福井コンピュータホールディングス	5,200	2,471.000	12,849,200	
ＪＢＣＣホールディングス	5,900	4,375.000	25,812,500	
ミロク情報サービス	7,900	1,837.000	14,512,300	

ソフトバンクグループ	433,300	8,168.000	3,539,194,400	
リョーサン菱洋ホールディングス	17,300	2,592.000	44,841,600	
高千穂交易	3,000	3,910.000	11,730,000	
伊藤忠食品	2,200	7,200.000	15,840,000	
エレマテック	8,000	1,714.000	13,712,000	
あらた	14,100	3,555.000	50,125,500	
トーメンデバイス	1,400	5,530.000	7,742,000	
東京エレクトロン　デバイス	9,400	3,485.000	32,759,000	
円谷フィールズホールディングス	16,800	2,250.000	37,800,000	
双日	102,000	3,185.000	324,870,000	
アルフレッサ　ホールディングス	93,100	2,319.500	215,945,450	
横浜冷凍	24,300	955.000	23,206,500	
ラサ商事	5,000	1,407.000	7,035,000	
アルコニックス	12,000	1,348.000	16,176,000	
神戸物産	72,000	4,573.000	329,256,000	
あい　ホールディングス	15,000	2,342.000	35,130,000	
ダイワボウホールディングス	40,800	2,688.500	109,690,800	
マクニカホールディングス	21,700	5,620.000	121,954,000	
ラクト・ジャパン	3,900	2,909.000	11,345,100	
グリムス	3,900	2,599.000	10,136,100	
バイタルケーエスケー・ホールディングス	14,200	1,203.000	17,082,600	
八洲電機	6,900	1,575.000	10,867,500	
メディアスホールディングス	7,000	782.000	5,474,000	
レスター	8,000	2,637.000	21,096,000	
ジオリーブグループ	1,600	1,118.000	1,788,800	
ＴＯＫＡＩホールディングス	46,500	988.000	45,942,000	
三洋貿易	9,900	1,455.000	14,404,500	
ビューティガレージ	3,300	1,603.000	5,289,900	
ウイン・パートナーズ	5,200	1,144.000	5,948,800	
シップヘルスケアホールディングス	33,500	2,132.000	71,422,000	
スターティアホールディングス	1,000	1,994.000	1,994,000	
コメダホールディングス	22,800	2,721.000	62,038,800	
フルサト・マルカホールディングス	8,300	2,197.000	18,235,100	
ヤマエグループホールディングス	9,100	1,955.000	17,790,500	
小野建	8,700	1,471.000	12,797,700	
南陽	5,000	1,067.000	5,335,000	
佐鳥電機	6,300	1,847.000	11,636,100	
エコートレーディング	2,500	930.000	2,325,000	
伯東	5,200	4,580.000	23,816,000	
コンドーテック	7,000	1,213.000	8,491,000	
ナガイレーベン	12,000	2,461.000	29,532,000	
三菱食品	9,300	5,220.000	48,546,000	
松田産業	6,800	3,085.000	20,978,000	
第一興商	34,500	1,731.000	59,719,500	

メディパルホールディングス	94,000	2,590.000	243,460,000	
ＳＰＫ	4,200	1,969.000	8,269,800	
萩原電気ホールディングス	4,300	3,440.000	14,792,000	
アズワン	29,000	2,800.500	81,214,500	
スズデン	3,800	1,793.000	6,813,400	
尾家産業	2,500	2,016.000	5,040,000	
シモジマ	6,600	1,279.000	8,441,400	
ドウシシャ	8,800	2,130.000	18,744,000	
高速	5,200	2,371.000	12,329,200	
たけびし	3,400	2,367.000	8,047,800	
リックス	2,300	2,826.000	6,499,800	
丸文	8,300	1,015.000	8,424,500	
ハピネット	9,400	3,980.000	37,412,000	
日本ライフライン	25,900	1,178.000	30,510,200	
タカショー	11,900	475.000	5,652,500	
ＩＤＯＭ	26,300	1,049.000	27,588,700	
進和	5,800	2,574.000	14,929,200	
ダイトロン	3,600	2,592.000	9,331,200	
シークス	12,500	1,027.000	12,837,500	
オーハシテクニカ	4,700	1,779.000	8,361,300	
白銅	2,600	2,423.000	6,299,800	
伊藤忠商事	622,800	7,310.000	4,552,668,000	
丸紅	767,500	2,208.000	1,694,640,000	
長瀬産業	41,100	3,141.000	129,095,100	
蝶理	5,500	3,470.000	19,085,000	
豊田通商	242,800	2,502.000	607,485,600	
三共生興	14,800	561.000	8,302,800	
兼松	37,100	2,394.000	88,817,400	
三井物産	1,387,600	2,822.500	3,916,501,000	
日本紙パルプ商事	4,600	6,650.000	30,590,000	
カメイ	9,500	1,992.000	18,924,000	
スターゼン	6,200	2,939.000	18,221,800	
山善	27,200	1,346.000	36,611,200	
椿本興業	6,000	1,747.000	10,482,000	
住友商事	559,900	3,118.000	1,745,768,200	
内田洋行	3,700	6,660.000	24,642,000	
三菱商事	1,778,800	2,824.500	5,024,220,600	
第一実業	9,200	2,249.000	20,690,800	
キヤノンマーケティングジャパン	21,400	4,741.000	101,457,400	
西華産業	4,000	3,835.000	15,340,000	
佐藤商事	6,200	1,347.000	8,351,400	
東京産業	8,900	691.000	6,149,900	
ユアサ商事	7,300	5,020.000	36,646,000	
神鋼商事	2,300	6,570.000	15,111,000	

阪和興業	16,100	4,820.000	77,602,000	
正栄食品工業	6,100	4,540.000	27,694,000	
カナデン	6,700	1,402.000	9,393,400	
ＲＹＯＤＥＮ	7,100	2,442.000	17,338,200	
岩谷産業	20,900	7,852.000	164,106,800	
ナイス	2,600	1,864.000	4,846,400	
極東貿易	5,400	1,476.000	7,970,400	
アステナホールディングス	18,300	504.000	9,223,200	
三愛オブリ	22,200	1,944.000	43,156,800	
稲畑産業	17,400	3,235.000	56,289,000	
ＧＳＩクレオス	5,000	1,962.000	9,810,000	
明和産業	12,500	645.000	8,062,500	
ワキタ	16,100	1,591.000	25,615,100	
東邦ホールディングス	25,100	4,759.000	119,450,900	
サンゲツ	21,200	2,810.000	59,572,000	
ミツウロコグループホールディングス	12,800	1,640.000	20,992,000	
シナネンホールディングス	2,900	6,250.000	18,125,000	
伊藤忠エネクス	22,900	1,580.000	36,182,000	
サンリオ	76,200	3,755.000	286,131,000	
サンワ　テクノス	4,600	1,934.000	8,896,400	
新光商事	12,600	963.000	12,133,800	
トーホー	4,000	2,665.000	10,660,000	
三信電気	3,900	1,956.000	7,628,400	
東陽テクニカ	9,100	1,669.000	15,187,900	
モスフードサービス	13,300	3,485.000	46,350,500	
加賀電子	8,000	5,340.000	42,720,000	
ソーダニッカ	9,700	1,151.000	11,164,700	
立花エレテック	6,400	2,507.000	16,044,800	
フォーバル	1,700	1,367.000	2,323,900	
ＰＡＬＴＡＣ	13,100	4,237.000	55,504,700	
三谷産業	19,000	320.000	6,080,000	
太平洋興発	3,400	735.000	2,499,000	
西本Ｗｉｓｍｅｔｔａｃホールディングス	6,900	1,332.000	9,190,800	
コーア商事ホールディングス	4,300	601.000	2,584,300	
ＫＰＰグループホールディングス	24,800	664.000	16,467,200	
ヤマタネ	4,500	3,175.000	14,287,500	
泉州電業	6,500	4,655.000	30,257,500	
トラスコ中山	18,900	2,430.000	45,927,000	
オートバックスセブン	31,900	1,469.000	46,861,100	
モリト	7,100	1,340.000	9,514,000	
加藤産業	11,300	4,250.000	48,025,000	
イエローハット	15,000	2,397.000	35,955,000	
ＪＫホールディングス	7,800	966.000	7,534,800	
日伝	6,400	3,210.000	20,544,000	

杉本商事	4,300	3,085.000	13,265,500	
因幡電機産業	23,400	3,825.000	89,505,000	
東テク	9,700	2,393.000	23,212,100	
ミスミグループ本社	140,200	2,525.500	354,075,100	
タキヒヨー	3,200	1,199.000	3,836,800	
スズケン	34,300	5,162.000	177,056,600	
ジェコス	6,100	889.000	5,422,900	
サンエー	13,200	2,599.000	34,306,800	
カワチ薬品	7,000	2,658.000	18,606,000	
エービーシー・マート	41,600	3,111.000	129,417,600	
ハードオフコーポレーション	3,500	1,919.000	6,716,500	
アスクル	22,600	2,009.000	45,403,400	
ゲオホールディングス	10,400	1,511.000	15,714,400	
アダストリア	11,200	3,435.000	38,472,000	
くら寿司	10,900	3,620.000	39,458,000	
キャンドゥ	4,200	3,500.000	14,700,000	
パルグループホールディングス	18,800	2,442.000	45,909,600	
エディオン	35,000	1,848.000	64,680,000	
サーラコーポレーション	18,900	821.000	15,516,900	
ハローズ	4,000	4,170.000	16,680,000	
フジオフードグループ本社	10,600	1,342.000	14,225,200	
あみやき亭	2,400	5,970.000	14,328,000	
大黒天物産	3,000	11,660.000	34,980,000	
ハニーズホールディングス	8,000	1,615.000	12,920,000	
アルペン	7,300	2,139.000	15,614,700	
クオールホールディングス	12,400	1,381.000	17,124,400	
ジンズホールディングス	7,400	5,200.000	38,480,000	
ビックカメラ	55,700	1,554.000	86,557,800	
ＤＣＭホールディングス	49,200	1,478.000	72,717,600	
ＭｏｎｏｔａＲＯ	131,800	2,397.000	315,924,600	
ＤＤグループ	2,900	1,284.000	3,723,600	
Ｊ．フロント　リテイリング	106,000	1,475.500	156,403,000	
ドトール・日レスホールディングス	15,400	2,300.000	35,420,000	
マツキヨココカラ＆カンパニー	168,400	2,237.500	376,795,000	
ブロンコビリー	5,400	3,695.000	19,953,000	
ＺＯＺＯ	59,200	4,929.000	291,796,800	
トレジャー・ファクトリー	6,600	1,695.000	11,187,000	
物語コーポレーション	15,300	3,645.000	55,768,500	
三越伊勢丹ホールディングス	153,100	2,196.500	336,284,150	
Ｈａｍｅｅ	4,900	1,037.000	5,081,300	
ウエルシアホールディングス	48,500	1,938.000	93,993,000	
クリエイトＳＤホールディングス	13,500	3,100.000	41,850,000	
チムニー	2,200	1,325.000	2,915,000	
シュッピン	8,200	1,178.000	9,659,600	

オイシックス・ラ・大地	12,500	1,340.000	16,750,000	
ネクステージ	21,700	1,764.000	38,278,800	
ジョイフル本田	25,700	2,139.000	54,972,300	
エターナルホスピタリティグループ	3,600	3,575.000	12,870,000	
ホットランド	7,200	2,331.000	16,783,200	
すかいらーくホールディングス	126,200	2,340.000	295,308,000	
ＳＦＰホールディングス	4,600	1,960.000	9,016,000	
綿半ホールディングス	6,100	1,769.000	10,790,900	
ヨシックスホールディングス	2,000	3,240.000	6,480,000	
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	32,800	842.000	27,617,600	
ＢＥＥＮＯＳ	5,600	2,457.000	13,759,200	
あさひ	7,500	1,618.000	12,135,000	
日本調剤	6,400	1,235.000	7,904,000	
コスモス薬品	15,600	7,306.000	113,973,600	
セブン&アイ・ホールディングス	938,900	2,158.500	2,026,615,650	
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	62,600	1,063.000	66,543,800	
ツルハホールディングス	19,500	8,607.000	167,836,500	
サンマルクホールディングス	7,000	2,127.000	14,889,000	
フェリシモ	4,000	908.000	3,632,000	
トリドールホールディングス	26,000	3,580.000	93,080,000	
ＴＯＫＹＯ　ＢＡＳＥ	11,600	228.000	2,644,800	
ＪＭホールディングス	6,900	3,290.000	22,701,000	
アレンザホールディングス	6,500	1,066.000	6,929,000	
串カツ田中ホールディングス	800	1,448.000	1,158,400	
クスリのアオキホールディングス	28,200	3,219.000	90,775,800	
力の源ホールディングス	5,500	1,187.000	6,528,500	
ＦＯＯＤ　＆　ＬＩＦＥ　ＣＯＭＰＡＮＩＥＳ	49,500	2,586.000	128,007,000	
メディカルシステムネットワーク	12,000	431.000	5,172,000	
ノジマ	26,900	1,926.000	51,809,400	
カッパ・クリエイト	14,400	1,722.000	24,796,800	
良品計画	110,400	2,555.000	282,072,000	
アドヴァングループ	4,900	916.000	4,488,400	
アルビス	2,500	2,811.000	7,027,500	
Ｇ－７ホールディングス	9,800	1,653.000	16,199,400	
イオン北海道	31,800	918.000	29,192,400	
コジマ	17,900	936.000	16,754,400	
コーナン商事	11,700	3,790.000	44,343,000	
エコス	3,600	2,094.000	7,538,400	
ワタミ	10,300	841.000	8,662,300	
パン・パシフィック・インターナショナルホールディングス	187,400	3,815.000	714,931,000	
西松屋チェーン	18,400	2,531.000	46,570,400	
ゼンショーホールディングス	47,300	7,913.000	374,284,900	

幸楽苑ホールディングス	7,000	1,210.000	8,470,000	
サイゼリヤ	13,900	5,130.000	71,307,000	
ＶＴホールディングス	33,100	479.000	15,854,900	
フジ・コーポレーション	4,200	2,036.000	8,551,200	
ユナイテッドアローズ	10,500	2,148.000	22,554,000	
ハイデイ日高	13,400	2,695.000	36,113,000	
コロワイド	39,800	1,750.000	69,650,000	
壱番屋	35,500	1,029.000	36,529,500	
スギホールディングス	58,400	2,479.000	144,773,600	
薬王堂ホールディングス	4,600	2,498.000	11,490,800	
スクロール	13,200	953.000	12,579,600	
ヨンドシーホールディングス	8,100	1,851.000	14,993,100	
木曽路	13,600	2,373.000	32,272,800	
ＳＲＳホールディングス	14,900	1,222.000	18,207,800	
リテールパートナーズ	13,000	1,368.000	17,784,000	
上新電機	8,500	2,736.000	23,256,000	
日本瓦斯	51,400	2,298.000	118,117,200	
ロイヤルホールディングス	16,500	2,388.000	39,402,000	
いなげや	8,600	1,196.000	10,285,600	
チヨダ	9,500	962.000	9,139,000	
ライフコーポレーション	9,400	3,655.000	34,357,000	
リンガーハット	12,100	2,172.000	26,281,200	
ＭｒＭａｘＨＤ	10,700	685.000	7,329,500	
ＡＯＫＩホールディングス	19,300	1,214.000	23,430,200	
オークワ	14,400	939.000	13,521,600	
コメリ	14,100	3,700.000	52,170,000	
青山商事	19,500	1,332.000	25,974,000	
しまむら	22,500	7,939.000	178,627,500	
高島屋	123,000	1,101.500	135,484,500	
松屋	15,500	862.000	13,361,000	
エイチ・ツー・オー　リテイリング	48,600	2,160.000	104,976,000	
近鉄百貨店	4,900	2,027.000	9,932,300	
丸井グループ	61,000	2,483.000	151,463,000	
アクシアル　リテイリング	24,100	935.000	22,533,500	
イオン	314,500	4,019.000	1,263,975,500	
イズミ	18,900	3,662.000	69,211,800	
平和堂	14,900	2,454.000	36,564,600	
フジ	14,500	2,135.000	30,957,500	
ヤオコー	11,100	10,035.000	111,388,500	
ゼビオホールディングス	12,200	1,248.000	15,225,600	
ケーズホールディングス	61,500	1,536.000	94,464,000	
Ｇｅｎｋｙ　ＤｒｕｇＳｔｏｒｅｓ	8,400	3,710.000	31,164,000	
ブックオフグループホールディングス	6,600	1,311.000	8,652,600	
ギフトホールディングス	4,700	2,599.000	12,215,300	

アインホールディングス	12,900	5,115.000	65,983,500	
ＧＥＮＫＩ　ＧＬＯＢＡＬ　ＤＩＮＩＮＧ　ＣＯＮＣＥＰＴＳ	5,800	4,265.000	24,737,000	
ヤマダホールディングス	288,200	443.900	127,931,980	
アークランズ	27,100	1,721.000	46,639,100	
ニトリホールディングス	33,800	22,735.000	768,443,000	
グルメ杵屋	5,900	1,087.000	6,413,300	
ケーユーホールディングス	2,900	1,039.000	3,013,100	
吉野家ホールディングス	34,100	3,188.000	108,710,800	
松屋フーズホールディングス	4,300	5,970.000	25,671,000	
サガミホールディングス	13,800	1,676.000	23,128,800	
王将フードサービス	6,700	8,380.000	56,146,000	
ミニストップ	6,700	1,646.000	11,028,200	
アークス	16,400	2,525.000	41,410,000	
バローホールディングス	16,900	2,231.000	37,703,900	
ベルク	4,600	6,310.000	29,026,000	
大　庄	5,500	1,068.000	5,874,000	
ファーストリテイリング	52,100	44,070.000	2,296,047,000	
サンドラッグ	33,000	4,151.000	136,983,000	
サックスバー　ホールディングス	7,700	810.000	6,237,000	
やまや	1,000	3,015.000	3,015,000	
ベルーナ	21,200	708.000	15,009,600	
いよぎんホールディングス	102,100	1,293.500	132,066,350	
しずおかフィナンシャルグループ	188,700	1,228.500	231,817,950	
ちゅうぎんフィナンシャルグループ	72,700	1,423.500	103,488,450	
楽天銀行	40,300	3,015.000	121,504,500	
京都フィナンシャルグループ	108,800	2,115.000	230,112,000	
じもとホールディングス	11,000	280.000	3,080,000	
めぶきフィナンシャルグループ	405,700	547.600	222,161,320	
東京きらぼしフィナンシャルグループ	10,600	4,100.000	43,460,000	
九州フィナンシャルグループ	166,700	681.900	113,672,730	
ゆうちょ銀行	948,900	1,300.000	1,233,570,000	
富山第一銀行	27,100	1,033.000	27,994,300	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	457,700	771.400	353,069,780	
西日本フィナンシャルホールディングス	49,000	1,570.000	76,930,000	
三十三フィナンシャルグループ	7,500	1,650.000	12,375,000	
第四北越フィナンシャルグループ	13,400	4,750.000	63,650,000	
ひろぎんホールディングス	119,900	1,065.500	127,753,450	
おきなわフィナンシャルグループ	6,900	2,252.000	15,538,800	
十六フィナンシャルグループ	10,600	3,925.000	41,605,000	
北國フィナンシャルホールディングス	8,900	4,380.000	38,982,000	
プロクレアホールディングス	10,800	1,763.000	19,040,400	
あいちフィナンシャルグループ	18,600	2,346.000	43,635,600	
あおぞら銀行	61,500	2,545.500	156,548,250	

三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	5,251,700	1,419.000	7,452,162,300	
りそなホールディングス	989,100	971.300	960,712,830	
三井住友トラスト・ホールディングス	306,600	3,355.000	1,028,643,000	
三井住友フィナンシャルグループ	603,900	8,750.000	5,284,125,000	
千葉銀行	239,500	1,115.000	267,042,500	
群馬銀行	166,300	907.100	150,850,730	
武蔵野銀行	11,000	2,676.000	29,436,000	
千葉興業銀行	20,300	929.000	18,858,700	
筑波銀行	36,200	237.000	8,579,400	
七十七銀行	25,100	3,825.000	96,007,500	
秋田銀行	5,200	2,204.000	11,460,800	
山形銀行	9,700	1,029.000	9,981,300	
岩手銀行	5,800	2,326.000	13,490,800	
東邦銀行	65,400	250.000	16,350,000	
東北銀行	4,600	1,130.000	5,198,000	
ふくおかフィナンシャルグループ	74,500	3,562.000	265,369,000	
スルガ銀行	72,500	1,122.000	81,345,000	
八十二銀行	185,200	804.900	149,067,480	
山梨中央銀行	9,100	1,584.000	14,414,400	
大垣共立銀行	15,400	1,820.000	28,028,000	
福井銀行	7,500	1,805.000	13,537,500	
清水銀行	3,600	1,449.000	5,216,400	
滋賀銀行	14,300	3,195.000	45,688,500	
南都銀行	12,400	3,050.000	37,820,000	
百五銀行	76,000	526.000	39,976,000	
紀陽銀行	30,500	1,709.000	52,124,500	
ほくほくフィナンシャルグループ	52,000	1,561.500	81,198,000	
山陰合同銀行	53,100	1,204.000	63,932,400	
鳥取銀行	3,900	1,257.000	4,902,300	
百十四銀行	7,900	2,469.000	19,505,100	
四国銀行	13,300	967.000	12,861,100	
阿波銀行	12,000	2,447.000	29,364,000	
大分銀行	5,100	3,105.000	15,835,500	
宮崎銀行	5,200	2,685.000	13,962,000	
佐賀銀行	5,100	2,050.000	10,455,000	
琉球銀行	19,200	1,016.000	19,507,200	
セブン銀行	270,400	285.200	77,118,080	
みずほフィナンシャルグループ	1,163,400	2,746.500	3,195,278,100	
山口フィナンシャルグループ	83,300	1,539.500	128,240,350	
名古屋銀行	5,300	6,240.000	33,072,000	
北洋銀行	129,900	377.000	48,972,300	
大光銀行	5,300	1,343.000	7,117,900	
愛媛銀行	11,600	1,056.000	12,249,600	
トマト銀行	5,100	1,145.000	5,839,500	

京葉銀行	37,400	700.000	26,180,000	
栃木銀行	42,100	259.000	10,903,900	
北日本銀行	2,600	2,351.000	6,112,600	
東和銀行	15,200	584.000	8,876,800	
大東銀行	8,500	666.000	5,661,000	
トモニホールディングス	81,100	376.000	30,493,600	
フィデアホールディングス	8,500	1,440.000	12,240,000	
池田泉州ホールディングス	114,300	320.000	36,576,000	
ＦＰＧ	31,400	2,131.000	66,913,400	
ジャパンインベストメントアドバイザー	14,800	1,071.000	15,850,800	
マーキュリアホールディングス	2,700	839.000	2,265,300	
ＳＢＩホールディングス	137,600	3,211.000	441,833,600	
ジャフコ　グループ	26,500	2,016.000	53,424,000	
大和証券グループ本社	666,100	996.200	663,568,820	
野村ホールディングス	1,447,000	743.400	1,075,699,800	
岡三証券グループ	74,900	635.000	47,561,500	
丸三証券	29,100	966.000	28,110,600	
東洋証券	27,400	406.000	11,124,400	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	95,600	486.000	46,461,600	
水戸証券	25,200	416.000	10,483,200	
いちよし証券	14,800	677.000	10,019,600	
松井証券	47,400	806.000	38,204,400	
マネックスグループ	85,200	610.000	51,972,000	
極東証券	13,200	1,437.000	18,968,400	
岩井コスモホールディングス	9,400	1,989.000	18,696,600	
アイザワ証券グループ	13,600	1,771.000	24,085,600	
スパークス・グループ	9,600	1,289.000	12,374,400	
かんぽ生命保険	88,300	2,553.000	225,429,900	
ＦＰパートナー	3,800	2,711.000	10,301,800	
ＳＯＭＰＯホールディングス	388,900	3,174.000	1,234,368,600	
アニコム　ホールディングス	29,500	659.000	19,440,500	
ＭＳ＆ＡＤインシュアランスグループホールディングス	579,200	3,117.000	1,805,366,400	
第一生命ホールディングス	405,300	3,484.000	1,412,065,200	
東京海上ホールディングス	841,900	4,925.000	4,146,357,500	
Ｔ＆Ｄホールディングス	231,400	2,366.000	547,492,400	
全国保証	22,600	5,597.000	126,492,200	
ジェイリース	7,700	1,353.000	10,418,100	
イントラスト	3,900	707.000	2,757,300	
日本モーゲージサービス	10,100	405.000	4,090,500	
ＳＢＩアルヒ	11,000	822.000	9,042,000	
プレミアグループ	15,300	2,046.000	31,303,800	
クレディセゾン	54,600	3,393.000	185,257,800	
芙蓉総合リース	7,700	10,735.000	82,659,500	

みずほリース	69,400	1,009.000	70,024,600	
東京センチュリー	64,300	1,646.500	105,869,950	
日本証券金融	32,000	1,942.000	62,144,000	
アイフル	130,200	315.000	41,013,000	
リコーリース	7,800	5,060.000	39,468,000	
イオンフィナンシャルサービス	48,800	1,238.500	60,438,800	
アコム	162,500	362.400	58,890,000	
ジャックス	8,900	3,860.000	34,354,000	
オリエントコーポレーション	26,800	937.000	25,111,600	
オリックス	516,900	3,337.000	1,724,895,300	
三菱ＨＣキャピタル	379,800	1,019.000	387,016,200	
九州リースサービス	4,800	991.000	4,756,800	
日本取引所グループ	222,700	3,377.000	752,057,900	
イー・ギャランティ	15,100	1,373.000	20,732,300	
アサックス	2,900	715.000	2,073,500	
ＮＥＣキャピタルソリューション	3,900	3,785.000	14,761,500	
Ｒｏｂｏｔ　Ｈｏｍｅ	32,000	138.000	4,416,000	
大東建託	31,500	17,670.000	556,605,000	
サムティホールディングス	10,100	2,625.000	26,512,500	
いちご	100,700	354.000	35,647,800	
日本駐車場開発	102,800	232.000	23,849,600	
スター・マイカ・ホールディングス	11,000	594.000	6,534,000	
ＳＲＥホールディングス	4,000	4,245.000	16,980,000	
ヒューリック	199,700	1,447.000	288,965,900	
野村不動産ホールディングス	47,300	3,889.000	183,949,700	
三重交通グループホールディングス	19,100	490.000	9,359,000	
ディア・ライフ	14,200	878.000	12,467,600	
地主	7,000	1,989.000	13,923,000	
プレサンスコーポレーション	14,600	1,859.000	27,141,400	
ＪＰＭＣ	4,500	1,094.000	4,923,000	
フージャースホールディングス	12,200	1,030.000	12,566,000	
オープンハウスグループ	31,500	5,482.000	172,683,000	
東急不動産ホールディングス	255,500	955.200	244,053,600	
飯田グループホールディングス	82,000	2,227.500	182,655,000	
ムゲンエステート	4,200	1,507.000	6,329,400	
Ａｎｄ　Ｄｏホールディングス	3,600	1,038.000	3,736,800	
シーアールイー	5,300	1,388.000	7,356,400	
ケイアイスター不動産	4,200	3,745.000	15,729,000	
グッドコムアセット	8,900	795.000	7,075,500	
ジェイ・エス・ビー	4,400	2,675.000	11,770,000	
ロードスターキャピタル	5,900	2,287.000	13,493,300	
霞ヶ関キャピタル	3,900	13,500.000	52,650,000	
パーク２４	66,900	1,784.500	119,383,050	
パラカ	3,200	1,763.000	5,641,600	

宮越ホールディングス	4,600	1,791.000	8,238,600	
三井不動産	1,195,600	1,373.000	1,641,558,800	
三菱地所	540,800	2,250.000	1,216,800,000	
平和不動産	13,900	4,010.000	55,739,000	
東京建物	73,900	2,221.000	164,131,900	
京阪神ビルディング	19,700	1,572.000	30,968,400	
住友不動産	124,400	4,665.000	580,326,000	
テーオーシー	18,100	633.000	11,457,300	
レオパレス２１	88,100	590.000	51,979,000	
スターツコーポレーション	12,500	3,360.000	42,000,000	
フジ住宅	10,800	698.000	7,538,400	
空港施設	12,000	579.000	6,948,000	
明和地所	6,200	954.000	5,914,800	
ゴールドクレスト	8,200	3,265.000	26,773,000	
エスリード	3,800	4,490.000	17,062,000	
日神グループホールディングス	15,200	487.000	7,402,400	
日本エスコン	16,700	1,016.000	16,967,200	
ＭＩＲＡＲＴＨホールディングス	48,900	494.000	24,156,600	
イオンモール	44,100	2,081.500	91,794,150	
毎日コムネット	6,300	705.000	4,441,500	
カチタス	23,600	1,750.000	41,300,000	
トーセイ	14,500	2,221.000	32,204,500	
穴吹興産	2,700	1,995.000	5,386,500	
サンフロンティア不動産	13,000	1,751.000	22,763,000	
ＦＪネクストホールディングス	8,800	1,237.000	10,885,600	
日本空港ビルデング	30,500	4,910.000	149,755,000	
ＬＩＦＵＬＬ	36,500	139.000	5,073,500	
ＭＩＸＩ	19,500	2,877.000	56,101,500	
ジェイエイシーリクルートメント	32,000	782.000	25,024,000	
日本M&Aセンターホールディングス	142,700	636.500	90,828,550	
メンバーズ	4,400	903.000	3,973,200	
ＵＴグループ	11,900	2,650.000	31,535,000	
アイティメディア	3,600	1,599.000	5,756,400	
ケアネット	18,100	633.000	11,457,300	
Ｅ・Ｊホールディングス	5,400	1,726.000	9,320,400	
オープンアップグループ	26,800	2,062.000	55,261,600	
コシダカホールディングス	27,700	999.000	27,672,300	
アルトナー	2,000	1,794.000	3,588,000	
パソナグループ	11,000	2,214.000	24,354,000	
リンクアンドモチベーション	26,700	620.000	16,554,000	
エス・エム・エス	31,900	2,122.000	67,691,800	
パーソルホールディングス	911,300	270.800	246,780,040	
リニカル	5,500	387.000	2,128,500	
学情	4,700	1,663.000	7,816,100	

スタジオアリス	4,800	2,077.000	9,969,600	
ＮＪＳ	2,000	3,375.000	6,750,000	
綜合警備保障	147,300	1,046.500	154,149,450	
カカクコム	57,700	2,579.500	148,837,150	
セントケア・ホールディング	7,500	742.000	5,565,000	
ルネサンス	6,700	1,064.000	7,128,800	
ディップ	13,900	2,762.000	38,391,800	
デジタルホールディングス	6,000	930.000	5,580,000	
新日本科学	8,700	1,150.000	10,005,000	
エムスリー	172,800	1,348.500	233,020,800	
ウェルネット	4,000	790.000	3,160,000	
ワールドホールディングス	4,200	1,870.000	7,854,000	
ディー・エヌ・エー	31,300	1,588.500	49,720,050	
博報堂ＤＹホールディングス	115,000	1,174.000	135,010,000	
ぐるなび	16,000	372.000	5,952,000	
タカミヤ	13,200	431.000	5,689,200	
ファンコミュニケーションズ	15,000	406.000	6,090,000	
ライク	3,800	1,436.000	5,456,800	
エスプール	30,200	344.000	10,388,800	
ＷＤＢホールディングス	4,500	1,725.000	7,762,500	
アドウェイズ	14,300	339.000	4,847,700	
バリューコマース	8,700	1,087.000	9,456,900	
インフォマート	94,600	323.000	30,555,800	
ＪＰホールディングス	26,200	730.000	19,126,000	
プレステージ・インターナショナル	43,300	717.000	31,046,100	
アミューズ	5,300	1,399.000	7,414,700	
ドリームインキュベータ	3,200	2,177.000	6,966,400	
クイック	5,900	2,104.000	12,413,600	
電通グループ	97,000	4,208.000	408,176,000	
テイクアンドギヴ・ニーズ	4,500	832.000	3,744,000	
ぴあ	3,100	3,045.000	9,439,500	
イオンファンタジー	3,600	2,132.000	7,675,200	
シーティーエス	10,600	827.000	8,766,200	
Ｈ．Ｕ．グループホールディングス	25,200	2,654.500	66,893,400	
アルプス技研	8,200	2,717.000	22,279,400	
日本空調サービス	10,200	1,079.000	11,005,800	
オリエンタルランド	476,200	3,902.000	1,858,132,400	
ダスキン	18,600	3,865.000	71,889,000	
明光ネットワークジャパン	13,800	677.000	9,342,600	
ファルコホールディングス	4,900	2,313.000	11,333,700	
ラウンドワン	83,400	1,001.000	83,483,400	
リゾートトラスト	39,000	2,900.000	113,100,000	
ビー・エム・エル	11,500	2,663.000	30,624,500	
リソー教育	50,900	250.000	12,725,000	

早稲田アカデミー	5,500	1,582.000	8,701,000	
ユー・エス・エス	200,300	1,360.500	272,508,150	
東京個別指導学院	19,000	403.000	7,657,000	
サイバーエージェント	198,400	1,024.000	203,161,600	
楽天グループ	635,300	942.900	599,024,370	
クリーク・アンド・リバー社	5,100	1,427.000	7,277,700	
ＳＢＩグローバルアセットマネジメント	18,000	587.000	10,566,000	
テー・オー・ダブリュー	23,800	313.000	7,449,400	
山田コンサルティンググループ	4,300	2,363.000	10,160,900	
セントラルスポーツ	3,700	2,495.000	9,231,500	
フルキャストホールディングス	8,800	1,558.000	13,710,400	
エン・ジャパン	15,200	2,502.000	38,030,400	
テクノプロ・ホールディングス	52,000	2,890.000	150,280,000	
アイ・アールジャパンホールディングス	5,400	902.000	4,870,800	
ＫｅｅＰｅｒ技研	5,700	4,265.000	24,310,500	
Ｇｕｎｏｓｙ	9,200	868.000	7,985,600	
イー・ガーディアン	4,300	1,838.000	7,903,400	
ジャパンマテリアル	27,200	1,746.000	47,491,200	
ベクトル	11,700	905.000	10,588,500	
チャーム・ケア・コーポレーション	7,900	1,369.000	10,815,100	
キャリアリンク	3,600	2,589.000	9,320,400	
ＩＢＪ	8,600	703.000	6,045,800	
アサンテ	5,200	1,670.000	8,684,000	
バリューＨＲ	8,000	1,614.000	12,912,000	
M&Aキャピタルパートナーズ	7,700	2,160.000	16,632,000	
ライドオンエクスプレスホールディングス	6,200	1,005.000	6,231,000	
ＥＲＩホールディングス	1,000	1,961.000	1,961,000	
シグマクシス・ホールディングス	12,300	1,599.000	19,667,700	
ウィルグループ	7,000	898.000	6,286,000	
メドピア	9,400	585.000	5,499,000	
リクルートホールディングス	648,400	8,650.000	5,608,660,000	
エラン	12,000	828.000	9,936,000	
日本郵政	939,100	1,352.500	1,270,132,750	
ベルシステム２４ホールディングス	11,300	1,527.000	17,255,100	
鎌倉新書	9,900	493.000	4,880,700	
エアトリ	7,200	1,177.000	8,474,400	
アトラエ	7,800	792.000	6,177,600	
ストライク	4,200	4,550.000	19,110,000	
ソラスト	25,400	560.000	14,224,000	
セラク	2,500	1,410.000	3,525,000	
インソース	20,100	1,055.000	21,205,500	
ベイカレント	66,300	5,129.000	340,052,700	
Ｏｒｃｈｅｓｔｒａ　Ｈｏｌｄｉｎｇｓ	2,500	819.000	2,047,500	
アイモバイル	14,100	503.000	7,092,300	

ＭＳ－Ｊａｐａｎ	4,000	999.000	3,996,000	
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	29,000	2,761.000	80,069,000	
グリーンズ	1,200	1,677.000	2,012,400	
エル・ティー・エス	1,300	1,782.000	2,316,600	
ミダックホールディングス	5,700	1,615.000	9,205,500	
キュービーネットホールディングス	5,900	1,047.000	6,177,300	
オープングループ	16,600	210.000	3,486,000	
マネジメントソリューションズ	4,300	1,530.000	6,579,000	
フロンティア・マネジメント	2,600	1,146.000	2,979,600	
コプロ・ホールディングス	1,600	1,519.000	2,430,400	
アンビスホールディングス	19,400	1,777.000	34,473,800	
カーブスホールディングス	24,400	756.000	18,446,400	
フォーラムエンジニアリング	13,000	962.000	12,506,000	
ＦＡＳＴ　ＦＩＴＮＥＳＳ　ＪＡＰＡＮ	3,800	1,218.000	4,628,400	
ダイレクトマーケティングミックス	13,800	243.000	3,353,400	
ポピンズ	1,600	1,466.000	2,345,600	
ＬＩＴＡＬＩＣＯ	7,200	1,191.000	8,575,200	
リログループ	44,700	1,817.000	81,219,900	
東祥	6,000	680.000	4,080,000	
ＩＤ＆Ｅ　ホールディングス	5,600	3,990.000	22,344,000	
ビーウィズ	2,400	1,853.000	4,447,200	
サンウェルズ	5,100	1,987.000	10,133,700	
ＴＲＥホールディングス	17,900	1,555.000	27,834,500	
人・夢・技術グループ	3,600	1,704.000	6,134,400	
ＮＩＳＳＯホールディングス	9,000	768.000	6,912,000	
大栄環境	16,400	3,015.000	49,446,000	
日本管財ホールディングス	8,900	2,605.000	23,184,500	
Ｍ＆Ａ総研ホールディングス	9,700	2,904.000	28,168,800	
エイチ・アイ・エス	28,100	1,659.000	46,617,900	
共立メンテナンス	28,600	2,259.500	64,621,700	
イチネンホールディングス	9,100	1,810.000	16,471,000	
建設技術研究所	4,600	4,380.000	20,148,000	
スペース	7,100	1,118.000	7,937,800	
燦ホールディングス	8,500	1,180.000	10,030,000	
スバル興業	3,200	2,973.000	9,513,600	
東京テアトル	7,000	1,106.000	7,742,000	
ナガワ	2,900	7,180.000	20,822,000	
東京都競馬	7,600	4,120.000	31,312,000	
カナモト	14,400	2,941.000	42,350,400	
ニシオホールディングス	8,300	4,060.000	33,698,000	
トランス・コスモス	11,300	3,520.000	39,776,000	
乃村工藝社	40,100	815.000	32,681,500	
藤田観光	4,000	9,230.000	36,920,000	
ＫＮＴ－ＣＴホールディングス	6,100	1,277.000	7,789,700	

トーカイ	7,600	2,141.000	16,271,600	
セコム	91,000	11,040.000	1,004,640,000	
セントラル警備保障	5,000	2,750.000	13,750,000	
丹青社	18,200	842.000	15,324,400	
メイテックグループホールディングス	29,600	3,244.000	96,022,400	
応用地質	8,700	2,510.000	21,837,000	
船井総研ホールディングス	18,500	2,275.000	42,087,500	
いであ	700	2,257.000	1,579,900	
学究社	4,200	1,948.000	8,181,600	
イオンディライト	9,700	4,115.000	39,915,500	
ダイセキ	18,100	3,785.000	68,508,500	
ステップ	3,200	1,943.000	6,217,600	
合　計	142,796,700		315,066,198,890	

(b)株式以外の有価証券

該当事項はありません。

②デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

外国株式インデックス・マザーファンド

（１）貸借対照表

（単位：円）

	(2024年9月17日現在)
資産の部	
流動資産	
預金	7,456,924,895
金銭信託	6,459,618
コール・ローン	642,239,656
株式	758,251,843,710
投資証券	16,563,925,164
派生商品評価勘定	124,880,923
未収入金	13,722,643
未収配当金	1,138,797,826
差入委託証拠金	3,235,576,151
流動資産合計	787,434,370,586
資産合計	787,434,370,586
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	24,356,897
未払解約金	204,421,002
流動負債合計	228,777,899
負債合計	228,777,899
純資産の部	
元本等	

元本	89,293,103,807
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	697,912,488,880
元本等合計	787,205,592,687
純資産合計	787,205,592,687
負債純資産合計	787,434,370,586

（２）注記表

（重要な会計方針の注記）

項　目	自 2023年9月16日 至 2024年9月17日
１．　有価証券の評価基準及び評価方法	株式、新株予約権証券、投資証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。 (1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。 (2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。 (3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。
２．　デリバティブの評価基準及び評価方法	(1) 先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算期間末日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場によっております。 (2) 為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。
３．　その他財務諸表作成のための基礎となる事項	外貨建資産等の会計処理 「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。

（重要な会計上の見積りに関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

項　目	(2024年9月17日現在)
１．　当計算期間の末日における受益権の総数	89,293,103,807口
２．　１単位当たり純資産の額	１口当たり純資産額　8.8160円

	（1万口当たりの純資産額88,160円）

（金融商品に関する注記）

Ⅰ．金融商品の状況に関する事項

項　目	自 2023年9月16日 至 2024年9月17日
1．　金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2．　金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	(1) 金融商品の内容 1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、株式、新株予約権証券、投資証券を組み入れております。 2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。 当計算期間については、先物取引、為替予約取引を行っております。 3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 (2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。
3．　金融商品に係るリスク管理体制	リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する会議をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。 また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限値、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用部署に是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用部署は、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。なお、投資信託協会の流動性リスク管理規制に抵触する場合には、流動性リスクを管理する会議で審議の上、流動性リスクの管理責任者が対処方針を決定します。その後、決定した対処方針やその実施等について、リスク管理会議に報告を行う体制となっております。 なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する会議にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れ

	は、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。

Ⅱ．金融商品の時価等に関する事項

項　目	(2024年9月17日現在)
1．　貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2．　時価の算定方法	(1) 有価証券（株式、新株予約権証券、投資証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。
3．　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。

(デリバティブ取引に関する注記)

(2024年9月17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	うち1年超	時　価	評価損益
市場取引	株価指数先物取引				
	買建				
	S&P 500 EMINI FUT SEP24	9,697,328,568	－	9,801,716,561	104,387,993
	SPI 200 FUTURES SEP24	340,301,635	－	346,514,558	6,212,923
	FTSE 100 IDX FUT SEP24	494,062,144	－	492,431,398	△1,630,746
	EURO STOXX 50 SEP24	1,683,087,836	－	1,677,580,407	△5,507,429
	小計	12,214,780,183	－	12,318,242,924	103,462,741
合　計		12,214,780,183	－	12,318,242,924	103,462,741

(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	453,699,747	－	450,483,130	△3,216,617
	スウェーデン・クローナ	39,563,120	－	39,839,312	276,192
	小計	493,262,867	－	490,322,442	△2,940,425
	売建				
	オーストラリア・ドル	28,461,900	－	28,460,190	1,710
	小計	28,461,900	－	28,460,190	1,710
合　計		521,724,767	－	518,782,632	△2,938,715

（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。

①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。

②計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。

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

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

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

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

２．ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

自 2023年9月16日 至 2024年9月17日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。

（その他の注記）

（2024年9月17日現在）

開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	80,676,406,829円
同期中における追加設定元本額	16,986,404,251円
同期中における一部解約元本額	8,369,707,273円
2024年9月17日現在の元本の内訳	
三井住友・ＤＣ外国株式インデックスファンドＳ	44,981,134,476円
三井住友・ＤＣ年金バランス３０（債券重点型）	247,742,375円
三井住友・ＤＣ年金バランス５０（標準型）	956,054,621円
三井住友・ＤＣ年金バランス７０（株式重点型）	766,986,589円
ＳＭＡＭ・グローバルバランスファンド（機動的資産配分型）	39,440,707円
三井住友・ＤＣターゲットイヤーファンド２０２０（４資産タイプ）	679,815円
三井住友・ＤＣターゲットイヤーファンド２０２５（４資産タイプ）	2,679,721円
三井住友・ＤＣターゲットイヤーファンド２０３０（４資産タイプ）	11,113,114円
三井住友・ＤＣターゲットイヤーファンド２０３５（４資産タイプ）	33,803,961円
三井住友・ＤＣターゲットイヤーファンド２０４０（４資産タイプ）	42,254,871円
三井住友・ＤＣターゲットイヤーファンド２０４５（４資産タイプ）	95,689,898円
外国株式指数ファンド	1,206,304,151円
三井住友・ＤＣつみたてＮＩＳＡ・全海外株インデックスファンド	24,324,748,344円
アセットアロケーション・ファンド（安定型）	23,754,138円
アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）	67,345,056円
アセットアロケーション・ファンド（成長型）	40,858,189円
三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０５０	33,382,010円
三井住友・資産最適化ファンド（１安定重視型）	157,575,065円
三井住友・資産最適化ファンド（２やや安定型）	145,828,305円
三井住友・資産最適化ファンド（３バランス型）	585,211,507円
三井住友・資産最適化ファンド（４やや成長型）	363,159,021円
三井住友・資産最適化ファンド（５成長重視型）	522,081,349円
三井住友・ＤＣつみたてＮＩＳＡ・世界分散ファンド	70,941,793円
三井住友ＤＳ・外国株式インデックス年金ファンド	3,126,855,164円
三井住友ＤＳ・年金バランス３０（債券重点型）	11,128,354円
三井住友ＤＳ・年金バランス５０（標準型）	57,165,915円
三井住友ＤＳ・年金バランス７０（株式重点型）	61,059,103円
三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０６０	4,714,636円
ＳＭＢＣ・ＤＣインデックスファンド（ＭＳＣＩコクサイ）	2,309,600,108円
日興ＦＷＳ・先進国株インデックス（為替ヘッジあり）	164,819,022円
日興ＦＷＳ・先進国株インデックス（為替ヘッジなし）	3,644,281,479円
三井住友ＤＳ・先進国株式インデックス・ファンド	167,821,130円
三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０３５	9,630,196円
三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０４０	6,305,022円
三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０４５	7,095,394円
三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０５５	3,948,075円
三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０６５	2,562,663円
三井住友ＤＳ・ＦＷ専用ポートフォリオ・レベル１（保守型）	175,874円

三井住友ＤＳ・ＦＷ専用ポートフォリオ・レベル２（安定型）	5,135,554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）	25,249,598円
三井住友ＤＳ・ＦＷ専用ポートフォリオ・レベル４（成長型）	27,273,315円
三井住友ＤＳ・ＦＷ専用ポートフォリオ・レベル５（積極成長型）	10,630,651円
ＳＭＡＭ・外国株式パッシブ・ファンド（適格機関投資家専用）	235,799,660円
バランスファンドＶＡ（安定運用型）＜適格機関投資家限定＞	1,694,845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＞	8,507,417円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ２５＜適格機関投資家専用＞	244,702,267円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ３７．５＜適格機関投資家専用＞	451,986,789円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ５０＜適格機関投資家専用＞	2,044,178,308円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＬ３０＜適格機関投資家限定＞	6,385,797円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＬ５０＜適格機関投資家限定＞	32,476,182円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ７５＜適格機関投資家専用＞	336,590,787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＞	23,753,768円
ＳＭＡＭ・インデックス・バランスＶＡ２５＜適格機関投資家専用＞	54,210,390円
ＳＭＡＭ・インデックス・バランスＶＡ５０＜適格機関投資家専用＞	286,136,389円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ４０＜適格機関投資家専用＞	183,205,513円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ３５＜適格機関投資家専用＞	404,330,166円
三井住友・外国株式インデックスファンド・ＶＡＳ（適格機関投資家専用）	165,260,941円
ＳＭＡＭ・グローバルバランス４０ＶＡ＜適格機関投資家限定＞	35,586,512円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２０Ａ＜適格機関投資家専用＞	4,094,878円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ３５Ａ＜適格機関投資家専用＞	3,762,642円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ５０Ａ＜適格機関投資家専用＞	3,045,479円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２０Ｌ＜適格機関投資家専用＞	9,255,993円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２５Ｌ＜適格機関投資家専用＞	31,912,804円
ＳＭＡＭ・グローバルバランスファンド（標準型）ＶＡ＜適格機関投資家限定＞	68,971,315円
ＳＭＡＭ・グローバルバランスファンド（債券重視型）ＶＡ＜適格機関投資家限定＞	28,947,304円
ＳＭＡＭ・世界バランスファンドＶＡ＜適格機関投資家限定＞	113,387,274円
ＳＭＡＭ・世界バランスファンドＶＡ２＜適格機関投資家限定＞	42,612,522円
ＳＭＡＭ・外国株式インデックスファンドＳＡ＜適格機関投資家限定＞	20,452,057円
ＳＭＡＭ・年金Ｗリスクコントロールファンド＜適格機関投資家限定＞	17,673,700円
ＳＭＡＭ・マルチアセットストラテジーファンド２０１６－０４＜適格機関投資家限定＞	11,287,097円
ＳＭＡＭ・マルチアセットストラテジー・オープン＜適格機関投資家限定＞	18,145,014円
ＳＭＡＭ・マルチアセット・ダイナミックアロケーション・ストラテジー・ファンドⅡ＜適格機関投資家限定＞	12,599,975円
ＳＭＤＡＭ・年金Ｗリスクコントロールファンド（リスク３％）＜適格機関投資家限定＞	27,929,693円
合　計	89,293,103,807円

（３）附属明細表

①有価証券明細表

(a)株式

通　貨	銘　柄	株　数	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカ・ドル	APA CORP	27,608	24.440	674,739.52	
	BAKER HUGHES CO	87,866	33.980	2,985,686.68	
	CHENIERE ENERGY INC	19,829	182.550	3,619,783.95	
	CHESAPEAKE ENERGY CORP	7,695	73.060	562,196.70	
	CHEVRON CORP	150,477	142.090	21,381,276.93	
	CHORD ENERGY CORP	5,159	134.410	693,421.19	
	CONOCOPHILLIPS	97,908	105.550	10,334,189.40	
	COTERRA ENERGY INC	59,741	22.920	1,369,263.72	
	DEVON ENERGY CORP	49,897	39.640	1,977,917.08	
	DIAMONDBACK ENERGY INC	14,567	174.810	2,546,457.27	
	EOG RESOURCES INC	50,302	121.670	6,120,244.34	
	EQT CORP	47,708	33.550	1,600,603.40	
	EXXON MOBIL CORP	384,075	112.710	43,289,093.25	
	HALLIBURTON CO	76,654	28.410	2,177,740.14	
	HESS CORP	23,450	128.920	3,023,174.00	
	HF SINCLAIR CORP	10,663	45.300	483,033.90	
	KINDER MORGAN INC	173,893	21.470	3,733,482.71	
	MARATHON OIL CORP	53,220	26.660	1,418,845.20	
	MARATHON PETROLEUM CORP	30,431	161.010	4,899,695.31	
	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	57,692	51.290	2,959,022.68	
	ONEOK INC	47,832	93.680	4,480,901.76	
	OVINTIV INC	23,075	39.160	903,617.00	
	PHILLIPS 66	36,059	127.340	4,591,753.06	
	SCHLUMBERGER LTD	121,500	40.400	4,908,600.00	
	TARGA RESOURCES CORP	18,523	150.590	2,789,378.57	
	TEXAS PACIFIC LAND CORP	1,661	838.610	1,392,931.21	
	VALERO ENERGY CORP	27,819	133.750	3,720,791.25	
	WILLIAMS COS INC	104,963	45.440	4,769,518.72	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	18,963	288.870	5,477,841.81	
	ALBEMARLE CORP	8,338	89.350	745,000.30	
	AMCOR PLC	122,899	11.120	1,366,636.88	
	AVERY DENNISON CORP	6,759	221.040	1,494,009.36	
	BALL CORP	28,423	67.000	1,904,341.00	
	CELANESE CORP	8,742	123.800	1,082,259.60	
	CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	14,020	79.730	1,117,814.60	
	CORTEVA INC	60,038	56.270	3,378,338.26	
	CRH PLC	58,997	89.170	5,260,762.49	
	CROWN HOLDINGS INC	9,413	92.470	870,420.11	
	DOW INC	59,685	50.660	3,023,642.10	
	DUPONT DE NEMOURS INC	36,397	82.000	2,984,554.00	

EASTMAN CHEMICAL CO	9,517	105.380	1,002,901.46	
ECOLAB INC	21,611	253.200	5,471,905.20	
FREEPORT-MCMORAN INC	121,991	42.890	5,232,193.99	
INTERNATIONAL PAPER CO	29,910	49.830	1,490,415.30	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	20,983	103.640	2,174,678.12	
LINDE PLC	40,847	474.910	19,398,648.77	
LYONDELLBASELL INDU-CL A	22,165	94.080	2,085,283.20	
MARTIN MARIETTA MATERIALS	5,394	529.780	2,857,633.32	
MOSAIC CO/THE	25,489	25.430	648,185.27	
NEWMONT CORP	101,538	53.130	5,394,713.94	
NUCOR CORP	20,787	142.960	2,971,709.52	
PACKAGING CORP OF AMERICA	7,111	214.590	1,525,949.49	
PPG INDUSTRIES INC	21,291	127.340	2,711,195.94	
RELIANCE INC	5,040	279.290	1,407,621.60	
RPM INTERNATIONAL INC	10,397	122.160	1,270,097.52	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	20,286	379.060	7,689,611.16	
SMURFIT WESTROCK PLC	47,029	46.730	2,197,665.17	
STEEL DYNAMICS INC	12,713	111.010	1,411,270.13	
VULCAN MATERIALS CO	11,015	242.870	2,675,213.05	
WESTLAKE CORP	4,430	141.200	625,516.00	
3M CO	46,568	134.610	6,268,518.48	
AECOM	10,261	98.410	1,009,785.01	
AERCAP HOLDINGS NV	18,294	93.940	1,718,538.36	
ALLEGION PLC	6,843	142.720	976,632.96	
AMETEK INC	20,578	168.350	3,464,306.30	
AXON ENTERPRISE INC	5,927	385.770	2,286,458.79	
BOEING CO/THE	50,840	155.550	7,908,162.00	
BUILDERS FIRSTSOURCE INC	9,801	187.650	1,839,157.65	
CARLISLE COS INC	4,354	418.290	1,821,234.66	
CARRIER GLOBAL CORP	66,639	77.110	5,138,533.29	
CATERPILLAR INC	41,903	347.960	14,580,567.88	
CNH INDUSTRIAL NV	87,561	10.280	900,127.08	
CUMMINS INC	11,429	301.070	3,440,929.03	
DEERE & CO	22,561	394.660	8,903,924.26	
DOVER CORP	12,242	186.770	2,286,438.34	
EATON CORP PLC	33,582	306.550	10,294,562.10	
EMCOR GROUP INC	4,293	402.690	1,728,748.17	
EMERSON ELECTRIC CO	48,843	102.390	5,001,034.77	
FASTENAL CO	47,002	70.090	3,294,370.18	
FERGUSON ENTERPRISES INC	18,035	197.220	3,556,862.70	
FORTIVE CORP	29,388	73.720	2,166,483.36	
FORTUNE BRANDS INNOVATIONS I	10,648	84.100	895,496.80	

GE VERNOVA INC	24,156	229.930	5,554,189.08	
GENERAL DYNAMICS CORP	19,558	307.550	6,015,062.90	
GENERAL ELECTRIC	93,374	181.440	16,941,778.56	
GRACO INC	15,068	83.970	1,265,259.96	
HEICO CORP	3,085	262.220	808,948.70	
HEICO CORP-CLASS A	6,593	204.020	1,345,103.86	
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	56,350	204.680	11,533,718.00	
HOWMET AEROSPACE INC	33,070	95.140	3,146,279.80	
HUBBELL INC	4,737	408.820	1,936,580.34	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	2,888	265.210	765,926.48	
IDEX CORP	6,048	202.680	1,225,808.64	
ILLINOIS TOOL WORKS	26,116	255.130	6,662,975.08	
INGERSOLL-RAND INC	33,421	90.940	3,039,305.74	
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	11,600	36.920	428,272.00	
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	57,700	72.510	4,183,827.00	
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	15,814	231.710	3,664,261.94	
LENNOX INTERNATIONAL INC	2,750	603.500	1,659,625.00	
LOCKHEED MARTIN CORP	18,178	572.920	10,414,539.76	
MASCO CORP	19,187	81.040	1,554,914.48	
NORDSON CORP	5,282	253.370	1,338,300.34	
NORTHROP GRUMMAN CORP	12,313	521.270	6,418,397.51	
OTIS WORLDWIDE CORP	35,270	94.810	3,343,948.70	
OWENS CORNING	7,597	167.770	1,274,548.69	
PACCAR INC	43,068	95.700	4,121,607.60	
PARKER HANNIFIN CORP	10,784	596.780	6,435,675.52	
PENTAIR PLC	15,664	92.950	1,455,968.80	
QUANTA SERVICES INC	13,102	271.540	3,557,717.08	
ROCKWELL AUTOMATION INC	9,863	262.080	2,584,895.04	
RTX CORP	114,772	119.200	13,680,822.40	
SMITH (A.O.) CORP	10,652	81.700	870,268.40	
SNAP-ON INC	4,041	281.440	1,137,299.04	
STANLEY BLACK & DECKER INC	12,917	102.590	1,325,155.03	
TEXTRON INC	14,870	88.330	1,313,467.10	
TORO CO	8,097	84.710	685,896.87	
TRANE TECHNOLOGIES PLC	19,070	368.890	7,034,732.30	
TRANSDIGM GROUP INC	4,733	1,372.920	6,498,030.36	
UNITED RENTALS INC	5,643	741.960	4,186,880.28	
VERTIV HOLDINGS CO-A	32,504	86.990	2,827,522.96	
WABTEC CORP	15,150	170.190	2,578,378.50	
WATSCO INC	3,112	487.330	1,516,570.96	
WW GRAINGER INC	3,717	1,008.210	3,747,516.57	
XYLEM INC	19,463	132.790	2,584,491.77	

AUTOMATIC DATA PROCESSING	34,745	278.600	9,679,957.00	
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	10,637	158.450	1,685,432.65	
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO	10,783	211.640	2,282,114.12	
CINTAS CORP	31,608	204.950	6,478,059.60	
COPART INC	72,947	49.750	3,629,113.25	
DAYFORCE INC	10,485	59.600	624,906.00	
EQUIFAX INC	10,373	304.110	3,154,533.03	
JACOBS SOLUTIONS INC	10,393	144.790	1,504,802.47	
LEIDOS HOLDINGS INC	11,403	154.810	1,765,298.43	
PAYCHEX INC	27,578	135.190	3,728,269.82	
PAYCOM SOFTWARE INC	3,778	169.090	638,822.02	
REPUBLIC SERVICES INC	19,598	205.360	4,024,645.28	
ROLLINS INC	25,137	50.910	1,279,724.67	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	19,314	75.510	1,458,400.14	
TRANSUNION	18,291	101.180	1,850,683.38	
VERALTO CORP	22,013	109.960	2,420,549.48	
VERISK ANALYTICS INC	12,690	269.400	3,418,686.00	
WASTE CONNECTIONS INC	22,344	185.510	4,145,035.44	
WASTE MANAGEMENT INC	33,524	208.320	6,983,719.68	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	8,726	100.310	875,305.06	
CSX CORP	165,227	33.810	5,586,324.87	
DELTA AIR LINES INC	14,192	45.320	643,181.44	
EXPEDITORS INTL WASH INC	13,237	121.080	1,602,735.96	
FEDEX CORP	19,408	292.630	5,679,363.04	
GRAB HOLDINGS LTD - CL A	216,253	3.500	756,885.50	
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	6,308	167.400	1,055,959.20	
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	12,089	52.310	632,375.59	
NORFOLK SOUTHERN CORP	19,928	247.070	4,923,610.96	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	16,449	191.920	3,156,892.08	
SOUTHWEST AIRLINES CO	14,057	28.540	401,186.78	
UBER TECHNOLOGIES INC	157,907	71.520	11,293,508.64	
U-HAUL HOLDING CO-NON VOTING	5,850	69.420	406,107.00	
UNION PACIFIC CORP	52,696	252.430	13,302,051.28	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	61,570	128.910	7,936,988.70	
APTIV PLC	23,575	68.790	1,621,724.25	
FORD MOTOR CO	325,996	10.800	3,520,756.80	
GENERAL MOTORS CO	99,425	46.870	4,660,049.75	
RIVIAN AUTOMOTIVE INC-A	72,072	13.200	951,350.40	
TESLA INC	245,643	226.780	55,706,919.54	
DECKERS OUTDOOR CORP	2,220	937.680	2,081,649.60	
DR HORTON INC	26,159	194.600	5,090,541.40	
GARMIN LTD	13,282	172.620	2,292,738.84	

LENNAR CORP-A	21,335	187.210	3,994,125.35	
LULULEMON ATHLETICA INC	10,287	265.300	2,729,141.10	
NIKE INC -CL B	102,257	79.800	8,160,108.60	
NVR INC	250	9,425.370	2,356,342.50	
PULTEGROUP INC	17,535	140.060	2,455,952.10	
AIRBNB INC-CLASS A	38,522	117.550	4,528,261.10	
BOOKING HOLDINGS INC	2,870	3,979.000	11,419,730.00	
CARNIVAL CORP	84,815	17.830	1,512,251.45	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	117,100	57.660	6,751,986.00	
DARDEN RESTAURANTS INC	9,323	160.140	1,492,985.22	
DOMINO'S PIZZA INC	2,875	408.970	1,175,788.75	
DOORDASH INC - A	24,823	130.870	3,248,586.01	
DRAFTKINGS INC-CL A	32,265	38.240	1,233,813.60	
EXPEDIA GROUP INC	10,081	135.790	1,368,898.99	
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC-DI	15,951	224.340	3,578,447.34	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	21,638	218.100	4,719,247.80	
HYATT HOTELS CORP - CL A	3,371	144.850	488,289.35	
LAS VEGAS SANDS CORP	27,977	40.260	1,126,354.02	
MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A	20,953	232.460	4,870,734.38	
MCDONALD'S CORP	61,103	296.690	18,128,649.07	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	22,198	36.440	808,895.12	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	21,669	169.740	3,678,096.06	
STARBUCKS CORP	95,086	96.310	9,157,732.66	
WYNN RESORTS LTD	7,730	78.950	610,283.50	
YUM! BRANDS INC	25,236	134.560	3,395,756.16	
AMAZON.COM INC	799,908	184.890	147,894,990.12	
AUTOZONE INC	1,423	3,101.040	4,412,779.92	
BATH & BODY WORKS INC	15,400	28.910	445,214.00	
BEST BUY CO INC	19,353	98.790	1,911,882.87	
BURLINGTON STORES INC	6,047	272.080	1,645,267.76	
CARMAX INC	14,212	79.040	1,123,316.48	
DICK'S SPORTING GOODS INC	4,406	212.330	935,525.98	
EBAY INC	40,534	64.360	2,608,768.24	
GENUINE PARTS CO	12,304	137.350	1,689,954.40	
GLOBAL-E ONLINE LTD	7,348	36.790	270,332.92	
HOME DEPOT INC	85,029	382.010	32,481,928.29	
LKQ CORP	24,732	40.430	999,914.76	
LOWE'S COS INC	48,054	256.640	12,332,578.56	
MERCADOLIBRE INC	3,878	2,105.510	8,165,167.78	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	4,881	1,130.720	5,519,044.32	
POOL CORP	3,252	358.490	1,165,809.48	
ROSS STORES INC	29,519	153.170	4,521,425.23	

TJX COMPANIES INC	95,580	119.610	11,432,323.80	
TRACTOR SUPPLY COMPANY	9,377	283.390	2,657,348.03	
ULTA BEAUTY INC	3,734	389.290	1,453,608.86	
WILLIAMS-SONOMA INC	10,952	145.020	1,588,259.04	
ALBERTSONS COS INC - CLASS A	31,907	18.860	601,766.02	
COSTCO WHOLESALE CORP	38,003	907.870	34,501,783.61	
DOLLAR GENERAL CORP	18,277	85.750	1,567,252.75	
DOLLAR TREE INC	15,923	71.910	1,145,022.93	
KROGER CO	56,767	56.190	3,189,737.73	
SYSCO CORP	44,624	77.120	3,441,402.88	
TARGET CORP	38,491	152.840	5,882,964.44	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	52,808	9.020	476,328.16	
WALMART INC	379,538	80.560	30,575,581.28	
ALTRIA GROUP INC	143,314	51.700	7,409,333.80	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	42,289	60.410	2,554,678.49	
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	18,548	46.620	864,707.76	
BUNGE GLOBAL SA	12,343	97.290	1,200,850.47	
CAMPBELL SOUP CO	12,945	51.560	667,444.20	
CELSIUS HOLDINGS INC	11,375	33.180	377,422.50	
COCA-COLA CO/THE	351,399	72.100	25,335,867.90	
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	18,105	81.880	1,482,437.40	
CONAGRA BRANDS INC	39,722	32.600	1,294,937.20	
CONSTELLATION BRANDS INC-A	13,962	253.650	3,541,461.30	
GENERAL MILLS INC	46,029	74.630	3,435,144.27	
HERSHEY CO/THE	12,733	200.810	2,556,913.73	
HORMEL FOODS CORP	25,536	32.530	830,686.08	
JM SMUCKER CO/THE	8,172	120.880	987,831.36	
KELLANOVA	25,249	80.680	2,037,089.32	
KEURIG DR PEPPER INC	93,410	37.350	3,488,863.50	
KRAFT HEINZ CO/THE	82,333	35.630	2,933,524.79	
LAMB WESTON HOLDINGS INC	10,534	64.760	682,181.84	
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	22,009	84.760	1,865,482.84	
MOLSON COORS BEVERAGE CO - B	16,433	55.500	912,031.50	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	113,082	75.530	8,541,083.46	
MONSTER BEVERAGE CORP	63,778	50.750	3,236,733.50	
PEPSICO INC	118,115	177.210	20,931,159.15	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	133,950	125.970	16,873,681.50	
TYSON FOODS INC-CL A	25,497	61.850	1,576,989.45	
CHURCH & DWIGHT CO INC	19,954	105.220	2,099,559.88	
CLOROX COMPANY	10,423	165.950	1,729,696.85	
COLGATE-PALMOLIVE CO	65,674	105.430	6,924,009.82	
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	19,241	85.130	1,637,986.33	

KENVUE INC	158,991	23.380	3,717,209.58	
KIMBERLY-CLARK CORP	28,172	144.200	4,062,402.40	
PROCTER & GAMBLE CO/THE	202,313	177.240	35,857,956.12	
ABBOTT LABORATORIES	149,852	117.630	17,627,090.76	
ALIGN TECHNOLOGY INC	5,703	249.560	1,423,240.68	
BAXTER INTERNATIONAL INC	39,241	40.260	1,579,842.66	
BECTON DICKINSON AND CO	24,215	234.040	5,667,278.60	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	124,087	83.510	10,362,505.37	
CARDINAL HEALTH INC	20,986	113.280	2,377,294.08	
CENCORA INC	15,601	241.240	3,763,585.24	
CENTENE CORP	44,436	76.570	3,402,464.52	
COOPER COS INC/THE	17,340	111.230	1,928,728.20	
CVS HEALTH CORP	104,686	58.370	6,110,521.82	
DAVITA INC	4,138	165.190	683,556.22	
DEXCOM INC	33,202	70.090	2,327,128.18	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	51,676	69.360	3,584,247.36	
ELEVANCE HEALTH INC	20,124	553.500	11,138,634.00	
GE HEALTHCARE TECHNOLOGY	35,095	86.640	3,040,630.80	
HCA HEALTHCARE INC	16,659	403.430	6,720,740.37	
HENRY SCHEIN INC	10,457	69.870	730,630.59	
HOLOGIC INC	19,730	82.700	1,631,671.00	
HUMANA INC	10,475	315.230	3,302,034.25	
IDEXX LABORATORIES INC	7,376	511.380	3,771,938.88	
INSULET CORP	5,082	233.890	1,188,628.98	
INTUITIVE SURGICAL INC	30,598	491.390	15,035,551.22	
LABCORP HOLDINGS INC	7,903	225.760	1,784,181.28	
MCKESSON CORP	10,903	519.820	5,667,597.46	
MEDTRONIC PLC	110,600	90.110	9,966,166.00	
MOLINA HEALTHCARE INC	4,673	360.770	1,685,878.21	
QUEST DIAGNOSTICS INC	9,647	156.360	1,508,404.92	
RESMED INC	12,536	251.770	3,156,188.72	
SOLVENTUM CORP	10,620	71.790	762,409.80	
STERIS PLC	9,126	243.730	2,224,279.98	
STRYKER CORP	29,004	371.960	10,788,327.84	
TELEFLEX INC	3,952	246.050	972,389.60	
THE CIGNA GROUP	23,734	366.850	8,706,817.90	
UNITEDHEALTH GROUP INC	78,512	589.140	46,254,559.68	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	5,785	234.990	1,359,417.15	
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	12,279	217.030	2,664,911.37	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	18,219	107.430	1,957,267.17	
ABBVIE INC	150,635	195.730	29,483,788.55	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	25,379	138.310	3,510,169.49	

ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	11,014	270.370	2,977,855.18	
AMGEN INC	46,259	335.260	15,508,792.34	
AVANTOR INC	56,039	27.200	1,524,260.80	
BIOGEN INC	12,779	199.580	2,550,432.82	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	18,017	69.860	1,258,667.62	
BIO-RAD LABORATORIES-A	1,728	330.260	570,689.28	
BIO-TECHNE CORP	13,296	74.760	994,008.96	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	170,214	49.990	8,508,997.86	
CATALENT INC	16,025	60.160	964,064.00	
CHARLES RIVER LABORATORIES	4,795	203.730	976,885.35	
DANAHER CORP	57,483	276.030	15,867,032.49	
ELI LILLY & CO	68,957	923.540	63,684,547.78	
EXACT SCIENCES CORP	13,570	69.480	942,843.60	
GILEAD SCIENCES INC	104,725	83.160	8,708,931.00	
ILLUMINA INC	14,966	129.520	1,938,396.32	
INCYTE CORP	15,899	66.410	1,055,852.59	
IQVIA HOLDINGS INC	15,286	239.380	3,659,162.68	
JOHNSON & JOHNSON	205,298	166.990	34,282,713.02	
MERCK & CO. INC.	216,057	117.960	25,486,083.72	
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	1,813	1,393.250	2,525,962.25	
MODERNA INC	27,369	69.170	1,893,113.73	
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	8,744	122.250	1,068,954.00	
PFIZER INC	489,096	30.070	14,707,116.72	
REGENERON PHARMACEUTICALS	9,121	1,153.080	10,517,242.68	
REVVITY INC	10,411	122.800	1,278,470.80	
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	27,162	28.260	767,598.12	
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	102,259	18.070	1,847,820.13	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	32,830	614.150	20,162,544.50	
UNITED THERAPEUTICS CORP	3,537	344.980	1,220,194.26	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	21,794	489.430	10,666,637.42	
VIATRIS INC	99,736	11.810	1,177,882.16	
WATERS CORP	5,084	328.650	1,670,856.60	
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	6,204	296.780	1,841,223.12	
ZOETIS INC	38,410	194.250	7,461,142.50	
BANK OF AMERICA CORP	596,414	39.100	23,319,787.40	
CITIGROUP INC	160,852	58.390	9,392,148.28	
CITIZENS FINANCIAL GROUP	36,122	40.600	1,466,553.20	
FIFTH THIRD BANCORP	58,586	42.380	2,482,874.68	
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	845	1,871.320	1,581,265.40	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	128,600	14.640	1,882,704.00	
JPMORGAN CHASE & CO	245,020	207.860	50,929,857.20	
KEYCORP	84,828	16.270	1,380,151.56	

M & T BANK CORP	14,423	173.080	2,496,332.84	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	34,855	180.920	6,305,966.60	
REGIONS FINANCIAL CORP	79,089	22.300	1,763,684.70	
TRUIST FINANCIAL CORP	110,627	42.130	4,660,715.51	
US BANCORP	129,406	44.690	5,783,154.14	
WELLS FARGO & CO	297,335	53.790	15,993,649.65	
ALLY FINANCIAL INC	20,139	33.030	665,191.17	
AMERICAN EXPRESS CO	49,743	261.090	12,987,399.87	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	8,870	445.140	3,948,391.80	
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	34,367	117.160	4,026,437.72	
ARES MANAGEMENT CORP - A	16,991	149.390	2,538,285.49	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	61,100	70.530	4,309,383.00	
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	113,330	451.780	51,200,227.40	
BLACKROCK INC	12,569	895.180	11,251,517.42	
BLACKSTONE INC	60,652	154.560	9,374,373.12	
BLOCK INC	49,568	65.780	3,260,583.04	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	32,018	140.950	4,512,937.10	
CARLYLE GROUP INC/THE	16,730	41.080	687,268.40	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	9,059	212.610	1,926,033.99	
CME GROUP INC	30,011	218.530	6,558,303.83	
COINBASE GLOBAL INC -CLASS A	16,066	161.500	2,594,659.00	
COREBRIDGE FINANCIAL INC	19,925	27.180	541,561.50	
CORPAY INC	6,278	307.630	1,931,301.14	
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	21,512	133.910	2,880,671.92	
EQUITABLE HOLDINGS INC	31,450	40.780	1,282,531.00	
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	2,946	453.980	1,337,425.08	
FIDELITY NATIONAL INFO SERV	47,604	85.030	4,047,768.12	
FISERV INC	49,889	175.350	8,748,036.15	
FRANKLIN RESOURCES INC	21,778	20.110	437,955.58	
FUTU HOLDINGS LTD-ADR	4,784	57.540	275,271.36	
GLOBAL PAYMENTS INC	20,594	111.050	2,286,963.70	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	27,281	485.160	13,235,649.96	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	48,090	161.910	7,786,251.90	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	6,120	177.060	1,083,607.20	
KKR & CO INC	54,340	126.540	6,876,183.60	
LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	6,164	208.140	1,282,974.96	
MARKETAXESS HOLDINGS INC	2,653	259.000	687,127.00	
MASTERCARD INC - A	71,169	497.710	35,421,522.99	
MOODY'S CORP	13,799	484.840	6,690,307.16	
MORGAN STANLEY	103,002	100.090	10,309,470.18	
MSCI INC	6,799	566.660	3,852,721.34	
NASDAQ INC	36,003	73.300	2,639,019.90	

NORTHERN TRUST CORP	16,793	89.750	1,507,171.75	
PAYPAL HOLDINGS INC	85,759	71.070	6,094,892.13	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	17,112	119.730	2,048,819.76	
ROBINHOOD MARKETS INC - A	50,779	22.210	1,127,801.59	
S&P GLOBAL INC	27,631	527.380	14,572,036.78	
SCHWAB (CHARLES) CORP	131,436	63.690	8,371,158.84	
SEI INVESTMENTS COMPANY	7,550	67.480	509,474.00	
STATE STREET CORP	25,474	85.460	2,177,008.04	
SYNCHRONY FINANCIAL	32,112	47.330	1,519,860.96	
T ROWE PRICE GROUP INC	20,577	105.865	2,178,384.10	
TOAST INC-CLASS A	35,993	26.570	956,334.01	
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	8,688	119.550	1,038,650.40	
VISA INC-CLASS A SHARES	134,891	290.480	39,183,137.68	
AFLAC INC	44,628	110.170	4,916,666.76	
ALLSTATE CORP	22,831	190.560	4,350,675.36	
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	4,866	136.120	662,359.92	
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	55,264	73.000	4,034,272.00	
AON PLC-CLASS A	16,323	350.690	5,724,312.87	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	32,647	114.220	3,728,940.34	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	18,202	299.550	5,452,409.10	
ASSURANT INC	4,977	192.920	960,162.84	
BROWN & BROWN INC	20,402	104.110	2,124,052.22	
CHUBB LTD	33,496	291.320	9,758,054.72	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	13,251	137.180	1,817,772.18	
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	2,244	527.900	1,184,607.60	
EVEREST GROUP LTD	3,547	389.430	1,381,308.21	
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	24,937	60.610	1,511,431.57	
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	25,592	116.630	2,984,794.96	
LOEWS CORP	16,971	78.840	1,337,993.64	
MARKEL GROUP INC	1,175	1,574.830	1,850,425.25	
MARSH & MCLENNAN COS	41,510	231.170	9,595,866.70	
METLIFE INC	52,395	77.380	4,054,325.10	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	19,458	82.170	1,598,863.86	
PROGRESSIVE CORP	50,624	256.310	12,975,437.44	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	32,008	117.730	3,768,301.84	
TRAVELERS COS INC/THE	19,523	242.260	4,729,641.98	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	8,848	293.970	2,601,046.56	
WR BERKLEY CORP	27,229	58.750	1,599,703.75	
ACCENTURE PLC-CL A	53,920	354.120	19,094,150.40	
ADOBE INC	37,625	521.500	19,621,437.50	
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	13,226	99.290	1,313,209.54	
ANSYS INC	7,892	318.050	2,510,050.60	

APPLOVIN CORP-CLASS A	19,293	116.250	2,242,811.25	
ASPEN TECHNOLOGY INC	1,901	226.100	429,816.10	
ATLASSIAN CORP-CL A	12,421	165.150	2,051,328.15	
AUTODESK INC	19,029	267.730	5,094,634.17	
BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	15,779	49.360	778,851.44	
CADENCE DESIGN SYS INC	22,681	273.130	6,194,861.53	
CHECK POINT SOFTWARE TECH	8,287	192.970	1,599,142.39	
CLOUDFLARE INC - CLASS A	27,192	79.930	2,173,456.56	
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	41,604	77.870	3,239,703.48	
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	19,060	267.810	5,104,458.60	
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	4,025	273.400	1,100,435.00	
DATADOG INC - CLASS A	22,908	111.400	2,551,951.20	
DOCUSIGN INC	17,164	56.760	974,228.64	
DYNATRACE INC	21,256	51.550	1,095,746.80	
EPAM SYSTEMS INC	4,815	205.460	989,289.90	
FAIR ISAAC CORP	2,176	1,894.980	4,123,476.48	
FORTINET INC	52,961	76.340	4,043,042.74	
GARTNER INC	6,537	510.080	3,334,392.96	
GEN DIGITAL INC	41,779	26.620	1,112,156.98	
GODADDY INC - CLASS A	11,895	150.300	1,787,818.50	
HUBSPOT INC	3,878	495.410	1,921,199.98	
INTL BUSINESS MACHINES CORP	79,188	217.160	17,196,466.08	
INTUIT INC	24,113	646.250	15,583,026.25	
MANHATTAN ASSOCIATES INC	4,648	270.400	1,256,819.20	
MICROSOFT CORP	602,701	431.340	259,969,049.34	
MICROSTRATEGY INC-CL A	14,020	134.530	1,886,110.60	
MONDAY.COM LTD	3,167	263.130	833,332.71	
MONGODB INC	5,921	290.050	1,717,386.05	
OKTA INC	13,914	74.030	1,030,053.42	
ORACLE CORP	142,145	170.330	24,211,557.85	
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	178,162	36.310	6,469,062.22	
PALO ALTO NETWORKS INC	27,325	346.110	9,457,455.75	
PTC INC	9,246	173.760	1,606,584.96	
ROPER TECHNOLOGIES INC	8,988	556.560	5,002,361.28	
SALESFORCE INC	82,659	256.910	21,235,923.69	
SAMSARA INC-CL A	13,749	46.940	645,378.06	
SERVICENOW INC	17,689	892.460	15,786,724.94	
SNOWFLAKE INC-CLASS A	24,978	112.840	2,818,517.52	
SYNOPSYS INC	12,929	498.570	6,446,011.53	
TWILIO INC - A	15,028	60.300	906,188.40	
TYLER TECHNOLOGIES INC	3,550	585.730	2,079,341.50	
VERISIGN INC	7,316	182.460	1,334,877.36	

WIX.COM LTD	3,881	156.590	607,725.79	
WORKDAY INC-CLASS A	18,596	249.210	4,634,309.16	
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	23,688	67.620	1,601,782.56	
ZSCALER INC	7,508	171.780	1,289,724.24	
AMPHENOL CORP-CL A	102,192	63.270	6,465,687.84	
APPLE INC	1,243,373	216.320	268,966,447.36	
ARISTA NETWORKS INC	22,318	359.160	8,015,732.88	
CDW CORP/DE	10,704	221.450	2,370,400.80	
CISCO SYSTEMS INC	346,969	51.030	17,705,828.07	
CORNING INC	64,764	42.910	2,779,023.24	
DELL TECHNOLOGIES -C	25,479	115.400	2,940,276.60	
F5 INC	4,939	213.420	1,054,081.38	
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	102,647	17.230	1,768,607.81	
HP INC	85,880	33.760	2,899,308.80	
JABIL INC	9,808	105.720	1,036,901.76	
JUNIPER NETWORKS INC	30,061	38.630	1,161,256.43	
KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	15,964	149.480	2,386,298.72	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	13,944	443.180	6,179,701.92	
NETAPP INC	17,045	117.860	2,008,923.70	
PURE STORAGE INC - CLASS A	28,039	49.580	1,390,173.62	
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	15,879	101.440	1,610,765.76	
SUPER MICRO COMPUTER INC	4,557	449.100	2,046,548.70	
TE CONNECTIVITY LTD	25,716	145.880	3,751,450.08	
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	4,328	429.140	1,857,317.92	
TRIMBLE INC	20,783	58.410	1,213,935.03	
WESTERN DIGITAL CORP	29,044	64.090	1,861,429.96	
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	4,189	343.790	1,440,136.31	
ADVANCED MICRO DEVICES	139,000	152.080	21,139,120.00	
ANALOG DEVICES INC	43,053	223.280	9,612,873.84	
APPLIED MATERIALS INC	69,692	187.580	13,072,825.36	
BROADCOM INC	378,262	164.020	62,042,533.24	
ENPHASE ENERGY INC	10,381	111.490	1,157,377.69	
ENTEGRIS INC	12,569	110.150	1,384,475.35	
FIRST SOLAR INC	8,882	233.310	2,072,259.42	
INTEL CORP	358,536	20.910	7,496,987.76	
KLA CORP	11,357	736.400	8,363,294.80	
LAM RESEARCH CORP	11,046	758.470	8,378,059.62	
MARVELL TECHNOLOGY INC	75,550	73.400	5,545,370.00	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	44,600	77.000	3,434,200.00	
MICRON TECHNOLOGY INC	93,001	87.180	8,107,827.18	
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	4,028	885.230	3,565,706.44	
NVIDIA CORP	2,099,584	116.780	245,189,419.52	

NXP SEMICONDUCTORS NV	22,287	230.010	5,126,232.87	
ON SEMICONDUCTOR	35,773	70.370	2,517,346.01	
QORVO INC	7,835	100.460	787,104.10	
QUALCOMM INC	96,155	166.610	16,020,384.55	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	13,506	97.250	1,313,458.50	
TERADYNE INC	12,464	127.980	1,595,142.72	
TEXAS INSTRUMENTS INC	78,458	198.470	15,571,559.26	
AT&T INC	619,933	22.270	13,805,907.91	
T-MOBILE US INC	45,251	205.850	9,314,918.35	
VERIZON COMMUNICATIONS INC	363,026	45.000	16,336,170.00	
AES CORP	54,086	19.010	1,028,174.86	
ALLIANT ENERGY CORP	21,204	60.510	1,283,054.04	
AMEREN CORPORATION	22,382	85.470	1,912,989.54	
AMERICAN ELECTRIC POWER	43,705	104.950	4,586,839.75	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	17,778	149.090	2,650,522.02	
ATMOS ENERGY CORP	13,505	138.270	1,867,336.35	
CENTERPOINT ENERGY INC	54,717	28.210	1,543,566.57	
CMS ENERGY CORP	27,913	70.480	1,967,308.24	
CONSOLIDATED EDISON INC	28,772	104.850	3,016,744.20	
CONSTELLATION ENERGY	26,817	199.250	5,343,287.25	
DOMINION ENERGY INC	72,436	58.530	4,239,679.08	
DTE ENERGY COMPANY	18,974	126.360	2,397,554.64	
DUKE ENERGY CORP	65,574	117.700	7,718,059.80	
EDISON INTERNATIONAL	32,299	86.250	2,785,788.75	
ENTERGY CORP	17,246	128.460	2,215,421.16	
ESSENTIAL UTILITIES INC	25,795	39.470	1,018,128.65	
EVERGY INC	22,411	62.010	1,389,706.11	
EVERSOURCE ENERGY	30,845	68.400	2,109,798.00	
EXELON CORP	84,941	40.430	3,434,164.63	
FIRSTENERGY CORP	45,110	44.340	2,000,177.40	
NEXTERA ENERGY INC	176,613	84.640	14,948,524.32	
NISOURCE INC	34,855	34.380	1,198,314.90	
NRG ENERGY INC	18,864	80.780	1,523,833.92	
P G & E CORP	174,106	20.010	3,483,861.06	
PPL CORP	61,956	32.680	2,024,722.08	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	42,789	84.770	3,627,223.53	
SEMPRA	53,312	83.600	4,456,883.20	
SOUTHERN CO/THE	92,045	89.890	8,273,925.05	
VISTRA CORP	29,322	89.400	2,621,386.80	
WEC ENERGY GROUP INC	25,816	96.140	2,481,950.24	
XCEL ENERGY INC	45,776	64.560	2,955,298.56	
ALPHABET INC-CL A	501,072	158.060	79,199,440.32	

	ALPHABET INC-CL C	431,512	158.990	68,606,092.88	
	CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	7,601	343.370	2,609,955.37	
	COMCAST CORP-CLASS A	333,137	39.360	13,112,272.32	
	ELECTRONIC ARTS INC	20,831	146.520	3,052,158.12	
	FOX CORP - CLASS A	23,886	39.710	948,513.06	
	FOX CORP - CLASS B	8,773	36.770	322,583.21	
	INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	32,096	31.170	1,000,432.32	
	LIBERTY MEDIA CORP-LIB-NEW-C	16,121	77.590	1,250,828.39	
	LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	13,554	101.520	1,376,002.08	
	MATCH GROUP INC	24,529	35.180	862,930.22	
	META PLATFORMS INC-CLASS A	187,256	533.280	99,859,879.68	
	NETFLIX INC	36,998	696.500	25,769,107.00	
	NEWS CORP - CLASS A	34,405	26.090	897,626.45	
	OMNICOM GROUP	18,370	101.090	1,857,023.30	
	PARAMOUNT GLOBAL-CLASS B	40,964	10.420	426,844.88	
	PINTEREST INC- CLASS A	48,115	28.890	1,390,042.35	
	ROBLOX CORP -CLASS A	37,893	46.240	1,752,172.32	
	ROKU INC	9,945	74.370	739,609.65	
	SEA LTD-ADR	31,577	79.880	2,522,370.76	
	SNAP INC - A	86,463	9.640	833,503.32	
	TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWRE	14,811	152.450	2,257,936.95	
	TRADE DESK INC/THE -CLASS A	36,722	105.370	3,869,397.14	
	WALT DISNEY CO/THE	154,051	91.850	14,149,584.35	
	WARNER BROS DISCOVERY INC	201,390	8.560	1,723,898.40	
	CBRE GROUP INC - A	27,148	119.500	3,244,186.00	
	COSTAR GROUP INC	33,292	77.900	2,593,446.80	
	HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	79,100	3.680	291,088.00	
	ZILLOW GROUP INC - C	16,334	62.590	1,022,345.06	
アメリカ・ドル小計		31,226,060		4,105,320,480.50 (577,905,964,040)	
カナダ・ドル	ARC RESOURCES LTD	44,923	23.210	1,042,662.83	
	CAMECO CORP	33,586	55.100	1,850,588.60	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	186,016	43.930	8,171,682.88	
	CENOVUS ENERGY INC	120,048	22.360	2,684,273.28	
	ENBRIDGE INC	189,679	55.960	10,614,436.84	
	IMPERIAL OIL LTD	16,267	91.050	1,481,110.35	
	KEYERA CORP	19,802	41.140	814,654.28	
	MEG ENERGY CORP	21,651	24.640	533,480.64	
	PARKLAND CORP	16,066	34.510	554,437.66	
	PEMBINA PIPELINE CORP	45,973	55.320	2,543,226.36	
	SUNCOR ENERGY INC	108,809	49.920	5,431,745.28	
	TC ENERGY CORP	90,192	63.550	5,731,701.60	

	TOURMALINE OIL CORP	26,107	59.110	1,543,184.77	
	AGNICO EAGLE MINES LTD	41,898	112.190	4,700,536.62	
	BARRICK GOLD CORP	157,839	27.880	4,400,551.32	
	CCL INDUSTRIES INC - CL B	13,268	81.470	1,080,943.96	
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	68,446	16.770	1,147,839.42	
	FRANCO-NEVADA CORP	15,696	169.790	2,665,023.84	
	IVANHOE MINES LTD-CL A	56,432	17.840	1,006,746.88	
	KINROSS GOLD CORP	110,156	12.860	1,416,606.16	
	LUNDIN MINING CORP	46,446	12.480	579,646.08	
	NUTRIEN LTD	42,180	63.290	2,669,572.20	
	PAN AMERICAN SILVER CORP	25,157	28.880	726,534.16	
	TECK RESOURCES LTD-CLS B	40,547	63.950	2,592,980.65	
	WEST FRASER TIMBER CO LTD	4,438	124.800	553,862.40	
	WHEATON PRECIOUS METALS CORP	40,353	84.600	3,413,863.80	
	CAE INC	27,474	23.950	658,002.30	
	STANTEC INC	9,939	107.730	1,070,728.47	
	TOROMONT INDUSTRIES LTD	6,027	128.970	777,302.19	
	WSP GLOBAL INC	11,089	233.250	2,586,509.25	
	ELEMENT FLEET MANAGEMENT COR	32,674	28.320	925,327.68	
	GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	15,630	54.590	853,241.70	
	RB GLOBAL INC	15,569	115.660	1,800,710.54	
	THOMSON REUTERS CORP	13,747	234.870	3,228,757.89	
	AIR CANADA	12,083	16.400	198,161.20	
	CANADIAN NATL RAILWAY CO	47,256	163.870	7,743,840.72	
	CANADIAN PACIFIC KANSAS CITY	79,413	118.610	9,419,175.93	
	TFI INTERNATIONAL INC	6,995	196.610	1,375,286.95	
	MAGNA INTERNATIONAL INC	22,436	54.530	1,223,435.08	
	BRP INC/CA- SUB VOTING	3,082	82.190	253,309.58	
	GILDAN ACTIVEWEAR INC	11,302	61.920	699,819.84	
	RESTAURANT BRANDS INTERN	25,379	94.990	2,410,751.21	
	CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	4,737	157.830	747,640.71	
	DOLLARAMA INC	24,084	136.480	3,286,984.32	
	ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	64,619	75.750	4,894,889.25	
	EMPIRE CO LTD 'A'	9,148	39.760	363,724.48	
	LOBLAW COMPANIES LTD	14,057	180.800	2,541,505.60	
	METRO INC/CN	18,929	86.400	1,635,465.60	
	WESTON (GEORGE) LTD	4,984	226.680	1,129,773.12	
	SAPUTO INC	18,270	29.410	537,320.70	
	BANK OF MONTREAL	60,312	117.980	7,115,609.76	
	BANK OF NOVA SCOTIA	102,004	71.530	7,296,346.12	
	CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	78,946	83.590	6,599,096.14	
	NATIONAL BANK OF CANADA	29,961	126.880	3,801,451.68	

	ROYAL BANK OF CANADA	122,095	167.580	20,460,680.10	
	TORONTO-DOMINION BANK	149,615	85.490	12,790,586.35	
	BROOKFIELD ASSET MGMT-A	31,451	61.410	1,931,405.91	
	BROOKFIELD CORP	113,931	68.500	7,804,273.50	
	IGM FINANCIAL INC	4,949	39.120	193,604.88	
	ONEX CORPORATION	4,217	91.170	384,463.89	
	TMX GROUP LTD	26,034	43.700	1,137,685.80	
	FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	1,745	1,684.980	2,940,290.10	
	GREAT-WEST LIFECO INC	22,964	45.520	1,045,321.28	
	IA FINANCIAL CORP INC	8,268	105.930	875,829.24	
	INTACT FINANCIAL CORP	16,097	254.610	4,098,457.17	
	MANULIFE FINANCIAL CORP	158,627	38.440	6,097,621.88	
	POWER CORP OF CANADA	50,268	42.350	2,128,849.80	
	SUN LIFE FINANCIAL INC	46,259	76.810	3,553,153.79	
	CGI INC	18,609	157.660	2,933,894.94	
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	1,727	4,355.410	7,521,793.07	
	DESCARTES SYSTEMS GRP/THE	6,424	135.440	870,066.56	
	OPEN TEXT CORP	21,507	43.670	939,210.69	
	SHOPIFY INC - CLASS A	104,152	99.980	10,413,116.96	
	BCE INC	8,653	46.710	404,181.63	
	QUEBECOR INC -CL B	14,578	34.550	503,669.90	
	ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	32,571	55.620	1,811,599.02	
	TELUS CORP	15,222	23.030	350,562.66	
	ALTAGAS LTD	27,309	35.310	964,280.79	
	BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	11,200	41.240	461,888.00	
	CANADIAN UTILITIES LTD-A	7,344	35.890	263,576.16	
	EMERA INC	22,591	53.360	1,205,455.76	
	FORTIS INC	41,868	61.990	2,595,397.32	
	HYDRO ONE LTD	33,037	47.940	1,583,793.78	
	FIRSTSERVICE CORP	3,669	245.830	901,950.27	
カナダ・ドル小計		3,479,102		244,292,722.07 (25,298,954,298)	
オーストラリア・ドル	AMPOL LTD	19,016	28.930	550,132.88	
	SANTOS LTD	278,806	7.000	1,951,642.00	
	WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	162,029	24.100	3,904,898.90	
	BHP GROUP LTD	438,420	39.550	17,339,511.00	
	BLUESCOPE STEEL LTD	37,214	20.050	746,140.70	
	FORTESCUE LTD	135,233	17.190	2,324,655.27	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	36,927	53.220	1,965,254.94	
	MINERAL RESOURCES LTD	17,115	38.270	654,991.05	
	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	92,960	15.830	1,471,556.80	
	ORICA LTD	36,212	17.640	638,779.68	

	PILBARA MINERALS LTD	280,194	2.880	806,958.72	
	RIO TINTO LTD	32,627	110.810	3,615,397.87	
	SOUTH32 LTD	336,639	3.170	1,067,145.63	
	REECE LTD	13,059	27.950	364,999.05	
	SEVEN GROUP HOLDINGS LTD	16,425	41.890	688,043.25	
	BRAMBLES LTD	122,717	18.540	2,275,173.18	
	COMPUTERSHARE LTD	50,853	27.730	1,410,153.69	
	QANTAS AIRWAYS LTD	78,226	7.030	549,928.78	
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	47,081	55.930	2,633,240.33	
	LOTTERY CORP LTD/THE	173,268	5.120	887,132.16	
	WESFARMERS LTD	96,169	70.580	6,787,608.02	
	COLES GROUP LTD	111,645	19.030	2,124,604.35	
	ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALI	138,738	5.050	700,626.90	
	WOOLWORTHS GROUP LTD	107,180	35.120	3,764,161.60	
	TREASURY WINE ESTATES LTD	62,913	11.140	700,850.82	
	COCHLEAR LTD	5,404	290.070	1,567,538.28	
	PRO MEDICUS LTD	5,586	162.170	905,881.62	
	RAMSAY HEALTH CARE LTD	14,565	40.350	587,697.75	
	SONIC HEALTHCARE LTD	37,362	27.190	1,015,872.78	
	CSL LTD	41,471	296.690	12,304,030.99	
	ANZ GROUP HOLDINGS LTD	253,422	31.200	7,906,766.40	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	143,830	142.990	20,566,251.70	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	264,499	38.780	10,257,271.22	
	WESTPAC BANKING CORP	303,158	32.790	9,940,550.82	
	ASX LTD	15,385	64.010	984,793.85	
	MACQUARIE GROUP LTD	31,658	228.400	7,230,687.20	
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	22,786	33.470	762,647.42	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP	173,755	7.750	1,346,601.25	
	MEDIBANK PRIVATE LTD	193,702	3.800	736,067.60	
	QBE INSURANCE GROUP LTD	124,450	16.670	2,074,581.50	
	SUNCORP GROUP LTD	117,223	18.260	2,140,491.98	
	WISETECH GLOBAL LTD	14,590	131.450	1,917,855.50	
	XERO LTD	12,671	144.400	1,829,692.40	
	TELSTRA GROUP LTD	367,025	4.010	1,471,770.25	
	ORIGIN ENERGY LTD	134,865	9.550	1,287,960.75	
	CAR GROUP LTD	27,943	36.850	1,029,699.55	
	REA GROUP LTD	3,813	201.640	768,853.32	
	SEEK LTD	29,833	22.750	678,700.75	
オーストラリア・ドル小計		5,260,662		149,235,852.45 (14,160,990,039)	
香港・ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	235,424	41.900	9,864,265.60	
	SWIRE PACIFIC LTD - CL A	27,000	62.250	1,680,750.00	

	TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	121,500	108.900	13,231,350.00	
	MTR CORP	118,500	26.950	3,193,575.00	
	SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	160,000	18.800	3,008,000.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	176,000	28.350	4,989,600.00	
	SANDS CHINA LTD	238,000	14.000	3,332,000.00	
	WH GROUP LTD	722,000	5.880	4,245,360.00	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	247,000	23.450	5,792,150.00	
	HANG SENG BANK LTD	63,400	90.150	5,715,510.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	102,400	221.200	22,650,880.00	
	AIA GROUP LTD	971,200	54.750	53,173,200.00	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	62,000	57.050	3,537,100.00	
	CLP HOLDINGS LTD	142,100	70.400	10,003,840.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	861,389	6.310	5,435,364.59	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	111,000	54.150	6,010,650.00	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	160,924	30.800	4,956,459.20	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	90,384	23.800	2,151,139.20	
	SINO LAND CO	248,200	8.040	1,995,528.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	135,500	79.000	10,704,500.00	
	WHARF HOLDINGS LTD	113,000	19.200	2,169,600.00	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	125,000	21.950	2,743,750.00	
香港・ドル小計		5,231,921		180,584,571.59 (3,261,357,363)	
シンガポール・ドル	KEPPEL LTD	115,000	6.330	727,950.00	
	SINGAPORE TECH ENGINEERING	108,600	4.620	501,732.00	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	113,566	6.500	738,179.00	
	GENTING SINGAPORE LTD	675,000	0.840	567,000.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	159,600	3.140	501,144.00	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	170,270	38.000	6,470,260.00	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	295,500	15.230	4,500,465.00	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	102,400	32.280	3,305,472.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	65,200	11.110	724,372.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	673,815	3.290	2,216,851.35	
	SEMBCORP INDUSTRIES LTD	89,200	5.130	457,596.00	
	CAPITALAND INVESTMENT LTD/SI	220,100	2.910	640,491.00	
シンガポール・ドル小計		2,788,251		21,351,512.35 (2,318,560,726)	
ニュージーランド・ドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	133,941	7.540	1,009,915.14	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	46,548	38.400	1,787,443.20	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	121,519	3.360	408,303.84	
	MERCURY NZ LTD	81,489	5.950	484,859.55	
	MERIDIAN ENERGY LTD	102,546	6.140	629,632.44	
ニュージーランド・ドル小計		486,043		4,320,154.17	

				(376,155,824)	
イギリス・ポンド	BP PLC	1,415,483	4.061	5,748,276.46	
	SHELL PLC	541,087	25.385	13,735,493.49	
	ANGLO AMERICAN PLC	104,777	20.995	2,199,793.11	
	ANTOFAGASTA PLC	30,983	17.615	545,765.54	
	CRODA INTERNATIONAL PLC	10,296	39.610	407,824.56	
	ENDEAVOUR MINING PLC	17,507	18.350	321,253.45	
	GLENCORE PLC	869,792	3.777	3,285,204.38	
	MONDI PLC	45,625	14.025	639,890.62	
	RIO TINTO PLC	95,791	47.740	4,573,062.34	
	ASHTEAD GROUP PLC	35,259	53.460	1,884,946.14	
	BAE SYSTEMS PLC	267,719	13.355	3,575,387.24	
	BUNZL PLC	26,105	36.720	958,575.60	
	DCC PLC	10,153	52.650	534,555.45	
	MELROSE INDUSTRIES PLC	119,456	4.672	558,098.43	
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	712,449	4.958	3,532,322.14	
	SMITHS GROUP PLC	36,853	18.160	669,250.48	
	SPIRAX GROUP PLC	5,904	73.650	434,829.60	
	EXPERIAN PLC	81,296	37.730	3,067,298.08	
	INTERTEK GROUP PLC	11,884	50.350	598,359.40	
	RELX PLC	159,389	36.400	5,801,759.60	
	RENTOKIL INITIAL PLC	190,467	3.758	715,774.98	
	BARRATT DEVELOPMENTS PLC	139,211	5.084	707,748.72	
	BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE	10,362	48.830	505,976.46	
	PERSIMMON PLC	27,665	16.540	457,579.10	
	TAYLOR WIMPEY PLC	353,772	1.655	585,492.66	
	COMPASS GROUP PLC	137,977	24.600	3,394,234.20	
	ENTAIN PLC	42,158	7.256	305,898.44	
	INTERCONTINENTAL HOTELS GROU	14,491	78.500	1,137,543.50	
	PEARSON PLC	46,942	10.575	496,411.65	
	WHITBREAD PLC	16,522	30.630	506,068.86	
	JD SPORTS FASHION PLC	251,482	1.543	388,036.72	
	KINGFISHER PLC	179,593	2.903	521,358.47	
	NEXT PLC	9,030	104.100	940,023.00	
	SAINSBURY (J) PLC	113,480	2.946	334,312.08	
	TESCO PLC	623,187	3.706	2,309,531.02	
	ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	30,992	22.320	691,741.44	
	BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	167,558	29.700	4,976,472.60	
	COCA-COLA HBC AG-DI	17,866	28.020	500,605.32	
	DIAGEO PLC	189,203	24.660	4,665,745.98	
	IMPERIAL BRANDS PLC	69,831	22.410	1,564,912.71	
	HALEON PLC	656,454	3.940	2,586,428.76	

	RECKITT BENCKISER GROUP PLC	56,558	45.850	2,593,184.30	
	UNILEVER PLC	214,792	49.500	10,632,204.00	
	NMC HEALTH PLC	3,940	0.010	39.40	
	SMITH & NEPHEW PLC	85,977	11.900	1,023,126.30	
	ASTRAZENECA PLC	132,243	120.160	15,890,318.88	
	GSK PLC	352,557	16.320	5,753,730.24	
	HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	14,590	19.530	284,942.70	
	BARCLAYS PLC	1,314,907	2.210	2,905,944.47	
	HSBC HOLDINGS PLC	1,585,380	6.547	10,379,482.86	
	LLOYDS BANKING GROUP PLC	5,165,051	0.581	3,000,894.63	
	NATWEST GROUP PLC	581,902	3.366	1,958,682.13	
	STANDARD CHARTERED PLC	182,397	7.594	1,385,122.81	
	3I GROUP PLC	81,145	32.390	2,628,286.55	
	HARGREAVES LANSDOWN PLC	31,008	11.055	342,793.44	
	LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	41,416	105.000	4,348,680.00	
	M&G PLC	217,201	2.074	450,474.87	
	SCHRODERS PLC	61,711	3.382	208,706.60	
	WISE PLC - A	43,661	6.300	275,064.30	
	ADMIRAL GROUP PLC	19,808	28.900	572,451.20	
	AVIVA PLC	217,835	4.914	1,070,441.19	
	LEGAL & GENERAL GROUP PLC	561,409	2.266	1,272,152.79	
	PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	59,286	5.460	323,701.56	
	PRUDENTIAL PLC	232,133	6.150	1,427,617.95	
	SAGE GROUP PLC/THE	75,045	10.175	763,582.87	
	HALMA PLC	32,277	26.000	839,202.00	
	BT GROUP PLC	540,623	1.475	797,418.92	
	VODAFONE GROUP PLC	1,981,261	0.784	1,553,308.62	
	CENTRICA PLC	527,715	1.171	617,954.26	
	NATIONAL GRID PLC	413,245	10.470	4,326,675.15	
	SEVERN TRENT PLC	20,117	26.890	540,946.13	
	SSE PLC	87,793	19.935	1,750,153.45	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	51,208	10.560	540,756.48	
	AUTO TRADER GROUP PLC	77,901	8.776	683,659.17	
	INFORMA PLC	105,332	8.466	891,740.71	
	WPP PLC	78,503	7.412	581,864.23	
イギリス・ポンド小計		23,133,978		163,979,147.94 (30,473,884,852)	
イスラエル・シュケル	ICL GROUP LTD	67,143	14.900	1,000,430.70	
	ELBIT SYSTEMS LTD	2,213	731.800	1,619,473.40	
	BANK HAPOALIM BM	98,327	34.970	3,438,495.19	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	135,088	33.470	4,521,395.36	
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	118,638	19.560	2,320,559.28	

	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	11,916	136.400	1,625,342.40	
	NICE LTD	4,458	614.900	2,741,224.20	
	AZRIELI GROUP LTD	3,527	245.000	864,115.00	
イスラエル・シュケル小計		441,310		18,131,035.53 (680,805,878)	
スイス・フラン	CLARIANT AG-REG	28,111	12.370	347,733.07	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	538	685.500	368,799.00	
	GIVAUDAN-REG	771	4,557.000	3,513,447.00	
	HOLCIM LTD	46,179	81.360	3,757,123.44	
	SIG GROUP AG	22,269	16.530	368,106.57	
	SIKA AG-REG	12,934	267.600	3,461,138.40	
	ABB LTD-REG	135,651	46.890	6,360,675.39	
	GEBERIT AG-REG	2,873	540.200	1,551,994.60	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	1,766	233.000	411,478.00	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	4,092	241.600	988,627.20	
	VAT GROUP AG	2,164	402.500	871,010.00	
	ADECCO GROUP AG-REG	14,810	27.080	401,054.80	
	SGS SA-REG	11,450	95.600	1,094,620.00	
	KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG	4,194	246.800	1,035,079.20	
	CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG	44,847	118.850	5,330,065.95	
	SWATCH GROUP AG/THE-BR	2,619	153.850	402,933.15	
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	5,225	30.500	159,362.50	
	AVOLTA AG	8,656	32.580	282,012.48	
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	382	1,456.000	556,192.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	72	10,880.000	783,360.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	8	106,200.000	849,600.00	
	NESTLE SA-REG	224,024	86.760	19,436,322.24	
	ALCON INC	41,643	83.340	3,470,527.62	
	SONOVA HOLDING AG-REG	4,173	303.500	1,266,505.50	
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	8,823	123.050	1,085,670.15	
	BACHEM HOLDING AG	1,756	75.350	132,314.60	
	GALDERMA GROUP AG	4,744	79.640	377,812.16	
	LONZA GROUP AG-REG	6,471	550.800	3,564,226.80	
	NOVARTIS AG-REG	166,888	98.410	16,423,448.08	
	ROCHE HOLDING AG-BR	2,584	283.800	733,339.20	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	60,422	264.100	15,957,450.20	
	SANDOZ GROUP AG	38,614	34.580	1,335,272.12	
	BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	3,006	89.150	267,984.90	
	JULIUS BAER GROUP LTD	15,168	47.100	714,412.80	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	2,044	1,192.000	2,436,448.00	
	UBS GROUP AG-REG	285,835	25.070	7,165,883.45	
	BALOISE HOLDING AG - REG	3,909	169.700	663,357.30	

	HELVETIA HOLDING AG-REG	4,111	137.100	563,618.10	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	2,277	699.800	1,593,444.60	
	SWISS RE AG	24,764	116.150	2,876,338.60	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	12,448	512.000	6,373,376.00	
	TEMENOS AG - REG	7,049	59.600	420,120.40	
	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	13,555	72.500	982,737.50	
	SWISSCOM AG-REG	1,994	552.000	1,100,688.00	
	BKW AG	1,385	154.000	213,290.00	
	SWISS PRIME SITE-REG	7,190	96.650	694,913.50	
スイス・フラン小計		1,294,488		122,743,914.57 (20,445,453,850)	
デンマーク・クローネ	NOVONESIS (NOVOZYMES) B	30,327	467.800	14,186,970.60	
	ROCKWOOL A/S-B SHS	849	2,934.000	2,490,966.00	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	86,250	159.150	13,726,687.50	
	AP MOLLER-MAERSK A/S-A	292	9,825.000	2,868,900.00	
	AP MOLLER-MAERSK A/S-B	412	10,110.000	4,165,320.00	
	DSV A/S	13,716	1,371.500	18,811,494.00	
	PANDORA A/S	7,823	1,190.500	9,313,281.50	
	CARLSBERG AS-B	8,080	794.200	6,417,136.00	
	COLOPLAST-B	10,365	942.000	9,763,830.00	
	DEMANT A/S	8,178	282.200	2,307,831.60	
	GENMAB A/S	5,493	1,776.500	9,758,314.50	
	NOVO NORDISK A/S-B	275,286	922.100	253,841,220.60	
	ZEALAND PHARMA A/S	5,299	915.000	4,848,585.00	
	DANSKE BANK A/S	59,312	205.600	12,194,547.20	
	TRYG A/S	24,975	158.000	3,946,050.00	
	ORSTED A/S	14,988	442.500	6,632,190.00	
デンマーク・クローネ小計		551,645		375,273,324.50 (7,873,234,348)	
ノルウェー・クローネ	AKER BP ASA	27,948	229.800	6,422,450.40	
	EQUINOR ASA	69,048	267.900	18,497,959.20	
	NORSK HYDRO ASA	149,325	62.020	9,261,136.50	
	YARA INTERNATIONAL ASA	12,718	308.800	3,927,318.40	
	KONGSBERG GRUPPEN ASA	7,896	1,101.000	8,693,496.00	
	MOWI ASA	36,354	187.000	6,798,198.00	
	ORKLA ASA	63,195	99.500	6,287,902.50	
	SALMAR ASA	6,204	548.500	3,402,894.00	
	DNB BANK ASA	71,576	214.800	15,374,524.80	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	18,691	194.700	3,639,137.70	
	TELENOR ASA	48,435	135.600	6,567,786.00	
ノルウェー・クローネ小計		511,390		88,872,803.50 (1,180,230,829)	

スウェーデン・クローナ	BOLIDEN AB	27,135	294.300	7,985,830.50	
	HOLMEN AB-B SHARES	7,024	425.200	2,986,604.80	
	SVENSKA CELLULOSA AB SCA-B	45,662	143.800	6,566,195.60	
	ADDTECH AB-B SHARES	27,319	311.400	8,507,136.60	
	ALFA LAVAL AB	23,093	462.200	10,673,584.60	
	ASSA ABLOY AB-B	80,816	329.100	26,596,545.60	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	235,332	178.600	42,030,295.20	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	125,066	157.500	19,697,895.00	
	BEIJER REF AB	27,042	173.050	4,679,618.10	
	EPIROC AB-A	56,566	193.800	10,962,490.80	
	EPIROC AB-B	33,182	172.600	5,727,213.20	
	HUSQVARNA AB-B SHS	34,897	65.600	2,289,243.20	
	INDUTRADE AB	27,951	305.400	8,536,235.40	
	INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	8,223	319.500	2,627,248.50	
	LIFCO AB-B SHS	24,912	331.000	8,245,872.00	
	NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	109,274	46.710	5,104,188.54	
	SAAB AB-B	27,812	233.000	6,480,196.00	
	SANDVIK AB	87,237	206.300	17,996,993.10	
	SKANSKA AB-B SHS	26,915	205.900	5,541,798.50	
	SKF AB-B SHARES	31,715	186.700	5,921,190.50	
	TRELLEBORG AB-B SHS	21,827	389.400	8,499,433.80	
	VOLVO AB-A SHS	13,283	257.800	3,424,357.40	
	VOLVO AB-B SHS	137,659	254.300	35,006,683.70	
	SECURITAS AB-B SHS	41,010	120.950	4,960,159.50	
	VOLVO CAR AB-B	100,230	24.490	2,454,632.70	
	EVOLUTION AB	14,444	1,001.000	14,458,444.00	
	HENNES & MAURITZ AB-B SHS	52,210	170.600	8,907,026.00	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	50,329	324.300	16,321,694.70	
	GETINGE AB-B SHS	21,124	223.000	4,710,652.00	
	SWEDISH ORPHAN BIOVITRUM AB	13,513	332.000	4,486,316.00	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	129,315	156.800	20,276,592.00	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	126,700	104.300	13,214,810.00	
	SWEDBANK AB - A SHARES	72,723	217.000	15,780,891.00	
	EQT AB	29,893	353.900	10,579,132.70	
	INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	10,598	358.400	3,798,323.20	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	14,289	356.000	5,086,884.00	
	INVESTOR AB-B SHS	146,684	303.750	44,555,265.00	
	LUNDBERGS AB-B SHS	6,081	564.500	3,432,724.50	
	ERICSSON LM-B SHS	253,908	75.300	19,119,272.40	
	HEXAGON AB-B SHS	175,674	99.200	17,426,860.80	
	TELE2 AB-B SHS	58,043	118.250	6,863,584.75	
	TELIA CO AB	187,675	33.190	6,228,933.25	

	FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	60,454	85.920	5,194,207.68	
	SAGAX AB-B	14,721	269.400	3,965,837.40	
スウェーデン・クローナ小計		2,819,560		487,909,094.22 (6,742,903,681)	
ユーロ	ENI SPA	196,350	14.114	2,771,283.90	
	GALP ENERGIA SGPS SA	43,361	17.030	738,437.83	
	NESTE OYJ	31,509	16.265	512,493.88	
	OMV AG	9,988	36.340	362,963.92	
	REPSOL SA	96,457	11.735	1,131,922.89	
	TENARIS SA	41,201	12.820	528,196.82	
	TOTALENERGIES SE	186,444	61.220	11,414,101.68	
	AIR LIQUIDE SA	49,230	169.520	8,345,469.60	
	AKZO NOBEL N.V.	14,109	57.440	810,420.96	
	ARCELORMITTAL	36,865	20.510	756,101.15	
	ARKEMA	5,145	79.100	406,969.50	
	BASF SE	73,728	43.555	3,211,223.04	
	COVESTRO AG	16,049	55.620	892,645.38	
	DSM-FIRMENICH AG	15,761	120.400	1,897,624.40	
	EVONIK INDUSTRIES AG	17,669	20.040	354,086.76	
	HEIDELBERG MATERIALS AG	12,541	93.760	1,175,844.16	
	OCI NV	11,025	26.850	296,021.25	
	STORA ENSO OYJ-R SHS	47,758	11.005	525,576.79	
	SYENSQO SA	6,353	71.730	455,700.69	
	SYMRISE AG	11,030	120.600	1,330,218.00	
	UPM-KYMMENE OYJ	43,970	29.110	1,279,966.70	
	VOESTALPINE AG	12,233	20.680	252,978.44	
	ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	19,741	41.000	809,381.00	
	AIRBUS SE	49,345	129.420	6,386,229.90	
	ALSTOM	25,574	17.250	441,151.50	
	BOUYGUES SA	17,123	32.040	548,620.92	
	BRENNTAG SE	12,153	63.660	773,659.98	
	COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN	36,112	78.660	2,840,569.92	
	DAIMLER TRUCK HOLDING AG	44,374	31.060	1,378,256.44	
	DASSAULT AVIATION SA	1,720	190.800	328,176.00	
	EIFFAGE	6,641	92.260	612,698.66	
	FERROVIAL SE	42,157	37.780	1,592,691.46	
	GEA GROUP AG	10,467	42.080	440,451.36	
	IMCD NV	4,340	156.000	677,040.00	
	KINGSPAN GROUP PLC	11,723	79.850	936,081.55	
	KNORR-BREMSE AG	7,217	74.350	536,583.95	
	KONE OYJ-B	27,371	49.820	1,363,623.22	
	LEGRAND SA	20,908	102.500	2,143,070.00	

LEONARDO SPA	35,486	20.780	737,399.08	
METSO CORP	50,483	8.448	426,480.38	
MTU AERO ENGINES AG	4,961	276.400	1,371,220.40	
PRYSMIAN SPA	24,541	61.520	1,509,762.32	
RATIONAL AG	350	879.000	307,650.00	
REXEL SA	23,491	25.050	588,449.55	
RHEINMETALL AG	3,447	518.200	1,786,235.40	
SAFRAN SA	29,905	203.300	6,079,686.50	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	46,198	227.150	10,493,875.70	
SIEMENS AG-REG	64,408	162.900	10,492,063.20	
SIEMENS ENERGY AG	55,049	29.110	1,602,476.39	
THALES SA	8,928	147.650	1,318,219.20	
VINCI SA	41,998	109.600	4,602,980.80	
WARTSILA OYJ ABP	45,125	18.700	843,837.50	
BUREAU VERITAS SA	30,794	29.980	923,204.12	
RANDSTAD NV	8,946	42.600	381,099.60	
TELEPERFORMANCE	4,299	99.800	429,040.20	
WOLTERS KLUWER	20,806	157.650	3,280,065.90	
ADP	3,679	115.500	424,924.50	
AENA SME SA	5,921	191.800	1,135,647.80	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	50,885	5.886	299,509.11	
DHL GROUP	90,860	39.620	3,599,873.20	
GETLINK SE	30,428	16.175	492,172.90	
INPOST SA	24,153	17.080	412,533.24	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	27,028	72.520	1,960,070.56	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF	6,498	68.850	447,387.30	
CONTINENTAL AG	8,078	53.280	430,395.84	
DR ING HC F PORSCHE AG	8,498	67.380	572,595.24	
FERRARI NV	10,626	416.800	4,428,916.80	
MERCEDES-BENZ GROUP AG	66,276	56.540	3,747,245.04	
MICHELIN (CGDE)	59,151	36.230	2,143,040.73	
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF	14,142	39.770	562,427.34	
RENAULT SA	14,764	38.770	572,400.28	
STELLANTIS NV	190,785	13.590	2,592,768.15	
VOLKSWAGEN AG-PREF	16,257	91.080	1,480,687.56	
ADIDAS AG	13,498	219.300	2,960,111.40	
HERMES INTERNATIONAL	2,670	1,896.000	5,062,320.00	
KERING	6,767	225.550	1,526,296.85	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	23,687	603.600	14,297,473.20	
MONCLER SPA	19,596	50.760	994,692.96	
PUMA SE	9,601	38.380	368,486.38	
SEB SA	1,127	93.000	104,811.00	

ACCOR SA	16,469	38.350	631,586.15	
AMADEUS IT GROUP SA	40,884	63.720	2,605,128.48	
DELIVERY HERO SE	13,293	27.830	369,944.19	
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	5,785	38.160	220,755.60	
SODEXO SA	6,960	78.200	544,272.00	
D'IETEREN GROUP	1,244	197.800	246,063.20	
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL	93,013	50.380	4,685,994.94	
PROSUS NV	117,720	32.250	3,796,470.00	
ZALANDO SE	17,418	24.000	418,032.00	
CARREFOUR SA	49,914	15.345	765,930.33	
JERONIMO MARTINS	22,106	16.760	370,496.56	
KESKO OYJ-B SHS	20,250	18.115	366,828.75	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	78,401	30.990	2,429,646.99	
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	78,137	58.120	4,541,322.44	
DANONE	55,871	65.300	3,648,376.30	
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	48,521	7.602	368,856.64	
HEINEKEN HOLDING NV	10,567	68.400	722,782.80	
HEINEKEN NV	22,805	81.960	1,869,097.80	
JDE PEET'S NV	13,317	20.440	272,199.48	
KERRY GROUP PLC-A	14,401	92.950	1,338,572.95	
LOTUS BAKERIES	31	12,120.000	375,720.00	
PERNOD RICARD SA	17,848	126.300	2,254,202.40	
BEIERSDORF AG	8,764	126.950	1,112,589.80	
HENKEL AG & CO KGAA	8,714	72.900	635,250.60	
HENKEL AG & CO KGAA VOR-PREF	15,381	80.500	1,238,170.50	
L'OREAL	20,209	365.900	7,394,473.10	
AMPLIFON SPA	10,123	27.270	276,054.21	
BIOMERIEUX	2,791	108.500	302,823.50	
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	3,583	57.000	204,231.00	
DIASORIN SPA	1,313	103.600	136,026.80	
ESSILORLUXOTTICA	25,357	208.100	5,276,791.70	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG	17,125	37.260	638,077.50	
FRESENIUS SE & CO KGAA	31,227	34.040	1,062,967.08	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	71,360	27.700	1,976,672.00	
SIEMENS HEALTHINEERS AG	23,498	49.410	1,161,036.18	
ARGENX SE	5,283	485.500	2,564,896.50	
BAYER AG-REG	82,511	26.710	2,203,868.81	
EUROFINS SCIENTIFIC	14,665	52.400	768,446.00	
GRIFOLS SA	15,169	10.100	153,206.90	
IPSEN	3,380	109.700	370,786.00	
MERCK KGAA	11,293	166.050	1,875,202.65	
ORION OYJ-CLASS B	10,542	47.090	496,422.78	

QIAGEN N.V.	20,951	41.755	874,809.00	
RECORDATI INDUSTRIA CHIMICA	8,068	50.550	407,837.40	
SANOFI	96,131	103.320	9,932,254.92	
SARTORIUS AG-VORZUG	2,164	240.000	519,360.00	
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	2,207	182.400	402,556.80	
UCB SA	10,385	164.450	1,707,813.25	
ABN AMRO BANK NV-CVA	43,340	16.210	702,541.40	
AIB GROUP PLC	154,127	5.325	820,726.27	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	484,418	9.322	4,515,744.59	
BANCO BPM SPA	108,163	5.974	646,165.76	
BANCO DE SABADELL SA	515,705	1.891	975,198.15	
BANCO SANTANDER SA	1,319,421	4.440	5,858,229.24	
BANK OF IRELAND GROUP PLC	87,661	9.790	858,201.19	
BNP PARIBAS	87,860	63.290	5,560,659.40	
CAIXABANK SA	308,048	5.430	1,672,700.64	
COMMERZBANK AG	82,105	15.595	1,280,427.47	
CREDIT AGRICOLE SA	90,899	14.260	1,296,219.74	
ERSTE GROUP BANK AG	30,160	47.740	1,439,838.40	
FINECOBANK SPA	60,333	15.080	909,821.64	
ING GROEP NV	280,658	16.298	4,574,164.08	
INTESA SANPAOLO	1,231,042	3.739	4,602,866.03	
KBC GROUP NV	20,304	68.940	1,399,757.76	
MEDIOBANCA SPA	47,708	14.950	713,234.60	
NORDEA BANK ABP	266,860	10.375	2,768,672.50	
SOCIETE GENERALE SA	68,477	22.275	1,525,325.17	
UNICREDIT SPA	125,812	37.100	4,667,625.20	
ADYEN NV	1,711	1,284.600	2,197,950.60	
AMUNDI SA	3,955	67.350	266,369.25	
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	161,748	14.598	2,361,197.30	
DEUTSCHE BOERSE AG	16,203	208.200	3,373,464.60	
EDENRED	20,297	35.570	721,964.29	
EURAZEO SE	3,897	72.200	281,363.40	
EURONEXT NV	7,818	100.600	786,490.80	
EXOR NV	8,669	97.650	846,527.85	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT NV	7,933	68.800	545,790.40	
NEXI SPA	57,060	6.076	346,696.56	
SOFINA	1,314	252.400	331,653.60	
AEGON LTD	127,748	5.434	694,182.63	
AGEAS	11,247	47.360	532,657.92	
ALLIANZ SE-REG	32,898	287.500	9,458,175.00	
ASR NEDERLAND NV	14,593	43.460	634,211.78	
AXA SA	152,526	36.190	5,519,915.94	

GENERALI	82,510	25.980	2,143,609.80	
HANNOVER RUECK SE	5,315	256.200	1,361,703.00	
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	11,630	485.900	5,651,017.00	
NN GROUP NV	20,802	44.690	929,641.38	
POSTE ITALIANE SPA	34,720	12.675	440,076.00	
SAMPO OYJ-A SHS	41,813	41.980	1,755,309.74	
TALANX AG	5,345	76.550	409,159.75	
BECHTLE AG	8,953	36.900	330,365.70	
CAPGEMINI SE	12,750	190.150	2,424,412.50	
DASSAULT SYSTEMES SE	57,951	35.500	2,057,260.50	
NEMETSCHEK SE	5,941	88.050	523,105.05	
SAP SE	89,076	200.150	17,828,561.40	
NOKIA OYJ	442,364	3.797	1,679,656.10	
ASM INTERNATIONAL NV	4,006	567.600	2,273,805.60	
ASML HOLDING NV	34,249	719.900	24,655,855.10	
BE SEMICONDUCTOR INDUSTRIES	6,286	111.250	699,317.50	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	106,869	29.050	3,104,544.45	
STMICROELECTRONICS NV	54,733	24.890	1,362,304.37	
CELLNEX TELECOM SA	39,938	36.700	1,465,724.60	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	301,061	26.910	8,101,551.51	
ELISA OYJ	14,245	46.920	668,375.40	
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	28,190	11.070	312,063.30	
KONINKLIJKE KPN NV	367,935	3.731	1,372,765.48	
ORANGE	153,827	10.905	1,677,483.43	
TELECOM ITALIA SPA	696,355	0.249	173,392.39	
TELEFONICA SA	375,409	4.307	1,616,886.56	
ACCIONA SA	1,810	129.900	235,119.00	
E.ON SE	196,435	13.655	2,682,319.92	
EDP RENOVAVEIS SA	27,294	15.760	430,153.44	
EDP SA	255,288	4.103	1,047,446.66	
ELIA GROUP SA/NV	3,348	105.800	354,218.40	
ENDESA SA	25,535	19.835	506,486.72	
ENEL SPA	694,419	7.132	4,952,596.30	
ENGIE	165,196	15.970	2,638,180.12	
FORTUM OYJ	42,339	14.030	594,016.17	
IBERDROLA SA	532,553	13.520	7,200,116.56	
REDEIA CORP SA	34,539	17.390	600,633.21	
RWE AG	53,937	32.670	1,762,121.79	
SNAM SPA	168,809	4.601	776,690.20	
TERNA-RETE ELETTRICA NAZIONA	109,980	8.144	895,677.12	
VEOLIA ENVIRONNEMENT	57,958	30.120	1,745,694.96	
VERBUND AG	5,338	73.450	392,076.10	

	BOLLORE SE	69,288	5.905	409,145.64	
	CTS EVENTIM AG & CO KGAA	6,099	85.750	522,989.25	
	PUBLICIS GROUPE	20,799	96.700	2,011,263.30	
	SCOUT24 SE	6,149	73.700	453,181.30	
	UNIVERSAL MUSIC GROUP NV	66,170	23.390	1,547,716.30	
	VIVENDI SE	57,161	10.100	577,326.10	
	LEG IMMOBILIEN SE	7,909	93.560	739,966.04	
	VONOVIA SE	60,885	33.200	2,021,382.00	
ユーロ小計		15,501,310		431,385,167.56 (67,533,347,982)	
合　計		92,725,720		758,251,843,710 (758,251,843,710)	

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

通　貨	銘柄数		組入株式時価比率	合計金額に対する比率
アメリカ・ドル	株式	572銘柄	73.4%	76.2%
カナダ・ドル	株式	84銘柄	3.2%	3.3%
オーストラリア・ドル	株式	48銘柄	1.8%	1.9%
香港・ドル	株式	22銘柄	0.4%	0.4%
シンガポール・ドル	株式	12銘柄	0.3%	0.3%
ニュージーランド・ドル	株式	5銘柄	0.0%	0.0%
イギリス・ポンド	株式	76銘柄	3.9%	4.0%
イスラエル・シュケル	株式	8銘柄	0.1%	0.1%
スイス・フラン	株式	46銘柄	2.6%	2.7%
デンマーク・クローネ	株式	16銘柄	1.0%	1.0%
ノルウェー・クローネ	株式	11銘柄	0.1%	0.2%
スウェーデン・クローナ	株式	44銘柄	0.9%	0.9%
ユーロ	株式	214銘柄	8.6%	8.9%

(b)株式以外の有価証券

種　類	通　貨	銘　柄	券面総額	評価額	備考
新株予約権証券	カナダ・ドル	CONSTELLATION SOFTWARE INC-CW40	1,480.00	-	
	カナダ・ドル小計		1,480.00	- (-)	
新株予約権証券合計				- (-)	
投資証券	アメリカ・ドル	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	13,343.00	1,664,005.53	
		AMERICAN HOMES 4 RENT- A	26,290.00	1,076,575.50	
		AMERICAN TOWER CORP	39,217.00	9,424,629.44	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	35,166.00	732,859.44	

		AVALONBAY COMMUNITIES INC	11,975.00	2,788,498.50	
		BXP INC	13,802.00	1,124,863.00	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	7,861.00	982,074.73	
		CROWN CASTLE INC	36,492.00	4,388,163.00	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	27,519.00	4,426,981.53	
		EQUINIX INC	8,298.00	7,273,777.86	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	14,256.00	1,073,619.36	
		EQUITY RESIDENTIAL	29,734.00	2,312,413.18	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	5,455.00	1,719,143.25	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	17,630.00	3,131,616.90	
		GAMING AND LEISURE PROPERTIE	22,625.00	1,168,581.25	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	65,292.00	1,463,193.72	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	59,277.00	1,034,976.42	
		INVITATION HOMES INC	55,309.00	2,033,711.93	
		IRON MOUNTAIN INC	23,774.00	2,809,849.06	
		KIMCO REALTY CORP	57,934.00	1,393,892.04	
		MID-AMERICA APARTMENT COMM	9,567.00	1,594,340.55	
		PROLOGIS INC	78,263.00	10,117,840.64	
		PUBLIC STORAGE	13,973.00	5,072,059.27	
		REALTY INCOME CORP	76,815.00	4,814,764.20	
		REGENCY CENTERS CORP	13,101.00	979,561.77	
		SBA COMMUNICATIONS CORP	8,887.00	2,178,114.83	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	28,094.00	4,632,700.60	
		SUN COMMUNITIES INC	10,118.00	1,476,317.38	
		UDR INC	27,406.00	1,287,259.82	
		VENTAS INC	34,880.00	2,256,736.00	
		VICI PROPERTIES INC	84,341.00	2,870,967.64	
		WELLTOWER INC	52,362.00	6,764,123.16	
		WEYERHAEUSER CO	65,282.00	2,122,317.82	
		WP CAREY INC	16,778.00	1,073,120.88	
	アメリカ・ドル小計		1,091,116.00	99,263,650.20 (13,973,344,040)	
	カナダ・ドル	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	8,170.00	460,134.40	
	カナダ・ドル小計		8,170.00	460,134.40 (47,651,518)	
	オーストラリア・ドル	APA GROUP	108,912.00	824,463.84	
		DEXUS/AU	125,845.00	952,646.65	
		GOODMAN GROUP	141,942.00	5,057,393.46	
		GPT GROUP	159,776.00	810,064.32	
		MIRVAC GROUP	326,863.00	735,441.75	
		SCENTRE GROUP	452,086.00	1,672,718.20	

		STOCKLAND	193,824.00	1,021,452.48	
		TRANSURBAN GROUP	256,783.00	3,566,715.87	
		VICINITY CENTRES	372,431.00	867,764.23	
		オーストラリア・ドル小計	2,138,462.00	15,508,660.80 (1,471,616,823)	
	香港・ドル	HKT TRUST AND HKT LTD-SS	437,000.00	4,422,440.00	
		LINK REIT	238,500.00	9,110,700.00	
		香港・ドル小計	675,500.00	13,533,140.00 (244,408,508)	
	シンガポール・ドル	CAPITALAND ASCENDAS REIT	322,200.00	947,268.00	
		CAPITALAND INTEGRATED COMMER	408,716.00	886,913.72	
		シンガポール・ドル小計	730,916.00	1,834,181.72 (199,173,793)	
	イギリス・ポンド	LAND SECURITIES GROUP PLC	59,857.00	403,735.46	
		SEGRO PLC	115,483.00	1,044,428.25	
		イギリス・ポンド小計	175,340.00	1,448,163.71 (269,126,744)	
	ユーロ	COVIVIO	7,110.00	389,983.50	
		GECINA SA	3,082.00	330,390.40	
		KLEPIERRE	18,172.00	530,258.96	
		UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	8,942.00	693,005.00	
		WAREHOUSES DE PAUW SCA	14,027.00	347,027.98	
		ユーロ小計	51,333.00	2,290,665.84 (358,603,737)	
投資証券合計				16,563,925,164 (16,563,925,164)	
合　計				16,563,925,164 (16,563,925,164)	

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

通　貨	銘柄数		組入 新株予約権証券 時価比率	組入 投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカ・ドル	投資証券	34銘柄	-	1.8%	84.4%
カナダ・ドル	新株予約権証券	1銘柄	-	-	-
	投資証券	1銘柄	-	0.0%	0.3%
オーストラリア・ドル	投資証券	9銘柄	-	0.2%	8.9%
香港・ドル	投資証券	2銘柄	-	0.0%	1.5%
シンガポール・ドル	投資証券	2銘柄	-	0.0%	1.2%
イギリス・ポンド	投資証券	2銘柄	-	0.0%	1.6%
ユーロ	投資証券	5銘柄	-	0.0%	2.2%

②デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

エマージング株式インデックス・マザーファンド

（１）貸借対照表

（単位：円）

	（2024年9月17日現在）
資産の部	
流動資産	
預金	2,384,665,288
金銭信託	1,461,846
コール・ローン	145,342,230
株式	39,236,619,466
投資信託受益証券	1,534,261,607
投資証券	3,276,149,883
派生商品評価勘定	32,943,135
未収入金	158,194
未収配当金	108,376,299
差入委託証拠金	663,023,388
流動資産合計	47,383,001,336
資産合計	47,383,001,336
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	23,123,012
未払解約金	12,816,610
流動負債合計	35,939,622
負債合計	35,939,622
純資産の部	
元本等	
元本	23,828,437,374
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	23,518,624,340
元本等合計	47,347,061,714
純資産合計	47,347,061,714
負債純資産合計	47,383,001,336

（２）注記表

(重要な会計方針の注記)

項　目	自 2023年9月16日 至 2024年9月17日
１．　有価証券の評価基準及び評価方法	株式、投資信託受益証券、投資証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。 (1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券

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

（重要な会計上の見積りに関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

項　目	（2024年9月17日現在）
1．　当計算期間の末日における受益権の総数	23,828,437,374口
2．　1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額　1.9870円 （1万口当たりの純資産額19,870円）

（金融商品に関する注記）

Ⅰ．金融商品の状況に関する事項

項　目	自 2023年9月16日 至 2024年9月17日
1．　金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2．　金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	(1) 金融商品の内容 1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、株式、投資信託受益証券、投資証券を組み入れております。 2) デリバティブ取引

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

Ⅱ．金融商品の時価等に関する事項

項　目	(2024年9月17日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券（株式、投資信託受益証券、投資証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等

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

(デリバティブ取引に関する注記)

(2024年9月17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	うち1年超	時　価	評価損益
市場取引	株価指数先物取引				
	買建				
	MSCI EMGMKT SEP24	3,385,269,337	－	3,395,562,440	10,293,103
	小計	3,385,269,337	－	3,395,562,440	10,293,103
合　計		3,385,269,337	－	3,395,562,440	10,293,103

(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	うち1年超	時　価	評価損益
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建				
	アメリカ・ドル	188,100,521	－	187,636,545	△463,976
	台湾・ドル	56,253	－	56,159	△94
	小計	188,156,774	－	187,692,704	△464,070
	売建				
	アメリカ・ドル	56,253	－	55,939	314
	台湾・ドル	2,600,521	－	2,609,745	△9,224
	小計	2,656,774	－	2,665,684	△8,910
合　計		190,813,548	－	190,358,388	△472,980

(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。

①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。

②計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。

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

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

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

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

２．ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

自 2023年9月16日 至 2024年9月17日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。

(その他の注記)

(2024年9月17日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	20,327,562,024円
同期中における追加設定元本額	6,666,201,801円
同期中における一部解約元本額	3,165,326,451円
2024年9月17日現在の元本の内訳	
三井住友・ＤＣつみたてＮＩＳＡ・全海外株インデックスファンド	12,841,087,357円
三井住友・ＤＣ新興国株式インデックスファンド	3,530,712,067円
アセットアロケーション・ファンド（安定型）	21,555,748円
アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）	163,832,351円
アセットアロケーション・ファンド（成長型）	110,983,901円
三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０５０	72,974,063円
三井住友・資産最適化ファンド（１安定重視型）	126,064,083円
三井住友・資産最適化ファンド（２やや安定型）	96,717,179円
三井住友・資産最適化ファンド（３バランス型）	480,854,552円
三井住友・資産最適化ファンド（４やや成長型）	333,559,569円
三井住友・資産最適化ファンド（５成長重視型）	520,021,139円
三井住友・ＤＣつみたてＮＩＳＡ・世界分散ファンド	154,489,712円
三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０６０	10,349,272円
日興ＦＷＳ・新興国株インデックス（為替ヘッジあり）	443,566,893円

日興ＦＷＳ・新興国株インデックス（為替ヘッジなし）	4,589,766,817 円
三井住友ＤＳ・新興国株式インデックス・ファンド	102,059,565 円
三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０３５	20,642,992 円
三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０４０	13,696,789 円
三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０４５	15,347,316 円
三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０５５	8,677,104 円
三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０６５	5,529,660 円
三井住友ＤＳ・ＦＷ専用ポートフォリオ・レベル１（保守型）	298,679 円
三井住友ＤＳ・ＦＷ専用ポートフォリオ・レベル２（安定型）	7,911,447 円
三井住友ＤＳ・ＦＷ専用ポートフォリオ・レベル３（安定成長型）	38,028,973 円
三井住友ＤＳ・ＦＷ専用ポートフォリオ・レベル４（成長型）	41,025,298 円
三井住友ＤＳ・ＦＷ専用ポートフォリオ・レベル５（積極成長型）	16,463,051 円
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＞	62,221,797 円
合　計	23,828,437,374 円

（３）附属明細表

①有価証券明細表

(a)株式

通　貨	銘　柄	株　数	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカ・ドル	INNER MONGOLIA YITAI COAL-B	42,200	1.913	80,728.60	
	CIA DE MINAS BUENAVENTUR-ADR	6,558	13.370	87,680.46	
	SOUTHERN COPPER CORP	3,538	99.470	351,924.86	
	H WORLD GROUP LTD-ADR	7,842	28.740	225,379.08	
	TAL EDUCATION GROUP- ADR	16,231	7.420	120,434.02	
	YUM CHINA HOLDINGS INC	15,709	34.530	542,431.77	
	PDD HOLDINGS INC	28,413	97.200	2,761,743.60	
	VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADR	15,698	12.840	201,562.32	
	LEGEND BIOTECH CORP-ADR	3,231	51.290	165,717.99	
	CREDICORP LTD	2,745	174.230	478,261.35	
	INTER & CO INC - CL A	9,819	7.220	70,893.18	
	NU HOLDINGS LTD/CAYMAN ISL-A	120,588	14.890	1,795,555.32	
	PAGSEGURO DIGITAL LTD-CL A	8,080	9.020	72,881.60	
	QIFU TECHNOLOGY INC	5,288	24.920	131,776.96	
	STONECO LTD-A	10,214	12.390	126,551.46	
	XP INC - CLASS A	15,095	19.460	293,748.70	
	SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE-B	28,195	1.328	37,442.96	
	AUTOHOME INC-ADR	2,773	27.210	75,453.33	
	IQIYI INC-ADR	21,954	1.970	43,249.38	
	KANZHUN LTD - ADR	10,834	12.250	132,716.50	
	TENCENT MUSIC ENTERTAINM-ADR	29,713	9.480	281,679.24	
	KE HOLDINGS INC-ADR	25,734	13.360	343,806.24	

アメリカ・ドル小計		430,452		8,421,618.92 (1,185,511,294)	
香港・ドル	CHINA COAL ENERGY CO-H	72,000	8.300	597,600.00	
	CHINA OILFIELD SERVICES-H	74,000	6.260	463,240.00	
	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	1,008,000	4.390	4,425,120.00	
	CHINA SHENHUA ENERGY CO-H	141,000	30.400	4,286,400.00	
	COSCO SHIPPING ENERGY TRAN-H	52,000	7.210	374,920.00	
	PETROCHINA CO LTD-H	854,000	5.640	4,816,560.00	
	YANKUANG ENERGY GROUP CO-H	145,600	8.900	1,295,840.00	
	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H	176,000	4.670	821,920.00	
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	53,000	17.440	924,320.00	
	CHINA HONGQIAO GROUP LTD	122,000	10.100	1,232,200.00	
	CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	216,000	2.090	451,440.00	
	CMOC GROUP LTD-H	150,000	5.670	850,500.00	
	JIANGXI COPPER CO LTD-H	51,000	12.400	632,400.00	
	MMG LTD	120,000	2.150	258,000.00	
	SHANDONG GOLD MINING CO LT-H	25,000	15.840	396,000.00	
	ZHAOJIN MINING INDUSTRY - H	54,000	12.960	699,840.00	
	ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H	240,000	14.740	3,537,600.00	
	AVICHINA INDUSTRY & TECH-H	99,000	3.070	303,930.00	
	BOC AVIATION LTD	10,300	63.100	649,930.00	
	CHINA COMMUNICATIONS SERVI-H	126,000	3.820	481,320.00	
	CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	152,000	3.120	474,240.00	
	CHINA STATE CONSTRUCTION INT	92,000	10.400	956,800.00	
	CITIC LTD	233,000	7.370	1,717,210.00	
	CRRC CORP LTD - H	203,000	4.290	870,870.00	
	FOSUN INTERNATIONAL LTD	72,000	3.990	287,280.00	
	HAITIAN INTERNATIONAL HLDGS	21,000	21.200	445,200.00	
	SINOTRUK HONG KONG LTD	30,000	19.640	589,200.00	
	WEICHAI POWER CO LTD-H	89,000	10.960	975,440.00	
	ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRI-H	19,400	26.300	510,220.00	
	CHINA MERCHANTS PORT HOLDING	60,140	11.940	718,071.60	
	COSCO SHIPPING HOLDINGS CO-H	114,400	10.480	1,198,912.00	
	JD LOGISTICS INC	70,500	10.200	719,100.00	
	JIANGSU EXPRESS CO LTD-H	50,000	7.570	378,500.00	
	ORIENT OVERSEAS INTL LTD	6,000	96.100	576,600.00	
	ZHEJIANG EXPRESSWAY CO-H	78,000	4.600	358,800.00	
	ZTO EXPRESS CAYMAN INC	17,300	173.000	2,992,900.00	
	BYD CO LTD-H	42,000	240.000	10,080,000.00	
	FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-H	23,600	48.450	1,143,420.00	
	GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	252,000	9.020	2,273,040.00	
	GREAT WALL MOTOR CO LTD-H	85,000	11.080	941,800.00	

GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	81,200	2.230	181,076.00	
LI AUTO INC-CLASS A	50,600	74.250	3,757,050.00	
NIO INC-CLASS A	55,210	43.000	2,374,030.00	
XPENG INC - CLASS A SHARES	46,700	35.100	1,639,170.00	
YADEA GROUP HOLDINGS LTD	48,000	10.920	524,160.00	
ZHEJIANG LEAPMOTOR TECHNOLOG	19,900	22.450	446,755.00	
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	53,400	69.400	3,705,960.00	
BOSIDENG INTL HLDGS LTD	172,000	3.600	619,200.00	
HAIER SMART HOME CO LTD-H	96,400	23.950	2,308,780.00	
HISENSE HOME APPLIANCES GR-H	14,000	20.150	282,100.00	
LI NING CO LTD	98,000	12.920	1,266,160.00	
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	34,400	56.450	1,941,880.00	
HAIDILAO INTERNATIONAL HOLDI	59,000	12.420	732,780.00	
MEITUAN-CLASS B	201,660	126.500	25,509,990.00	
NEW ORIENTAL EDUCATION & TEC	63,100	47.100	2,972,010.00	
TONGCHENG TRAVEL HOLDINGS LT	52,400	14.180	743,032.00	
TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	29,000	8.900	258,100.00	
TRIP.COM GROUP LTD	22,850	371.800	8,495,630.00	
ALIBABA GROUP HOLDING LTD	619,900	82.000	50,831,800.00	
CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROU	68,200	6.000	409,200.00	
JD.COM INC-CLASS A	101,685	103.400	10,514,229.00	
MINISO GROUP HOLDING LTD	13,200	30.200	398,640.00	
POP MART INTERNATIONAL GROUP	21,000	49.150	1,032,150.00	
TOPSPORTS INTERNATIONAL HOLD	49,000	2.340	114,660.00	
ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS	33,000	9.010	297,330.00	
ALIBABA HEALTH INFORMATION T	208,000	2.750	572,000.00	
JD HEALTH INTERNATIONAL INC	40,800	22.500	918,000.00	
ANHUI GUJING DISTILLERY CO-B	5,000	93.000	465,000.00	
CHINA FEIHE LTD	127,000	4.360	553,720.00	
CHINA MENGNIU DAIRY CO	133,000	12.520	1,665,160.00	
CHINA RESOURCES BEER HOLDING	68,000	22.100	1,502,800.00	
NONGFU SPRING CO LTD-H	78,600	24.350	1,913,910.00	
SMOORE INTERNATIONAL HOLDING	89,000	8.900	792,100.00	
TINGYI (CAYMAN ISLN) HLDG CO	90,000	10.580	952,200.00	
TSINGTAO BREWERY CO LTD-H	26,000	40.950	1,064,700.00	
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	166,000	4.700	780,200.00	
GIANT BIOGENE HOLDING CO LTD	14,200	35.700	506,940.00	
HENGAN INTL GROUP CO LTD	25,500	21.850	557,175.00	
SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H	78,400	4.430	347,312.00	
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	24,700	10.220	252,434.00	
SINOPHARM GROUP CO-H	55,600	16.740	930,744.00	
AKESO INC	27,000	71.600	1,933,200.00	

BEIGENE LTD	28,500	120.000	3,420,000.00	
CHINA RESOURCES PHARMACEUTIC	54,500	4.820	262,690.00	
CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LT	324,800	4.650	1,510,320.00	
GENSCRIPT BIOTECH CORP	50,000	11.880	594,000.00	
HANSOH PHARMACEUTICAL GROUP	48,000	19.600	940,800.00	
INNOVENT BIOLOGICS INC	48,500	44.200	2,143,700.00	
SINO BIOPHARMACEUTICAL	387,000	3.270	1,265,490.00	
WUXI APPTEC CO LTD-H	13,711	37.700	516,904.70	
WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	150,500	11.460	1,724,730.00	
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	1,160,000	3.520	4,083,200.00	
BANK OF CHINA LTD-H	3,266,000	3.400	11,104,400.00	
BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	377,000	5.290	1,994,330.00	
CHINA CITIC BANK CORP LTD-H	363,000	4.460	1,618,980.00	
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	3,933,000	5.450	21,434,850.00	
CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	77,000	2.250	173,250.00	
CHINA MERCHANTS BANK-H	158,500	29.450	4,667,825.00	
CHINA MINSHENG BANKING COR-H	265,100	2.730	723,723.00	
IND & COMM BK OF CHINA-H	2,850,000	4.260	12,141,000.00	
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-H	326,000	4.130	1,346,380.00	
CHINA GALAXY SECURITIES CO-H	132,000	4.180	551,760.00	
CHINA INTERNATIONAL CAPITA-H	58,400	8.080	471,872.00	
CITIC SECURITIES CO LTD-H	64,500	11.620	749,490.00	
FAR EAST HORIZON LTD	84,000	5.430	456,120.00	
HAITONG SECURITIES CO LTD-H	80,800	3.660	295,728.00	
HUATAI SECURITIES CO LTD-H	43,200	8.160	352,512.00	
CHINA LIFE INSURANCE CO-H	292,000	11.420	3,334,640.00	
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	110,400	19.640	2,168,256.00	
CHINA TAIPING INSURANCE HOLD	61,000	9.450	576,450.00	
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H	30,100	15.800	475,580.00	
PEOPLE'S INSURANCE CO GROU-H	397,000	3.040	1,206,880.00	
PICC PROPERTY & CASUALTY-H	286,000	10.120	2,894,320.00	
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	269,500	35.100	9,459,450.00	
KINGDEE INTERNATIONAL SFTWR	104,000	5.420	563,680.00	
AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS IN	33,000	28.500	940,500.00	
BYD ELECTRONIC INTL CO LTD	29,000	25.550	740,950.00	
LENOVO GROUP LTD	316,000	9.400	2,970,400.00	
SUNNY OPTICAL TECH	31,500	43.500	1,370,250.00	
XIAOMI CORP-CLASS B	631,600	19.240	12,151,984.00	
ZTE CORP-H	23,800	15.120	359,856.00	
GCL TECHNOLOGY HOLDINGS LTD	846,000	1.020	862,920.00	
HUA HONG SEMICONDUCTOR LTD	19,000	15.340	291,460.00	
XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	194,000	2.790	541,260.00	

	CHINA TOWER CORP LTD-H	1,886,000	0.960	1,810,560.00	
	BEIJING ENTERPRISES HLDGS	17,000	23.550	400,350.00	
	BEIJING ENTERPRISES WATER GR	206,000	2.150	442,900.00	
	CGN POWER CO LTD-H	446,000	2.800	1,248,800.00	
	CHINA GAS HOLDINGS LTD	94,400	6.040	570,176.00	
	CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	141,000	5.390	759,990.00	
	CHINA POWER INTERNATIONAL	211,000	3.350	706,850.00	
	CHINA RESOURCES GAS GROUP LT	39,400	27.850	1,097,290.00	
	CHINA RESOURCES POWER HOLDIN	78,000	18.640	1,453,920.00	
	ENN ENERGY HOLDINGS LTD	32,300	45.800	1,479,340.00	
	GUANGDONG INVESTMENT LTD	92,000	4.530	416,760.00	
	HUANENG POWER INTL INC-H	152,000	4.170	633,840.00	
	KUNLUN ENERGY CO LTD	162,000	7.290	1,180,980.00	
	BAIDU INC-CLASS A	91,900	82.600	7,590,940.00	
	BILIBILI INC-CLASS Z	10,220	114.900	1,174,278.00	
	CHINA LITERATURE LTD	12,200	25.400	309,880.00	
	CHINA RUYI HOLDINGS LTD	304,000	2.010	611,040.00	
	KINGSOFT CORP LTD	33,600	21.500	722,400.00	
	KUAISHOU TECHNOLOGY	98,500	39.900	3,930,150.00	
	NETEASE INC	77,700	120.200	9,339,540.00	
	TENCENT HOLDINGS LTD	266,600	377.800	100,721,480.00	
	C&D INTERNATIONAL INVESTMENT	21,000	10.280	215,880.00	
	CHINA OVERSEAS LAND & INVEST	152,500	10.700	1,631,750.00	
	CHINA RESOURCES LAND LTD	126,000	19.180	2,416,680.00	
	CHINA RESOURCES MIXC LIFESTY	23,400	23.750	555,750.00	
	CHINA VANKE CO LTD-H	78,900	3.840	302,976.00	
	LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD	80,500	7.830	630,315.00	
香港・ドル小計		31,811,876		450,577,856.30 (8,137,436,085)	
台湾・ドル	ASIA CEMENT CORP	103,000	45.000	4,635,000.00	
	CHINA STEEL CORP	489,000	21.400	10,464,600.00	
	FORMOSA CHEMICALS & FIBRE	128,000	40.650	5,203,200.00	
	FORMOSA PLASTICS CORP	159,000	48.250	7,671,750.00	
	NAN YA PLASTICS CORP	198,000	42.150	8,345,700.00	
	TCC GROUP HOLDINGS CO LTD	270,676	32.200	8,715,767.20	
	AIRTAC INTERNATIONAL GROUP	5,000	774.000	3,870,000.00	
	FAR EASTERN NEW CENTURY CORP	105,000	36.950	3,879,750.00	
	FORTUNE ELECTRIC CO LTD	5,500	577.000	3,173,500.00	
	VOLTRONIC POWER TECHNOLOGY	3,000	2,020.000	6,060,000.00	
	WALSIN LIHWA CORP	108,000	31.600	3,412,800.00	
	CHINA AIRLINES LTD	106,000	20.650	2,188,900.00	
	EVA AIRWAYS CORP	120,000	35.900	4,308,000.00	

	EVERGREEN MARINE CORP LTD	39,096	184.500	7,213,212.00	
	TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP	64,000	29.700	1,900,800.00	
	WAN HAI LINES LTD	25,605	78.300	2,004,871.50	
	YANG MING MARINE TRANSPORT	75,000	61.700	4,627,500.00	
	CHENG SHIN RUBBER IND CO LTD	63,000	48.750	3,071,250.00	
	ECLAT TEXTILE COMPANY LTD	9,000	535.000	4,815,000.00	
	FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	21,276	140.500	2,989,278.00	
	NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	6,000	480.000	2,880,000.00	
	POU CHEN	104,000	34.600	3,598,400.00	
	HOTAI MOTOR COMPANY LTD	12,200	642.000	7,832,400.00	
	PRESIDENT CHAIN STORE CORP	21,000	292.000	6,132,000.00	
	UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	202,000	86.500	17,473,000.00	
	PHARMAESSENTIA CORP	9,000	698.000	6,282,000.00	
	CHANG HWA COMMERCIAL BANK	278,418	17.750	4,941,919.50	
	CTBC FINANCIAL HOLDING CO LT	654,000	32.700	21,385,800.00	
	E.SUN FINANCIAL HOLDING CO	561,385	27.700	15,550,364.50	
	FIRST FINANCIAL HOLDING CO	474,876	27.350	12,987,858.60	
	HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS C	358,519	25.500	9,142,234.50	
	MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT	484,702	39.350	19,073,023.70	
	SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS	430,039	23.450	10,084,414.55	
	TAISHIN FINANCIAL HOLDING	491,828	18.850	9,270,957.80	
	TAIWAN BUSINESS BANK	237,530	15.650	3,717,344.50	
	TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL	453,197	25.700	11,647,162.90	
	THE SHANGHAI COMMERCIAL & SA	143,299	38.350	5,495,516.65	
	CHAILEASE HOLDING CO LTD	58,988	142.000	8,376,296.00	
	YUANTA FINANCIAL HOLDING CO	427,393	30.500	13,035,486.50	
	CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	388,000	63.100	24,482,800.00	
	FUBON FINANCIAL HOLDING CO	332,741	86.800	28,881,918.80	
	KGI FINANCIAL HOLDING CO LTD	639,196	16.000	10,227,136.00	
	SHIN KONG FINANCIAL HOLDING	616,432	13.350	8,229,367.20	
	ACCTON TECHNOLOGY CORP	20,000	550.000	11,000,000.00	
	ACER INC	111,000	41.700	4,628,700.00	
	ADVANTECH CO LTD	18,727	325.500	6,095,638.50	
	ASIA VITAL COMPONENTS	13,000	544.000	7,072,000.00	
	ASUSTEK COMPUTER INC	28,000	544.000	15,232,000.00	
	AUO CORP	296,600	17.050	5,057,030.00	
	CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	26,000	236.000	6,136,000.00	
	COMPAL ELECTRONICS	157,000	34.150	5,361,550.00	
	DELTA ELECTRONICS INC	79,000	385.500	30,454,500.00	
	E INK HOLDINGS INC	37,000	294.000	10,878,000.00	
	GIGABYTE TECHNOLOGY CO LTD	22,000	251.500	5,533,000.00	
	HON HAI PRECISION INDUSTRY	509,800	181.000	92,273,800.00	

	INNOLUX CORP	331,903	15.500	5,144,496.50	
	INVENTEC CORP	110,000	43.550	4,790,500.00	
	LARGAN PRECISION CO LTD	4,480	2,625.000	11,760,000.00	
	LITE-ON TECHNOLOGY CORP	84,000	101.500	8,526,000.00	
	MICRO-STAR INTERNATIONAL CO	27,000	170.500	4,603,500.00	
	PEGATRON CORP	81,000	101.500	8,221,500.00	
	QUANTA COMPUTER INC	108,000	254.000	27,432,000.00	
	SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP	53,000	69.900	3,704,700.00	
	UNIMICRON TECHNOLOGY CORP	56,000	146.500	8,204,000.00	
	WISTRON CORP	114,000	103.000	11,742,000.00	
	WIWYNN CORP	4,000	1,820.000	7,280,000.00	
	WPG HOLDINGS LTD	62,520	74.300	4,645,236.00	
	YAGEO CORPORATION	17,427	615.000	10,717,605.00	
	ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING	30,000	119.000	3,570,000.00	
	ALCHIP TECHNOLOGIES LTD	3,000	2,400.000	7,200,000.00	
	ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LT	131,000	154.000	20,174,000.00	
	EMEMORY TECHNOLOGY INC	3,000	2,340.000	7,020,000.00	
	GLOBAL UNICHIP CORP	4,000	1,045.000	4,180,000.00	
	GLOBALWAFERS CO LTD	11,000	461.000	5,071,000.00	
	MEDIATEK INC	62,000	1,130.000	70,060,000.00	
	NANYA TECHNOLOGY CORP	48,000	46.600	2,236,800.00	
	NOVATEK MICROELECTRONICS COR	23,000	532.000	12,236,000.00	
	REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	20,000	468.000	9,360,000.00	
	SILERGY CORP	13,800	394.000	5,437,200.00	
	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	1,002,000	947.000	948,894,000.00	
	UNITED MICROELECTRONICS CORP	448,000	54.500	24,416,000.00	
	VANGUARD INTERNATIONAL SEMI	40,000	106.500	4,260,000.00	
	WINBOND ELECTRONICS CORP	118,000	21.050	2,483,900.00	
	CHUNGHWA TELECOM CO LTD	159,000	125.000	19,875,000.00	
	FAR EASTONE TELECOMM CO LTD	72,000	91.900	6,616,800.00	
	TAIWAN MOBILE CO LTD	73,000	116.000	8,468,000.00	
	RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	73,443	47.200	3,466,509.60	
台湾・ドル小計		14,187,596		1,840,797,246.00 (8,124,726,805)	
エジプト・ポンド	EASTERN CO SAE	48,781	25.700	1,253,671.70	
	COMMERCIAL INTERNATIONAL BAN	96,608	85.460	8,256,119.68	
	T M G HOLDING	30,309	57.000	1,727,613.00	
エジプト・ポンド小計		175,698		11,237,404.38 (32,650,277)	
トルコ・リラ	TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE	38,176	163.400	6,237,958.40	
	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK	48,657	47.620	2,317,046.34	
	SASA POLYESTER SANAYI	371,264	4.250	1,577,872.00	

	ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI	50,276	57.350	2,883,328.60	
	KOC HOLDING AS	31,180	172.000	5,362,960.00	
	TURK SISE VE CAM FABRIKALARI	47,908	40.820	1,955,604.56	
	PEGASUS HAVA TASIMACILIGI AS	9,051	239.000	2,163,189.00	
	TURK HAVA YOLLARI AO	22,378	286.250	6,405,702.50	
	FORD OTOMOTIV SANAYI AS	2,571	894.500	2,299,759.50	
	TOFAS TURK OTOMOBIL FABRIKA	4,752	217.000	1,031,184.00	
	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	18,318	568.000	10,404,624.00	
	ANADOLU EFES BIRACILIK VE	10,793	206.300	2,226,595.90	
	COCA-COLA ICECEK AS	39,039	62.750	2,449,697.25	
	AKBANK T.A.S.	126,956	56.200	7,134,927.20	
	HACI OMER SABANCI HOLDING	46,491	91.000	4,230,681.00	
	TURKIYE IS BANKASI-C	396,383	12.700	5,034,064.10	
	YAPI VE KREDI BANKASI	148,083	28.440	4,211,480.52	
	TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	48,118	91.200	4,388,361.60	
トルコ・リラ小計		1,460,394		72,315,036.47 (299,304,703)	
メキシコ・ペソ	GRUPO MEXICO SAB DE CV-SER B	126,200	103.420	13,051,604.00	
	INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	6,795	249.190	1,693,246.05	
	ORBIA ADVANCE CORP SAB DE CV	40,100	19.690	789,569.00	
	ALFA S.A.B.-A	126,300	13.300	1,679,790.00	
	GRUPO CARSO SAB DE CV-SER A1	24,300	116.050	2,820,015.00	
	GRUPO AEROPORT DEL PACIFIC-B	15,935	335.450	5,345,395.75	
	GRUPO AEROPORT DEL SURESTE-B	7,585	542.420	4,114,255.70	
	GRUPO AEROPORTUARIO DEL CENT	11,400	172.100	1,961,940.00	
	PROMOTORA Y OPERADORA DE INF	7,195	179.180	1,289,200.10	
	GRUPO COMERCIAL CHEDRAUI SA	13,700	147.670	2,023,079.00	
	WALMART DE MEXICO SAB DE CV	210,300	60.640	12,752,592.00	
	ARCA CONTINENTAL SAB DE CV	20,700	179.510	3,715,857.00	
	GRUMA S.A.B.-B	6,425	366.460	2,354,505.50	
	GRUPO BIMBO SAB- SERIES A	56,400	68.940	3,888,216.00	
	KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A	63,600	31.840	2,025,024.00	
	BANCO DEL BAJIO SA	26,900	46.370	1,247,353.00	
	GRUPO FINANCIERO BANORTE-O	103,200	142.080	14,662,656.00	
	GRUPO FINANCIERO INBURSA-O	67,700	45.060	3,050,562.00	
	AMERICA MOVIL SAB DE C-SER B	770,000	16.250	12,512,500.00	
	OPERADORA DE SITES MEX- A-1	47,400	16.050	760,770.00	
メキシコ・ペソ小計		1,752,135		91,738,130.10 (671,367,158)	
フィリピン・ペソ	AYALA CORPORATION	11,640	634.000	7,379,760.00	
	JG SUMMIT HOLDINGS INC	116,262	25.900	3,011,185.80	
	SM INVESTMENTS CORP	9,035	948.500	8,569,697.50	

	INTL CONTAINER TERM SVCS INC	41,320	413.400	17,081,688.00	
	JOLLIBEE FOODS CORP	19,650	255.000	5,010,750.00	
	UNIVERSAL ROBINA CORP	27,990	92.800	2,597,472.00	
	BANK OF THE PHILIPPINE ISLAN	75,036	125.800	9,439,528.80	
	BDO UNIBANK INC	92,674	159.900	14,818,572.60	
	METROPOLITAN BANK & TRUST	84,590	73.150	6,187,758.50	
	PLDT INC	2,690	1,460.000	3,927,400.00	
	MANILA ELECTRIC COMPANY	10,060	420.000	4,225,200.00	
	AYALA LAND INC	275,600	34.700	9,563,320.00	
	SM PRIME HOLDINGS INC	404,100	31.800	12,850,380.00	
フィリピン・ペソ小計		1,170,647		104,662,713.20 (263,666,307)	
チリ・ペソ	EMPRESAS CMPC SA	48,976	1,521.000	74,492,496.00	
	SOC QUIMICA Y MINERA CHILE-B	5,698	35,052.000	199,726,296.00	
	LATAM AIRLINES GROUP SA	6,352,877	12.200	77,505,099.40	
	EMPRESAS COPEC SA	17,285	5,900.000	101,981,500.00	
	FALABELLA SA	34,870	3,011.000	104,993,570.00	
	CENCOSUD SA	53,544	1,775.000	95,040,600.00	
	BANCO DE CHILE	1,848,499	114.700	212,022,835.30	
	BANCO DE CREDITO E INVERSION	3,107	28,100.000	87,306,700.00	
	BANCO SANTANDER CHILE	2,903,646	47.830	138,881,388.18	
	ENEL AMERICAS SA	843,379	93.000	78,434,247.00	
	ENEL CHILE SA	971,320	48.730	47,332,423.60	
チリ・ペソ小計		13,083,201		1,217,717,155.48 (185,586,183)	
コロンビア・ペソ	BANCOLOMBIA SA	9,095	35,700.000	324,691,500.00	
	BANCOLOMBIA SA-PREF	18,853	33,700.000	635,346,100.00	
	INTERCONEXION ELECTRICA SA	19,631	16,800.000	329,800,800.00	
コロンビア・ペソ小計		47,579		1,289,838,400.00 (42,805,867)	
インド・ルピー	BHARAT PETROLEUM CORP LTD	57,472	340.650	19,577,836.80	
	COAL INDIA LTD	75,181	493.250	37,083,028.25	
	HINDUSTAN PETROLEUM CORP	42,181	410.200	17,302,646.20	
	INDIAN OIL CORP LTD	106,892	171.820	18,366,183.44	
	OIL & NATURAL GAS CORP LTD	125,071	292.500	36,583,267.50	
	OIL INDIA LTD	19,843	607.600	12,056,606.80	
	PETRONET LNG LTD	27,436	336.100	9,221,239.60	
	RELIANCE INDUSTRIES LTD	124,068	2,942.700	365,094,903.60	
	AMBUJA CEMENTS LTD	24,411	627.300	15,313,020.30	
	APL APOLLO TUBES LTD	6,265	1,452.950	9,102,731.75	
	ASIAN PAINTS LTD	15,258	3,335.800	50,897,636.40	
	GRASIM INDUSTRIES LTD	10,470	2,765.300	28,952,691.00	

	HINDALCO INDUSTRIES LTD	53,203	685.150	36,452,035.45	
	JINDAL STAINLESS LTD	14,795	759.450	11,236,062.75	
	JINDAL STEEL & POWER LTD	14,959	1,043.100	15,603,732.90	
	JSW STEEL LTD	26,244	971.000	25,482,924.00	
	NMDC LTD	43,717	219.100	9,578,394.70	
	PI INDUSTRIES LTD	3,459	4,656.500	16,106,833.50	
	PIDILITE INDUSTRIES LTD	5,741	3,304.750	18,972,569.75	
	SHREE CEMENT LTD	324	25,619.400	8,300,685.60	
	SOLAR INDUSTRIES INDIA LTD	1,212	10,767.300	13,049,967.60	
	SRF LTD	5,894	2,436.900	14,363,088.60	
	SUPREME INDUSTRIES LTD	2,423	5,394.000	13,069,662.00	
	TATA STEEL LTD	297,861	154.210	45,933,144.81	
	ULTRATECH CEMENT LTD	4,814	11,642.650	56,047,717.10	
	UPL LTD	15,397	613.800	9,450,678.60	
	VEDANTA LTD	58,464	446.300	26,092,483.20	
	ABB INDIA LTD	2,065	7,765.200	16,035,138.00	
	ADANI ENTERPRISES LTD	6,462	2,984.900	19,288,423.80	
	ASHOK LEYLAND LTD	56,114	243.800	13,680,593.20	
	ASTRAL LTD	4,691	1,904.150	8,932,367.65	
	BHARAT ELECTRONICS LTD	149,477	290.400	43,408,120.80	
	BHARAT HEAVY ELECTRICALS	39,537	269.500	10,655,221.50	
	CG POWER AND INDUSTRIAL SOLU	23,122	714.200	16,513,732.40	
	CUMMINS INDIA LTD	5,373	3,817.700	20,512,502.10	
	HAVELLS INDIA LTD	9,425	1,989.900	18,754,807.50	
	HINDUSTAN AERONAUTICS LTD	8,223	4,597.350	37,804,009.05	
	LARSEN & TOUBRO LTD	27,749	3,662.250	101,623,775.25	
	POLYCAB INDIA LTD	2,271	6,724.450	15,271,225.95	
	RAIL VIKAS NIGAM LTD	23,469	545.300	12,797,645.70	
	SIEMENS LTD	3,370	6,712.800	22,622,136.00	
	SUZLON ENERGY LTD	405,457	84.700	34,342,207.90	
	THERMAX LTD	1,883	5,003.900	9,422,343.70	
	INDIAN RAILWAY CATERING & TO	9,083	935.750	8,499,417.25	
	ADANI PORTS AND SPECIAL ECON	21,871	1,440.700	31,509,549.70	
	CONTAINER CORP OF INDIA LTD	10,064	951.500	9,575,896.00	
	GMR AIRPORTS INFRASTRUCTURE	104,248	97.130	10,125,608.24	
	INTERGLOBE AVIATION LTD	7,201	4,947.100	35,624,067.10	
	BAJAJ AUTO LTD	2,566	11,688.350	29,992,306.10	
	BALKRISHNA INDUSTRIES LTD	3,466	3,069.750	10,639,753.50	
	BHARAT FORGE LTD	10,961	1,601.200	17,550,753.20	
	BOSCH LTD	318	34,037.000	10,823,766.00	
	EICHER MOTORS LTD	5,571	4,899.200	27,293,443.20	
	HERO MOTOCORP LTD	5,124	5,779.450	29,613,901.80	

MAHINDRA & MAHINDRA LTD	37,574	2,757.400	103,606,547.60	
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	5,221	12,289.000	64,160,869.00	
MRF LTD	88	136,427.000	12,005,576.00	
SAMVARDHANA MOTHERSON INTERN	116,035	193.790	22,486,422.65	
SONA BLW PRECISION FORGINGS	15,537	733.650	11,398,720.05	
TATA MOTORS LTD	82,248	988.400	81,293,923.20	
TUBE INVESTMENTS OF INDIA LT	4,025	4,047.100	16,289,577.50	
TVS MOTOR CO LTD	10,138	2,841.750	28,809,661.50	
DIXON TECHNOLOGIES INDIA LTD	1,437	13,990.300	20,104,061.10	
PAGE INDUSTRIES LTD	277	43,055.600	11,926,401.20	
TITAN CO LTD	14,492	3,740.650	54,209,499.80	
INDIAN HOTELS CO LTD	32,256	690.950	22,287,283.20	
JUBILANT FOODWORKS LTD	14,355	664.250	9,535,308.75	
ZOMATO LTD	263,052	277.700	73,049,540.40	
TRENT LTD	7,472	7,318.800	54,686,073.60	
AVENUE SUPERMARTS LTD	6,442	5,204.800	33,529,321.60	
BRITANNIA INDUSTRIES LTD	4,328	6,063.000	26,240,664.00	
ITC LTD	122,008	511.100	62,358,288.80	
MARICO LTD	23,047	695.200	16,022,274.40	
NESTLE INDIA LTD	13,199	2,549.600	33,652,170.40	
TATA CONSUMER PRODUCTS LTD	24,849	1,218.500	30,278,506.50	
UNITED SPIRITS LTD	12,742	1,547.250	19,715,059.50	
VARUN BEVERAGES LTD	48,407	621.050	30,063,167.35	
COLGATE PALMOLIVE (INDIA)	5,865	3,664.150	21,490,239.75	
DABUR INDIA LTD	21,140	661.350	13,980,939.00	
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	16,369	1,456.350	23,838,993.15	
HINDUSTAN UNILEVER LTD	33,218	2,867.100	95,239,327.80	
APOLLO HOSPITALS ENTERPRISE	3,981	7,031.350	27,991,804.35	
MAX HEALTHCARE INSTITUTE LTD	32,458	931.000	30,218,398.00	
AUROBINDO PHARMA LTD	11,043	1,564.000	17,271,252.00	
CIPLA LTD	21,693	1,659.400	35,997,364.20	
DIVI'S LABORATORIES LTD	4,834	5,479.350	26,487,177.90	
DR. REDDY'S LABORATORIES	4,591	6,647.100	30,516,836.10	
LUPIN LTD	9,298	2,251.850	20,937,701.30	
MANKIND PHARMA LTD	4,543	2,456.250	11,158,743.75	
SUN PHARMACEUTICAL INDUS	38,994	1,862.950	72,643,872.30	
TORRENT PHARMACEUTICALS LTD	3,991	3,453.900	13,784,514.90	
ZYDUS LIFESCIENCES LTD	10,229	1,115.850	11,414,029.65	
AU SMALL FINANCE BANK LTD	16,362	718.950	11,763,459.90	
AXIS BANK LTD	91,881	1,231.050	113,110,105.05	
BANK OF BARODA	38,009	239.150	9,089,852.35	
CANARA BANK	82,629	106.690	8,815,688.01	

HDFC BANK LIMITED	174,052	1,670.950	290,832,189.40	
ICICI BANK LTD	212,839	1,262.850	268,783,731.15	
IDFC FIRST BANK LTD	131,058	73.740	9,664,216.92	
INDUSIND BANK LTD	10,740	1,470.200	15,789,948.00	
KOTAK MAHINDRA BANK LTD	44,196	1,831.300	80,936,134.80	
PUNJAB NATIONAL BANK	83,349	110.810	9,235,902.69	
STATE BANK OF INDIA	72,455	785.550	56,917,025.25	
UNION BANK OF INDIA	56,109	123.210	6,913,189.89	
YES BANK LTD	625,769	23.500	14,705,571.50	
BAJAJ FINANCE LTD	11,259	7,345.750	82,705,799.25	
BAJAJ FINSERV LTD	16,333	1,857.600	30,340,180.80	
BAJAJ HOLDINGS AND INVESTMEN	1,217	10,400.000	12,656,800.00	
CHOLAMANDALAM INVESTMENT AND	15,890	1,564.750	24,863,877.50	
HDFC ASSET MANAGEMENT CO LTD	3,636	4,433.000	16,118,388.00	
JIO FINANCIAL SERVICES LTD	117,174	348.800	40,870,291.20	
MUTHOOT FINANCE LTD	4,186	2,013.600	8,428,929.60	
POWER FINANCE CORPORATION	61,445	491.050	30,172,567.25	
REC LTD	55,630	560.700	31,191,741.00	
SBI CARDS & PAYMENT SERVICES	10,068	800.500	8,059,434.00	
SHRIRAM FINANCE LTD	11,734	3,418.950	40,117,959.30	
SUNDARAM FINANCE LTD	2,718	4,903.200	13,326,897.60	
HDFC LIFE INSURANCE CO LTD	41,129	701.350	28,845,824.15	
ICICI LOMBARD GENERAL INSURA	9,130	2,094.900	19,126,437.00	
ICICI PRUDENTIAL LIFE INSURA	12,502	749.900	9,375,249.80	
PB FINTECH LTD	12,666	1,797.200	22,763,335.20	
SBI LIFE INSURANCE CO LTD	19,037	1,821.250	34,671,136.25	
HCL TECHNOLOGIES LTD	37,770	1,811.850	68,433,574.50	
INFOSYS LTD	135,071	1,950.250	263,422,217.75	
LTIMINDTREE LTD	3,273	6,423.450	21,023,951.85	
MPHASIS LTD	4,655	3,125.750	14,550,366.25	
ORACLE FINANCIAL SERVICES	882	12,239.100	10,794,886.20	
PERSISTENT SYSTEMS LTD	4,385	5,301.000	23,244,885.00	
TATA CONSULTANCY SVCS LTD	37,071	4,513.250	167,310,690.75	
TATA ELXSI LTD	1,296	7,688.750	9,964,620.00	
TECH MAHINDRA LTD	21,364	1,649.000	35,229,236.00	
WIPRO LTD	53,173	551.900	29,346,178.70	
BHARTI AIRTEL LTD	105,011	1,635.450	171,740,239.95	
INDUS TOWERS LTD	52,261	428.700	22,404,290.70	
TATA COMMUNICATIONS LTD	4,533	2,047.500	9,281,317.50	
VODAFONE IDEA LTD	1,045,879	13.240	13,847,437.96	
ADANI GREEN ENERGY LTD	12,008	1,930.800	23,185,046.40	
ADANI POWER LTD	29,195	665.950	19,442,410.25	

	GAIL INDIA LTD	87,099	217.830	18,972,775.17	
	JSW ENERGY LTD	13,899	771.600	10,724,468.40	
	NHPC LTD	120,274	96.190	11,569,156.06	
	NTPC LTD	173,525	411.100	71,336,127.50	
	POWER GRID CORP OF INDIA LTD	184,930	338.250	62,552,572.50	
	TATA POWER CO LTD	61,507	443.350	27,269,128.45	
	TORRENT POWER LTD	6,689	1,780.800	11,911,771.20	
	INFO EDGE INDIA LTD	2,865	7,903.800	22,644,387.00	
	DLF LTD	29,330	862.100	25,285,393.00	
	GODREJ PROPERTIES LTD	5,192	2,838.500	14,737,492.00	
	MACROTECH DEVELOPERS LTD	11,864	1,276.000	15,138,464.00	
	PHOENIX MILLS LTD	4,304	3,532.250	15,202,804.00	
	PRESTIGE ESTATES PROJECTS	6,459	1,834.900	11,851,619.10	
インド・ルピー小計		7,514,658		5,425,493,967.99 (9,169,084,806)	
インドネシア・ルピア	ADARO ENERGY INDONESIA TBK P	658,700	3,670.000	2,417,429,000.00	
	UNITED TRACTORS TBK PT	65,100	26,350.000	1,715,385,000.00	
	AMMAN MINERAL INTERNASIONAL	278,700	10,325.000	2,877,577,500.00	
	BARITO PACIFIC TBK PT	1,349,151	1,140.000	1,538,032,140.00	
	CHANDRA ASRI PACIFIC TBK PT	335,100	9,000.000	3,015,900,000.00	
	INDAH KIAT PULP & PAPER TBK	90,200	8,375.000	755,425,000.00	
	MERDEKA COPPER GOLD TBK PT	380,461	2,290.000	871,255,690.00	
	ASTRA INTERNATIONAL TBK PT	858,900	5,075.000	4,358,917,500.00	
	GOTO GOJEK TOKOPEDIA TBK PT	39,296,900	61.000	2,397,110,900.00	
	SUMBER ALFARIA TRIJAYA TBK P	716,700	3,150.000	2,257,605,000.00	
	CHAROEN POKPHAND INDONESI PT	260,300	4,800.000	1,249,440,000.00	
	INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR T	71,100	11,325.000	805,207,500.00	
	INDOFOOD SUKSES MAKMUR TBK P	143,900	7,100.000	1,021,690,000.00	
	UNILEVER INDONESIA TBK PT	240,800	2,200.000	529,760,000.00	
	KALBE FARMA TBK PT	973,100	1,705.000	1,659,135,500.00	
	BANK CENTRAL ASIA TBK PT	2,231,900	10,425.000	23,267,557,500.00	
	BANK MANDIRI PERSERO TBK PT	1,551,700	7,275.000	11,288,617,500.00	
	BANK NEGARA INDONESIA PERSER	599,600	5,625.000	3,372,750,000.00	
	BANK RAKYAT INDONESIA PERSER	2,765,400	5,300.000	14,656,620,000.00	
	TELKOM INDONESIA PERSERO TBK	1,927,000	3,110.000	5,992,970,000.00	
インドネシア・ルピア小計		54,794,712		86,048,385,730.00 (791,645,149)	
ブラジル・レアル	COSAN SA	42,588	13.130	559,180.44	
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS	149,900	40.770	6,111,423.00	
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	184,400	37.210	6,861,524.00	
	PRIO SA	34,500	42.740	1,474,530.00	
	ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	26,800	23.070	618,276.00	

	CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	20,900	11.910	248,919.00	
	GERDAU SA-PREF	50,928	18.480	941,149.44	
	SUZANO SA	31,215	53.020	1,655,019.30	
	VALE SA	139,888	58.500	8,183,448.00	
	EMBRAER SA	30,500	49.180	1,499,990.00	
	WEG SA	68,260	53.000	3,617,780.00	
	CCR SA	46,500	13.140	611,010.00	
	LOCALIZA RENT A CAR	35,730	43.790	1,564,616.70	
	RUMO SA	56,700	21.110	1,196,937.00	
	VIBRA ENERGIA SA	44,080	24.740	1,090,539.20	
	ATACADAO SA	19,900	8.950	178,105.00	
	RAIA DROGASIL SA	51,280	27.000	1,384,560.00	
	SENDAS DISTRIBUIDORA SA	55,700	8.750	487,375.00	
	AMBEV SA	199,000	12.860	2,559,140.00	
	BRF SA	27,400	25.000	685,000.00	
	JBS SA	29,700	33.590	997,623.00	
	NATURA &CO HOLDING SA	38,000	14.250	541,500.00	
	HAPVIDA PARTICIPACOES E INVE	213,319	4.620	985,533.78	
	REDE D'OR SAO LUIZ SA	33,700	34.440	1,160,628.00	
	HYPERA SA	13,000	29.060	377,780.00	
	BANCO BRADESCO S.A.	59,481	13.880	825,596.28	
	BANCO BRADESCO SA-PREF	221,536	15.430	3,418,300.48	
	BANCO DO BRASIL S.A.	71,200	28.570	2,034,184.00	
	ITAU UNIBANCO HOLDING S-PREF	195,100	37.000	7,218,700.00	
	ITAUSA SA	211,580	11.200	2,369,696.00	
	B3 SA-BRASIL BOLSA BALCAO	231,600	12.160	2,816,256.00	
	BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	26,200	36.400	953,680.00	
	CAIXA SEGURIDADE PARTICIPACO	27,300	15.210	415,233.00	
	TOTVS SA	22,800	30.260	689,928.00	
	TELEFONICA BRASIL S.A.	16,800	55.800	937,440.00	
	TIM SA	29,400	18.660	548,604.00	
	CENTRAIS ELETRICAS BRASILIER	47,305	42.000	1,986,810.00	
	CENTRAIS ELETRICAS BRAS-PR B	8,000	46.200	369,600.00	
	CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF	68,508	11.740	804,283.92	
	CIA SANEAMENTO BASICO DE SP	19,000	96.500	1,833,500.00	
	COMPANHIA PARANAENSE -PREF B	51,700	10.820	559,394.00	
	CPFL ENERGIA SA	7,300	34.260	250,098.00	
	ENGIE BRASIL ENERGIA SA	6,450	44.270	285,541.50	
	EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD	49,900	34.060	1,699,594.00	
ブラジル・レアル小計		3,015,048		75,608,026.04 (1,930,189,736)	
チェコ・コ	KOMERCNI BANKA AS	2,663	769.000	2,047,847.00	

ルナ	MONETA MONEY BANK AS	12,093	110.000	1,330,230.00	
	CEZ AS	6,730	855.500	5,757,515.00	
チェコ・コルナ小計		21,486		9,135,592.00 (56,832,518)	
韓国・ウォン	HD HYUNDAI	2,022	78,700.000	159,131,400.00	
	SK INNOVATION CO LTD	2,672	110,700.000	295,790,400.00	
	S-OIL CORP	1,775	59,700.000	105,967,500.00	
	ENCHEM CO LTD	519	183,300.000	95,132,700.00	
	HANWHA SOLUTIONS CORP	5,063	24,600.000	124,549,800.00	
	HYUNDAI STEEL CO	2,767	24,500.000	67,791,500.00	
	KOREA ZINC CO LTD	371	666,000.000	247,086,000.00	
	KUM YANG CO LTD	1,245	48,500.000	60,382,500.00	
	KUMHO PETROCHEMICAL CO LTD	531	133,300.000	70,782,300.00	
	LG CHEM LTD	2,074	321,500.000	666,791,000.00	
	LG CHEM LTD-PREFERENCE	227	213,500.000	48,464,500.00	
	LOTTE CHEMICAL CORP	723	80,600.000	58,273,800.00	
	POSCO HOLDINGS INC	2,913	370,000.000	1,077,810,000.00	
	SKC CO LTD	898	123,800.000	111,172,400.00	
	DOOSAN BOBCAT INC	2,210	41,350.000	91,383,500.00	
	DOOSAN ENERBILITY CO LTD	16,971	18,160.000	308,193,360.00	
	ECOPRO BM CO LTD	1,920	159,100.000	305,472,000.00	
	ECOPRO CO LTD	3,930	76,800.000	301,824,000.00	
	ECOPRO MATERIALS CO LTD	616	103,600.000	63,817,600.00	
	GS HOLDINGS	2,131	44,700.000	95,255,700.00	
	HANWHA AEROSPACE CO LTD	1,363	290,000.000	395,270,000.00	
	HANWHA OCEAN CO LTD	3,632	30,600.000	111,139,200.00	
	HD HYUNDAI ELECTRIC CO LTD	930	283,500.000	263,655,000.00	
	HD HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES	830	187,600.000	155,708,000.00	
	HD KOREA SHIPBUILDING & OFFS	1,607	183,000.000	294,081,000.00	
	HYUNDAI ENGINEERING & CONST	2,816	31,250.000	88,000,000.00	
	KOREA AEROSPACE INDUSTRIES	3,106	53,000.000	164,618,000.00	
	L&F CO LTD	1,068	90,400.000	96,547,200.00	
	LG CORP	4,097	84,000.000	344,148,000.00	
	LG ENERGY SOLUTION	1,956	399,500.000	781,422,000.00	
	LS ELECTRIC CO LTD	737	145,000.000	106,865,000.00	
	POSCO FUTURE M CO LTD	1,173	232,000.000	272,136,000.00	
	POSCO INTERNATIONAL CORP	2,522	54,400.000	137,196,800.00	
	SAMSUNG C&T CORP	3,755	149,200.000	560,246,000.00	
	SAMSUNG E&A CO LTD	7,079	24,150.000	170,957,850.00	
	SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES	27,200	10,340.000	281,248,000.00	
	SK INC	1,385	147,900.000	204,841,500.00	
	SK SQUARE CO LTD	3,944	77,000.000	303,688,000.00	

HMM CO LTD	10,696	16,860.000	180,334,560.00	
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	1,482	115,700.000	171,467,400.00	
KOREAN AIR LINES CO LTD	6,388	22,400.000	143,091,200.00	
HANKOOK TIRE & TECHNOLOGY CO	2,945	41,200.000	121,334,000.00	
HYUNDAI MOBIS CO LTD	2,378	223,500.000	531,483,000.00	
HYUNDAI MOTOR CO	5,491	237,000.000	1,301,367,000.00	
HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PRF	1,565	176,500.000	276,222,500.00	
HYUNDAI MOTOR CO LTD-PRF	913	173,000.000	157,949,000.00	
KIA CORP	9,951	100,500.000	1,000,075,500.00	
COWAY CO LTD	1,996	66,100.000	131,935,600.00	
LG ELECTRONICS INC	4,419	104,400.000	461,343,600.00	
HANJIN KAL CORP	1,262	71,000.000	89,602,000.00	
CJ CHEILJEDANG CORP	261	317,000.000	82,737,000.00	
KT&G CORP	4,383	111,500.000	488,704,500.00	
ORION CORP/REPUBLIC OF KOREA	1,190	89,000.000	105,910,000.00	
AMOREPACIFIC CORP	1,133	140,600.000	159,299,800.00	
LG H&H	359	350,000.000	125,650,000.00	
HLB INC	4,671	89,200.000	416,653,200.00	
ALTEOGEN INC	1,692	319,500.000	540,594,000.00	
CELLTRION INC	6,183	195,200.000	1,206,921,600.00	
CELLTRION PHARM INC	857	68,200.000	58,447,400.00	
HANMI PHARM CO LTD	246	323,500.000	79,581,000.00	
SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	745	990,000.000	737,550,000.00	
SK BIOPHARMACEUTICALS CO LTD	1,453	104,300.000	151,547,900.00	
SK BIOSCIENCE CO LTD	902	55,500.000	50,061,000.00	
YUHAN CORP	2,342	125,000.000	292,750,000.00	
HANA FINANCIAL GROUP	11,955	60,700.000	725,668,500.00	
INDUSTRIAL BANK OF KOREA	11,154	13,890.000	154,929,060.00	
KAKAOBANK CORP	6,317	21,400.000	135,183,800.00	
KB FINANCIAL GROUP INC	15,500	81,800.000	1,267,900,000.00	
SHINHAN FINANCIAL GROUP LTD	17,971	55,900.000	1,004,578,900.00	
WOORI FINANCIAL GROUP INC	26,970	15,420.000	415,877,400.00	
KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO	1,369	72,900.000	99,800,100.00	
MERITZ FINANCIAL GROUP INC	3,907	93,100.000	363,741,700.00	
MIRAE ASSET SECURITIES CO LT	8,457	8,700.000	73,575,900.00	
NH INVESTMENT & SECURITIES C	5,391	14,180.000	76,444,380.00	
DB INSURANCE CO LTD	1,789	112,600.000	201,441,400.00	
SAMSUNG FIRE & MARINE INS	1,227	357,500.000	438,652,500.00	
SAMSUNG LIFE INSURANCE CO LT	3,201	97,500.000	312,097,500.00	
POSCO DX CO LTD	1,864	29,350.000	54,708,400.00	
SAMSUNG SDS CO LTD	1,822	164,800.000	300,265,600.00	
COSMOAM&T CO LTD	821	109,300.000	89,735,300.00	

	LG DISPLAY CO LTD	11,601	10,520.000	122,042,520.00	
	LG INNOTEK CO LTD	495	231,500.000	114,592,500.00	
	SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO	2,356	130,700.000	307,929,200.00	
	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	194,488	64,400.000	12,525,027,200.00	
	SAMSUNG ELECTRONICS-PREF	33,810	52,500.000	1,775,025,000.00	
	SAMSUNG SDI CO LTD	2,241	365,000.000	817,965,000.00	
	HANMI SEMICONDUCTOR CO LTD	1,863	99,500.000	185,368,500.00	
	SK HYNIX INC	22,327	162,800.000	3,634,835,600.00	
	KT CORP	1,784	42,050.000	75,017,200.00	
	LG UPLUS CORP	6,942	10,000.000	69,420,000.00	
	SK TELECOM	2,212	58,300.000	128,959,600.00	
	KOREA ELECTRIC POWER CORP	9,785	22,250.000	217,716,250.00	
	HYBE CO LTD	801	164,000.000	131,364,000.00	
	KAKAO CORP	12,106	35,600.000	430,973,600.00	
	KRAFTON INC	1,234	338,000.000	417,092,000.00	
	NAVER CORP	5,285	160,100.000	846,128,500.00	
	NCSOFT CORP	485	179,800.000	87,203,000.00	
	NETMARBLE CORP	1,568	60,700.000	95,177,600.00	
韓国・ウォン小計		627,779		45,845,889,980.00 (4,891,756,461)	
マレーシア・リンギット	PETRONAS DAGANGAN BHD	10,400	19.080	198,432.00	
	PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	105,000	5.500	577,500.00	
	PRESS METAL ALUMINIUM HOLDIN	140,100	4.780	669,678.00	
	GAMUDA BHD	84,800	7.590	643,632.00	
	SIME DARBY BERHAD	93,800	2.320	217,616.00	
	SUNWAY BHD	92,600	4.090	378,734.00	
	MALAYSIA AIRPORTS HLDGS BHD	30,900	10.500	324,450.00	
	MISC BHD	61,600	8.040	495,264.00	
	GENTING BHD	78,200	4.210	329,222.00	
	GENTING MALAYSIA BHD	124,300	2.450	304,535.00	
	MR DIY GROUP M BHD	136,150	1.960	266,854.00	
	IOI CORP BHD	101,000	3.860	389,860.00	
	KUALA LUMPUR KEPONG BHD	21,300	20.780	442,614.00	
	NESTLE (MALAYSIA) BERHAD	2,300	101.300	232,990.00	
	PPB GROUP BERHAD	30,140	14.200	427,988.00	
	QL RESOURCES BHD	54,350	6.780	368,493.00	
	SD GUTHRIE BHD	80,400	4.540	365,016.00	
	IHH HEALTHCARE BHD	85,700	6.780	581,046.00	
	AMMB HOLDINGS BHD	108,500	5.170	560,945.00	
	CIMB GROUP HOLDINGS BHD	286,100	8.160	2,334,576.00	
	HONG LEONG BANK BERHAD	22,700	21.200	481,240.00	
	MALAYAN BANKING BHD	227,100	10.640	2,416,344.00	

	PUBLIC BANK BERHAD	605,200	4.700	2,844,440.00	
	RHB BANK BHD	73,100	6.300	460,530.00	
	INARI AMERTRON BHD	125,200	3.040	380,608.00	
	AXIATA GROUP BERHAD	89,500	2.500	223,750.00	
	CELCOMDIGI BHD	123,800	3.700	458,060.00	
	MAXIS BHD	85,300	3.840	327,552.00	
	TELEKOM MALAYSIA BHD	56,700	6.700	379,890.00	
	PETRONAS GAS BHD	30,700	17.980	551,986.00	
	TENAGA NASIONAL BHD	104,400	14.780	1,543,032.00	
	YTL CORP BHD	149,000	2.550	379,950.00	
	YTL POWER INTERNATIONAL BHD	108,600	3.660	397,476.00	
マレーシア・リンギット小計		3,528,940		20,954,303.00 (686,259,710)	
南アフリカ・ランド	EXXARO RESOURCES LTD	11,192	155.040	1,735,207.68	
	ANGLO AMERICAN PLATINUM LTD	2,321	556.810	1,292,356.01	
	ANGLOGOLD ASHANTI PLC	16,779	496.410	8,329,263.39	
	GOLD FIELDS LTD	36,395	255.900	9,313,480.50	
	HARMONY GOLD MINING CO LTD	23,472	175.350	4,115,815.20	
	IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	38,529	91.020	3,506,909.58	
	KUMBA IRON ORE LTD	2,544	349.860	890,043.84	
	NORTHAM PLATINUM HOLDINGS LT	14,047	104.360	1,465,944.92	
	SASOL LTD	24,977	124.600	3,112,134.20	
	SIBANYE STILLWATER LTD	119,878	18.210	2,182,978.38	
	BIDVEST GROUP LTD	14,536	274.390	3,988,533.04	
	NASPERS LTD-N SHS	7,250	3,478.000	25,215,500.00	
	PEPKOR HOLDINGS LTD	97,392	22.400	2,181,580.80	
	WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	38,194	63.000	2,406,222.00	
	BID CORP LTD	13,980	438.300	6,127,434.00	
	CLICKS GROUP LTD	9,867	370.240	3,653,158.08	
	SHOPRITE HOLDINGS LTD	21,011	297.940	6,260,017.34	
	ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT	15,681	193.490	3,034,116.69	
	ABSA GROUP LTD	34,551	169.380	5,852,248.38	
	CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	3,583	2,982.500	10,686,297.50	
	NEDBANK GROUP LTD	19,433	288.240	5,601,367.92	
	STANDARD BANK GROUP LTD	54,772	232.600	12,739,967.20	
	FIRSTRAND LTD	204,749	82.720	16,936,837.28	
	REINET INVESTMENTS SCA	4,918	468.890	2,306,001.02	
	REMGRO LTD	19,028	145.780	2,773,901.84	
	DISCOVERY LTD	22,003	154.990	3,410,244.97	
	OLD MUTUAL LTD	170,915	12.500	2,136,437.50	
	OUTSURANCE GROUP LTD	34,388	51.050	1,755,507.40	
	SANLAM LTD	70,266	85.650	6,018,282.90	

	MTN GROUP LTD	67,043	92.520	6,202,818.36	
	VODACOM GROUP LTD	25,348	110.790	2,808,304.92	
	NEPI ROCKCASTLE N.V.	23,182	148.810	3,449,713.42	
南アフリカ・ランド小計		1,262,224		171,488,626.26 (1,368,479,238)	
タイ・バーツ	PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR	56,500	137.000	7,740,500.00	
	PTT PCL-NVDR	391,900	33.250	13,030,675.00	
	THAI OIL PCL-NVDR	52,500	51.250	2,690,625.00	
	PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	78,600	28.750	2,259,750.00	
	SCG PACKAGING PCL-NVDR	41,600	27.500	1,144,000.00	
	SIAM CEMENT PCL-NVDR	31,300	249.000	7,793,700.00	
	AIRPORTS OF THAILAND PC-NVDR	178,800	62.750	11,219,700.00	
	BANGKOK EXPRESSWAY-NVDR	348,900	8.000	2,791,200.00	
	MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	126,300	28.500	3,599,550.00	
	CENTRAL RETAIL CORP PCL-NVDR	63,391	32.250	2,044,359.75	
	HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR	235,400	10.800	2,542,320.00	
	PTT OIL & RETAIL BUSINE-NVDR	110,600	17.000	1,880,200.00	
	CP ALL PCL-NVDR	229,200	65.500	15,012,600.00	
	CP AXTRA PCL-NVDR	77,100	33.000	2,544,300.00	
	CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR	154,600	24.600	3,803,160.00	
	BANGKOK DUSIT MED SERVI-NVDR	455,100	29.750	13,539,225.00	
	BUMRUNGRAD HOSPITAL PCL-NVDR	22,300	270.000	6,021,000.00	
	KASIKORNBANK PCL-NVDR	23,700	157.500	3,732,750.00	
	KRUNG THAI BANK - NVDR	171,100	20.400	3,490,440.00	
	SCB X PCL-NVDR	30,600	112.000	3,427,200.00	
	TMBTHANACHART BANK PCL-NVDR	1,077,800	1.960	2,112,488.00	
	KRUNGTHAI CARD PCL-NVDR	50,200	46.500	2,334,300.00	
	DELTA ELECTRONICS THAI-NVDR	130,500	102.500	13,376,250.00	
	ADVANCED INFO SERVICE-NVDR	49,900	256.000	12,774,400.00	
	INTOUCH HOLDINGS PCL-NVDR	35,900	89.250	3,204,075.00	
	TRUE CORP PCL/NEW-NVDR	474,567	10.700	5,077,866.90	
	GULF ENERGY DEVELOPMENT-NVDR	130,000	55.750	7,247,500.00	
	CENTRAL PATTANA PCL-NVDR	76,200	65.500	4,991,100.00	
タイ・バーツ小計		4,904,558		161,425,234.65 (682,828,743)	
ポーランド・ズロチ	ORLEN SA	23,604	60.700	1,432,762.80	
	KGHM POLSKA MIEDZ SA	5,950	138.600	824,670.00	
	BUDIMEX	546	595.500	325,143.00	
	LPP SA	48	14,540.000	697,920.00	
	ALLEGRO.EU SA	23,505	37.800	888,489.00	
	DINO POLSKA SA	1,969	303.300	597,197.70	
	ALIOR BANK SA	4,307	92.940	400,292.58	

	BANK PEKAO SA	7,306	148.850	1,087,498.10	
	MBANK SA	477	634.400	302,608.80	
	PKO BANK POLSKI SA	36,275	55.820	2,024,870.50	
	SANTANDER BANK POLSKA SA	1,451	463.000	671,813.00	
	POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZE	23,952	39.150	937,720.80	
	PGE SA	36,813	7.172	264,022.83	
	CD PROJEKT SA	2,415	172.900	417,553.50	
ポーランド・ズロチ小計		168,618		10,872,562.61 (397,900,998)	
ハンガリー・フォリント	MOL HUNGARIAN OIL AND GAS PL	17,123	2,636.000	45,136,228.00	
	RICHTER GEDEON NYRT	5,767	10,750.000	61,995,250.00	
	OTP BANK PLC	8,992	18,500.000	166,352,000.00	
ハンガリー・フォリント小計		31,882		273,483,478.00 (108,566,376)	
ユーロ	METLEN ENERGY & METALS SA	4,436	33.440	148,339.84	
	FF GROUP	123	4.800	590.40	
	OPAP SA	7,358	15.950	117,360.10	
	JUMBO SA	4,834	24.280	117,369.52	
	ALPHA SERVICES AND HOLDINGS	91,747	1.549	142,116.10	
	EUROBANK ERGASIAS SERVICES A	105,462	1.980	208,814.76	
	NATIONAL BANK OF GREECE	32,591	7.384	240,651.94	
	PIRAEUS FINANCIAL HOLDINGS S	40,213	3.850	154,820.05	
	HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	7,649	15.040	115,040.96	
	PUBLIC POWER CORP	8,551	11.280	96,455.28	
ユーロ小計		302,964		1,341,558.95 (210,021,054)	
合　計		140,292,447		39,236,619,466 (39,236,619,466)	

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

通　貨	銘柄数		組入株式時価比率	合計金額に対する比率
アメリカ・ドル	株式	22銘柄	2.5%	3.0%
香港・ドル	株式	151銘柄	17.2%	20.7%
台湾・ドル	株式	87銘柄	17.2%	20.7%
エジプト・ポンド	株式	3銘柄	0.1%	0.1%
トルコ・リラ	株式	18銘柄	0.6%	0.8%
メキシコ・ペソ	株式	20銘柄	1.4%	1.7%
フィリピン・ペソ	株式	13銘柄	0.6%	0.7%
チリ・ペソ	株式	11銘柄	0.4%	0.5%
コロンビア・ペソ	株式	3銘柄	0.1%	0.1%
インド・ルピー	株式	151銘柄	19.4%	23.4%
インドネシア・ルピア	株式	20銘柄	1.7%	2.0%

ブラジル・レアル	株式	44銘柄	4.1%	4.9%
チェコ・コルナ	株式	3銘柄	0.1%	0.1%
韓国・ウォン	株式	98銘柄	10.3%	12.5%
マレーシア・リンギット	株式	33銘柄	1.4%	1.7%
南アフリカ・ランド	株式	32銘柄	2.9%	3.5%
タイ・バーツ	株式	28銘柄	1.4%	1.7%
ポーランド・ズロチ	株式	14銘柄	0.8%	1.0%
ハンガリー・フォリント	株式	3銘柄	0.2%	0.3%
ユーロ	株式	10銘柄	0.4%	0.5%

(b)株式以外の有価証券

種　類	通　貨	銘　柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	オフショア・人民元	CHINAAMC ETF SERIES - CH-CNY	2,368,000.00	77,433,600.00	
	オフショア・人民元小計		2,368,000.00	77,433,600.00 (1,534,261,607)	
投資信託受益証券合計				1,534,261,607 (1,534,261,607)	
投資証券	アメリカ・ドル	ISHARES MSCI KUWAIT ETF	70,532.00	2,293,700.64	
		ISHARES MSCI QATAR ETF	141,785.00	2,580,487.00	
		ISHARES MSCI SAUDI ARABIA ETF	299,238.00	12,343,567.50	
		ISHARES MSCI UAE ETF	256,688.00	3,873,421.92	
	アメリカ・ドル小計		768,243.00	21,091,177.06 (2,969,004,995)	
	メキシコ・ペソ	CEMEX SAB-CPO	642,700.00	7,448,893.00	
		COCA-COLA FEMSA SAB DE CV	20,875.00	3,497,188.75	
		FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	74,500.00	14,941,720.00	
		PROLOGIS PROPERTY MEXICO SA	45,560.00	2,923,129.60	
		TRUST FIBRA UNO	117,000.00	2,626,650.00	
	メキシコ・ペソ小計		900,635.00	31,437,581.35 (230,069,652)	
	ブラジル・レアル	BANCO BTG PACTUAL SA-UNIT	49,300.00	1,739,797.00	
		ENERGISA SA-UNITS	11,000.00	531,520.00	
		KLABIN SA - UNIT	34,430.00	747,819.60	
	ブラジル・レアル小計		94,730.00	3,019,136.60 (77,075,236)	
投資証券合計				3,276,149,883 (3,276,149,883)	
合　計				4,810,411,490 (4,810,411,490)	

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

通　貨	銘柄数		組入 投資信託受益証券 時価比率	組入 投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカ・ドル	投資証券	4銘柄	－	6.3%	61.7%
メキシコ・ペソ	投資証券	5銘柄	－	0.5%	4.8%
ブラジル・レアル	投資証券	3銘柄	－	0.2%	1.6%
オフショア・人民元	投資信託受益証券	1銘柄	3.2%	－	31.9%

②デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

Ｊリート・インデックス・マザーファンド

（１）貸借対照表

（単位：円）

	（2024年9月17日現在）
資産の部	
流動資産	
金銭信託	1,441,190
コール・ローン	143,288,588
投資証券	15,569,551,000
未収配当金	222,744,759
前払金	108,000
差入委託証拠金	2,163,770
流動資産合計	15,939,297,307
資産合計	15,939,297,307
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	72,400
未払金	95,458,028
未払解約金	11,491,761
流動負債合計	107,022,189
負債合計	107,022,189
純資産の部	
元本等	
元本	6,047,916,666
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	9,784,358,452
元本等合計	15,832,275,118
純資産合計	15,832,275,118
負債純資産合計	15,939,297,307

（２）注記表

（重要な会計方針の注記）

項　目	自 2023年9月16日 至 2024年9月17日
１．　有価証券の評価基準及び評価方法	投資証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。 (1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。 (2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。 (3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。
２．　デリバティブの評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算期間末日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場によっております。

（重要な会計上の見積りに関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

項　目	(2024年9月17日現在)
１．　当計算期間の末日における受益権の総数	6,047,916,666口
２．　１単位当たり純資産の額	１口当たり純資産額　2.6178円 （１万口当たりの純資産額26,178円）

（金融商品に関する注記）

Ⅰ．金融商品の状況に関する事項

項　目	自 2023年9月16日 至 2024年9月17日
１．　金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
２．　金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	(1) 金融商品の内容 1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、投資証券を組み入れております。

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

Ⅱ．金融商品の時価等に関する事項

項　目	(2024年9月17日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券（投資証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。

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

(デリバティブ取引に関する注記)

(2024年9月17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	うち1年超	時価	評価損益
市場取引	リート指数先物取引 買建 TREIT 先物 0612 月	35,002,400	-	34,930,000	△72,400
	小計	35,002,400	-	34,930,000	△72,400
合計		35,002,400	-	34,930,000	△72,400

(注) 1．時価の算定方法

リート指数先物取引の時価の算定方法については以下のように評価しております。

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

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

2)リート指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

2．ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

自 2023年9月16日 至 2024年9月17日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。

(その他の注記)

(2024年9月17日現在)	
開示対象ファンドの 期首における当該親投資信託の元本額	5,033,491,862円
同期中における追加設定元本額	2,858,545,945円
同期中における一部解約元本額	1,844,121,141円
2024年9月17日現在の元本の内訳 アセットアロケーション・ファンド(安定型)	62,443,375円

アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）	143,794,181円
アセットアロケーション・ファンド（成長型）	104,273,357円
三井住友・ＤＣ日本リートインデックスファンド	2,829,637,094円
三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０５０	32,189,464円
三井住友・資産最適化ファンド（１安定重視型）	48,821,857円
三井住友・資産最適化ファンド（２やや安定型）	52,586,537円
三井住友・資産最適化ファンド（３バランス型）	239,482,273円
三井住友・資産最適化ファンド（４やや成長型）	156,128,374円
三井住友・資産最適化ファンド（５成長重視型）	127,306,138円
三井住友・ＤＣつみたてＮＩＳＡ・世界分散ファンド	61,188,113円
三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０６０	4,457,083円
三井住友ＤＳ・国内リートインデックス年金ファンド	398,251,532円
日興ＦＷＳ・Ｊリートインデックス	1,131,384,417円
三井住友ＤＳ・国内リートインデックス・ファンド	190,356,944円
三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０３５	6,123,718円
三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０４０	4,111,113円
三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０４５	5,773,534円
三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０５５	3,711,895円
三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０６５	2,393,809円
三井住友ＤＳ・ＦＷ専用ポートフォリオ・レベル１（保守型）	415,601円
三井住友ＤＳ・ＦＷ専用ポートフォリオ・レベル２（安定型）	18,223,704円
三井住友ＤＳ・ＦＷ専用ポートフォリオ・レベル３（安定成長型）	95,461,417円
三井住友ＤＳ・ＦＷ専用ポートフォリオ・レベル４（成長型）	102,437,174円
三井住友ＤＳ・ＦＷ専用ポートフォリオ・レベル５（積極成長型）	40,514,770円
ＳＭＡＭ・世界リート・インデックスファンドＶＡ＜適格機関投資家限定＞	2,641,141円
ＳＭＡＭ・年金Ｗリスクコントロールファンド＜適格機関投資家限定＞	69,740,411円
ＳＭＡＭ・マルチアセットストラテジーファンド２０１６－０４＜適格機関投資家限定＞	43,842,620円
ＳＭＡＭ・マルチアセットストラテジー・オープン＜適格機関投資家限定＞	70,225,020円
合　計	6,047,916,666円

（３）附属明細表

①有価証券明細表

(a)株式

該当事項はありません。

(b)株式以外の有価証券

（単位：円）

種　類	銘　柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	エスコンジャパンリート投資法人	340	40,970,000	
	サンケイリアルエステート投資法人	490	39,249,000	
	ＳＯＳＩＬＡ物流リート投資法人	764	87,936,400	
	東海道リート投資法人	260	29,510,000	
	日本アコモデーションファンド投資法人	527	347,293,000	

	森ヒルズリート投資法人	1,800	228,960,000	
	産業ファンド投資法人	2,803	338,602,400	
	アドバンス・レジデンス投資法人	1,505	506,432,500	
	アクティビア・プロパティーズ投資法人	745	242,870,000	
	ＧＬＰ投資法人	5,142	695,198,400	
	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	774	256,968,000	
	日本プロロジスリート投資法人	2,666	714,754,600	
	星野リゾート・リート投資法人	322	153,433,000	
	Ｏｎｅリート投資法人	267	65,895,600	
	イオンリート投資法人	1,878	253,717,800	
	ヒューリックリート投資法人	1,352	189,550,400	
	日本リート投資法人	497	157,549,000	
	積水ハウス・リート投資法人	4,601	369,920,400	
	トーセイ・リート投資法人	333	45,621,000	
	ヘルスケア＆メディカル投資法人	378	44,377,200	
	サムティ・レジデンシャル投資法人	391	39,569,200	
	野村不動産マスターファンド投資法人	4,949	748,783,700	
	いちごホテルリート投資法人	252	30,668,400	
	ラサールロジポート投資法人	1,960	283,808,000	
	スターアジア不動産投資法人	2,820	148,896,000	
	マリモ地方創生リート投資法人	277	32,270,500	
	三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	639	278,284,500	
	日本ホテル＆レジデンシャル投資法人	246	17,712,000	
	投資法人みらい	2,108	92,014,200	
	三菱地所物流リート投資法人	528	197,736,000	
	ＣＲＥロジスティクスファンド投資法人	659	98,915,900	
	ザイマックス・リート投資法人	261	30,041,100	
	タカラレーベン不動産投資法人	997	86,938,400	
	アドバンス・ロジスティクス投資法人	671	83,472,400	
	日本ビルファンド投資法人	1,785	1,206,660,000	
	ジャパンリアルエステイト投資法人	1,571	930,032,000	
	日本都市ファンド投資法人	7,711	781,124,300	
	オリックス不動産投資法人	3,051	474,125,400	
	日本プライムリアルティ投資法人	1,047	369,591,000	
	ＮＴＴ都市開発リート投資法人	1,557	181,234,800	
	東急リアル・エステート投資法人	1,028	161,601,600	
	グローバル・ワン不動産投資法人	1,130	115,486,000	
	ユナイテッド・アーバン投資法人	3,425	480,527,500	

	森トラストリート投資法人	2,951	191,519,900	
	インヴィンシブル投資法人	8,435	489,230,000	
	フロンティア不動産投資法人	567	245,511,000	
	平和不動産リート投資法人	1,122	144,850,200	
	日本ロジスティクスファンド投資法人	1,030	285,722,000	
	福岡リート投資法人	863	126,774,700	
	ＫＤＸ不動産投資法人	4,283	662,151,800	
	いちごオフィスリート投資法人	1,116	92,739,600	
	大和証券オフィス投資法人	621	194,994,000	
	阪急阪神リート投資法人	731	91,448,100	
	スターツプロシード投資法人	265	51,251,000	
	大和ハウスリート投資法人	2,294	539,548,800	
	ジャパン・ホテル・リート投資法人	5,624	385,806,400	
	大和証券リビング投資法人	2,203	224,926,300	
	ジャパンエクセレント投資法人	1,314	164,775,600	
	投資証券　小計		15,569,551,000	
合　計			15,569,551,000	

②デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

外国リート・インデックス・マザーファンド

（１）貸借対照表

（単位：円）

	（2024年9月17日現在）
資産の部	
流動資産	
預金	1,312,343,586
金銭信託	3,113,032
コール・ローン	309,509,424
投資証券	39,923,748,353
派生商品評価勘定	1,431
未収入金	2,371,294
未収配当金	138,503,013
流動資産合計	41,689,590,133
資産合計	41,689,590,133
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	1,402,297
未払解約金	2,692,818
流動負債合計	4,095,115
負債合計	4,095,115
純資産の部	

元本等	
元本	11,577,053,279
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	30,108,441,739
元本等合計	41,685,495,018
純資産合計	41,685,495,018
負債純資産合計	41,689,590,133

（２）注記表

（重要な会計方針の注記）

項　目	自 2023年9月16日 至 2024年9月17日
１．　有価証券の評価基準及び評価方法	投資証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。 (1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。 (2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。 (3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。
２．　デリバティブの評価基準及び評価方法	為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。
３．　その他財務諸表作成のための基礎となる事項	外貨建資産等の会計処理 「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。

（重要な会計上の見積りに関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

項　目	(2024年9月17日現在)
１．　当計算期間の末日における受益権の総数	11,577,053,279口
２．　１単位当たり純資産の額	１口当たり純資産額　3.6007円 （１万口当たりの純資産額36,007円）

（金融商品に関する注記）

Ⅰ．金融商品の状況に関する事項

項　目	自 2023年9月16日 至 2024年9月17日
1．　金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2．　金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	(1) 金融商品の内容 1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、投資証券を組み入れております。 2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。 当計算期間については、為替予約取引を行っております。 3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 (2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。
3．　金融商品に係るリスク管理体制	リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する会議をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。 また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限値、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用部署に是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用部署は、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。なお、投資信託協会の流動性リスク管理規制に抵触する場合には、流動性リスクを管理する会議で審議の上、流動性リスクの管理責任者が対処方針を決定します。その後、決定した対処方針やその実施等について、リスク管理会議に報告を行う体制となっております。 なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する会議にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に

	実施し、投資対象としての適格性を判断しております。

Ⅱ．金融商品の時価等に関する事項

項　目	(2024年9月17日現在)
1．　貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2．　時価の算定方法	(1) 有価証券（投資証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。
3．　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。

(デリバティブ取引に関する注記)

(2024年9月17日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位：円)

区　分	種　類	契　約　額　等		時　価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建				
	アメリカ・ドル	242,400,000	－	241,170,782	△1,229,218
	カナダ・ドル	9,000,000	－	8,940,332	△59,668
	オーストラリア・ドル	18,000,000	－	17,948,727	△51,273
	シンガポール・ドル	8,800,000	－	8,780,283	△19,717
	イギリス・ポンド	13,000,000	－	12,995,166	△4,834
	ユーロ	15,100,000	－	15,063,844	△36,156
	小計	306,300,000	－	304,899,134	△1,400,866
合　計		306,300,000	－	304,899,134	△1,400,866

(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。

①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。

②計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。

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

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

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

２．ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

自 2023年9月16日 至 2024年9月17日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。

(その他の注記)

(2024年9月17日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	9,988,366,894円
同期中における追加設定元本額	2,559,789,268円
同期中における一部解約元本額	971,102,883円
2024年9月17日現在の元本の内訳	
アセットアロケーション・ファンド（安定型）	9,287,763円
アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）	14,066,046円
アセットアロケーション・ファンド（成長型）	8,047,360円
三井住友・ＤＣ外国リートインデックスファンド	9,060,936,613円
三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０５０	11,148,089円
三井住友・資産最適化ファンド（１安定重視型）	38,740,973円
三井住友・資産最適化ファンド（２やや安定型）	38,588,464円
三井住友・資産最適化ファンド（３バランス型）	167,348,435円
三井住友・資産最適化ファンド（４やや成長型）	112,510,735円
三井住友・資産最適化ファンド（５成長重視型）	94,715,195円
三井住友・ＤＣつみたてＮＩＳＡ・世界分散ファンド	132,220,140円
三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０６０	1,569,833円
三井住友ＤＳ・外国リートインデックス年金ファンド	442,720,455円
日興ＦＷＳ・Ｇリートインデックス（為替ヘッジあり）	61,520,971円
日興ＦＷＳ・Ｇリートインデックス（為替ヘッジなし）	1,121,601,869円
三井住友ＤＳ・先進国リートインデックス・ファンド	154,761,724円
三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０３５	3,744,661円
三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０４０	2,066,872円
三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０４５	2,234,489円

三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０５５	1,250,247円
三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０６５	817,062円
三井住友ＤＳ・ＦＷ専用ポートフォリオ・レベル１（保守型）	60,300円
三井住友ＤＳ・ＦＷ専用ポートフォリオ・レベル２（安定型）	1,108,014円
三井住友ＤＳ・ＦＷ専用ポートフォリオ・レベル３（安定成長型）	6,189,308円
三井住友ＤＳ・ＦＷ専用ポートフォリオ・レベル４（成長型）	6,844,237円
三井住友ＤＳ・ＦＷ専用ポートフォリオ・レベル５（積極成長型）	2,761,958円
ＳＭＡＭ・世界リート・インデックスファンドＶＡ＜適格機関投資家限定＞	28,476,244円
ＳＭＡＭ・年金Ｗリスクコントロールファンド＜適格機関投資家限定＞	51,715,222円
合　計	11,577,053,279円

（３）附属明細表

①有価証券明細表

(a)株式

該当事項はありません。

(b)株式以外の有価証券

種　類	通　貨	銘　柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	アメリカ・ドル	ACADIA REALTY TRUST	20,375.00	468,828.75	
		AGREE REALTY CORP	17,601.00	1,350,172.71	
		ALEXANDER & BALDWIN INC	12,195.00	241,339.05	
		ALEXANDER'S INC	300.00	73,251.00	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	28,835.00	3,596,012.85	
		ALPINE INCOME PROPERTY TRUST	2,165.00	40,030.85	
		AMERICAN ASSETS TRUST INC	10,429.00	280,122.94	
		AMERICAN HEALTHCARE REIT INC	14,873.00	362,603.74	
		AMERICAN HOMES 4 RENT- A	59,403.00	2,432,552.85	
		AMERICOLD REALTY TRUST INC	48,007.00	1,374,440.41	
		APARTMENT INVT & MGMT CO -A	23,200.00	210,656.00	
		APPLE HOSPITALITY REIT INC	40,321.00	578,203.14	
		ARMADA HOFFLER PROPERTIES IN	15,799.00	190,377.95	
		ASHFORD HOSPITALITY TRUST	2,515.00	2,029.60	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	25,857.00	6,021,061.02	
		BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	8,400.00	25,620.00	
		BRANDYWINE REALTY TRUST	34,607.00	187,916.01	
		BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	54,159.00	1,524,034.26	
		BROADSTONE NET LEASE INC	31,774.00	594,809.28	
		BRT APARTMENTS CORP	500.00	9,540.00	
		BXP INC	26,897.00	2,192,105.50	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	19,215.00	2,400,529.95	
		CARETRUST REIT INC	24,090.00	751,608.00	
		CBL & ASSOCIATES PROPERTIES	3,648.00	92,586.24	
		CENTERSPACE	2,600.00	191,958.00	

		CHATHAM LODGING TRUST	12,827.00	106,720.64	
		CITY OFFICE REIT INC	4,603.00	28,998.90	
		CLIPPER REALTY INC	800.00	4,192.00	
		COMMUNITY HEALTHCARE TRUST I	3,216.00	57,148.32	
		COPT DEFENSE PROPERTIES	20,034.00	603,023.40	
		COUSINS PROPERTIES INC	28,470.00	839,865.00	
		CTO REALTY GROWTH INC	3,839.00	74,975.67	
		CUBESMART	40,256.00	2,195,964.80	
		DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	33,165.00	279,912.60	
		DIGITAL CORE REIT MANAGEMENT	178,800.00	104,598.00	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	58,588.00	9,425,051.56	
		DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	23,884.00	85,265.88	
		DOUGLAS EMMETT INC	30,537.00	516,380.67	
		EAGLE HOSPITALITY TRUST	20,000.00	2,740.00	
		EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI	15,924.00	218,795.76	
		EASTGROUP PROPERTIES INC	8,959.00	1,704,539.34	
		ELME COMMUNITIES	15,190.00	276,609.90	
		EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	21,276.00	225,738.36	
		EPR PROPERTIES	12,612.00	616,096.20	
		EQUINIX INC	17,094.00	14,984,087.58	
		EQUITY COMMONWEALTH	17,598.00	357,415.38	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	34,434.00	2,593,224.54	
		EQUITY RESIDENTIAL	62,983.00	4,898,187.91	
		ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	32,895.00	1,088,166.60	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	11,550.00	3,639,982.50	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	38,227.00	6,790,262.01	
		FARMLAND PARTNERS INC	7,194.00	75,608.94	
		FEDERAL REALTY INVS TRUST	13,176.00	1,544,490.72	
		FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	22,908.00	1,298,196.36	
		FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	17,953.00	547,207.44	
		FRANKLIN STREET PROPERTIES C	15,115.00	25,846.65	
		GAMING AND LEISURE PROPERTIE	49,019.00	2,531,831.35	
		GETTY REALTY CORP	10,369.00	337,718.33	
		GLADSTONE COMMERCIAL CORP	5,368.00	86,585.84	
		GLADSTONE LAND CORP	4,464.00	65,129.76	
		GLOBAL MEDICAL REIT INC	12,642.00	127,304.94	
		GLOBAL NET LEASE INC	30,518.00	272,220.56	
		HEALTHCARE REALTY TRUST INC	69,152.00	1,288,993.28	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	128,507.00	2,879,841.87	
		HIGHWOODS PROPERTIES INC	19,816.00	656,305.92	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	130,084.00	2,271,266.64	
		HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN	17,289.00	87,828.12	

INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	42,537.00	897,105.33	
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT	6,274.00	31,871.92	
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER	5,313.00	705,725.79	
INVENTRUST PROPERTIES CORP	11,866.00	353,606.80	
INVITATION HOMES INC	103,209.00	3,794,994.93	
IRON MOUNTAIN INC	52,925.00	6,255,205.75	
JBG SMITH PROPERTIES	14,792.00	273,504.08	
KEPPEL PACIFIC OAK US REIT	130,900.00	33,379.50	
KILROY REALTY CORP	19,409.00	736,377.46	
KIMCO REALTY CORP	117,891.00	2,836,457.46	
KITE REALTY GROUP TRUST	38,279.00	1,024,728.83	
LINEAGE INC	10,282.00	849,601.66	
LTC PROPERTIES INC	7,251.00	273,652.74	
LXP INDUSTRIAL TRUST	52,073.00	532,186.06	
MACERICH CO/THE	38,484.00	639,988.92	
MANULIFE US REAL ESTATE INV	245,900.00	26,311.30	
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	97,588.00	619,683.80	
MID-AMERICA APARTMENT COMM	21,016.00	3,502,316.40	
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	13,122.00	639,172.62	
NATL HEALTH INVESTORS INC	7,193.00	611,908.51	
NET LEASE OFFICE PROPERTY	2,275.00	68,727.75	
NETSTREIT CORP	13,768.00	233,780.64	
NEXPOINT DIVERSIFIED REAL ES	7,980.00	49,476.00	
NEXPOINT RESIDENTIAL	3,529.00	164,133.79	
NNN REIT INC	32,073.00	1,564,841.67	
OFFICE PROPERTIES INCOME TRU	9,538.00	21,174.36	
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	45,355.00	1,850,484.00	
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	2,352.00	67,102.56	
ORION OFFICE REIT INC	8,094.00	33,751.98	
PARAMOUNT GROUP INC	23,577.00	120,006.93	
PARK HOTELS & RESORTS INC	35,722.00	502,965.76	
PEAKSTONE REALTY TRUST	7,728.00	114,219.84	
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	20,329.00	262,040.81	
PHILLIPS EDISON & COMPANY IN	22,600.00	878,462.00	
PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A	19,902.00	199,617.06	
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	8,798.00	204,113.60	
POSTAL REALTY TRUST INC- A	1,424.00	21,004.00	
PRIME US REIT	143,770.00	27,747.61	
PROLOGIS INC	167,586.00	21,665,518.08	
PUBLIC STORAGE	28,551.00	10,363,727.49	
REALTY INCOME CORP	158,136.00	9,911,964.48	
REGENCY CENTERS CORP	30,479.00	2,278,914.83	

		RETAIL OPPORTUNITY INVESTMEN	22,092.00	351,925.56	
		REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN	39,699.00	2,033,779.77	
		RLJ LODGING TRUST	24,132.00	218,153.28	
		RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	10,529.00	1,063,429.00	
		SABRA HEALTH CARE REIT INC	44,231.00	831,100.49	
		SAFEHOLD INC	10,598.00	282,118.76	
		SAUL CENTERS INC	2,331.00	94,895.01	
		SERVICE PROPERTIES TRUST	37,820.00	169,055.40	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	59,090.00	9,743,941.00	
		SITE CENTERS CORP	8,123.00	491,360.27	
		SL GREEN REALTY CORP	11,643.00	823,043.67	
		STAG INDUSTRIAL INC	32,025.00	1,285,483.50	
		SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	14,098.00	90,227.20	
		SUN COMMUNITIES INC	22,550.00	3,290,270.50	
		SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	39,745.00	403,809.20	
		TANGER INC	20,789.00	660,258.64	
		TERRENO REALTY CORP	17,748.00	1,234,018.44	
		UDR INC	55,893.00	2,625,294.21	
		UMH PROPERTIES INC	11,316.00	228,470.04	
		UNITI GROUP INC	46,029.00	246,255.15	
		UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	1,344.00	61,555.20	
		URBAN EDGE PROPERTIES	20,402.00	438,643.00	
		VENTAS INC	72,232.00	4,673,410.40	
		VERIS RESIDENTIAL INC	16,966.00	305,048.68	
		VICI PROPERTIES INC	188,053.00	6,401,324.12	
		VORNADO REALTY TRUST	27,687.00	1,037,708.76	
		WELLTOWER INC	108,411.00	14,004,532.98	
		WHITESTONE REIT	12,068.00	161,228.48	
		WP CAREY INC	39,026.00	2,496,102.96	
		XENIA HOTELS & RESORTS INC	17,827.00	246,190.87	
	アメリカ・ドル小計		4,693,467.00	222,240,899.98 (31,284,851,490)	
	カナダ・ドル	ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT	14,869.00	282,362.31	
		ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	9,662.00	75,460.22	
		BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	4,788.00	433,888.56	
		BSR REAL ESTATE INVESTMENT T	3,187.00	61,795.93	
		BTB REAL ESTATE INVESTMENT T	6,841.00	24,217.14	
		CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	14,077.00	792,816.64	
		CHOICE PROPERTIES REIT	30,541.00	463,001.56	
		CROMBIE REAL ESTATE INVESTME	10,639.00	166,393.96	
		CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	9,193.00	148,007.30	
		DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE	23,474.00	337,321.38	

	DREAM OFFICE REAL ESTATE INV	2,732.00	59,038.52	
	FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	21,618.00	396,690.30	
	GRANITE REAL ESTATE INVESTME	5,260.00	426,060.00	
	H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	21,001.00	237,101.29	
	INTERRENT REAL ESTATE INVEST	11,198.00	144,902.12	
	KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	8,107.00	173,895.15	
	MINTO APARTMENT REAL ESTATE	1,447.00	24,381.95	
	MORGUARD NORTH AMERICAN RESI	1,557.00	29,365.02	
	NEXUS INDUSTRIAL REIT	4,345.00	39,105.00	
	NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT	20,754.00	111,656.52	
	PRIMARIS REIT	6,318.00	101,340.72	
	PRO REAL ESTATE INVESTMENT T	15,604.00	92,219.64	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	24,676.00	505,117.72	
	SLATE GROCERY REIT-CL U	3,196.00	44,424.40	
	SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	12,000.00	324,840.00	
	TRUE NORTH COMMERCIAL REAL E	829.00	11,158.34	
カナダ・ドル小計		287,913.00	5,506,561.69 (570,259,529)	
オーストラリア・ドル	ABACUS GROUP	50,980.00	66,783.80	
	ABACUS STORAGE KING	145,482.00	189,126.60	
	ARENA REIT	80,503.00	332,477.39	
	BWP TRUST	115,823.00	437,810.94	
	CENTURIA CAPITAL GROUP	160,667.00	306,070.63	
	CENTURIA INDUSTRIAL REIT	84,443.00	276,128.61	
	CENTURIA OFFICE REIT	68,559.00	84,327.57	
	CHARTER HALL GROUP	83,440.00	1,324,192.80	
	CHARTER HALL LONG WALE REIT	134,611.00	539,790.11	
	CHARTER HALL RETAIL REIT	91,686.00	335,570.76	
	CHARTER HALL SOCIAL INFRASTR	72,491.00	200,800.07	
	CROMWELL PROPERTY GROUP	218,718.00	95,142.33	
	DEXUS INDUSTRIA REIT	30,237.00	87,989.67	
	DEXUS/AU	190,461.00	1,441,789.77	
	GDI PROPERTY GROUP	83,204.00	54,082.60	
	GOODMAN GROUP	314,107.00	11,191,632.41	
	GPT GROUP	330,937.00	1,677,850.59	
	GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR	52,361.00	141,374.70	
	HEALTHCO REIT	51,410.00	60,920.85	
	HMC CAPITAL LTD	53,344.00	431,552.96	
	HOMECO DAILY NEEDS REIT	332,002.00	429,942.59	
	HOTEL PROPERTY INVESTMENTS	55,080.00	204,897.60	
	INGENIA COMMUNITIES GROUP	62,840.00	326,768.00	
	MIRVAC GROUP	701,595.00	1,578,588.75	

	NATIONAL STORAGE REIT	208,817.00	507,425.31	
	REGION RE LTD	191,819.00	446,938.27	
	RURAL FUNDS GROUP	52,739.00	106,005.39	
	SCENTRE GROUP	960,992.00	3,555,670.40	
	STOCKLAND	416,620.00	2,195,587.40	
	VICINITY CENTRES	664,812.00	1,549,011.96	
	WAYPOINT REIT	113,111.00	308,793.03	
オーストラリア・ドル小計		6,173,891.00	30,485,043.86 (2,892,725,812)	
香港・ドル	CHAMPION REIT	435,000.00	804,750.00	
	FORTUNE REIT	259,000.00	1,082,620.00	
	LINK REIT	449,900.00	17,186,180.00	
	PROSPERITY REIT	312,000.00	411,840.00	
	SUNLIGHT REAL ESTATE INVEST	202,000.00	381,780.00	
	YUEXIU REAL ESTATE INVESTMEN	494,000.00	454,480.00	
香港・ドル小計		2,151,900.00	20,321,650.00 (367,008,999)	
シンガポール・ドル	AIMS APAC REIT	113,300.00	150,689.00	
	CAPITALAND ASCENDAS REIT	654,700.00	1,924,818.00	
	CAPITALAND ASCOTT TRUST	428,155.00	402,465.70	
	CAPITALAND CHINA TRUST	205,700.00	150,161.00	
	CAPITALAND INTEGRATED COMMER	956,708.00	2,076,056.36	
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	159,550.00	153,168.00	
	EC WORLD REIT	52,800.00	14,784.00	
	ESR-LOGOS REIT	1,097,413.00	312,762.70	
	FAR EAST HOSPITALITY TRUST	190,000.00	122,550.00	
	FRASERS CENTREPOINT TRUST	221,100.00	528,429.00	
	FRASERS LOGISTICS & COMMERCI	527,638.00	617,336.46	
	KEPPEL DC REIT	258,900.00	579,936.00	
	KEPPEL REIT	363,300.00	346,951.50	
	LENDLEASE GLOBAL COMMERCIAL	262,000.00	162,440.00	
	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	363,300.00	926,415.00	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	558,250.00	803,880.00	
	MAPLETREE PAN ASIA COM TRUST	446,000.00	660,080.00	
	PARAGON REIT	215,200.00	186,148.00	
	PARKWAYLIFE REAL ESTATE	69,800.00	286,878.00	
	SASSEUR REAL ESTATE INVESTME	66,700.00	44,689.00	
	STARHILL GLOBAL REIT	195,000.00	102,375.00	
	SUNTEC REIT	416,400.00	545,484.00	
シンガポール・ドル小計		7,821,914.00	11,098,496.72 (1,205,185,759)	
ニュージ	ARGOSY PROPERTY LTD	153,482.00	171,899.84	

ーラン ド・ドル	GOODMAN PROPERTY TRUST	211,264.00	454,217.60	
	KIWI PROPERTY GROUP LTD	264,918.00	247,698.33	
	PRECINCT PROPERTIES GROUP	269,326.00	348,777.17	
ニュージーランド・ドル小計		898,990.00	1,222,592.94 (106,451,167)	
イギリ ス・ポン ド	ABRDN PROPERTY INCOME TRUST	53,280.00	31,168.80	
	AEW UK REIT PLC	9,000.00	8,874.00	
	ASSURA PLC	472,915.00	199,097.21	
	BALANCED COMM PROPERTY TRUST	154,750.00	146,857.75	
	BIG YELLOW GROUP PLC	35,499.00	468,586.80	
	BRITISH LAND CO PLC	162,562.00	751,686.68	
	CLS HOLDINGS PLC	41,598.00	38,103.76	
	CUSTODIAN PROPERTY INCOME RE	84,958.00	71,534.63	
	DERWENT LONDON PLC	20,725.00	519,783.00	
	EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	95,000.00	94,050.00	
	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	71,900.00	262,794.50	
	HAMMERSON PLC	740,000.00	222,000.00	
	HELICAL PLC	17,000.00	38,675.00	
	HOME REIT PLC	96,051.00	36,499.38	
	IMPACT HEALTHCARE REIT PLC	88,651.00	80,495.10	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	141,683.00	955,651.83	
	LIFE SCIENCE REIT PLC	104,502.00	32,918.13	
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	367,037.00	767,107.33	
	NEWRIVER REIT PLC	46,021.00	36,954.86	
	PICTON PROPERTY INCOME LTD	153,900.00	118,041.30	
	PRIMARY HEALTH PROPERTIES	270,348.00	274,132.87	
	PRS REIT PLC/THE	89,207.00	86,619.99	
	REGIONAL REIT LTD	15,921.00	21,557.03	
	SAFESTORE HOLDINGS PLC	41,662.00	383,707.02	
	SCHRODER REAL ESTATE INVESTM	70,698.00	37,045.75	
	SEGRO PLC	239,847.00	2,169,176.26	
	SHAFTESBURY CAPITAL PLC	361,237.00	551,970.13	
	SUPERMARKET INCOME REIT PLC	187,422.00	145,626.89	
	TARGET HEALTHCARE REIT PLC	113,949.00	102,212.25	
	TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING	34,770.00	22,878.66	
	TRITAX BIG BOX REIT PLC	420,000.00	696,780.00	
	UNITE GROUP PLC/THE	80,812.00	795,190.08	
	URBAN LOGISTICS REIT PLC	76,400.00	94,888.80	
	WAREHOUSE REIT PLC	72,100.00	65,034.20	
	WORKSPACE GROUP PLC	20,210.00	131,365.00	
イギリス・ポンド小計		5,051,615.00	10,459,064.99 (1,943,712,638)	

イスラエル・シュケル	MENIVIM- THE NEW REIT LTD	110,000.00	187,330.00	
	REIT 1 LTD	36,017.00	508,560.04	
	SELLA CAPITAL REAL ESTATE LT	36,242.00	254,781.26	
	イスラエル・シュケル小計	182,259.00	950,671.30 (35,696,947)	
韓国・ウォン	D&D PLATFORM REIT CO LTD	6,350.00	23,622,000.00	
	ESR KENDALL SQUARE REIT CO L	24,000.00	123,360,000.00	
	JR REIT XXVII	36,632.00	131,875,200.00	
	KORAMCO LIFE INFRA REIT	6,226.00	29,480,110.00	
	KORAMCO LIFE INFRA RE-RIGHTS	618.00	205,794.00	
	LOTTE REIT CO LTD	20,121.00	77,264,640.00	
	NH ALL-ONE REIT CO LTD	12,561.00	46,601,310.00	
	SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	8,762.00	51,695,800.00	
	SHINHAN ALPHA REIT CO-RIGHTS	3,124.00	349,888.00	
	SK REITS CO LTD	27,115.00	143,438,350.00	
	韓国・ウォン小計	145,509.00	627,893,092.00 (66,996,193)	
ユーロ	AEDIFICA	9,212.00	592,331.60	
	ALTAREA	723.00	79,530.00	
	CARE PROPERTY INVEST	5,582.00	84,734.76	
	CARMILA	10,208.00	179,864.96	
	COFINIMMO	6,947.00	462,322.85	
	COVIVIO	8,887.00	487,451.95	
	CROMWELL REIT EUR	48,320.00	76,345.60	
	EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	7,912.00	200,964.80	
	GECINA SA	9,405.00	1,008,216.00	
	HAMBORNER REIT AG	12,897.00	84,862.26	
	ICADE	5,968.00	157,913.28	
	IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	7,889.00	20,669.18	
	INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	52,295.00	336,256.85	
	IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	62,588.00	56,642.14	
	KLEPIERRE	34,558.00	1,008,402.44	
	LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	12,639.00	103,639.80	
	MERCIALYS	15,342.00	189,166.86	
	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	71,325.00	842,348.25	
	MONTEA NV	3,238.00	255,154.40	
	NSI NV	2,966.00	61,989.40	
	RETAIL ESTATES	2,065.00	139,594.00	
	SHURGARD SELF STORAGE LTD	5,756.00	247,795.80	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	18,737.00	1,452,117.50	
	VASTNED RETAIL NV	2,919.00	69,910.05	
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	30,825.00	762,610.50	

		WERELDHAVE NV	6,708.00	100,217.52	
		XIOR STUDENT HOUSING NV	5,846.00	206,656.10	
	ユーロ小計		461,757.00	9,267,708.85 (1,450,859,819)	
投資証券合計				39,923,748,353 (39,923,748,353)	
合　計				39,923,748,353 (39,923,748,353)	

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

通　貨	銘柄数		組入 投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカ・ドル	投資証券	139 銘柄	75.0%	78.4%
カナダ・ドル	投資証券	26 銘柄	1.4%	1.4%
オーストラリア・ドル	投資証券	31 銘柄	6.9%	7.2%
香港・ドル	投資証券	6 銘柄	0.9%	0.9%
シンガポール・ドル	投資証券	22 銘柄	2.9%	3.0%
ニュージーランド・ドル	投資証券	4 銘柄	0.3%	0.3%
イギリス・ポンド	投資証券	35 銘柄	4.7%	4.9%
イスラエル・シュケル	投資証券	3 銘柄	0.1%	0.1%
韓国・ウォン	投資証券	10 銘柄	0.2%	0.2%
ユーロ	投資証券	27 銘柄	3.5%	3.6%

②デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

国内債券パッシブ・マザーファンド

（１）貸借対照表

（単位：円）

	(2024年9月17日現在)
資産の部	
流動資産	
金銭信託	4,585,240
コール・ローン	455,881,936
国債証券	107,491,698,990
地方債証券	11,575,813,850
特殊債券	10,141,610,704
社債券	7,733,533,100
未収入金	217,687,500
未収利息	404,056,654
前払費用	26,703,741
流動資産合計	138,051,571,715
資産合計	138,051,571,715
負債の部	

流動負債	
未払解約金	198,289,999
流動負債合計	198,289,999
負債合計	198,289,999
純資産の部	
元本等	
元本	114,582,435,445
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	23,270,846,271
元本等合計	137,853,281,716
純資産合計	137,853,281,716
負債純資産合計	138,051,571,715

（２）注記表

（重要な会計方針の注記）

項　目	自 2023年9月16日 至 2024年9月17日
１．　有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券は個別法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。 (1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。 (2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。 (3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。

（重要な会計上の見積りに関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

項　目	(2024年9月17日現在)
１．　当計算期間の末日における受益権の総数	114,582,435,445口
２．　１単位当たり純資産の額	１口当たり純資産額　1.2031円 （１万口当たりの純資産額12,031円）

（金融商品に関する注記）

Ⅰ．金融商品の状況に関する事項

項　目	自 2023年9月16日 至 2024年9月17日
1．　金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2．　金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	(1) 金融商品の内容 1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券を組み入れております。 2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。 3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 (2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。
3．　金融商品に係るリスク管理体制	リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する会議をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。 また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限値、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用部署に是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用部署は、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。なお、投資信託協会の流動性リスク管理規制に抵触する場合には、流動性リスクを管理する会議で審議の上、流動性リスクの管理責任者が対処方針を決定します。その後、決定した対処方針やその実施等について、リスク管理会議に報告を行う体制となっております。 なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する会議にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。

Ⅱ．金融商品の時価等に関する事項

項　目	(2024年9月17日現在)
１．　貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
２．　時価の算定方法	(1) 有価証券（国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。
３．　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。

(デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

自 2023年9月16日 至 2024年9月17日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。

(その他の注記)

(2024年9月17日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	105,659,583,769円
同期中における追加設定元本額	29,471,236,502円
同期中における一部解約元本額	20,548,384,826円
2024年9月17日現在の元本の内訳	
三井住友・ＤＣ年金バランス３０（債券重点型）	10,343,539,283円
三井住友・ＤＣ年金バランス５０（標準型）	16,888,922,140円
三井住友・ＤＣ年金バランス７０（株式重点型）	4,452,977,078円
ＳＭＡＭ・グローバルバランスファンド（機動的資産配分型）	884,408,392円
三井住友・ＤＣターゲットイヤーファンド２０２０（４資産タイプ）	43,596,669円
三井住友・ＤＣターゲットイヤーファンド２０２５（４資産タイプ）	168,936,664円
三井住友・ＤＣターゲットイヤーファンド２０３０（４資産タイプ）	631,790,723円
三井住友・ＤＣターゲットイヤーファンド２０３５（４資産タイプ）	1,290,389,853円
三井住友・ＤＣターゲットイヤーファンド２０４０（４資産タイプ）	737,500,143円

三井住友・ＤＣターゲットイヤーファンド２０４５（４資産タイプ）	882,263,784 円
三井住友・ＤＣ年金バランスゼロ（債券型）	135,923,163 円
アセットアロケーション・ファンド（安定型）	2,579,085,471 円
アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）	1,128,067,579 円
アセットアロケーション・ファンド（成長型）	432,894,496 円
三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０５０	185,583,392 円
三井住友・資産最適化ファンド（１安定重視型）	3,838,117,862 円
三井住友・資産最適化ファンド（２やや安定型）	1,152,749,545 円
三井住友・資産最適化ファンド（３バランス型）	2,399,387,825 円
三井住友・資産最適化ファンド（４やや成長型）	582,772,045 円
三井住友・資産最適化ファンド（５成長重視型）	90,370,739 円
三井住友・ＤＣつみたてＮＩＳＡ・世界分散ファンド	395,038,749 円
三井住友ＤＳ・年金バランス３０（債券重点型）	459,312,002 円
三井住友ＤＳ・年金バランス５０（標準型）	1,022,810,205 円
三井住友ＤＳ・年金バランス７０（株式重点型）	354,619,551 円
三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０６０	19,874,233 円
三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０３５	264,771,474 円
三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０４０	129,124,993 円
三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０４５	82,730,168 円
三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０５５	16,396,505 円
三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０６５	10,595,273 円
三井住友ＤＳ・ＦＷ専用ポートフォリオ・レベル１（保守型）	12,241,466 円
三井住友ＤＳ・ＦＷ専用ポートフォリオ・レベル２（安定型）	114,469,362 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）	301,057,687 円
三井住友ＤＳ・ＦＷ専用ポートフォリオ・レベル４（成長型）	150,851,209 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）	13,623,862 円
ＳＭＡＭ・年金グローバル債券ファンド＜適格機関投資家限定＞	997,067,571 円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ２５＜適格機関投資家専用＞	7,349,765,218 円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ３７．５＜適格機関投資家専用＞	5,880,259,722 円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ５０＜適格機関投資家専用＞	15,321,899,551 円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＬ３０＜適格機関投資家限定＞	299,682,684 円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＬ５０＜適格機関投資家限定＞	492,021,940 円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ７５＜適格機関投資家専用＞	284,234,196 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＞	122,911,810 円
ＳＭＡＭ・インデックス・バランスＶＡ２５＜適格機関投資家専用＞	1,771,183,954 円
ＳＭＡＭ・インデックス・バランスＶＡ５０＜適格機関投資家専用＞	2,237,429,887 円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ４０＜適格機関投資家専用＞	2,074,157,208 円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ３５＜適格機関投資家専用＞	7,253,535,759 円
三井住友・国内債券インデックスファンド・ＶＡＳ（適格機関投資家専用）	885,421,999 円
ＳＭＡＭ・グローバルバランス４０ＶＡ＜適格機関投資家限定＞	365,526,555 円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２０Ａ＜適格機関投資家専用＞	416,257,652 円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ３５Ａ＜適格機関投資家専用＞	140,691,746 円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ５０Ａ＜適格機関投資家専用＞	54,178,432 円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２０Ｌ＜適格機関投資家専用＞	1,053,377,150 円

ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２５Ｌ＜適格機関投資家専用＞	1,912,644,726円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２０Ａ２＜適格機関投資家専用＞	532,613,671円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ３５Ａ２＜適格機関投資家専用＞	228,840,970円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ５０Ａ２＜適格機関投資家専用＞	26,228,031円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ３０Ｌ２＜適格機関投資家専用＞	234,896,115円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２５Ｌ２＜適格機関投資家専用＞	4,481,901,742円
ＳＭＡＭ・年金Wリスクコントロールファンド＜適格機関投資家限定＞	1,372,264,667円
ＳＭＡＭ・マルチアセットストラテジーファンド２０１６－０４＜適格機関投資家限定＞	665,197,090円
ＳＭＡＭ・マルチアセットストラテジー・オープン＜適格機関投資家限定＞	1,061,464,793円
ＳＭＡＭ・マルチアセット・ダイナミックアロケーション・ストラテジー・ファンドⅡ＜適格機関投資家限定＞	4,256,860,308円
ＳＭＤＡＭ・年金Wリスクコントロールファンド（リスク３％）＜適格機関投資家限定＞	613,126,713円
合　計	114,582,435,445円

（３）附属明細表

①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	４５９　２年国債	1,960,000,000	1,955,648,800	
	４６０　２年国債	500,000,000	499,555,000	
	４６１　２年国債	2,000,000,000	2,001,340,000	
	４６２　２年国債	50,000,000	50,031,000	
	４６３　２年国債	350,000,000	350,161,000	
	１４８　５年国債	1,180,000,000	1,172,589,600	
	１４９　５年国債	1,090,000,000	1,082,075,700	
	１５０　５年国債	2,590,000,000	2,568,554,800	
	１５１　５年国債	100,000,000	99,070,000	
	１５２　５年国債	730,000,000	724,933,800	
	１５３　５年国債	800,000,000	791,712,000	
	１５４　５年国債	1,220,000,000	1,209,483,600	
	１５６　５年国債	1,180,000,000	1,172,601,400	
	１５７　５年国債	370,000,000	367,443,300	
	１５８　５年国債	880,000,000	870,883,200	
	１５９　５年国債	100,000,000	98,854,000	
	１６０　５年国債	690,000,000	684,638,700	
	１６１　５年国債	790,000,000	786,784,700	
	１６２　５年国債	220,000,000	218,915,400	
	１６３　５年国債	570,000,000	569,435,700	

	１６４　５年国債	240,000,000	237,592,800	
	１６５　５年国債	820,000,000	815,203,000	
	１６６　５年国債	440,000,000	439,260,800	
	１６７　５年国債	140,000,000	139,598,200	
	１６８　５年国債	710,000,000	714,224,500	
	１６９　５年国債	670,000,000	671,031,800	
	１７０　５年国債	610,000,000	613,257,400	
	１７１　５年国債	390,000,000	388,459,500	
	１　４０年国債	40,000,000	44,440,400	
	２　４０年国債	242,000,000	258,017,980	
	３　４０年国債	185,000,000	196,048,200	
	４　４０年国債	247,000,000	260,288,600	
	５　４０年国債	235,000,000	236,466,400	
	６　４０年国債	240,000,000	235,214,400	
	７　４０年国債	265,000,000	246,813,050	
	８　４０年国債	330,000,000	283,103,700	
	９　４０年国債	543,000,000	336,410,220	
	１０　４０年国債	500,000,000	363,055,000	
	１１　４０年国債	380,000,000	263,180,400	
	１２　４０年国債	410,000,000	249,772,000	
	１３　４０年国債	555,000,000	330,974,250	
	１４　４０年国債	535,000,000	339,227,450	
	１５　４０年国債	550,000,000	383,999,000	
	１６　４０年国債	550,000,000	420,106,500	
	１７　４０年国債	230,000,000	227,355,000	
	３４３　１０年国債	310,000,000	308,567,800	
	３４４　１０年国債	811,000,000	806,636,820	
	３４５　１０年国債	258,000,000	256,413,300	
	３４６　１０年国債	340,000,000	337,640,400	
	３４７　１０年国債	100,000,000	99,223,000	
	３４８　１０年国債	145,000,000	143,750,100	
	３４９　１０年国債	650,000,000	643,838,000	
	３５０　１０年国債	510,000,000	504,716,400	
	３５１　１０年国債	50,000,000	49,427,000	
	３５２　１０年国債	150,000,000	148,080,000	
	３５３　１０年国債	180,000,000	177,442,200	
	３５４　１０年国債	265,000,000	260,733,500	
	３５５　１０年国債	160,000,000	157,209,600	
	３５６　１０年国債	530,000,000	520,025,400	
	３５７　１０年国債	1,050,000,000	1,029,021,000	
	３５８　１０年国債	930,000,000	910,563,000	
	３５９　１０年国債	1,130,000,000	1,105,027,000	

３６０　１０年国債	850,000,000	830,169,500	
３６１　１０年国債	1,160,000,000	1,131,162,400	
３６２　１０年国債	1,180,000,000	1,148,470,400	
３６３　１０年国債	1,190,000,000	1,155,882,700	
３６４　１０年国債	1,120,000,000	1,085,268,800	
３６５　１０年国債	1,160,000,000	1,121,232,800	
３６６　１０年国債	1,180,000,000	1,146,523,400	
３６７　１０年国債	1,150,000,000	1,114,258,000	
３６８　１０年国債	1,110,000,000	1,072,393,200	
３６９　１０年国債	1,220,000,000	1,204,237,600	
３７０　１０年国債	1,220,000,000	1,201,382,800	
３７１　１０年国債	1,240,000,000	1,207,313,600	
３７２　１０年国債	1,050,000,000	1,055,313,000	
３７３　１０年国債	1,020,000,000	1,004,577,600	
３７４　１０年国債	1,000,000,000	1,000,000,000	
３７５　１０年国債	1,030,000,000	1,055,564,600	
２　３０年国債	440,000,000	485,047,200	
４　３０年国債	340,000,000	389,558,400	
５　３０年国債	290,000,000	321,708,600	
７　３０年国債	474,000,000	534,245,400	
９　３０年国債	240,000,000	254,200,800	
１０　３０年国債	95,000,000	98,246,150	
１１　３０年国債	430,000,000	466,042,600	
１２　３０年国債	570,000,000	637,328,400	
１４　３０年国債	392,000,000	449,365,280	
１６　３０年国債	205,000,000	237,064,050	
１８　３０年国債	190,000,000	216,142,100	
１９　３０年国債	170,000,000	193,522,900	
２１　３０年国債	345,000,000	392,754,900	
２２　３０年国債	315,000,000	365,431,500	
２３　３０年国債	349,000,000	405,122,690	
２４　３０年国債	460,000,000	533,954,200	
２５　３０年国債	260,000,000	295,929,400	
２６　３０年国債	253,000,000	290,742,540	
２７　３０年国債	250,000,000	290,150,000	
２８　３０年国債	96,000,000	111,406,080	
２９　３０年国債	157,000,000	179,912,580	
３０　３０年国債	142,000,000	160,697,140	
３１　３０年国債	235,000,000	262,048,500	
３２　３０年国債	360,000,000	405,658,800	
３３　３０年国債	208,000,000	225,053,920	
３４　３０年国債	87,000,000	96,393,390	

３５　３０年国債	260,000,000	279,697,600	
３６　３０年国債	90,000,000	96,571,800	
３７　３０年国債	225,000,000	237,422,250	
３８　３０年国債	220,000,000	227,744,000	
３９　３０年国債	220,000,000	230,850,400	
４０　３０年国債	260,000,000	267,966,400	
４１　３０年国債	240,000,000	243,172,800	
４２　３０年国債	280,000,000	283,108,000	
４３　３０年国債	295,000,000	297,416,050	
４４　３０年国債	310,000,000	312,095,600	
４５　３０年国債	315,000,000	305,735,850	
４６　３０年国債	315,000,000	304,957,800	
４７　３０年国債	370,000,000	363,765,500	
４８　３０年国債	400,000,000	378,204,000	
４９　３０年国債	395,000,000	372,425,750	
５０　３０年国債	395,000,000	328,920,450	
５１　３０年国債	355,000,000	262,323,700	
５２　３０年国債	223,000,000	172,017,740	
５３　３０年国債	297,000,000	233,504,370	
５４　３０年国債	175,000,000	143,412,500	
５５　３０年国債	285,000,000	232,611,300	
５６　３０年国債	410,000,000	333,264,400	
５７　３０年国債	425,000,000	344,046,000	
５８　３０年国債	430,000,000	346,674,600	
５９　３０年国債	420,000,000	329,158,200	
６０　３０年国債	280,000,000	229,300,400	
６１　３０年国債	295,000,000	228,999,650	
６２　３０年国債	275,000,000	201,536,500	
６３　３０年国債	230,000,000	163,127,500	
６４　３０年国債	315,000,000	222,100,200	
６５　３０年国債	295,000,000	206,945,450	
６６　３０年国債	360,000,000	251,064,000	
６７　３０年国債	410,000,000	300,919,500	
６８　３０年国債	340,000,000	248,370,000	
６９　３０年国債	460,000,000	343,735,000	
７０　３０年国債	370,000,000	275,243,000	
７１　３０年国債	390,000,000	288,802,800	
７２　３０年国債	400,000,000	294,856,000	
７３　３０年国債	410,000,000	300,853,900	
７４　３０年国債	380,000,000	301,864,400	
７５　３０年国債	330,000,000	282,470,100	
７６　３０年国債	390,000,000	341,554,200	

７７　３０年国債	360,000,000	330,127,200	
７８　３０年国債	390,000,000	339,807,000	
７９　３０年国債	390,000,000	322,159,500	
８０　３０年国債	360,000,000	343,940,400	
８１　３０年国債	340,000,000	309,471,400	
８２　３０年国債	380,000,000	362,200,800	
８３　３０年国債	280,000,000	291,533,200	
８８　２０年国債	742,000,000	767,079,600	
８９　２０年国債	20,000,000	20,641,200	
９０　２０年国債	580,000,000	601,187,400	
９２　２０年国債	324,000,000	336,532,320	
９３　２０年国債	632,000,000	657,444,320	
９５　２０年国債	305,000,000	321,000,300	
９７　２０年国債	327,000,000	344,684,160	
９９　２０年国債	153,000,000	161,433,360	
１００　２０年国債	207,000,000	219,941,640	
１０１　２０年国債	355,000,000	379,644,100	
１０２　２０年国債	457,000,000	490,886,550	
１０５　２０年国債	370,000,000	394,638,300	
１０６　２０年国債	370,000,000	396,096,100	
１０７　２０年国債	378,000,000	404,460,000	
１０９　２０年国債	40,000,000	42,549,200	
１１１　２０年国債	386,000,000	417,045,980	
１１３　２０年国債	27,000,000	29,159,190	
１１４　２０年国債	163,000,000	176,623,540	
１１８　２０年国債	200,000,000	217,140,000	
１１９　２０年国債	295,000,000	316,889,000	
１２０　２０年国債	200,000,000	212,600,000	
１２１　２０年国債	55,000,000	59,558,400	
１２２　２０年国債	130,000,000	140,016,500	
１２３　２０年国債	70,000,000	76,862,800	
１２５　２０年国債	205,000,000	227,014,950	
１２６　２０年国債	180,000,000	197,001,000	
１２７　２０年国債	145,000,000	157,781,750	
１２８　２０年国債	65,000,000	70,898,100	
１３０　２０年国債	155,000,000	168,295,900	
１３１　２０年国債	80,000,000	86,321,600	
１３２　２０年国債	450,000,000	486,099,000	
１３３　２０年国債	190,000,000	206,568,000	
１３４　２０年国債	200,000,000	217,774,000	
１３５　２０年国債	155,000,000	167,658,850	
１３６　２０年国債	120,000,000	128,890,800	

１３７　２０年国債	185,000,000	200,223,650	
１３９　２０年国債	60,000,000	64,468,800	
１４０　２０年国債	420,000,000	454,939,800	
１４１　２０年国債	360,000,000	389,919,600	
１４２　２０年国債	240,000,000	261,928,800	
１４３　２０年国債	150,000,000	161,349,000	
１４４　２０年国債	170,000,000	181,420,600	
１４５　２０年国債	110,000,000	119,220,200	
１４６　２０年国債	195,000,000	211,249,350	
１４７　２０年国債	840,000,000	902,176,800	
１４８　２０年国債	459,000,000	488,449,440	
１４９　２０年国債	625,000,000	663,981,250	
１５０　２０年国債	691,000,000	726,379,200	
１５１　２０年国債	680,000,000	700,461,200	
１５２　２０年国債	640,000,000	657,785,600	
１５３　２０年国債	587,000,000	608,231,790	
１５４　２０年国債	600,000,000	614,328,000	
１５５　２０年国債	450,000,000	450,225,000	
１５６　２０年国債	400,000,000	373,124,000	
１５７　２０年国債	445,000,000	403,526,000	
１５８　２０年国債	430,000,000	402,424,100	
１５９　２０年国債	508,000,000	479,272,600	
１６０　２０年国債	445,000,000	423,341,850	
１６１　２０年国債	480,000,000	449,136,000	
１６２　２０年国債	620,000,000	577,821,400	
１６３　２０年国債	620,000,000	575,484,000	
１６４　２０年国債	535,000,000	487,802,300	
１６５　２０年国債	600,000,000	544,314,000	
１６６　２０年国債	545,000,000	505,956,200	
１６７　２０年国債	530,000,000	476,141,400	
１６８　２０年国債	520,000,000	458,146,000	
１６９　２０年国債	570,000,000	491,824,500	
１７０　２０年国債	1,015,000,000	870,606,100	
１７１　２０年国債	505,000,000	430,835,700	
１７２　２０年国債	500,000,000	431,365,000	
１７３　２０年国債	515,000,000	441,967,850	
１７４　２０年国債	690,000,000	588,990,900	
１７５　２０年国債	705,000,000	608,887,350	
１７６　２０年国債	750,000,000	644,400,000	
１７７　２０年国債	740,000,000	621,851,600	
１７８　２０年国債	630,000,000	536,281,200	
１７９　２０年国債	550,000,000	465,987,500	

	１８０　２０年国債	540,000,000	480,276,000	
	１８１　２０年国債	590,000,000	531,790,600	
	１８２　２０年国債	660,000,000	613,437,000	
	１８３　２０年国債	590,000,000	574,542,000	
	１８４　２０年国債	570,000,000	526,303,800	
	１８５　２０年国債	600,000,000	551,946,000	
	１８６　２０年国債	480,000,000	471,283,200	
	１８７　２０年国債	450,000,000	426,051,000	
	１８８　２０年国債	450,000,000	447,336,000	
	１８９　２０年国債	440,000,000	458,436,000	
	国債証券　小計		107,491,698,990	
地方債証券	７５５　東京都公債	400,000,000	397,738,800	
	１　東京都３０年	100,000,000	111,849,100	
	８　東京都３０年	400,000,000	443,640,400	
	１３　東京都３０年	500,000,000	523,275,000	
	６　東京都２０年	100,000,000	100,871,200	
	２６－１５　北海道公債	100,000,000	100,078,500	
	３０－８　北海道公債	200,000,000	197,862,800	
	３０－１８　北海道公債	200,000,000	196,397,000	
	２２６　神奈川県公債	200,000,000	198,659,800	
	３　神奈川県２０年	100,000,000	101,368,600	
	７　神奈川県２０年	100,000,000	104,357,400	
	１３　神奈川県２０年	100,000,000	108,448,900	
	８９　神奈川県５年	200,000,000	198,190,800	
	３９２　大阪府公債	100,000,000	100,038,800	
	１　大阪府２０年	200,000,000	215,914,400	
	１７３　大阪府５年	300,000,000	299,196,900	
	１７９　大阪府５年	100,000,000	99,435,600	
	１９３　大阪府５年	300,000,000	296,494,800	
	２７－４　京都府公債	100,000,000	100,195,300	
	２９－４　京都府公債	100,000,000	99,231,900	
	４　兵庫県公債１５年	100,000,000	102,677,500	
	５　兵庫県公債１５年	300,000,000	308,854,500	
	１０兵庫県公債２０年	100,000,000	108,863,400	
	２７－８　静岡県公債	100,000,000	100,139,200	
	７　静岡県３０年	100,000,000	104,855,700	
	１　静岡県２０年	100,000,000	101,840,700	
	２２－８　愛知県２０年	200,000,000	215,363,000	
	２７－１６　愛知県公債	400,000,000	400,278,000	
	２７－７　埼玉県公債	300,000,000	300,269,400	
	２　埼玉県公債	300,000,000	297,792,900	
	５　埼玉県２０年	100,000,000	106,447,700	

	２６－１０　福岡県公債	100,000,000	100,088,200	
	１－１　福岡県公債	200,000,000	194,950,600	
	１－３　福岡県３０年	100,000,000	69,572,000	
	２７－３　千葉県公債	100,000,000	100,175,800	
	２７－４　千葉県公債	100,000,000	100,245,500	
	２８－１　千葉県公債	100,000,000	99,398,300	
	１－９　千葉県公債	200,000,000	194,301,200	
	９　千葉県２０年	200,000,000	214,904,600	
	１４８　共同発行地方	350,000,000	350,722,750	
	１５５　共同発行地方	100,000,000	99,703,500	
	１７０　共同発行地方	400,000,000	396,924,000	
	１７２　共同発行地方	500,000,000	496,517,000	
	１７９　共同発行地方	100,000,000	99,157,300	
	１８３　共同発行地方	600,000,000	593,407,200	
	１８４　共同発行地方	300,000,000	296,181,900	
	１９９　共同発行地方	100,000,000	97,367,700	
	４９４　名古屋市債	200,000,000	200,160,000	
	３３　名古屋市５年	300,000,000	300,231,600	
	３　名古屋市２０年	100,000,000	101,309,000	
	５　名古屋市２０年	100,000,000	103,672,300	
	１　京都市３０年	100,000,000	115,450,900	
	７　京都市２０年	100,000,000	107,363,200	
	２６－１７　神戸市公債	100,000,000	100,009,700	
	４　横浜市２０年	100,000,000	100,881,200	
	７　横浜市２０年	100,000,000	102,082,800	
	９　横浜市２０年	100,000,000	103,326,400	
	１４　横浜市２０年	100,000,000	106,337,200	
	２７－５　札幌市公債	100,000,000	100,129,200	
	２－７　札幌市公債	100,000,000	97,057,300	
	９４　川崎市公債	100,000,000	96,354,700	
	２０２０－９　福岡市５年	100,000,000	99,505,400	
	１－２　岡山県公債	100,000,000	97,697,400	
	地方債証券　小計		11,575,813,850	
特殊債券	４７日本政策投資ＣＯ	100,000,000	101,848,300	
	１２４　日本政策投資	100,000,000	97,241,200	
	３６　日本政策投資Ｂ	100,000,000	104,491,700	
	１８　道路機構	100,000,000	116,264,300	
	２２　道路機構	300,000,000	337,638,600	
	２７　道路機構	100,000,000	105,455,400	
	３７　道路機構	300,000,000	320,492,100	
	４７　道路機構	200,000,000	215,983,800	
	１３５　道路機構	200,000,000	202,732,000	

	７４　政保道路機構	100,000,000	105,955,200	
	７９　政保道路機構	200,000,000	214,173,000	
	８１　政保道路機構	200,000,000	214,432,800	
	８８　政保道路機構	100,000,000	111,858,600	
	９０　政保道路機構	500,000,000	538,355,500	
	９９　政保道路機構	100,000,000	108,689,700	
	１２７　政保道路機構	200,000,000	217,693,800	
	１７６　政保道路機構	100,000,000	107,198,900	
	１９６　政保道路機構	100,000,000	108,319,300	
	２１０　政保道路機構	200,000,000	212,193,400	
	２８８　政保道路機構	189,000,000	187,367,796	
	９　道路債券	100,000,000	115,718,400	
	２　地方公営２０年	100,000,000	107,525,300	
	４　地方公共団２０年	100,000,000	107,635,100	
	１８　地方公共団２０	300,000,000	321,744,600	
	Ｆ９６　地方公共団体	100,000,000	102,384,700	
	Ｆ１４３地方公共団体	100,000,000	102,353,500	
	７６政保地方公共団	300,000,000	300,356,700	
	８５　地方公共団体	100,000,000	99,239,900	
	１０１　地方公共団体	100,000,000	99,036,100	
	１０６　地方公共団体	200,000,000	197,600,400	
	２９　地方公共団５年	300,000,000	297,168,600	
	１５　公営企業２０年	100,000,000	101,761,300	
	１７　公営企業２０年	100,000,000	102,841,600	
	２０　公営企業２０年	100,000,000	104,279,300	
	２２　公営企業２０年	100,000,000	104,850,100	
	２４　公営企業２０年	200,000,000	212,301,400	
	１０　日本政策金融	100,000,000	108,143,600	
	８９　都市再生	100,000,000	102,059,400	
	９３　都市再生	100,000,000	102,123,000	
	１１７　都市再生	100,000,000	100,758,700	
	３３　政保中部空港	200,000,000	198,555,400	
	２３９　政保預金保険	600,000,000	598,933,800	
	５２　住宅支援機構	100,000,000	107,672,200	
	９３　住宅支援機構	100,000,000	102,283,300	
	１２４　住宅支援機構	100,000,000	102,796,600	
	１３０　住宅支援機構	200,000,000	214,536,200	
	２２６　住宅支援機構	100,000,000	98,966,700	
	Ｓ１１　住宅機構ＲＭＢＳ	9,994,000	10,001,995	
	１９　住宅機構ＲＭＢＳ	12,247,000	12,565,422	
	２４　住宅機構ＲＭＢＳ	24,418,000	25,043,100	
	２６　住宅機構ＲＭＢＳ	38,139,000	39,184,008	

	２７　住宅機構ＲＭＢＳ	13,724,000	14,145,326	
	２８　住宅機構ＲＭＢＳ	16,038,000	16,685,935	
	２９　住宅機構ＲＭＢＳ	17,319,000	18,048,129	
	３０　住宅機構ＲＭＢＳ	16,888,000	17,595,607	
	３２　住宅機構ＲＭＢＳ	33,390,000	34,565,328	
	３５　住宅機構ＲＭＢＳ	17,074,000	17,736,471	
	３６　住宅機構ＲＭＢＳ	16,102,000	16,659,129	
	４３　住宅機構ＲＭＢＳ	20,972,000	21,641,006	
	４６　住宅機構ＲＭＢＳ	16,227,000	16,780,340	
	４８　住宅機構ＲＭＢＳ	30,780,000	31,786,506	
	４９　住宅機構ＲＭＢＳ	15,755,000	16,232,376	
	５１　住宅機構ＲＭＢＳ	34,412,000	35,440,918	
	５５　住宅機構ＲＭＢＳ	46,052,000	47,175,668	
	５７　住宅機構ＲＭＢＳ	22,041,000	22,609,657	
	５８　住宅機構ＲＭＢＳ	24,597,000	25,209,465	
	５９　住宅機構ＲＭＢＳ	46,784,000	48,028,454	
	６０　住宅機構ＲＭＢＳ	70,830,000	72,409,509	
	６１　住宅機構ＲＭＢＳ	23,971,000	24,421,654	
	６７　住宅機構ＲＭＢＳ	30,814,000	31,038,942	
	６９　住宅機構ＲＭＢＳ	64,550,000	65,621,530	
	７０　住宅機構ＲＭＢＳ	55,884,000	56,884,323	
	７３　住宅機構ＲＭＢＳ	31,674,000	32,253,634	
	９９　住宅機構ＲＭＢＳ	50,295,000	49,646,194	
	１２３　住宅機構ＲＭＢＳ	67,494,000	64,146,297	
	１２４　住宅機構ＲＭＢＳ	66,891,000	63,379,222	
	１２５　住宅機構ＲＭＢＳ	66,799,000	63,298,732	
	１２７　住宅機構ＲＭＢＳ	69,078,000	65,223,447	
	１２８　住宅機構ＲＭＢＳ	67,542,000	63,935,257	
	１２９　住宅機構ＲＭＢＳ	69,469,000	65,842,718	
	１３７　住宅機構ＲＭＢＳ	71,576,000	67,660,792	
	１６７　住宅機構ＲＭＢＳ	83,537,000	77,823,069	
	１８３　住宅機構ＲＭＢＳ	179,846,000	169,936,485	
	１８６　住宅機構ＲＭＢＳ	91,710,000	88,215,849	
	１９８　住宅機構ＲＭＢＳ	191,656,000	191,981,814	
	８５　中日本高速道	300,000,000	298,745,100	
	特殊債券　小計		10,141,610,704	
社債券	８６　東日本高速道	200,000,000	197,717,800	
	１１４　東日本高速道	100,000,000	100,389,900	
	１０７　中日本高速道	200,000,000	200,676,400	
	８４　西日本高速道	200,000,000	198,877,200	
	８７　西日本高速道	200,000,000	200,417,400	
	１３　大和ハウス	100,000,000	98,982,700	

	１７　アサヒグループＨＤ	200,000,000	198,023,400	
	３０　東レ	100,000,000	99,112,600	
	１２　旭化成	200,000,000	194,174,000	
	２４三菱ケミカルホールデイ	100,000,000	98,818,000	
	２１富士フイルムホールデイ	100,000,000	100,107,000	
	３２　住友電工	100,000,000	98,440,800	
	１６　小松製作所	100,000,000	98,512,200	
	２２　日立製作所	100,000,000	100,071,000	
	９　ＴＤＫ	100,000,000	97,520,800	
	６３　三井物産	100,000,000	104,390,400	
	８　みずほコーポレート	100,000,000	105,340,600	
	８　住友信託　劣後	100,000,000	104,071,000	
	９　みずほ銀行劣後	100,000,000	104,229,300	
	１７　ＮＴＴフアイナンス	200,000,000	197,393,800	
	１８　ＮＴＴフアイナンス	200,000,000	194,204,800	
	７３　ホンダファイナンス	200,000,000	197,637,400	
	１０１　トヨタファイナンス	200,000,000	199,148,800	
	２０７　オリツクス	200,000,000	198,185,600	
	２　三菱ＨＣキヤピタル	200,000,000	197,660,200	
	５８　三菱地所	100,000,000	113,817,400	
	１３５　三菱地所	200,000,000	191,105,200	
	１０　東急	100,000,000	94,854,300	
	３８　京王電鉄	100,000,000	98,837,500	
	１１０東日本旅客鉄	100,000,000	95,219,900	
	１６９　東日本旅客鉄	200,000,000	191,187,400	
	２６　西日本旅客鉄	100,000,000	108,035,600	
	６０　西日本旅客鉄	200,000,000	194,305,200	
	４１　東海旅客鉄道	100,000,000	106,090,900	
	４２　東海旅客鉄道	100,000,000	106,974,100	
	４５　東京地下鉄	200,000,000	193,487,000	
	６４　阪急阪神ＨＬＤＧ	100,000,000	98,848,000	
	１５　九州旅客鉄道	200,000,000	198,443,600	
	３１　ＫＤＤＩ	200,000,000	198,410,800	
	５４６　中部電力	200,000,000	191,442,400	
	５５３　中部電力	200,000,000	198,339,600	
	５５０　関西電力	300,000,000	297,933,600	
	５６０　関西電力	200,000,000	201,724,200	
	５０８　東北電力	200,000,000	197,121,800	
	５４７　東北電力	100,000,000	98,630,700	
	４９６　九州電力	300,000,000	285,753,600	
	５６　東京電力ＰＧ	200,000,000	200,540,800	
	６６　東京電力ＰＧ	100,000,000	97,530,500	

	４１　大阪瓦斯	200,000,000	191,893,600	
	７　フアーストリテイリング	100,000,000	98,902,300	
	社債券　小計		7,733,533,100	
合　計			136,942,656,644	

②デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

外国債券パッシブ・マザーファンド

（１）貸借対照表

（単位：円）

	（2024年9月17日現在）
資産の部	
流動資産	
預金	246,807,464
金銭信託	11,830,239
コール・ローン	1,176,207,159
国債証券	176,657,238,753
未収利息	1,324,496,618
前払費用	108,052,760
流動資産合計	179,524,632,993
資産合計	179,524,632,993
負債の部	
流動負債	
未払解約金	79,722,933
流動負債合計	79,722,933
負債合計	79,722,933
純資産の部	
元本等	
元本	80,572,354,466
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	98,872,555,594
元本等合計	179,444,910,060
純資産合計	179,444,910,060
負債純資産合計	179,524,632,993

（２）注記表

（重要な会計方針の注記）

項　目	自 2023年9月16日 至 2024年9月17日
１．　有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券は個別法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。 (1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券

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

（重要な会計上の見積りに関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

項　目	（2024 年 9 月 17 日現在）
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	80,572,354,466 口
2. １単位当たり純資産の額	１口当たり純資産額　2.2271 円 （１万口当たりの純資産額 22,271 円）

（金融商品に関する注記）

Ⅰ．金融商品の状況に関する事項

項　目	自 2023 年 9 月 16 日 至 2024 年 9 月 17 日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第 2 条第 4 項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	(1) 金融商品の内容 1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、国債証券を組み入れております。 2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。 当計算期間については、為替予約取引を行っております。

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

Ⅱ．金融商品の時価等に関する事項

項　目	(2024年9月17日現在)
1．　貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2．　時価の算定方法	(1) 有価証券（国債証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。
3．　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ

	取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。

(デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

自 2023年9月16日 至 2024年9月17日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。

(その他の注記)

(2024年9月17日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	79,403,960,652円
同期中における追加設定元本額	13,863,647,209円
同期中における一部解約元本額	12,695,253,395円
2024年9月17日現在の元本の内訳	
三井住友・ＤＣ外国債券インデックスファンドＳ	28,332,788,368円
三井住友・ＤＣ年金バランス３０（債券重点型）	1,002,073,370円
三井住友・ＤＣ年金バランス５０（標準型）	2,523,871,866円
三井住友・ＤＣ年金バランス７０（株式重点型）	1,532,824,942円
ＳＭＡＭ・グローバルバランスファンド（機動的資産配分型）	118,967,029円
三井住友・ＤＣターゲットイヤーファンド２０２０（４資産タイプ）	5,567,516円
三井住友・ＤＣターゲットイヤーファンド２０２５（４資産タイプ）	21,970,186円
三井住友・ＤＣターゲットイヤーファンド２０３０（４資産タイプ）	80,585,426円
三井住友・ＤＣターゲットイヤーファンド２０３５（４資産タイプ）	252,816,462円
三井住友・ＤＣターゲットイヤーファンド２０４０（４資産タイプ）	211,076,276円
三井住友・ＤＣターゲットイヤーファンド２０４５（４資産タイプ）	353,704,343円
三井住友・ＤＣ年金バランスゼロ（債券型）	19,521,498円
アセットアロケーション・ファンド（安定型）	38,612,613円
アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）	64,743,524円
アセットアロケーション・ファンド（成長型）	40,503,731円
三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０５０	52,122,910円
三井住友・資産最適化ファンド（１安定重視型）	394,400,984円
三井住友・資産最適化ファンド（２やや安定型）	272,850,257円
三井住友・資産最適化ファンド（３バランス型）	800,274,081円
三井住友・資産最適化ファンド（４やや成長型）	261,559,099円
三井住友・資産最適化ファンド（５成長重視型）	143,088,978円
三井住友・ＤＣつみたてＮＩＳＡ・世界分散ファンド	277,027,246円
三井住友ＤＳ・外国債券インデックス年金ファンド	1,357,837,734円
三井住友ＤＳ・年金バランス３０（債券重点型）	44,539,158円

三井住友ＤＳ・年金バランス５０（標準型）	151,428,714 円
三井住友ＤＳ・年金バランス７０（株式重点型）	121,439,101 円
三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０６０	7,187,541 円
日興ＦＷＳ・先進国債インデックス（為替ヘッジなし）	4,463,559,766 円
三井住友ＤＳ・先進国債インデックス・ファンド	329,834,076 円
三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０３５	14,950,436 円
三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０４０	9,480,528 円
三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０４５	10,584,382 円
三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０５５	6,029,387 円
三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０６５	3,874,367 円
三井住友ＤＳ・ＦＷ専用ポートフォリオ・レベル１（保守型）	1,120,762 円
三井住友ＤＳ・ＦＷ専用ポートフォリオ・レベル２（安定型）	3,819,119 円
三井住友ＤＳ・ＦＷ専用ポートフォリオ・レベル３（安定成長型）	18,685,645 円
三井住友ＤＳ・ＦＷ専用ポートフォリオ・レベル４（成長型）	18,586,871 円
三井住友ＤＳ・ＦＷ専用ポートフォリオ・レベル５（積極成長型）	7,167,837 円
ＳＭＡＭ・年金外国債券パッシブ・ファンド＜適格機関投資家限定＞	5,458,669,632 円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ安定成長型＜適格機関投資家限定＞	18,176,913 円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ２５＜適格機関投資家専用＞	3,451,385,598 円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ３７．５＜適格機関投資家専用＞	3,386,540,500 円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ５０＜適格機関投資家専用＞	8,181,059,523 円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＬ３０＜適格機関投資家限定＞	25,374,037 円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＬ５０＜適格機関投資家限定＞	64,513,915 円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ７５＜適格機関投資家専用＞	652,639,659 円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＬ国際分散型＜適格機関投資家限定＞	94,448,421 円
ＳＭＡＭ・インデックス・バランスＶＡ２５＜適格機関投資家専用＞	787,304,796 円
ＳＭＡＭ・インデックス・バランスＶＡ５０＜適格機関投資家専用＞	1,169,912,566 円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ４０＜適格機関投資家専用＞	1,107,177,726 円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ３５＜適格機関投資家専用＞	3,286,663,120 円
ＳＭＡＭ・外国債券パッシブファンドＶＡ＜適格機関投資家限定＞	5,703,664,886 円
三井住友・外国債券インデックスファンド・ＶＡＳ（適格機関投資家専用）	267,494,495 円
ＳＭＡＭ・グローバルバランス４０ＶＡ＜適格機関投資家限定＞	95,826,153 円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２０Ａ＜適格機関投資家専用＞	50,442,563 円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ３５Ａ＜適格機関投資家専用＞	22,317,166 円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ５０Ａ＜適格機関投資家専用＞	11,781,731 円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２０Ｌ＜適格機関投資家専用＞	56,501,585 円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２５Ｌ＜適格機関投資家専用＞	304,304,665 円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２０Ａ２＜適格機関投資家専用＞	60,667,510 円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ３５Ａ２＜適格機関投資家専用＞	35,582,152 円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ５０Ａ２＜適格機関投資家専用＞	5,723,530 円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２５Ｌ２＜適格機関投資家専用＞	692,755,925 円
ＳＭＡＭ・グローバルバランスファンド（標準型）ＶＡ＜適格機関投資家限定＞	445,487,788 円
ＳＭＡＭ・グローバルバランスファンド（債券重視型）ＶＡ＜適格機関投資家限定＞	580,475,822 円
ＳＭＡＭ・世界バランスファンドＶＡ＜適格機関投資家限定＞	219,399,292 円
ＳＭＡＭ・世界バランスファンドＶＡ２＜適格機関投資家限定＞	195,107,235 円

ＳＭＡＭ・年金Ｗリスクコントロールファンド＜適格機関投資家限定＞	149,601,796円
ＳＭＡＭ・マルチアセットストラテジーファンド２０１６－０４＜適格機関投資家限定＞	90,241,775円
ＳＭＡＭ・マルチアセットストラテジー・オープン＜適格機関投資家限定＞	143,958,855円
ＳＭＡＭ・マルチアセット・ダイナミックアロケーション・ストラテジー・ファンドⅡ＜適格機関投資家限定＞	149,555,150円
ＳＭＤＡＭ・年金Ｗリスクコントロールファンド（リスク３％）＜適格機関投資家限定＞	236,521,857円
合　計	80,572,354,466円

（３）附属明細表

①有価証券明細表

(a)株式

該当事項はありません。

(b)株式以外の有価証券

種　類	通　貨	銘　柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカ・ドル	T 0.25 09/30/25	2,000,000.00	1,925,500.00	
		T 0.25 10/31/25	1,000,000.00	960,390.00	
		T 0.375 01/31/26	2,500,000.00	2,387,775.00	
		T 0.375 07/31/27	900,000.00	825,165.00	
		T 0.375 09/30/27	1,000,000.00	912,650.00	
		T 0.375 11/30/25	2,000,000.00	1,919,020.00	
		T 0.375 12/31/25	3,000,000.00	2,872,500.00	
		T 0.5 04/30/27	1,200,000.00	1,111,776.00	
		T 0.5 05/31/27	2,500,000.00	2,310,775.00	
		T 0.5 06/30/27	2,600,000.00	2,397,876.00	
		T 0.5 10/31/27	1,000,000.00	913,670.00	
		T 0.625 03/31/27	2,400,000.00	2,235,456.00	
		T 0.625 05/15/30	5,000,000.00	4,278,300.00	
		T 0.625 07/31/26	800,000.00	757,560.00	
		T 0.625 08/15/30	4,800,000.00	4,076,880.00	
		T 0.625 11/30/27	3,400,000.00	3,113,108.00	
		T 0.625 12/31/27	5,600,000.00	5,116,104.00	
		T 0.75 01/31/28	5,900,000.00	5,400,801.00	
		T 0.75 04/30/26	1,500,000.00	1,431,900.00	
		T 0.75 05/31/26	2,000,000.00	1,905,380.00	
		T 0.75 08/31/26	1,500,000.00	1,421,160.00	
		T 0.875 06/30/26	2,000,000.00	1,906,360.00	
		T 0.875 09/30/26	2,500,000.00	2,370,650.00	
		T 0.875 11/15/30	4,900,000.00	4,201,897.00	
		T 1 07/31/28	2,900,000.00	2,646,743.00	
		T 1.125 02/15/31	5,700,000.00	4,943,838.00	

		T 1.125 02/28/27	2,000,000.00	1,890,220.00	
		T 1.125 05/15/40	1,650,000.00	1,118,188.50	
		T 1.125 08/15/40	3,100,000.00	2,082,301.00	
		T 1.125 08/31/28	3,500,000.00	3,204,740.00	
		T 1.125 10/31/26	3,700,000.00	3,519,181.00	
		T 1.25 05/15/50	3,100,000.00	1,728,467.00	
		T 1.25 05/31/28	3,000,000.00	2,774,460.00	
		T 1.25 06/30/28	3,000,000.00	2,769,990.00	
		T 1.25 08/15/31	5,200,000.00	4,483,752.00	
		T 1.25 09/30/28	3,000,000.00	2,755,170.00	
		T 1.25 11/30/26	4,200,000.00	4,000,332.00	
		T 1.25 12/31/26	2,600,000.00	2,473,380.00	
		T 1.375 08/15/50	4,500,000.00	2,582,190.00	
		T 1.375 08/31/26	600,000.00	575,526.00	
		T 1.375 10/31/28	3,000,000.00	2,765,010.00	
		T 1.375 11/15/31	4,900,000.00	4,239,137.00	
		T 1.375 11/15/40	3,500,000.00	2,433,025.00	
		T 1.375 12/31/28	1,000,000.00	919,120.00	
		T 1.5 01/31/27	3,400,000.00	3,247,238.00	
		T 1.5 02/15/30	2,100,000.00	1,899,513.00	
		T 1.5 11/30/28	4,500,000.00	4,162,905.00	
		T 1.625 02/15/26	2,900,000.00	2,816,277.00	
		T 1.625 05/15/26	11,450,000.00	11,078,905.50	
		T 1.625 05/15/31	5,500,000.00	4,892,415.00	
		T 1.625 08/15/29	3,750,000.00	3,450,712.50	
		T 1.625 09/30/26	900,000.00	866,421.00	
		T 1.625 11/15/50	3,200,000.00	1,957,408.00	
		T 1.625 11/30/26	200,000.00	192,014.00	
		T 1.75 01/31/29	3,300,000.00	3,076,656.00	
		T 1.75 08/15/41	3,400,000.00	2,469,046.00	
		T 1.75 11/15/29	1,300,000.00	1,198,028.00	
		T 1.75 12/31/26	2,500,000.00	2,405,025.00	
		T 1.875 02/15/32	5,300,000.00	4,729,932.00	
		T 1.875 02/15/41	3,300,000.00	2,479,125.00	
		T 1.875 02/15/51	3,800,000.00	2,473,838.00	
		T 1.875 02/28/27	3,400,000.00	3,273,146.00	
		T 1.875 02/28/29	2,800,000.00	2,621,864.00	
		T 1.875 07/31/26	2,500,000.00	2,422,925.00	
		T 1.875 11/15/51	3,300,000.00	2,136,849.00	
		T 2 02/15/50	2,800,000.00	1,890,980.00	
		T 2 08/15/51	2,900,000.00	1,940,042.00	
		T 2 11/15/26	1,000,000.00	968,350.00	

		T 2 11/15/41	2,800,000.00	2,110,220.00	
		T 2.25 02/15/27	4,400,000.00	4,274,688.00	
		T 2.25 02/15/52	1,700,000.00	1,204,773.00	
		T 2.25 03/31/26	8,200,000.00	8,025,094.00	
		T 2.25 05/15/41	3,000,000.00	2,379,840.00	
		T 2.25 08/15/27	2,200,000.00	2,127,554.00	
		T 2.25 08/15/46	1,950,000.00	1,441,245.00	
		T 2.25 08/15/49	1,500,000.00	1,075,605.00	
		T 2.25 11/15/25	4,000,000.00	3,926,840.00	
		T 2.25 11/15/27	4,400,000.00	4,244,108.00	
		T 2.375 02/15/42	2,800,000.00	2,232,104.00	
		T 2.375 03/31/29	5,000,000.00	4,779,250.00	
		T 2.375 05/15/27	3,000,000.00	2,917,020.00	
		T 2.375 05/15/29	2,400,000.00	2,291,568.00	
		T 2.375 05/15/51	3,900,000.00	2,851,251.00	
		T 2.375 11/15/49	1,900,000.00	1,397,336.00	
		T 2.5 02/15/45	1,400,000.00	1,100,148.00	
		T 2.5 02/15/46	1,000,000.00	778,820.00	
		T 2.5 02/28/26	2,100,000.00	2,063,733.00	
		T 2.5 03/31/27	3,000,000.00	2,931,300.00	
		T 2.5 05/15/46	1,000,000.00	776,910.00	
		T 2.625 01/31/26	2,200,000.00	2,167,330.00	
		T 2.625 02/15/29	1,800,000.00	1,741,320.00	
		T 2.625 05/31/27	4,800,000.00	4,697,616.00	
		T 2.625 07/31/29	1,100,000.00	1,060,246.00	
		T 2.625 12/31/25	1,400,000.00	1,379,434.00	
		T 2.75 02/15/28	5,300,000.00	5,182,976.00	
		T 2.75 04/30/27	1,600,000.00	1,571,744.00	
		T 2.75 05/31/29	1,400,000.00	1,358,756.00	
		T 2.75 08/15/32	4,200,000.00	3,969,294.00	
		T 2.75 08/15/42	1,000,000.00	841,230.00	
		T 2.75 08/15/47	1,800,000.00	1,448,820.00	
		T 2.75 08/31/25	3,400,000.00	3,360,186.00	
		T 2.75 11/15/42	300,000.00	251,706.00	
		T 2.75 11/15/47	1,500,000.00	1,205,295.00	
		T 2.875 04/30/29	3,500,000.00	3,417,260.00	
		T 2.875 05/15/28	3,500,000.00	3,432,660.00	
		T 2.875 05/15/32	5,700,000.00	5,447,148.00	
		T 2.875 05/15/43	1,200,000.00	1,019,520.00	
		T 2.875 05/15/49	1,400,000.00	1,142,120.00	
		T 2.875 05/15/52	3,200,000.00	2,599,296.00	
		T 2.875 08/15/28	4,500,000.00	4,408,830.00	

		T 2.875 08/15/45	800,000.00	668,872.00	
		T 2.875 11/15/46	1,000,000.00	828,590.00	
		T 2.875 11/30/25	2,500,000.00	2,471,475.00	
		T 3 02/15/47	1,500,000.00	1,267,845.00	
		T 3 02/15/48	2,400,000.00	2,014,200.00	
		T 3 02/15/49	2,300,000.00	1,922,110.00	
		T 3 05/15/42	800,000.00	701,544.00	
		T 3 05/15/45	900,000.00	769,248.00	
		T 3 05/15/47	1,700,000.00	1,434,103.00	
		T 3 08/15/48	2,000,000.00	1,674,320.00	
		T 3 08/15/52	3,000,000.00	2,500,470.00	
		T 3 09/30/25	1,000,000.00	990,270.00	
		T 3 10/31/25	2,600,000.00	2,574,390.00	
		T 3 11/15/44	1,000,000.00	856,640.00	
		T 3 11/15/45	800,000.00	682,368.00	
		T 3.125 02/15/42	1,000,000.00	898,330.00	
		T 3.125 02/15/43	1,800,000.00	1,593,558.00	
		T 3.125 05/15/48	2,400,000.00	2,057,568.00	
		T 3.125 08/15/44	700,000.00	612,661.00	
		T 3.125 08/31/29	2,700,000.00	2,661,606.00	
		T 3.125 11/15/28	2,900,000.00	2,864,939.00	
		T 3.125 11/15/41	1,000,000.00	903,120.00	
		T 3.25 05/15/42	2,200,000.00	1,997,864.00	
		T 3.25 06/30/29	3,000,000.00	2,974,920.00	
		T 3.375 05/15/33	5,500,000.00	5,415,850.00	
		T 3.375 05/15/44	500,000.00	455,175.00	
		T 3.375 08/15/42	2,000,000.00	1,845,000.00	
		T 3.375 11/15/48	3,100,000.00	2,771,028.00	
		T 3.5 01/31/28	1,000,000.00	1,002,300.00	
		T 3.5 01/31/30	2,500,000.00	2,505,500.00	
		T 3.5 02/15/33	4,200,000.00	4,178,412.00	
		T 3.5 02/15/39	200,000.00	195,084.00	
		T 3.5 04/30/28	3,000,000.00	3,007,890.00	
		T 3.5 04/30/30	2,500,000.00	2,505,075.00	
		T 3.625 02/15/44	300,000.00	283,650.00	
		T 3.625 02/15/53	2,700,000.00	2,540,835.00	
		T 3.625 03/31/28	3,000,000.00	3,020,670.00	
		T 3.625 03/31/30	1,200,000.00	1,210,068.00	
		T 3.625 05/15/26	2,500,000.00	2,498,775.00	
		T 3.625 05/15/53	2,900,000.00	2,732,438.00	
		T 3.625 05/31/28	2,000,000.00	2,013,860.00	
		T 3.625 08/15/43	500,000.00	473,885.00	

		T 3.75 04/15/26	3,300,000.00	3,303,927.00	
		T 3.75 05/31/30	3,000,000.00	3,043,710.00	
		T 3.75 06/30/30	4,400,000.00	4,463,756.00	
		T 3.75 08/15/41	1,100,000.00	1,084,402.00	
		T 3.75 11/15/43	700,000.00	674,646.00	
		T 3.75 12/31/28	1,000,000.00	1,013,000.00	
		T 3.75 12/31/30	2,400,000.00	2,435,760.00	
		T 3.875 01/15/26	5,300,000.00	5,306,996.00	
		T 3.875 02/15/43	2,600,000.00	2,564,900.00	
		T 3.875 05/15/43	2,200,000.00	2,165,526.00	
		T 3.875 08/15/33	5,000,000.00	5,105,650.00	
		T 3.875 08/15/34	2,100,000.00	2,144,121.00	
		T 3.875 08/15/40	500,000.00	504,390.00	
		T 3.875 09/30/29	2,300,000.00	2,345,586.00	
		T 3.875 12/31/27	4,400,000.00	4,462,612.00	
		T 3.875 12/31/29	1,500,000.00	1,530,165.00	
		T 4 01/15/27	4,900,000.00	4,953,851.00	
		T 4 01/31/29	4,100,000.00	4,195,981.00	
		T 4 02/15/26	2,000,000.00	2,007,560.00	
		T 4 02/15/34	5,100,000.00	5,256,570.00	
		T 4 02/28/30	1,500,000.00	1,540,485.00	
		T 4 02/29/28	5,000,000.00	5,092,950.00	
		T 4 06/30/28	3,000,000.00	3,061,680.00	
		T 4 07/31/29	2,500,000.00	2,564,625.00	
		T 4 07/31/30	2,200,000.00	2,261,358.00	
		T 4 10/31/29	1,600,000.00	1,641,056.00	
		T 4 11/15/42	2,000,000.00	2,010,660.00	
		T 4 11/15/52	2,600,000.00	2,612,740.00	
		T 4.125 02/15/27	5,500,000.00	5,579,475.00	
		T 4.125 03/31/29	3,000,000.00	3,088,230.00	
		T 4.125 03/31/31	2,000,000.00	2,073,780.00	
		T 4.125 06/15/26	2,000,000.00	2,016,740.00	
		T 4.125 07/31/28	1,000,000.00	1,025,230.00	
		T 4.125 07/31/31	2,000,000.00	2,075,920.00	
		T 4.125 08/15/53	3,100,000.00	3,192,008.00	
		T 4.125 08/31/30	1,700,000.00	1,759,058.00	
		T 4.125 10/31/27	3,500,000.00	3,571,365.00	
		T 4.125 11/15/32	5,600,000.00	5,827,584.00	
		T 4.25 01/31/26	3,300,000.00	3,321,186.00	
		T 4.25 02/15/54	3,500,000.00	3,685,920.00	
		T 4.25 02/28/29	2,500,000.00	2,586,175.00	
		T 4.25 02/28/31	2,000,000.00	2,087,640.00	

		T 4.25 03/15/27	3,900,000.00	3,973,047.00	
		T 4.25 05/15/39	100,000.00	105,601.00	
		T 4.25 08/15/54	1,100,000.00	1,161,182.00	
		T 4.25 10/15/25	2,000,000.00	2,006,480.00	
		T 4.25 11/15/40	600,000.00	632,142.00	
		T 4.25 12/31/25	5,800,000.00	5,831,378.00	
		T 4.375 05/15/34	5,500,000.00	5,837,260.00	
		T 4.375 05/15/40	900,000.00	962,874.00	
		T 4.375 05/15/41	300,000.00	320,367.00	
		T 4.375 07/15/27	1,000,000.00	1,024,800.00	
		T 4.375 07/31/26	2,600,000.00	2,636,556.00	
		T 4.375 08/15/26	4,000,000.00	4,059,280.00	
		T 4.375 08/15/43	2,000,000.00	2,104,140.00	
		T 4.375 08/31/28	1,000,000.00	1,034,840.00	
		T 4.375 11/15/39	300,000.00	320,805.00	
		T 4.375 11/30/28	1,900,000.00	1,970,281.00	
		T 4.375 11/30/30	1,900,000.00	1,993,689.00	
		T 4.375 12/15/26	4,000,000.00	4,074,120.00	
		T 4.5 02/15/44	2,100,000.00	2,241,078.00	
		T 4.5 03/31/26	2,500,000.00	2,529,625.00	
		T 4.5 05/15/38	1,200,000.00	1,304,244.00	
		T 4.5 05/31/29	1,500,000.00	1,570,545.00	
		T 4.5 07/15/26	3,900,000.00	3,961,230.00	
		T 4.5 08/15/39	300,000.00	325,089.00	
		T 4.5 11/15/25	3,800,000.00	3,826,638.00	
		T 4.5 11/15/33	4,800,000.00	5,135,616.00	
		T 4.625 02/15/40	1,000,000.00	1,098,630.00	
		T 4.625 03/15/26	2,500,000.00	2,533,050.00	
		T 4.625 04/30/29	2,500,000.00	2,628,125.00	
		T 4.625 04/30/31	1,000,000.00	1,066,480.00	
		T 4.625 05/15/44	700,000.00	758,947.00	
		T 4.625 05/15/54	700,000.00	784,322.00	
		T 4.625 05/31/31	2,900,000.00	3,093,633.00	
		T 4.625 09/15/26	4,000,000.00	4,081,480.00	
		T 4.625 09/30/28	2,500,000.00	2,612,350.00	
		T 4.625 09/30/30	1,500,000.00	1,593,075.00	
		T 4.625 10/15/26	2,300,000.00	2,349,404.00	
		T 4.625 11/15/26	4,800,000.00	4,908,336.00	
		T 4.75 02/15/41	900,000.00	1,003,986.00	
		T 4.75 11/15/43	2,200,000.00	2,428,030.00	
		T 4.75 11/15/53	3,300,000.00	3,763,914.00	
		T 4.875 10/31/28	1,400,000.00	1,477,406.00	

		T 4.875 11/30/25	1,200,000.00	1,214,148.00	
		T 5.25 11/15/28	500,000.00	535,605.00	
		T 5.375 02/15/31	320,000.00	355,760.00	
		T 6 02/15/26	1,000,000.00	1,033,880.00	
		T 6.125 11/15/27	1,000,000.00	1,080,970.00	
	アメリカ・ドル小計		619,920,000.00	585,099,150.50 (82,364,407,416)	
	カナダ・ドル	CAN 0.5 09/01/25	2,300,000.00	2,238,705.00	
		CAN 1 06/01/27	800,000.00	766,504.00	
		CAN 1.25 03/01/27	400,000.00	385,864.00	
		CAN 1.25 06/01/30	2,100,000.00	1,939,791.00	
		CAN 1.5 06/01/26	2,600,000.00	2,540,018.00	
		CAN 1.5 12/01/31	2,100,000.00	1,928,745.00	
		CAN 1.75 12/01/53	1,100,000.00	823,669.00	
		CAN 2 06/01/28	700,000.00	684,439.00	
		CAN 2 06/01/32	2,000,000.00	1,892,940.00	
		CAN 2.25 06/01/29	1,100,000.00	1,083,962.00	
		CAN 2.25 12/01/29	1,600,000.00	1,570,208.00	
		CAN 2.5 12/01/32	2,930,000.00	2,868,264.90	
		CAN 2.75 06/01/33	1,800,000.00	1,792,242.00	
		CAN 2.75 09/01/27	2,600,000.00	2,603,250.00	
		CAN 2.75 12/01/48	1,300,000.00	1,233,726.00	
		CAN 2.75 12/01/55	800,000.00	751,120.00	
		CAN 3 04/01/26	400,000.00	399,784.00	
		CAN 3 10/01/25	900,000.00	897,480.00	
		CAN 3.25 12/01/33	880,000.00	909,506.40	
		CAN 3.5 03/01/34	300,000.00	316,689.00	
		CAN 3.5 12/01/45	1,200,000.00	1,285,752.00	
		CAN 4 06/01/41	1,300,000.00	1,467,310.00	
		CAN 4.5 11/01/25	1,800,000.00	1,824,282.00	
		CAN 5 06/01/37	400,000.00	486,232.00	
		CAN 5.75 06/01/29	250,000.00	284,540.00	
		CAN 5.75 06/01/33	300,000.00	366,942.00	
		CANADA 2.75 12/01/64	700,000.00	661,941.00	
	カナダ・ドル小計		34,660,000.00	34,003,906.30 (3,521,444,536)	
	オーストラリア・ドル	ACGB 0.25 11/21/25	1,150,000.00	1,104,437.00	
		ACGB 0.5 09/21/26	200,000.00	188,560.00	
		ACGB 1.25 05/21/32	1,300,000.00	1,088,464.00	
		ACGB 1.5 06/21/31	3,900,000.00	3,408,834.00	
		ACGB 1.75 06/21/51	500,000.00	294,390.00	
		ACGB 1.75 11/21/32	1,400,000.00	1,204,602.00	

	ACGB 2.25 05/21/28	1,300,000.00	1,249,352.00	
	ACGB 2.5 05/21/30	1,600,000.00	1,517,488.00	
	ACGB 2.75 05/21/41	600,000.00	498,720.00	
	ACGB 2.75 06/21/35	800,000.00	722,440.00	
	ACGB 2.75 11/21/27	1,200,000.00	1,176,984.00	
	ACGB 2.75 11/21/28	200,000.00	195,052.00	
	ACGB 2.75 11/21/29	1,800,000.00	1,739,898.00	
	ACGB 3 03/21/47	1,200,000.00	971,952.00	
	ACGB 3 11/21/33	900,000.00	845,055.00	
	ACGB 3.25 04/21/29	800,000.00	794,224.00	
	ACGB 3.25 06/21/39	2,000,000.00	1,825,680.00	
	ACGB 3.5 12/21/34	600,000.00	583,110.00	
	ACGB 3.75 04/21/37	1,100,000.00	1,081,366.00	
	ACGB 3.75 05/21/34	200,000.00	199,020.00	
	ACGB 4.25 04/21/26	2,150,000.00	2,173,564.00	
	ACGB 4.25 06/21/34	100,000.00	103,565.00	
	ACGB 4.5 04/21/33	1,500,000.00	1,580,925.00	
オーストラリア・ドル小計		26,500,000.00	24,547,682.00 (2,329,329,545)	
シンガポール・ドル	SIGB 0.5 11/01/25	200,000.00	195,518.00	
	SIGB 1.25 11/01/26	800,000.00	783,096.00	
	SIGB 1.625 07/01/31	300,000.00	286,956.00	
	SIGB 2.625 05/01/28	800,000.00	810,560.00	
	SIGB 2.625 08/01/32	200,000.00	203,700.00	
	SIGB 2.75 03/01/46	1,000,000.00	1,037,510.00	
	SIGB 2.75 04/01/42	550,000.00	569,800.00	
	SIGB 2.875 07/01/29	100,000.00	102,694.00	
	SIGB 2.875 09/01/30	600,000.00	619,980.00	
	SIGB 3.25 06/01/54	600,000.00	691,950.00	
	SIGB 3.375 05/01/34	200,000.00	216,124.00	
	SIGB 3.375 09/01/33	400,000.00	431,200.00	
	SIGB 3.5 03/01/27	880,000.00	906,848.80	
シンガポール・ドル小計		6,630,000.00	6,855,936.80 (744,486,177)	
ニュージーランド・ドル	NZGB 0.5 05/15/26	200,000.00	189,412.00	
	NZGB 1.5 05/15/31	200,000.00	172,470.00	
	NZGB 1.75 05/15/41	1,200,000.00	814,128.00	
	NZGB 2 05/15/32	1,120,000.00	975,934.40	
	NZGB 2.75 05/15/51	500,000.00	359,410.00	
	NZGB 3 04/20/29	1,000,000.00	972,690.00	
	NZGB 4.25 05/15/34	250,000.00	253,480.00	
	NZGB 4.5 04/15/27	1,100,000.00	1,123,705.00	

	NZGB 4.5 05/15/30	720,000.00	746,906.40	
ニュージーランド・ドル小計		6,290,000.00	5,608,135.80 (488,300,384)	
イギリス・ポンド	UK TSY GILT 1.125 01/31/39	600,000.00	413,418.00	
	UKT 0.125 01/30/26	1,500,000.00	1,432,410.00	
	UKT 0.125 01/31/28	1,800,000.00	1,612,476.00	
	UKT 0.25 07/31/31	1,300,000.00	1,042,054.00	
	UKT 0.375 10/22/26	2,000,000.00	1,871,040.00	
	UKT 0.375 10/22/30	1,100,000.00	913,803.00	
	UKT 0.5 01/31/29	1,850,000.00	1,627,741.00	
	UKT 0.5 10/22/61	1,200,000.00	389,904.00	
	UKT 0.625 07/31/35	1,350,000.00	972,540.00	
	UKT 0.875 01/31/46	400,000.00	211,872.00	
	UKT 0.875 07/31/33	1,300,000.00	1,026,168.00	
	UKT 0.875 10/22/29	500,000.00	440,210.00	
	UKT 1 01/31/32	2,100,000.00	1,750,665.00	
	UKT 1.125 10/22/73	300,000.00	118,350.00	
	UKT 1.25 07/22/27	900,000.00	845,028.00	
	UKT 1.25 07/31/51	1,400,000.00	725,578.00	
	UKT 1.25 10/22/41	800,000.00	519,592.00	
	UKT 1.5 07/22/26	1,100,000.00	1,057,705.00	
	UKT 1.5 07/22/47	1,000,000.00	597,250.00	
	UKT 1.625 10/22/28	900,000.00	838,242.00	
	UKT 1.625 10/22/54	500,000.00	276,100.00	
	UKT 1.75 01/22/49	1,950,000.00	1,207,381.50	
	UKT 1.75 09/07/37	700,000.00	547,939.00	
	UKT 2 09/07/25	1,100,000.00	1,078,275.00	
	UKT 2.5 07/22/65	1,600,000.00	1,063,280.00	
	UKT 3.25 01/22/44	1,600,000.00	1,391,200.00	
	UKT 3.25 01/31/33	2,400,000.00	2,328,024.00	
	UKT 3.5 01/22/45	1,250,000.00	1,121,250.00	
	UKT 3.5 07/22/68	1,300,000.00	1,109,550.00	
	UKT 3.5 10/22/25	700,000.00	694,897.00	
	UKT 3.75 01/29/38	1,100,000.00	1,078,693.00	
	UKT 3.75 03/07/27	300,000.00	299,904.00	
	UKT 3.75 07/22/52	1,200,000.00	1,089,240.00	
	UKT 3.75 10/22/53	1,300,000.00	1,174,628.00	
	UKT 4 01/22/60	1,300,000.00	1,228,058.00	
	UKT 4 10/22/31	100,000.00	102,326.00	
	UKT 4.125 01/29/27	1,700,000.00	1,713,226.00	
	UKT 4.125 07/22/29	300,000.00	306,759.00	
	UKT 4.25 03/07/36	700,000.00	726,915.00	

		UKT 4.25 06/07/32	500,000.00	522,495.00	
		UKT 4.25 07/31/34	450,000.00	468,180.00	
		UKT 4.25 09/07/39	600,000.00	613,650.00	
		UKT 4.25 12/07/27	1,200,000.00	1,226,244.00	
		UKT 4.25 12/07/40	600,000.00	609,618.00	
		UKT 4.25 12/07/46	1,500,000.00	1,490,370.00	
		UKT 4.25 12/07/49	900,000.00	890,838.00	
		UKT 4.25 12/07/55	1,700,000.00	1,676,965.00	
		UKT 4.375 07/31/54	350,000.00	351,634.50	
		UKT 4.5 06/07/28	550,000.00	566,445.00	
		UKT 4.5 09/07/34	400,000.00	424,852.00	
		UKT 4.5 12/07/42	1,050,000.00	1,091,097.00	
		UKT 4.625 01/31/34	1,800,000.00	1,926,504.00	
		UKT 4.75 10/22/43	700,000.00	747,425.00	
		UKT 4.75 12/07/30	1,000,000.00	1,067,910.00	
		UKT 4.75 12/07/38	1,000,000.00	1,082,380.00	
		UKT 6 12/07/28	650,000.00	714,187.50	
	イギリス・ポンド小計		59,450,000.00	52,414,486.50 (9,740,708,171)	
	イスラエル・シュケル	ILGOV 1 03/31/30	1,400,000.00	1,157,982.00	
		ILGOV 1.3 04/30/32	1,000,000.00	782,450.00	
		ILGOV 1.5 05/31/37	1,200,000.00	806,172.00	
		ILGOV 2 03/31/27	1,500,000.00	1,416,720.00	
		ILGOV 2.25 09/28/28	1,900,000.00	1,746,062.00	
		ILGOV 3.75 02/28/29	500,000.00	484,450.00	
		ILGOV 3.75 03/31/47	3,600,000.00	2,869,668.00	
		ILGOV 3.75 09/30/27	1,000,000.00	981,400.00	
		ILGOV 4 03/30/35	500,000.00	463,340.00	
		ILGOV 6.25 10/30/26	3,300,000.00	3,426,852.00	
	イスラエル・シュケル小計		15,900,000.00	14,135,096.00 (530,761,547)	
	デンマーク・クローネ	DGB 0 11/15/31	500,000.00	435,975.00	
		DGB 0.25 11/15/52	1,800,000.00	1,055,052.00	
		DGB 0.5 11/15/27	6,100,000.00	5,840,506.00	
		DGB 0.5 11/15/29	5,400,000.00	5,030,424.00	
		DGB 1.75 11/15/25	100,000.00	99,440.00	
		DGB 2.25 11/15/33	1,200,000.00	1,219,656.00	
		DGB 4.5 11/15/39	7,000,000.00	8,974,840.00	
	デンマーク・クローネ小計		22,100,000.00	22,655,893.00 (475,320,635)	
	ノルウェー・クロ	NGB 1.375 08/19/30	4,200,000.00	3,817,044.00	
		NGB 1.5 02/19/26	1,700,000.00	1,654,882.00	

ーネ	NGB 1.75 02/17/27	700,000.00	677,446.00	
	NGB 1.75 09/06/29	5,000,000.00	4,696,300.00	
	NGB 2 04/26/28	5,900,000.00	5,688,426.00	
	NGB 3 08/15/33	1,100,000.00	1,083,566.00	
	NGB 3.5 10/06/42	2,300,000.00	2,377,096.00	
	NGB 3.625 04/13/34	1,000,000.00	1,029,810.00	
ノルウェー・クローネ小計		21,900,000.00	21,024,570.00 (279,206,290)	
スウェーデン・クローナ	SGB 0.125 05/12/31	500,000.00	449,855.00	
	SGB 0.75 05/12/28	3,700,000.00	3,586,151.00	
	SGB 0.75 11/12/29	4,200,000.00	4,009,446.00	
	SGB 1 11/12/26	6,400,000.00	6,307,712.00	
	SGB 1.75 11/11/33	400,000.00	397,288.00	
	SGB 3.5 03/30/39	4,900,000.00	5,778,276.00	
スウェーデン・クローナ小計		20,100,000.00	20,528,728.00 (283,707,021)	
メキシコ・ペソ	MBONO 5.5 03/04/27	15,000,000.00	13,804,650.00	
	MBONO 5.75 03/05/26	19,000,000.00	17,950,820.00	
	MBONO 7.5 05/26/33	6,000,000.00	5,377,020.00	
	MBONO 7.5 06/03/27	22,000,000.00	21,133,640.00	
	MBONO 7.75 05/29/31	27,000,000.00	25,066,530.00	
	MBONO 7.75 11/23/34	18,000,000.00	16,258,860.00	
	MBONO 8 11/07/47	13,000,000.00	11,121,110.00	
	MBONO 8.5 05/31/29	37,000,000.00	36,005,440.00	
	MBONO 8.5 11/18/38	40,000,000.00	37,054,000.00	
メキシコ・ペソ小計		197,000,000.00	183,772,070.00 (1,344,899,140)	
オフショア・人民元	CGB 1.85 05/15/27	11,000,000.00	11,109,670.00	
	CGB 1.91 07/15/29	5,500,000.00	5,550,875.00	
	CGB 1.99 03/15/26	35,000,000.00	35,333,550.00	
	CGB 2.04 02/25/27	76,000,000.00	77,059,440.00	
	CGB 2.05 04/15/29	25,000,000.00	25,376,000.00	
	CGB 2.11 08/25/34	20,000,000.00	20,075,800.00	
	CGB 2.18 08/15/26	22,800,000.00	23,127,864.00	
	CGB 2.27 05/25/34	17,000,000.00	17,293,250.00	
	CGB 2.28 03/25/31	28,000,000.00	28,623,000.00	
	CGB 2.3 05/15/26	17,000,000.00	17,247,180.00	
	CGB 2.35 02/25/34	22,000,000.00	22,525,140.00	
	CGB 2.37 01/15/29	19,000,000.00	19,534,470.00	
	CGB 2.39 11/15/26	72,000,000.00	73,409,760.00	
	CGB 2.4 07/15/28	38,000,000.00	39,054,500.00	
	CGB 2.46 02/15/26	29,000,000.00	29,402,810.00	

	CGB 2.48 04/15/27	9,000,000.00	9,225,090.00	
	CGB 2.5 07/25/27	11,000,000.00	11,307,010.00	
	CGB 2.52 08/25/33	11,000,000.00	11,423,720.00	
	CGB 2.54 12/25/30	27,000,000.00	28,042,470.00	
	CGB 2.55 10/15/28	11,000,000.00	11,379,940.00	
	CGB 2.6 09/15/30	32,000,000.00	33,345,280.00	
	CGB 2.62 04/15/28	27,000,000.00	27,936,360.00	
	CGB 2.62 06/25/30	22,000,000.00	22,929,280.00	
	CGB 2.62 09/25/29	19,000,000.00	19,794,580.00	
	CGB 2.64 01/15/28	31,500,000.00	32,563,125.00	
	CGB 2.67 05/25/33	14,000,000.00	14,700,700.00	
	CGB 2.67 11/25/33	15,000,000.00	15,777,000.00	
	CGB 2.69 08/12/26	50,000,000.00	51,198,000.00	
	CGB 2.8 03/24/29	22,000,000.00	23,040,600.00	
	CGB 2.8 03/25/30	15,000,000.00	15,771,300.00	
	CGB 2.8 11/15/32	21,000,000.00	22,238,790.00	
	CGB 2.88 02/25/33	10,900,000.00	11,652,536.00	
	CGB 2.91 10/14/28	21,000,000.00	22,021,860.00	
	CGB 3 10/15/53	13,500,000.00	15,710,760.00	
	CGB 3.02 05/27/31	32,400,000.00	34,720,812.00	
	CGB 3.12 10/25/52	17,000,000.00	20,097,570.00	
	CGB 3.19 04/15/53	13,000,000.00	15,600,650.00	
	CGB 3.72 04/12/51	38,700,000.00	50,056,128.00	
オフショア・人民元小計		921,300,000.00	965,256,870.00 (19,125,503,096)	
マレーシア・リンギット	MGS 3.502 05/31/27	5,100,000.00	5,123,613.00	
	MGS 3.582 07/15/32	2,500,000.00	2,476,050.00	
	MGS 3.757 05/22/40	1,400,000.00	1,367,520.00	
	MGS 3.9 11/30/26	1,300,000.00	1,317,719.00	
	MGS 3.955 09/15/25	3,200,000.00	3,224,128.00	
	MGS 4.498 04/15/30	4,000,000.00	4,185,160.00	
	MGS 4.504 04/30/29	700,000.00	730,716.00	
	MGS 4.696 10/15/42	2,200,000.00	2,394,018.00	
	MGS 4.736 03/15/46	6,700,000.00	7,330,470.00	
マレーシア・リンギット小計		27,100,000.00	28,149,394.00 (921,901,098)	
ポーランド・ズロチ	POLGB 0 10/25/25	2,200,000.00	2,104,784.00	
	POLGB 0.25 10/25/26	7,900,000.00	7,221,864.00	
	POLGB 1.25 10/25/30	10,200,000.00	8,214,060.00	
	POLGB 2.75 04/25/28	4,000,000.00	3,738,040.00	
	POLGB 2.75 10/25/29	700,000.00	632,611.00	
	POLGB 6 10/25/33	2,800,000.00	2,962,260.00	

	POLGB 7.5 07/25/28	1,050,000.00	1,146,432.00	
ポーランド・ズロチ小計		28,850,000.00	26,020,051.00 (952,250,602)	
ユーロ	BGB 0 10/22/27	650,000.00	606,619.00	
	BGB 0 10/22/31	1,500,000.00	1,261,200.00	
	BGB 0.1 06/22/30	700,000.00	614,726.00	
	BGB 0.35 06/22/32	1,200,000.00	1,015,788.00	
	BGB 0.4 06/22/40	800,000.00	536,176.00	
	BGB 0.65 06/22/71	400,000.00	176,008.00	
	BGB 0.8 06/22/27	800,000.00	769,336.00	
	BGB 0.8 06/22/28	700,000.00	663,992.00	
	BGB 0.9 06/22/29	900,000.00	843,444.00	
	BGB 1 06/22/26	700,000.00	684,257.00	
	BGB 1 06/22/31	1,100,000.00	1,002,078.00	
	BGB 1.25 04/22/33	900,000.00	811,503.00	
	BGB 1.45 06/22/37	1,000,000.00	846,830.00	
	BGB 1.6 06/22/47	650,000.00	483,216.50	
	BGB 1.7 06/22/50	1,100,000.00	805,662.00	
	BGB 1.9 06/22/38	700,000.00	616,882.00	
	BGB 2.15 06/22/66	500,000.00	382,330.00	
	BGB 2.25 06/22/57	500,000.00	395,595.00	
	BGB 2.85 10/22/34	200,000.00	202,426.00	
	BGB 3 06/22/34	200,000.00	205,846.00	
	BGB 3.45 06/22/43	500,000.00	521,275.00	
	BGB 3.75 06/22/45	600,000.00	651,930.00	
	BGB 4 03/28/32	300,000.00	329,847.00	
	BGB 4.25 03/28/41	680,000.00	782,455.60	
	BGB 4.5 03/28/26	650,000.00	670,169.50	
	BGB 5 03/28/35	1,000,000.00	1,202,460.00	
	BGB 5.5 03/28/28	1,000,000.00	1,108,610.00	
	BKO 2.5 03/19/26	2,100,000.00	2,105,082.00	
	BKO 3.1 09/18/25	300,000.00	301,413.00	
	BTPS 0 08/01/26	1,300,000.00	1,240,421.00	
	BTPS 0.45 02/15/29	2,400,000.00	2,176,080.00	
	BTPS 0.5 02/01/26	1,500,000.00	1,457,055.00	
	BTPS 0.85 01/15/27	900,000.00	867,060.00	
	BTPS 0.9 04/01/31	2,000,000.00	1,753,820.00	
	BTPS 0.95 03/01/37	1,000,000.00	738,160.00	
	BTPS 0.95 06/01/32	3,300,000.00	2,816,253.00	
	BTPS 0.95 08/01/30	1,200,000.00	1,073,520.00	
	BTPS 0.95 09/15/27	800,000.00	763,920.00	
	BTPS 0.95 12/01/31	900,000.00	778,590.00	

		BTPS 1.1 04/01/27	1,500,000.00	1,448,415.00	
		BTPS 1.25 12/01/26	800,000.00	779,040.00	
		BTPS 1.35 04/01/30	1,900,000.00	1,754,631.00	
		BTPS 1.45 03/01/36	400,000.00	323,180.00	
		BTPS 1.6 06/01/26	1,200,000.00	1,181,508.00	
		BTPS 1.65 12/01/30	1,100,000.00	1,018,270.00	
		BTPS 1.7 09/01/51	1,500,000.00	953,580.00	
		BTPS 2 02/01/28	1,500,000.00	1,472,700.00	
		BTPS 2 12/01/25	1,300,000.00	1,289,873.00	
		BTPS 2.05 08/01/27	1,300,000.00	1,283,308.00	
		BTPS 2.1 07/15/26	1,000,000.00	992,480.00	
		BTPS 2.2 06/01/27	900,000.00	892,962.00	
		BTPS 2.25 09/01/36	500,000.00	438,395.00	
		BTPS 2.45 09/01/33	600,000.00	563,982.00	
		BTPS 2.45 09/01/50	1,700,000.00	1,285,965.00	
		BTPS 2.5 11/15/25	200,000.00	199,638.00	
		BTPS 2.65 12/01/27	400,000.00	401,244.00	
		BTPS 2.7 03/01/47	950,000.00	778,848.00	
		BTPS 2.8 03/01/67	700,000.00	533,505.00	
		BTPS 2.8 06/15/29	1,000,000.00	1,001,440.00	
		BTPS 2.8 12/01/28	1,300,000.00	1,307,579.00	
		BTPS 2.95 02/15/27	2,000,000.00	2,018,660.00	
		BTPS 2.95 09/01/38	1,000,000.00	920,410.00	
		BTPS 3 08/01/29	2,000,000.00	2,021,580.00	
		BTPS 3.1 03/01/40	700,000.00	644,595.00	
		BTPS 3.25 03/01/38	800,000.00	763,624.00	
		BTPS 3.25 09/01/46	1,100,000.00	992,332.00	
		BTPS 3.35 03/01/35	700,000.00	695,639.00	
		BTPS 3.35 07/01/29	600,000.00	614,640.00	
		BTPS 3.45 03/01/48	1,000,000.00	923,990.00	
		BTPS 3.45 07/15/31	170,000.00	174,003.50	
		BTPS 3.5 02/15/31	1,000,000.00	1,027,740.00	
		BTPS 3.5 03/01/30	1,000,000.00	1,034,340.00	
		BTPS 3.7 06/15/30	1,900,000.00	1,976,646.00	
		BTPS 3.85 02/01/35	800,000.00	827,600.00	
		BTPS 3.85 07/01/34	1,000,000.00	1,038,840.00	
		BTPS 3.85 09/01/49	1,100,000.00	1,076,075.00	
		BTPS 3.85 09/15/26	2,900,000.00	2,972,094.00	
		BTPS 3.85 12/15/29	1,300,000.00	1,363,518.00	
		BTPS 4 02/01/37	2,000,000.00	2,095,660.00	
		BTPS 4 04/30/35	500,000.00	526,810.00	
		BTPS 4.1 02/01/29	1,500,000.00	1,583,190.00	

		BTPS 4.4 05/01/33	3,000,000.00	3,265,650.00	
		BTPS 4.5 03/01/26	1,300,000.00	1,334,203.00	
		BTPS 4.75 09/01/28	1,800,000.00	1,939,374.00	
		BTPS 4.75 09/01/44	1,200,000.00	1,335,636.00	
		BTPS 5 08/01/34	1,570,000.00	1,785,152.80	
		BTPS 5 08/01/39	1,800,000.00	2,051,676.00	
		BTPS 5 09/01/40	1,700,000.00	1,935,161.00	
		BTPS 5.75 02/01/33	1,700,000.00	2,012,783.00	
		BTPS 6 05/01/31	1,200,000.00	1,417,320.00	
		BTPS 6.5 11/01/27	1,700,000.00	1,901,739.00	
		BTPS 7.25 11/01/26	400,000.00	439,044.00	
		DBR 0 02/15/30	1,500,000.00	1,352,460.00	
		DBR 0 02/15/32	2,700,000.00	2,335,554.00	
		DBR 0 05/15/35	1,600,000.00	1,273,504.00	
		DBR 0 05/15/36	800,000.00	619,032.00	
		DBR 0 08/15/29	2,500,000.00	2,275,100.00	
		DBR 0 08/15/30	2,500,000.00	2,232,925.00	
		DBR 0 08/15/31	1,300,000.00	1,137,136.00	
		DBR 0 08/15/31	1,700,000.00	1,487,364.00	
		DBR 0 08/15/50	2,000,000.00	1,088,720.00	
		DBR 0 08/15/50	2,100,000.00	1,145,151.00	
		DBR 0 11/15/27	1,000,000.00	939,910.00	
		DBR 0 11/15/28	500,000.00	461,820.00	
		DBR 0.25 02/15/27	300,000.00	287,604.00	
		DBR 0.25 02/15/29	1,200,000.00	1,115,844.00	
		DBR 0.25 08/15/28	1,500,000.00	1,406,265.00	
		DBR 0.5 02/15/26	3,200,000.00	3,121,184.00	
		DBR 0.5 02/15/28	1,600,000.00	1,524,960.00	
		DBR 0.5 08/15/27	2,100,000.00	2,014,110.00	
		DBR 1 05/15/38	1,600,000.00	1,355,760.00	
		DBR 1.25 08/15/48	1,650,000.00	1,306,090.50	
		DBR 1.7 08/15/32	2,400,000.00	2,347,992.00	
		DBR 1.8 08/15/53	1,200,000.00	1,052,088.00	
		DBR 1.8 08/15/53	1,000,000.00	878,210.00	
		DBR 2.1 11/15/29	1,400,000.00	1,406,734.00	
		DBR 2.2 02/15/34	100,000.00	100,929.00	
		DBR 2.3 02/15/33	1,600,000.00	1,632,544.00	
		DBR 2.3 02/15/33	1,300,000.00	1,327,053.00	
		DBR 2.4 11/15/30	1,100,000.00	1,124,475.00	
		DBR 2.5 07/04/44	1,600,000.00	1,620,352.00	
		DBR 2.5 08/15/46	1,500,000.00	1,520,025.00	
		DBR 2.5 08/15/54	500,000.00	510,715.00	

		DBR 2.6 08/15/33	900,000.00	939,465.00	
		DBR 2.6 08/15/34	450,000.00	469,071.00	
		DBR 3.25 07/04/42	800,000.00	897,352.00	
		DBR 4 01/04/37	1,300,000.00	1,539,941.00	
		DBR 4.25 07/04/39	700,000.00	864,262.00	
		DBR 4.75 07/04/28	1,600,000.00	1,760,416.00	
		DBR 4.75 07/04/34	600,000.00	739,086.00	
		DBR 4.75 07/04/40	1,450,000.00	1,900,834.00	
		DBR 5.5 01/04/31	900,000.00	1,083,735.00	
		DBR 5.625 01/04/28	1,000,000.00	1,114,630.00	
		DBR 6.25 01/04/30	500,000.00	605,645.00	
		DBR 6.5 07/04/27	1,000,000.00	1,119,510.00	
		FRTR 0 02/25/26	2,000,000.00	1,931,360.00	
		FRTR 0 02/25/27	1,100,000.00	1,039,016.00	
		FRTR 0 05/25/32	2,900,000.00	2,377,797.00	
		FRTR 0 11/25/29	2,500,000.00	2,203,975.00	
		FRTR 0 11/25/30	4,100,000.00	3,517,021.00	
		FRTR 0 11/25/31	3,000,000.00	2,499,090.00	
		FRTR 0.25 11/25/26	2,900,000.00	2,770,515.00	
		FRTR 0.5 05/25/26	3,100,000.00	3,003,342.00	
		FRTR 0.5 05/25/29	3,000,000.00	2,744,310.00	
		FRTR 0.5 05/25/40	1,300,000.00	880,373.00	
		FRTR 0.5 05/25/72	500,000.00	191,235.00	
		FRTR 0.5 06/25/44	350,000.00	212,810.50	
		FRTR 0.75 02/25/28	4,200,000.00	3,976,644.00	
		FRTR 0.75 05/25/28	2,500,000.00	2,357,500.00	
		FRTR 0.75 05/25/52	3,000,000.00	1,623,960.00	
		FRTR 0.75 11/25/28	3,400,000.00	3,177,572.00	
		FRTR 1 05/25/27	2,000,000.00	1,930,060.00	
		FRTR 1 11/25/25	800,000.00	785,368.00	
		FRTR 1.25 05/25/34	1,500,000.00	1,307,340.00	
		FRTR 1.25 05/25/36	1,850,000.00	1,545,490.00	
		FRTR 1.25 05/25/38	900,000.00	719,091.00	
		FRTR 1.5 05/25/31	2,650,000.00	2,483,553.50	
		FRTR 1.5 05/25/50	2,400,000.00	1,656,288.00	
		FRTR 1.75 05/25/66	800,000.00	526,648.00	
		FRTR 1.75 06/25/39	2,000,000.00	1,691,960.00	
		FRTR 2 05/25/48	2,000,000.00	1,579,580.00	
		FRTR 2 11/25/32	2,700,000.00	2,569,455.00	
		FRTR 2.5 05/25/30	2,100,000.00	2,101,533.00	
		FRTR 2.5 05/25/43	1,100,000.00	988,042.00	
		FRTR 2.5 09/24/26	3,100,000.00	3,106,789.00	

		FRTR 2.5 09/24/27	1,100,000.00	1,103,894.00	
		FRTR 2.75 02/25/29	1,600,000.00	1,619,824.00	
		FRTR 2.75 02/25/30	600,000.00	606,966.00	
		FRTR 2.75 10/25/27	2,650,000.00	2,679,812.50	
		FRTR 3 05/25/33	2,200,000.00	2,249,698.00	
		FRTR 3 05/25/54	1,300,000.00	1,205,854.00	
		FRTR 3 11/25/34	500,000.00	507,345.00	
		FRTR 3.25 05/25/45	900,000.00	901,179.00	
		FRTR 3.5 04/25/26	1,800,000.00	1,829,646.00	
		FRTR 3.5 11/25/33	3,400,000.00	3,606,312.00	
		FRTR 4 04/25/55	1,370,000.00	1,525,769.00	
		FRTR 4 04/25/60	1,400,000.00	1,575,546.00	
		FRTR 4 10/25/38	2,000,000.00	2,216,380.00	
		FRTR 4.5 04/25/41	1,900,000.00	2,230,809.00	
		FRTR 4.75 04/25/35	800,000.00	938,152.00	
		FRTR 5.5 04/25/29	1,650,000.00	1,864,747.50	
		FRTR 5.75 10/25/32	400,000.00	489,068.00	
		FRTR 6 10/25/25	1,700,000.00	1,761,319.00	
		IRISH 0 10/18/31	500,000.00	425,405.00	
		IRISH 0.9 05/15/28	500,000.00	478,450.00	
		IRISH 1 05/15/26	1,000,000.00	978,620.00	
		IRISH 1.1 05/15/29	500,000.00	475,785.00	
		IRISH 1.3 05/15/33	250,000.00	229,180.00	
		IRISH 1.35 03/18/31	500,000.00	472,370.00	
		IRISH 1.5 05/15/50	500,000.00	380,415.00	
		IRISH 1.7 05/15/37	300,000.00	269,154.00	
		IRISH 2 02/18/45	1,100,000.00	962,423.00	
		IRISH 2.4 05/15/30	600,000.00	604,728.00	
		IRISH 2.6 10/18/34	300,000.00	302,739.00	
		NETHER 0 01/15/27	1,300,000.00	1,238,068.00	
		NETHER 0 07/15/30	1,700,000.00	1,497,309.00	
		NETHER 0.25 07/15/29	500,000.00	456,590.00	
		NETHER 0.5 01/15/40	1,500,000.00	1,106,880.00	
		NETHER 0.5 07/15/26	1,300,000.00	1,261,130.00	
		NETHER 0.5 07/15/32	1,200,000.00	1,047,840.00	
		NETHER 0.75 07/15/27	400,000.00	385,220.00	
		NETHER 0.75 07/15/28	1,700,000.00	1,614,082.00	
		NETHER 2 01/15/54	200,000.00	175,168.00	
		NETHER 2.5 01/15/33	600,000.00	607,950.00	
		NETHER 2.5 07/15/33	800,000.00	809,232.00	
		NETHER 2.75 01/15/47	2,300,000.00	2,353,199.00	
		NETHER 3.25 01/15/44	200,000.00	218,540.00	

NETHER 3.75 01/15/42	1,300,000.00	1,502,046.00	
NETHER 4 01/15/37	300,000.00	346,269.00	
NETHER 5.5 01/15/28	700,000.00	774,333.00	
OBL 0 04/10/26	2,100,000.00	2,029,104.00	
OBL 0 04/16/27	2,200,000.00	2,088,988.00	
OBL 0 10/09/26	2,700,000.00	2,586,546.00	
OBL 1.3 10/15/27	300,000.00	294,048.00	
OBL 2.1 04/12/29	1,000,000.00	1,004,350.00	
OBL 2.1 04/12/29	600,000.00	602,850.00	
OBL 2.2 04/13/28	600,000.00	604,260.00	
OBL 2.4 10/19/28	1,600,000.00	1,625,088.00	
RAGB 0 02/20/30	800,000.00	703,736.00	
RAGB 0 02/20/31	1,400,000.00	1,197,798.00	
RAGB 0 10/20/40	300,000.00	189,222.00	
RAGB 0.5 02/20/29	550,000.00	508,821.50	
RAGB 0.5 04/20/27	700,000.00	669,669.00	
RAGB 0.75 02/20/28	600,000.00	570,372.00	
RAGB 0.75 03/20/51	900,000.00	542,970.00	
RAGB 0.75 10/20/26	600,000.00	581,454.00	
RAGB 0.85 06/30/20	250,000.00	118,410.00	
RAGB 0.9 02/20/32	600,000.00	535,512.00	
RAGB 1.2 10/20/25	1,000,000.00	985,550.00	
RAGB 1.5 02/20/47	700,000.00	533,526.00	
RAGB 1.5 11/02/86	200,000.00	125,808.00	
RAGB 2.4 05/23/34	1,000,000.00	982,280.00	
RAGB 2.9 02/20/33	500,000.00	512,055.00	
RAGB 2.9 02/20/34	300,000.00	306,939.00	
RAGB 3.15 06/20/44	500,000.00	513,955.00	
RAGB 3.15 10/20/53	150,000.00	154,087.50	
RAGB 3.2 07/15/39	200,000.00	207,570.00	
RAGB 3.8 01/26/62	700,000.00	829,675.00	
RAGB 4.15 03/15/37	300,000.00	342,480.00	
RAGB 4.85 03/15/26	800,000.00	827,536.00	
RAGB 6.25 07/15/27	1,000,000.00	1,108,430.00	
RFGB 0 09/15/26	300,000.00	286,629.00	
RFGB 0 09/15/30	400,000.00	346,832.00	
RFGB 0.25 09/15/40	700,000.00	465,465.00	
RFGB 0.5 04/15/26	700,000.00	680,176.00	
RFGB 0.5 09/15/27	700,000.00	665,448.00	
RFGB 0.5 09/15/28	300,000.00	279,750.00	
RFGB 0.5 09/15/29	100,000.00	91,324.00	
RFGB 0.75 04/15/31	800,000.00	718,608.00	

RFGB 1.375 04/15/47	500,000.00	374,635.00	
RFGB 2.625 07/04/42	800,000.00	769,576.00	
RFGB 2.75 04/15/38	200,000.00	197,768.00	
RFGB 2.75 07/04/28	200,000.00	203,540.00	
RFGB 3 09/15/33	800,000.00	826,608.00	
SPGB 0 01/31/27	500,000.00	472,745.00	
SPGB 0.1 04/30/31	800,000.00	681,000.00	
SPGB 0.5 04/30/30	1,600,000.00	1,435,200.00	
SPGB 0.5 10/31/31	1,400,000.00	1,210,090.00	
SPGB 0.7 04/30/32	1,400,000.00	1,213,450.00	
SPGB 0.8 07/30/27	1,100,000.00	1,053,030.00	
SPGB 0.8 07/30/29	700,000.00	647,143.00	
SPGB 0.85 07/30/37	500,000.00	379,395.00	
SPGB 1 10/31/50	800,000.00	461,464.00	
SPGB 1.2 10/31/40	1,400,000.00	1,031,058.00	
SPGB 1.25 10/31/30	3,000,000.00	2,782,830.00	
SPGB 1.3 10/31/26	1,400,000.00	1,369,494.00	
SPGB 1.4 04/30/28	1,500,000.00	1,450,035.00	
SPGB 1.4 07/30/28	1,200,000.00	1,156,968.00	
SPGB 1.45 04/30/29	2,100,000.00	2,011,548.00	
SPGB 1.45 10/31/27	1,300,000.00	1,264,848.00	
SPGB 1.45 10/31/71	400,000.00	209,532.00	
SPGB 1.5 04/30/27	1,500,000.00	1,467,690.00	
SPGB 1.85 07/30/35	600,000.00	538,938.00	
SPGB 1.95 04/30/26	2,300,000.00	2,282,014.00	
SPGB 1.95 07/30/30	700,000.00	679,119.00	
SPGB 2.15 10/31/25	1,600,000.00	1,591,408.00	
SPGB 2.35 07/30/33	700,000.00	676,648.00	
SPGB 2.5 05/31/27	1,400,000.00	1,403,766.00	
SPGB 2.55 10/31/32	1,600,000.00	1,581,536.00	
SPGB 2.7 10/31/48	750,000.00	653,527.50	
SPGB 2.8 05/31/26	1,100,000.00	1,105,797.00	
SPGB 2.9 10/31/46	1,700,000.00	1,553,919.00	
SPGB 3.15 04/30/33	1,900,000.00	1,955,537.00	
SPGB 3.45 07/30/43	700,000.00	699,741.00	
SPGB 3.45 07/30/66	1,300,000.00	1,242,826.00	
SPGB 3.45 10/31/34	600,000.00	627,642.00	
SPGB 3.55 10/31/33	1,800,000.00	1,904,148.00	
SPGB 3.9 07/30/39	700,000.00	750,834.00	
SPGB 4.2 01/31/37	1,050,000.00	1,170,729.00	
SPGB 4.7 07/30/41	1,100,000.00	1,292,434.00	
SPGB 4.9 07/30/40	1,400,000.00	1,670,984.00	

		SPGB 5.15 10/31/28	1,500,000.00	1,660,020.00	
		SPGB 5.15 10/31/44	1,400,000.00	1,746,696.00	
		SPGB 5.75 07/30/32	1,000,000.00	1,216,510.00	
		SPGB 5.9 07/30/26	500,000.00	531,255.00	
		SPGB 6 01/31/29	1,900,000.00	2,181,238.00	
	ユーロ小計		358,690,000.00	342,095,260.90 (53,555,013,094)	
国債証券合計				176,657,238,753 (176,657,238,753)	
合　計				176,657,238,753 (176,657,238,753)	

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

通　貨	銘柄数		組入債券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカ・ドル	国債証券	241 銘柄	45.9%	46.6%
カナダ・ドル	国債証券	27 銘柄	2.0%	2.0%
オーストラリア・ドル	国債証券	23 銘柄	1.3%	1.3%
シンガポール・ドル	国債証券	13 銘柄	0.4%	0.4%
ニュージーランド・ドル	国債証券	9 銘柄	0.3%	0.3%
イギリス・ポンド	国債証券	56 銘柄	5.4%	5.5%
イスラエル・シュケル	国債証券	10 銘柄	0.3%	0.3%
デンマーク・クローネ	国債証券	7 銘柄	0.3%	0.3%
ノルウェー・クローネ	国債証券	8 銘柄	0.2%	0.2%
スウェーデン・クローナ	国債証券	6 銘柄	0.2%	0.2%
メキシコ・ペソ	国債証券	9 銘柄	0.7%	0.8%
オフショア・人民元	国債証券	38 銘柄	10.7%	10.8%
マレーシア・リンギット	国債証券	9 銘柄	0.5%	0.5%
ポーランド・ズロチ	国債証券	7 銘柄	0.5%	0.5%
ユーロ	国債証券	296 銘柄	29.8%	30.3%

②デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド

（1）貸借対照表

(単位：円)

(2024年9月17日現在)

資産の部	
流動資産	
預金	54,658,617
金銭信託	1,648,908
コール・ローン	163,940,704
国債証券	35,995,014,946
派生商品評価勘定	1,100,915,977

未収利息	197,559,064
前払費用	93,368,679
流動資産合計	37,607,106,895
資産合計	37,607,106,895
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	1,844,038
未払解約金	32,490,110
流動負債合計	34,334,148
負債合計	34,334,148
純資産の部	
元本等	
元本	30,179,065,454
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	7,393,707,293
元本等合計	37,572,772,747
純資産合計	37,572,772,747
負債純資産合計	37,607,106,895

（２）注記表

(重要な会計方針の注記)

項　目	自 2023年9月16日 至 2024年9月17日
１．　有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券は個別法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。 (1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。 (2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。 (3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。
２．　デリバティブの評価基準及び評価方法	為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。
３．　その他財務諸表作成のための基礎となる事項	外貨建資産等の会計処理 「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。

（重要な会計上の見積りに関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

項　目	（2024年9月17日現在）
1．　当計算期間の末日における受益権の総数	30,179,065,454口
2．　1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額　1.2450円 （1万口当たりの純資産額12,450円）

（金融商品に関する注記）

Ⅰ．金融商品の状況に関する事項

項　目	自 2023年9月16日 至 2024年9月17日
1．　金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2．　金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	(1) 金融商品の内容 1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、国債証券を組み入れております。 2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。 当計算期間については、為替予約取引を行っております。 3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 (2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。
3．　金融商品に係るリスク管理体制	リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する会議をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。 また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限値、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用部

	署に是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用部署は、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。なお、投資信託協会の流動性リスク管理規制に抵触する場合には、流動性リスクを管理する会議で審議の上、流動性リスクの管理責任者が対処方針を決定します。その後、決定した対処方針やその実施等について、リスク管理会議に報告を行う体制となっております。 なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する会議にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。

Ⅱ．金融商品の時価等に関する事項

項　目	(2024年9月17日現在)
1．　貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2．　時価の算定方法	(1) 有価証券（国債証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。
3．　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。

(デリバティブ取引に関する注記)

(2024年9月17日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位：円)

区　分	種　類	契　約　額　等		時　価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建				
	アメリカ・ドル	33,402,971	－	32,303,500	△1,099,471
	カナダ・ドル	1,076,790	－	1,033,627	△43,163
	オーストラリア・ドル	1,964,476	－	1,894,174	△70,302
	デンマーク・クローネ	215,469	－	209,480	△5,989
	メキシコ・ペソ	1,978,322	－	1,965,654	△12,668

	ユーロ	22,491,831	－	21,881,902	△609,929
	小計	61,129,859	－	59,288,337	△1,841,522
	売建				
	アメリカ・ドル	17,116,557,245	－	16,588,549,500	528,007,745
	カナダ・ドル	740,241,648	－	711,135,376	29,106,272
	オーストラリア・ドル	491,624,572	－	473,543,500	18,081,072
	シンガポール・ドル	338,519,497	－	329,611,088	8,908,409
	ニュージーランド・ドル	102,374,761	－	98,166,151	4,208,610
	イギリス・ポンド	2,013,352,923	－	1,959,931,680	53,421,243
	イスラエル・シュケル	116,330,735	－	109,005,981	7,324,754
	デンマーク・クローネ	100,735,779	－	98,036,640	2,699,139
	ノルウェー・クローネ	57,914,153	－	56,061,459	1,852,694
	スウェーデン・クローナ	55,289,960	－	53,814,930	1,475,030
	メキシコ・ペソ	267,650,821	－	265,654,498	1,996,323
	オフショア・人民元	4,042,344,219	－	3,903,674,070	138,670,149
	ポーランド・ズロチ	192,422,075	－	187,202,934	5,219,141
	ユーロ	11,158,055,251	－	10,858,112,371	299,942,880
	小計	36,793,413,639	－	35,692,500,178	1,100,913,461
合　計		36,854,543,498	－	35,751,788,515	1,099,071,939

（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。

①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。

②計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。

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

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

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

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

２．ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

自 2023年9月16日 至 2024年9月17日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていな

いため、該当事項はございません。

（その他の注記）

（2024年9月17日現在）

開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	15,809,721,819円
同期中における追加設定元本額	20,671,411,508円
同期中における一部解約元本額	6,302,067,873円
2024年9月17日現在の元本の内訳	
アセットアロケーション・ファンド（安定型）	2,011,510,031円
アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）	2,201,553,605円
アセットアロケーション・ファンド（成長型）	848,422,165円
イオン・バランス戦略ファンド	1,260,478,663円
三井住友・資産最適化ファンド（１安定重視型）	3,398,635,377円
三井住友・資産最適化ファンド（２やや安定型）	1,573,946,740円
三井住友・資産最適化ファンド（３バランス型）	2,650,606,842円
三井住友・資産最適化ファンド（４やや成長型）	730,726,946円
三井住友・資産最適化ファンド（５成長重視型）	97,175,055円
三井住友・ＤＣつみたてＮＩＳＡ・世界分散ファンド	127,986,090円
日興ＦＷＳ・先進国債インデックス（為替ヘッジあり）	331,420,961円
三井住友ＤＳ・ＦＷ専用ポートフォリオ・レベル１（保守型）	14,903,918円
三井住友ＤＳ・ＦＷ専用ポートフォリオ・レベル２（安定型）	138,921,791円
三井住友ＤＳ・ＦＷ専用ポートフォリオ・レベル３（安定成長型）	367,591,701円
三井住友ＤＳ・ＦＷ専用ポートフォリオ・レベル４（成長型）	182,125,785円
三井住友ＤＳ・ＦＷ専用ポートフォリオ・レベル５（積極成長型）	16,859,938円
ＳＭＡＭ・年金グローバル債券ファンド＜適格機関投資家限定＞	970,009,355円
ＳＭＡＭ・ヘッジ付き年金外国債券パッシブファンドⅡ＜適格機関投資家限定＞	10,283,969,685円
ＳＭＡＭ・年金Ｗリスクコントロールファンド＜適格機関投資家限定＞	915,871,890円
ＳＭＡＭ・マルチアセットストラテジーファンド２０１６－０４＜適格機関投資家限定＞	512,269,018円
ＳＭＡＭ・マルチアセットストラテジー・オープン＜適格機関投資家限定＞	817,092,061円
ＳＭＤＡＭ・年金Ｗリスクコントロールファンド（リスク３％）＜適格機関投資家限定＞	726,987,837円
合　計	30,179,065,454円

（３）附属明細表

①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	T 0.25 08/31/25	590,000.00	569,409.00	

	カ・ドル	T 0.25 09/30/25	290,000.00	279,197.50	
		T 0.25 10/31/25	420,000.00	403,363.80	
		T 0.375 01/31/26	570,000.00	544,412.70	
		T 0.375 07/31/27	100,000.00	91,685.00	
		T 0.375 09/30/27	470,000.00	428,945.50	
		T 0.375 11/30/25	510,000.00	489,350.10	
		T 0.375 12/31/25	500,000.00	478,750.00	
		T 0.5 02/28/26	550,000.00	525,206.00	
		T 0.5 05/31/27	80,000.00	73,944.80	
		T 0.5 06/30/27	310,000.00	285,900.60	
		T 0.5 08/31/27	340,000.00	312,188.00	
		T 0.5 10/31/27	400,000.00	365,468.00	
		T 0.625 03/31/27	120,000.00	111,772.80	
		T 0.625 05/15/30	500,000.00	427,830.00	
		T 0.625 07/31/26	710,000.00	672,334.50	
		T 0.625 08/15/30	750,000.00	637,012.50	
		T 0.625 11/30/27	730,000.00	668,402.60	
		T 0.625 12/31/27	350,000.00	319,756.50	
		T 0.75 01/31/28	460,000.00	421,079.40	
		T 0.75 03/31/26	530,000.00	506,998.00	
		T 0.75 04/30/26	500,000.00	477,300.00	
		T 0.75 05/31/26	2,010,000.00	1,914,906.90	
		T 0.75 08/31/26	460,000.00	435,822.40	
		T 0.875 06/30/26	390,000.00	371,740.20	
		T 0.875 09/30/26	540,000.00	512,060.40	
		T 0.875 11/15/30	710,000.00	608,846.30	
		T 1.125 02/15/31	530,000.00	459,690.20	
		T 1.125 02/28/27	30,000.00	28,353.30	
		T 1.125 02/29/28	540,000.00	499,759.20	
		T 1.125 05/15/40	630,000.00	426,944.70	
		T 1.125 08/15/40	510,000.00	342,572.10	
		T 1.125 08/31/28	650,000.00	595,166.00	
		T 1.125 10/31/26	130,000.00	123,646.90	
		T 1.25 03/31/28	460,000.00	426,843.20	
		T 1.25 04/30/28	720,000.00	666,950.40	
		T 1.25 05/15/50	500,000.00	278,785.00	
		T 1.25 05/31/28	580,000.00	536,395.60	
		T 1.25 06/30/28	330,000.00	304,698.90	
		T 1.25 08/15/31	920,000.00	793,279.20	
		T 1.25 09/30/28	570,000.00	523,482.30	
		T 1.25 11/30/26	420,000.00	400,033.20	
		T 1.25 12/31/26	850,000.00	808,605.00	

		T 1.375 08/15/50	450,000.00	258,219.00	
		T 1.375 08/31/26	240,000.00	230,210.40	
		T 1.375 10/31/28	500,000.00	460,835.00	
		T 1.375 11/15/31	1,040,000.00	899,735.20	
		T 1.375 11/15/40	450,000.00	312,817.50	
		T 1.375 12/31/28	510,000.00	468,751.20	
		T 1.5 02/15/30	570,000.00	515,582.10	
		T 1.5 11/30/28	380,000.00	351,534.20	
		T 1.625 05/15/26	120,000.00	116,110.80	
		T 1.625 05/15/31	230,000.00	204,591.90	
		T 1.625 08/15/29	220,000.00	202,441.80	
		T 1.625 09/30/26	110,000.00	105,895.90	
		T 1.625 11/15/50	140,000.00	85,636.60	
		T 1.625 11/30/26	350,000.00	336,024.50	
		T 1.75 01/31/29	450,000.00	419,544.00	
		T 1.75 08/15/41	810,000.00	588,213.90	
		T 1.875 02/15/32	1,050,000.00	937,062.00	
		T 1.875 02/15/41	320,000.00	240,400.00	
		T 1.875 02/15/51	390,000.00	253,893.90	
		T 1.875 02/28/27	530,000.00	510,225.70	
		T 1.875 02/28/29	480,000.00	449,462.40	
		T 1.875 06/30/26	200,000.00	194,038.00	
		T 1.875 07/31/26	880,000.00	852,869.60	
		T 1.875 11/15/51	470,000.00	304,339.10	
		T 2 02/15/50	570,000.00	384,949.50	
		T 2 08/15/51	460,000.00	307,730.80	
		T 2 11/15/26	490,000.00	474,491.50	
		T 2 11/15/41	170,000.00	128,120.50	
		T 2.125 05/31/26	320,000.00	312,048.00	
		T 2.25 02/15/52	300,000.00	212,607.00	
		T 2.25 03/31/26	700,000.00	685,069.00	
		T 2.25 05/15/41	810,000.00	642,556.80	
		T 2.25 08/15/46	250,000.00	184,775.00	
		T 2.25 08/15/49	630,000.00	451,754.10	
		T 2.375 02/15/42	200,000.00	159,436.00	
		T 2.375 03/31/29	90,000.00	86,026.50	
		T 2.375 04/30/26	50,000.00	48,990.00	
		T 2.375 05/15/29	100,000.00	95,482.00	
		T 2.375 05/15/51	590,000.00	431,343.10	
		T 2.375 11/15/49	580,000.00	426,555.20	
		T 2.5 02/15/45	220,000.00	172,880.40	
		T 2.5 02/15/46	220,000.00	171,340.40	

		T 2.5 03/31/27	700,000.00	683,970.00	
		T 2.5 05/15/46	230,000.00	178,689.30	
		T 2.625 01/31/26	230,000.00	226,584.50	
		T 2.625 05/31/27	180,000.00	176,160.60	
		T 2.625 07/31/29	220,000.00	212,049.20	
		T 2.625 12/31/25	110,000.00	108,384.10	
		T 2.75 02/15/28	420,000.00	410,726.40	
		T 2.75 04/30/27	1,140,000.00	1,119,867.60	
		T 2.75 05/31/29	1,000,000.00	970,540.00	
		T 2.75 07/31/27	350,000.00	343,395.50	
		T 2.75 08/15/32	980,000.00	926,168.60	
		T 2.75 08/15/42	230,000.00	193,482.90	
		T 2.75 08/15/47	250,000.00	201,225.00	
		T 2.75 11/15/47	250,000.00	200,882.50	
		T 2.875 04/30/29	100,000.00	97,636.00	
		T 2.875 05/15/32	850,000.00	812,294.00	
		T 2.875 05/15/43	290,000.00	246,384.00	
		T 2.875 05/15/49	590,000.00	481,322.00	
		T 2.875 05/15/52	520,000.00	422,385.60	
		T 2.875 08/15/28	300,000.00	293,922.00	
		T 2.875 08/15/45	110,000.00	91,969.90	
		T 3 02/15/48	360,000.00	302,130.00	
		T 3 02/15/49	370,000.00	309,209.00	
		T 3 05/15/45	290,000.00	247,868.80	
		T 3 05/15/47	300,000.00	253,077.00	
		T 3 08/15/48	500,000.00	418,580.00	
		T 3 08/15/52	360,000.00	300,056.40	
		T 3 09/30/25	620,000.00	613,967.40	
		T 3 11/15/44	220,000.00	188,460.80	
		T 3.125 02/15/42	150,000.00	134,749.50	
		T 3.125 05/15/48	420,000.00	360,074.40	
		T 3.125 08/15/44	320,000.00	280,073.60	
		T 3.125 08/31/27	430,000.00	426,237.50	
		T 3.125 08/31/29	870,000.00	857,628.60	
		T 3.125 11/15/28	100,000.00	98,791.00	
		T 3.125 11/15/41	210,000.00	189,655.20	
		T 3.25 05/15/42	370,000.00	336,004.40	
		T 3.25 06/30/27	100,000.00	99,500.00	
		T 3.25 06/30/29	660,000.00	654,482.40	
		T 3.375 05/15/33	720,000.00	708,984.00	
		T 3.375 05/15/44	300,000.00	273,105.00	
		T 3.375 08/15/42	330,000.00	304,425.00	

		T 3.375 11/15/48	300,000.00	268,164.00	
		T 3.5 01/31/28	980,000.00	982,254.00	
		T 3.5 01/31/30	500,000.00	501,100.00	
		T 3.5 02/15/33	1,020,000.00	1,014,757.20	
		T 3.5 02/15/39	50,000.00	48,771.00	
		T 3.5 04/30/28	800,000.00	802,104.00	
		T 3.5 04/30/30	500,000.00	501,015.00	
		T 3.625 02/15/44	270,000.00	255,285.00	
		T 3.625 02/15/53	700,000.00	658,735.00	
		T 3.625 03/31/28	730,000.00	735,029.70	
		T 3.625 03/31/30	940,000.00	947,886.60	
		T 3.625 05/15/26	830,000.00	829,593.30	
		T 3.625 05/15/53	530,000.00	499,376.60	
		T 3.625 05/31/28	400,000.00	402,772.00	
		T 3.625 08/15/43	230,000.00	217,987.10	
		T 3.75 04/15/26	440,000.00	440,523.60	
		T 3.75 06/30/30	280,000.00	284,057.20	
		T 3.75 08/15/27	300,000.00	302,541.00	
		T 3.75 12/31/28	800,000.00	810,400.00	
		T 3.75 12/31/30	350,000.00	355,215.00	
		T 3.875 01/15/26	390,000.00	390,514.80	
		T 3.875 02/15/43	450,000.00	443,925.00	
		T 3.875 05/15/43	670,000.00	659,501.10	
		T 3.875 08/15/33	1,180,000.00	1,204,933.40	
		T 3.875 08/15/34	580,000.00	592,185.80	
		T 3.875 08/15/40	40,000.00	40,351.20	
		T 3.875 09/30/29	200,000.00	203,964.00	
		T 3.875 11/30/27	410,000.00	415,428.40	
		T 3.875 11/30/29	340,000.00	346,810.20	
		T 3.875 12/31/27	260,000.00	263,699.80	
		T 3.875 12/31/29	620,000.00	632,468.20	
		T 4 01/15/27	1,190,000.00	1,203,078.10	
		T 4 01/31/29	890,000.00	910,834.90	
		T 4 01/31/31	670,000.00	689,497.00	
		T 4 02/15/26	640,000.00	642,419.20	
		T 4 02/15/34	1,300,000.00	1,339,910.00	
		T 4 02/28/30	770,000.00	790,782.30	
		T 4 02/29/28	600,000.00	611,154.00	
		T 4 06/30/28	370,000.00	377,607.20	
		T 4 07/31/29	700,000.00	718,095.00	
		T 4 10/31/29	300,000.00	307,698.00	
		T 4 11/15/42	300,000.00	301,599.00	

		T 4 11/15/52	380,000.00	381,862.00	
		T 4 12/15/25	300,000.00	300,642.00	
		T 4.125 02/15/27	750,000.00	760,837.50	
		T 4.125 03/31/29	700,000.00	720,587.00	
		T 4.125 03/31/31	700,000.00	725,823.00	
		T 4.125 06/15/26	900,000.00	907,533.00	
		T 4.125 07/31/28	170,000.00	174,289.10	
		T 4.125 07/31/31	600,000.00	622,776.00	
		T 4.125 08/15/53	930,000.00	957,602.40	
		T 4.125 09/30/27	880,000.00	897,820.00	
		T 4.125 10/31/27	470,000.00	479,583.30	
		T 4.125 11/15/32	1,010,000.00	1,051,046.40	
		T 4.25 01/31/26	580,000.00	583,723.60	
		T 4.25 02/15/54	1,290,000.00	1,358,524.80	
		T 4.25 02/28/29	600,000.00	620,682.00	
		T 4.25 02/28/31	750,000.00	782,865.00	
		T 4.25 03/15/27	750,000.00	764,047.50	
		T 4.25 05/15/39	70,000.00	73,920.70	
		T 4.25 06/30/29	750,000.00	777,210.00	
		T 4.25 06/30/31	650,000.00	679,549.00	
		T 4.25 08/15/54	500,000.00	527,810.00	
		T 4.25 11/15/40	140,000.00	147,499.80	
		T 4.25 12/31/25	600,000.00	603,246.00	
		T 4.375 05/15/34	1,060,000.00	1,124,999.20	
		T 4.375 05/15/40	140,000.00	149,780.40	
		T 4.375 07/15/27	600,000.00	614,880.00	
		T 4.375 07/31/26	500,000.00	507,030.00	
		T 4.375 08/15/26	500,000.00	507,410.00	
		T 4.375 08/15/43	600,000.00	631,242.00	
		T 4.375 08/31/28	900,000.00	931,356.00	
		T 4.375 11/15/39	80,000.00	85,548.00	
		T 4.375 11/30/28	400,000.00	414,796.00	
		T 4.375 11/30/30	300,000.00	314,793.00	
		T 4.375 12/15/26	600,000.00	611,118.00	
		T 4.5 02/15/36	50,000.00	54,443.00	
		T 4.5 02/15/44	500,000.00	533,590.00	
		T 4.5 03/31/26	1,000,000.00	1,011,850.00	
		T 4.5 04/15/27	1,200,000.00	1,230,276.00	
		T 4.5 05/15/27	800,000.00	820,776.00	
		T 4.5 05/31/29	1,170,000.00	1,225,025.10	
		T 4.5 07/15/26	750,000.00	761,775.00	
		T 4.5 11/15/25	400,000.00	402,804.00	

		T 4.5 11/15/33	960,000.00	1,027,123.20	
		T 4.625 02/15/40	100,000.00	109,863.00	
		T 4.625 02/28/26	500,000.00	506,285.00	
		T 4.625 03/15/26	900,000.00	911,898.00	
		T 4.625 04/30/29	900,000.00	946,125.00	
		T 4.625 04/30/31	1,200,000.00	1,279,776.00	
		T 4.625 05/15/44	700,000.00	758,947.00	
		T 4.625 05/15/54	1,300,000.00	1,456,598.00	
		T 4.625 05/31/31	600,000.00	640,062.00	
		T 4.625 06/15/27	570,000.00	587,567.40	
		T 4.625 06/30/26	700,000.00	712,054.00	
		T 4.625 09/15/26	900,000.00	918,333.00	
		T 4.625 09/30/28	470,000.00	491,121.80	
		T 4.625 09/30/30	530,000.00	562,886.50	
		T 4.625 10/15/26	900,000.00	919,332.00	
		T 4.625 11/15/26	900,000.00	920,313.00	
		T 4.75 11/15/43	980,000.00	1,081,577.00	
		T 4.75 11/15/53	630,000.00	718,565.40	
		T 4.875 04/30/26	1,000,000.00	1,018,710.00	
		T 4.875 05/31/26	700,000.00	714,000.00	
		T 4.875 10/31/28	900,000.00	949,761.00	
		T 4.875 11/30/25	550,000.00	556,484.50	
	アメリカ・ドル小計		123,680,000.00	119,142,957.40 (16,771,754,113)	
	カナダ・ドル	CAN 0.25 03/01/26	70,000.00	67,267.90	
		CAN 0.5 09/01/25	180,000.00	175,203.00	
		CAN 0.5 12/01/30	220,000.00	192,471.40	
		CAN 1 06/01/27	140,000.00	134,138.20	
		CAN 1.25 03/01/27	390,000.00	376,217.40	
		CAN 1.25 06/01/30	150,000.00	138,556.50	
		CAN 1.5 06/01/26	20,000.00	19,538.60	
		CAN 1.5 06/01/31	290,000.00	268,145.60	
		CAN 1.5 12/01/31	60,000.00	55,107.00	
		CAN 1.75 12/01/53	350,000.00	262,076.50	
		CAN 2 06/01/28	60,000.00	58,666.20	
		CAN 2 06/01/32	400,000.00	378,588.00	
		CAN 2 12/01/51	240,000.00	192,945.60	
		CAN 2.25 06/01/29	60,000.00	59,125.20	
		CAN 2.25 12/01/29	310,000.00	304,227.80	
		CAN 2.5 12/01/32	110,000.00	107,682.30	
		CAN 2.75 06/01/33	670,000.00	667,112.30	
		CAN 2.75 09/01/27	60,000.00	60,075.00	

	CAN 2.75 12/01/48	70,000.00	66,431.40	
	CAN 2.75 12/01/55	240,000.00	225,336.00	
	CAN 3 04/01/26	200,000.00	199,892.00	
	CAN 3 06/01/34	130,000.00	131,489.80	
	CAN 3 10/01/25	280,000.00	279,216.00	
	CAN 3.25 09/01/28	460,000.00	469,908.40	
	CAN 3.25 12/01/34	130,000.00	134,056.00	
	CAN 3.5 03/01/28	230,000.00	236,154.80	
	CAN 3.5 03/01/34	220,000.00	232,238.60	
	CAN 3.5 09/01/29	50,000.00	51,900.00	
	CAN 3.5 12/01/45	90,000.00	96,431.40	
	CAN 4 03/01/29	120,000.00	126,643.20	
	CAN 4 08/01/26	570,000.00	581,576.70	
	CAN 4.5 11/01/25	250,000.00	253,372.50	
	CAN 5 06/01/37	210,000.00	255,271.80	
	CANADA 2.75 12/01/64	120,000.00	113,475.60	
カナダ・ドル小計		7,150,000.00	6,970,538.70 (721,868,988)	
オーストラリア・ドル	ACGB 0.25 11/21/25	200,000.00	192,076.00	
	ACGB 0.5 09/21/26	430,000.00	405,404.00	
	ACGB 1 11/21/31	340,000.00	283,322.00	
	ACGB 1 12/21/30	710,000.00	608,555.20	
	ACGB 1.25 05/21/32	400,000.00	334,912.00	
	ACGB 1.5 06/21/31	190,000.00	166,071.40	
	ACGB 1.75 06/21/51	230,000.00	135,419.40	
	ACGB 1.75 11/21/32	200,000.00	172,086.00	
	ACGB 2.75 05/21/41	240,000.00	199,488.00	
	ACGB 2.75 06/21/35	50,000.00	45,152.50	
	ACGB 2.75 11/21/27	220,000.00	215,780.40	
	ACGB 2.75 11/21/28	440,000.00	429,114.40	
	ACGB 2.75 11/21/29	200,000.00	193,322.00	
	ACGB 3 03/21/47	210,000.00	170,091.60	
	ACGB 3 11/21/33	370,000.00	347,411.50	
	ACGB 3.25 04/21/29	130,000.00	129,061.40	
	ACGB 3.5 12/21/34	370,000.00	359,584.50	
	ACGB 3.75 04/21/37	90,000.00	88,475.40	
	ACGB 3.75 05/21/34	150,000.00	149,265.00	
	ACGB 4.25 04/21/26	130,000.00	131,424.80	
	ACGB 4.25 06/21/34	170,000.00	176,060.50	
	ACGB 4.75 04/21/27	80,000.00	82,636.80	
オーストラリア・ドル小計		5,550,000.00	5,014,714.80 (475,846,287)	

シンガポール・ドル	SIGB 0.5 11/01/25	40,000.00	39,103.60	
	SIGB 1.25 11/01/26	100,000.00	97,887.00	
	SIGB 1.875 03/01/50	140,000.00	123,480.00	
	SIGB 1.875 10/01/51	30,000.00	26,115.00	
	SIGB 2.125 06/01/26	190,000.00	189,403.40	
	SIGB 2.25 08/01/36	250,000.00	245,375.00	
	SIGB 2.375 07/01/39	170,000.00	167,902.20	
	SIGB 2.625 05/01/28	200,000.00	202,640.00	
	SIGB 2.75 03/01/46	40,000.00	41,500.40	
	SIGB 2.875 07/01/29	150,000.00	154,041.00	
	SIGB 2.875 09/01/30	480,000.00	495,984.00	
	SIGB 3 04/01/29	110,000.00	113,597.00	
	SIGB 3 08/01/72	80,000.00	90,662.40	
	SIGB 3.25 06/01/54	100,000.00	115,325.00	
	SIGB 3.375 09/01/33	930,000.00	1,002,540.00	
	シンガポール・ドル小計	3,010,000.00	3,105,556.00 (337,232,326)	
ニュージーランド・ドル	NZGB 0.25 05/15/28	300,000.00	265,863.00	
	NZGB 0.5 05/15/26	70,000.00	66,294.20	
	NZGB 1.75 05/15/41	190,000.00	128,903.60	
	NZGB 2 05/15/32	340,000.00	296,265.80	
	NZGB 2.75 04/15/37	80,000.00	67,850.40	
	NZGB 2.75 05/15/51	30,000.00	21,564.60	
	NZGB 4.5 04/15/27	110,000.00	112,370.50	
	NZGB 4.5 05/15/30	120,000.00	124,484.40	
	NZGB 5 05/15/54	50,000.00	53,000.50	
	ニュージーランド・ドル小計	1,290,000.00	1,136,597.00 (98,963,501)	
イギリス・ポンド	UK TSY GILT 1.125 01/31/39	190,000.00	130,915.70	
	UKT 0.125 01/30/26	320,000.00	305,580.80	
	UKT 0.125 01/31/28	170,000.00	152,289.40	
	UKT 0.25 07/31/31	210,000.00	168,331.80	
	UKT 0.375 10/22/26	270,000.00	252,590.40	
	UKT 0.375 10/22/30	350,000.00	290,755.50	
	UKT 0.5 01/31/29	600,000.00	527,916.00	
	UKT 0.5 10/22/61	360,000.00	116,971.20	
	UKT 0.625 07/31/35	70,000.00	50,428.00	
	UKT 0.625 10/22/50	260,000.00	112,743.80	
	UKT 0.875 01/31/46	550,000.00	291,324.00	
	UKT 0.875 10/22/29	160,000.00	140,867.20	
	UKT 1 01/31/32	170,000.00	141,720.50	
	UKT 1.125 10/22/73	90,000.00	35,505.00	

		UKT 1.25 07/22/27	130,000.00	122,059.60	
		UKT 1.25 07/31/51	90,000.00	46,644.30	
		UKT 1.25 10/22/41	590,000.00	383,199.10	
		UKT 1.5 07/22/26	240,000.00	230,772.00	
		UKT 1.5 07/22/47	110,000.00	65,697.50	
		UKT 1.5 07/31/53	20,000.00	10,790.00	
		UKT 1.625 10/22/28	70,000.00	65,196.60	
		UKT 1.625 10/22/54	100,000.00	55,220.00	
		UKT 1.625 10/22/71	130,000.00	63,414.00	
		UKT 1.75 01/22/49	90,000.00	55,725.30	
		UKT 1.75 07/22/57	120,000.00	67,165.20	
		UKT 1.75 09/07/37	170,000.00	133,070.90	
		UKT 2 09/07/25	30,000.00	29,407.50	
		UKT 2.5 07/22/65	120,000.00	79,746.00	
		UKT 3.25 01/22/44	90,000.00	78,255.00	
		UKT 3.25 01/31/33	650,000.00	630,506.50	
		UKT 3.5 01/22/45	120,000.00	107,640.00	
		UKT 3.5 07/22/68	140,000.00	119,490.00	
		UKT 3.5 10/22/25	100,000.00	99,271.00	
		UKT 3.75 01/29/38	450,000.00	441,283.50	
		UKT 3.75 03/07/27	520,000.00	519,833.60	
		UKT 3.75 07/22/52	40,000.00	36,308.00	
		UKT 3.75 10/22/53	380,000.00	343,352.80	
		UKT 4 01/22/60	110,000.00	103,912.60	
		UKT 4 10/22/63	350,000.00	329,756.00	
		UKT 4.125 01/29/27	410,000.00	413,189.80	
		UKT 4.125 07/22/29	230,000.00	235,181.90	
		UKT 4.25 03/07/36	180,000.00	186,921.00	
		UKT 4.25 06/07/32	140,000.00	146,298.60	
		UKT 4.25 07/31/34	110,000.00	114,444.00	
		UKT 4.25 09/07/39	80,000.00	81,820.00	
		UKT 4.25 12/07/27	80,000.00	81,749.60	
		UKT 4.25 12/07/49	90,000.00	89,083.80	
		UKT 4.375 07/31/54	410,000.00	411,914.70	
		UKT 4.5 06/07/28	220,000.00	226,578.00	
		UKT 4.5 09/07/34	30,000.00	31,863.90	
		UKT 4.5 12/07/42	50,000.00	51,957.00	
		UKT 4.625 01/31/34	560,000.00	599,356.80	
		UKT 4.75 10/22/43	420,000.00	448,455.00	
		UKT 4.75 12/07/30	110,000.00	117,470.10	
		UKT 4.75 12/07/38	410,000.00	443,775.80	
		UKT 6 12/07/28	100,000.00	109,875.00	

イギリス・ポンド小計		12,360,000.00	10,725,591.30 (1,993,243,887)	
イスラエル・シュケル	ILGOV 0.5 02/27/26	290,000.00	275,065.00	
	ILGOV 1 03/31/30	520,000.00	430,107.60	
	ILGOV 1.3 04/30/32	500,000.00	391,225.00	
	ILGOV 1.5 05/31/37	440,000.00	295,596.40	
	ILGOV 1.75 08/31/25	150,000.00	146,694.00	
	ILGOV 2 03/31/27	260,000.00	245,564.80	
	ILGOV 2.25 09/28/28	480,000.00	441,110.40	
	ILGOV 2.8 11/29/52	220,000.00	137,845.40	
	ILGOV 3.75 02/28/29	210,000.00	203,469.00	
	ILGOV 3.75 03/31/47	230,000.00	183,339.90	
	ILGOV 6.25 10/30/26	110,000.00	114,228.40	
イスラエル・シュケル小計		3,410,000.00	2,864,245.90 (107,550,142)	
デンマーク・クローネ	DGB 0 11/15/31	770,000.00	671,401.50	
	DGB 0.25 11/15/52	390,000.00	228,594.60	
	DGB 0.5 11/15/27	570,000.00	545,752.20	
	DGB 0.5 11/15/29	820,000.00	763,879.20	
	DGB 1.75 11/15/25	340,000.00	338,096.00	
	DGB 2.25 11/15/33	950,000.00	965,561.00	
	DGB 4.5 11/15/39	910,000.00	1,166,729.20	
デンマーク・クローネ小計		4,750,000.00	4,680,013.70 (98,186,687)	
ノルウェー・クローネ	NGB 1.25 09/17/31	390,000.00	344,584.50	
	NGB 1.375 08/19/30	680,000.00	617,997.60	
	NGB 1.5 02/19/26	370,000.00	360,180.20	
	NGB 1.75 02/17/27	790,000.00	764,546.20	
	NGB 1.75 09/06/29	170,000.00	159,674.20	
	NGB 2 04/26/28	620,000.00	597,766.80	
	NGB 2.125 05/18/32	200,000.00	186,242.00	
	NGB 3 08/15/33	810,000.00	797,898.60	
	NGB 3.5 10/06/42	310,000.00	320,391.20	
	NGB 3.625 04/13/34	70,000.00	72,086.70	
ノルウェー・クローネ小計		4,410,000.00	4,221,368.00 (56,059,767)	
スウェーデン・クローナ	SGB 0.125 05/12/31	400,000.00	359,884.00	
	SGB 0.75 05/12/28	1,060,000.00	1,027,383.80	
	SGB 0.75 11/12/29	600,000.00	572,778.00	
	SGB 1 11/12/26	510,000.00	502,645.80	
	SGB 1.75 11/11/33	710,000.00	705,186.20	
	SGB 2.25 06/01/32	340,000.00	351,169.00	

	SGB 3.5 03/30/39	330,000.00	389,149.20	
スウェーデン・クローナ小計		3,950,000.00	3,908,196.00 (54,011,269)	
メキシコ・ペソ	MBONO 5.5 03/04/27	3,100,000.00	2,852,961.00	
	MBONO 5.75 03/05/26	3,300,000.00	3,117,774.00	
	MBONO 7 09/03/26	1,000,000.00	953,830.00	
	MBONO 7.5 05/26/33	3,900,000.00	3,495,063.00	
	MBONO 7.5 06/03/27	2,800,000.00	2,689,736.00	
	MBONO 7.75 05/29/31	6,700,000.00	6,220,213.00	
	MBONO 7.75 11/13/42	2,500,000.00	2,106,800.00	
	MBONO 7.75 11/23/34	920,000.00	831,008.40	
	MBONO 8 05/24/35	3,500,000.00	3,163,440.00	
	MBONO 8 11/07/47	3,100,000.00	2,651,957.00	
	MBONO 8.5 03/01/29	3,300,000.00	3,209,844.00	
	MBONO 8.5 05/31/29	3,500,000.00	3,405,920.00	
	MBONO 8.5 11/18/38	1,900,000.00	1,760,065.00	
メキシコ・ペソ小計		39,520,000.00	36,458,611.40 (266,815,056)	
オフショア・人民元	CGB 1.62 08/15/27	8,700,000.00	8,739,846.00	
	CGB 1.85 05/15/27	8,300,000.00	8,382,751.00	
	CGB 1.91 07/15/29	4,800,000.00	4,844,400.00	
	CGB 1.99 03/15/26	10,800,000.00	10,902,924.00	
	CGB 2.04 02/25/27	10,400,000.00	10,544,976.00	
	CGB 2.05 04/15/29	3,200,000.00	3,248,128.00	
	CGB 2.11 08/25/34	2,000,000.00	2,007,580.00	
	CGB 2.12 06/25/31	6,200,000.00	6,277,562.00	
	CGB 2.18 08/15/26	6,000,000.00	6,086,280.00	
	CGB 2.27 05/25/34	4,700,000.00	4,781,075.00	
	CGB 2.28 03/25/31	5,900,000.00	6,031,275.00	
	CGB 2.28 11/25/25	4,800,000.00	4,848,528.00	
	CGB 2.3 05/15/26	6,400,000.00	6,493,056.00	
	CGB 2.35 02/25/34	5,700,000.00	5,836,059.00	
	CGB 2.37 01/15/29	8,200,000.00	8,430,666.00	
	CGB 2.4 07/15/28	5,300,000.00	5,447,075.00	
	CGB 2.44 10/15/27	900,000.00	923,958.00	
	CGB 2.46 02/15/26	3,600,000.00	3,650,004.00	
	CGB 2.48 04/15/27	6,800,000.00	6,970,068.00	
	CGB 2.48 09/25/28	10,200,000.00	10,508,754.00	
	CGB 2.6 09/15/30	5,400,000.00	5,627,016.00	
	CGB 2.62 06/25/30	5,400,000.00	5,628,096.00	
	CGB 2.64 01/15/28	5,400,000.00	5,582,250.00	
	CGB 2.67 05/25/33	10,500,000.00	11,025,525.00	

	CGB 2.69 08/12/26	1,200,000.00	1,228,752.00	
	CGB 2.79 12/15/29	2,800,000.00	2,942,156.00	
	CGB 2.8 03/25/30	6,000,000.00	6,308,520.00	
	CGB 2.8 11/15/32	3,300,000.00	3,494,667.00	
	CGB 2.91 10/14/28	3,500,000.00	3,670,310.00	
	CGB 3 10/15/53	4,400,000.00	5,120,544.00	
	CGB 3.02 05/27/31	2,800,000.00	3,000,564.00	
	CGB 3.03 03/11/26	1,300,000.00	1,331,330.00	
	CGB 3.12 10/25/52	3,600,000.00	4,255,956.00	
	CGB 3.19 04/15/53	5,300,000.00	6,360,265.00	
	CGB 3.69 05/17/28	2,000,000.00	2,161,480.00	
	CGB 3.72 04/12/51	3,100,000.00	4,009,664.00	
オフショア・人民元小計		188,900,000.00	196,702,060.00 (3,897,434,947)	
ポーランド・ズロチ	POLGB 0 04/25/26	400,000.00	373,320.00	
	POLGB 0.25 10/25/26	520,000.00	475,363.20	
	POLGB 1.25 10/25/30	820,000.00	660,346.00	
	POLGB 1.75 04/25/32	270,000.00	213,678.00	
	POLGB 2.5 07/25/27	240,000.00	226,183.20	
	POLGB 2.75 04/25/28	50,000.00	46,725.50	
	POLGB 2.75 10/25/29	380,000.00	343,417.40	
	POLGB 3.75 05/25/27	680,000.00	663,761.60	
	POLGB 4.75 07/25/29	930,000.00	921,723.00	
	POLGB 5 10/25/34	140,000.00	137,275.60	
	POLGB 6 10/25/33	280,000.00	296,226.00	
	POLGB 7.5 07/25/28	690,000.00	753,369.60	
ポーランド・ズロチ小計		5,400,000.00	5,111,389.10 (187,060,485)	
ユーロ	BGB 0 10/22/27	150,000.00	139,989.00	
	BGB 0 10/22/31	10,000.00	8,408.00	
	BGB 0.1 06/22/30	370,000.00	324,926.60	
	BGB 0.35 06/22/32	150,000.00	126,973.50	
	BGB 0.4 06/22/40	390,000.00	261,385.80	
	BGB 0.65 06/22/71	30,000.00	13,200.60	
	BGB 0.8 06/22/27	270,000.00	259,650.90	
	BGB 0.8 06/22/28	280,000.00	265,596.80	
	BGB 0.9 06/22/29	220,000.00	206,175.20	
	BGB 1 06/22/26	40,000.00	39,100.40	
	BGB 1.25 04/22/33	50,000.00	45,083.50	
	BGB 1.4 06/22/53	200,000.00	130,658.00	
	BGB 1.45 06/22/37	20,000.00	16,936.60	
	BGB 1.6 06/22/47	100,000.00	74,341.00	

		BGB 1.7 06/22/50	30,000.00	21,972.60	
		BGB 1.9 06/22/38	60,000.00	52,875.60	
		BGB 2.75 04/22/39	320,000.00	311,558.40	
		BGB 2.85 10/22/34	50,000.00	50,606.50	
		BGB 3 06/22/33	240,000.00	247,399.20	
		BGB 3 06/22/34	140,000.00	144,092.20	
		BGB 3.45 06/22/43	430,000.00	448,296.50	
		BGB 3.5 06/22/55	50,000.00	51,341.00	
		BGB 3.75 06/22/45	100,000.00	108,655.00	
		BGB 4 03/28/32	130,000.00	142,933.70	
		BGB 4.5 03/28/26	150,000.00	154,654.50	
		BGB 5.5 03/28/28	80,000.00	88,688.80	
		BKO 2.5 03/19/26	400,000.00	400,968.00	
		BKO 2.7 09/17/26	470,000.00	474,685.90	
		BKO 2.9 06/18/26	380,000.00	384,199.00	
		BKO 3.1 09/18/25	140,000.00	140,659.40	
		BTPS 0 04/01/26	60,000.00	57,682.20	
		BTPS 0 08/01/26	200,000.00	190,834.00	
		BTPS 0.25 03/15/28	180,000.00	165,996.00	
		BTPS 0.45 02/15/29	170,000.00	154,139.00	
		BTPS 0.5 02/01/26	260,000.00	252,556.20	
		BTPS 0.6 08/01/31	50,000.00	42,561.00	
		BTPS 0.85 01/15/27	120,000.00	115,608.00	
		BTPS 0.9 04/01/31	260,000.00	227,996.60	
		BTPS 0.95 06/01/32	330,000.00	281,625.30	
		BTPS 0.95 08/01/30	520,000.00	465,192.00	
		BTPS 0.95 09/15/27	210,000.00	200,529.00	
		BTPS 0.95 12/01/31	100,000.00	86,510.00	
		BTPS 1.1 04/01/27	130,000.00	125,529.30	
		BTPS 1.35 04/01/30	170,000.00	156,993.30	
		BTPS 1.45 03/01/36	20,000.00	16,159.00	
		BTPS 1.5 04/30/45	130,000.00	86,876.40	
		BTPS 1.6 06/01/26	130,000.00	127,996.70	
		BTPS 1.65 03/01/32	20,000.00	18,132.00	
		BTPS 1.8 03/01/41	120,000.00	90,703.20	
		BTPS 2 02/01/28	190,000.00	186,542.00	
		BTPS 2 12/01/25	220,000.00	218,286.20	
		BTPS 2.05 08/01/27	160,000.00	157,945.60	
		BTPS 2.1 07/15/26	150,000.00	148,872.00	
		BTPS 2.15 03/01/72	140,000.00	88,499.60	
		BTPS 2.15 09/01/52	100,000.00	69,427.00	
		BTPS 2.25 09/01/36	170,000.00	149,054.30	

		BTPS 2.45 09/01/50	280,000.00	211,806.00	
		BTPS 2.5 11/15/25	20,000.00	19,963.80	
		BTPS 2.5 12/01/32	290,000.00	276,341.00	
		BTPS 2.65 12/01/27	270,000.00	270,839.70	
		BTPS 2.7 03/01/47	150,000.00	122,976.00	
		BTPS 2.8 03/01/67	90,000.00	68,593.50	
		BTPS 2.8 06/15/29	250,000.00	250,360.00	
		BTPS 2.8 12/01/28	20,000.00	20,116.60	
		BTPS 2.95 02/15/27	530,000.00	534,944.90	
		BTPS 2.95 09/01/38	200,000.00	184,082.00	
		BTPS 3 08/01/29	120,000.00	121,294.80	
		BTPS 3.1 03/01/40	220,000.00	202,587.00	
		BTPS 3.1 08/28/26	390,000.00	393,701.10	
		BTPS 3.25 03/01/38	350,000.00	334,085.50	
		BTPS 3.25 09/01/46	90,000.00	81,190.80	
		BTPS 3.35 07/01/29	430,000.00	440,492.00	
		BTPS 3.4 04/01/28	420,000.00	430,852.80	
		BTPS 3.45 03/01/48	10,000.00	9,239.90	
		BTPS 3.45 07/15/27	400,000.00	409,476.00	
		BTPS 3.45 07/15/31	490,000.00	501,539.50	
		BTPS 3.5 01/15/26	80,000.00	80,814.40	
		BTPS 3.5 02/15/31	170,000.00	174,715.80	
		BTPS 3.6 09/29/25	220,000.00	221,676.40	
		BTPS 3.7 06/15/30	270,000.00	280,891.80	
		BTPS 3.8 04/15/26	510,000.00	519,159.60	
		BTPS 3.85 02/01/35	150,000.00	155,175.00	
		BTPS 3.85 07/01/34	510,000.00	529,808.40	
		BTPS 3.85 09/01/49	10,000.00	9,782.50	
		BTPS 3.85 12/15/29	410,000.00	430,032.60	
		BTPS 4 04/30/35	30,000.00	31,608.60	
		BTPS 4 10/30/31	120,000.00	127,473.60	
		BTPS 4.05 10/30/37	350,000.00	365,393.00	
		BTPS 4.1 02/01/29	340,000.00	358,856.40	
		BTPS 4.15 10/01/39	400,000.00	416,640.00	
		BTPS 4.2 03/01/34	200,000.00	213,900.00	
		BTPS 4.4 05/01/33	360,000.00	391,878.00	
		BTPS 4.45 09/01/43	630,000.00	672,890.40	
		BTPS 4.5 03/01/26	130,000.00	133,420.30	
		BTPS 4.5 10/01/53	200,000.00	213,816.00	
		BTPS 4.75 09/01/28	200,000.00	215,486.00	
		BTPS 5 08/01/34	170,000.00	193,296.80	
		BTPS 5 08/01/39	220,000.00	250,760.40	

		BTPS 5 09/01/40	180,000.00	204,899.40	
		BTPS 5.25 11/01/29	250,000.00	279,372.50	
		BTPS 5.75 02/01/33	310,000.00	367,036.90	
		BTPS 6 05/01/31	130,000.00	153,543.00	
		BTPS 6.5 11/01/27	190,000.00	212,547.30	
		DBR 0 02/15/30	290,000.00	261,475.60	
		DBR 0 02/15/31	350,000.00	309,386.00	
		DBR 0 02/15/32	290,000.00	250,855.80	
		DBR 0 05/15/35	140,000.00	111,431.60	
		DBR 0 05/15/36	230,000.00	177,971.70	
		DBR 0 08/15/26	220,000.00	211,442.00	
		DBR 0 08/15/29	250,000.00	227,510.00	
		DBR 0 08/15/30	260,000.00	232,224.20	
		DBR 0 08/15/30	110,000.00	98,264.10	
		DBR 0 08/15/31	200,000.00	174,944.00	
		DBR 0 08/15/31	210,000.00	183,733.20	
		DBR 0 08/15/50	100,000.00	54,436.00	
		DBR 0 08/15/50	300,000.00	163,593.00	
		DBR 0 08/15/52	140,000.00	72,903.60	
		DBR 0 11/15/27	220,000.00	206,780.20	
		DBR 0 11/15/28	310,000.00	286,328.40	
		DBR 0.25 02/15/29	160,000.00	148,779.20	
		DBR 0.25 08/15/28	100,000.00	93,751.00	
		DBR 0.5 02/15/26	100,000.00	97,537.00	
		DBR 0.5 02/15/28	100,000.00	95,310.00	
		DBR 1 05/15/38	700,000.00	593,145.00	
		DBR 1.25 08/15/48	120,000.00	94,988.40	
		DBR 1.7 08/15/32	180,000.00	176,099.40	
		DBR 1.8 08/15/53	390,000.00	341,928.60	
		DBR 1.8 08/15/53	150,000.00	131,731.50	
		DBR 2.1 11/15/29	220,000.00	221,058.20	
		DBR 2.2 02/15/34	480,000.00	484,459.20	
		DBR 2.3 02/15/33	390,000.00	397,932.60	
		DBR 2.3 02/15/33	260,000.00	265,410.60	
		DBR 2.4 11/15/30	250,000.00	255,562.50	
		DBR 2.5 07/04/44	330,000.00	334,197.60	
		DBR 2.5 08/15/46	230,000.00	233,070.50	
		DBR 2.5 08/15/54	370,000.00	377,929.10	
		DBR 2.6 05/15/41	380,000.00	390,358.80	
		DBR 2.6 08/15/33	250,000.00	260,962.50	
		DBR 2.6 08/15/34	170,000.00	177,204.60	
		DBR 4 01/04/37	140,000.00	165,839.80	

		DBR 4.25 07/04/39	90,000.00	111,119.40	
		DBR 4.75 07/04/28	170,000.00	187,044.20	
		DBR 4.75 07/04/40	130,000.00	170,419.60	
		DBR 5.625 01/04/28	160,000.00	178,340.80	
		DBR 6.25 01/04/30	130,000.00	157,467.70	
		DBR 6.5 07/04/27	90,000.00	100,755.90	
		FRANCE O.A.T. 0.75 05/25/53	450,000.00	237,595.50	
		FRTR 0 02/25/26	310,000.00	299,360.80	
		FRTR 0 02/25/27	900,000.00	850,104.00	
		FRTR 0 05/25/32	890,000.00	729,737.70	
		FRTR 0 11/25/29	540,000.00	476,058.60	
		FRTR 0 11/25/30	1,130,000.00	969,325.30	
		FRTR 0 11/25/31	630,000.00	524,808.90	
		FRTR 0.25 11/25/26	650,000.00	620,977.50	
		FRTR 0.5 05/25/26	270,000.00	261,581.40	
		FRTR 0.5 05/25/29	400,000.00	365,908.00	
		FRTR 0.5 05/25/40	640,000.00	433,414.40	
		FRTR 0.5 05/25/72	80,000.00	30,597.60	
		FRTR 0.5 06/25/44	300,000.00	182,409.00	
		FRTR 0.75 02/25/28	950,000.00	899,479.00	
		FRTR 0.75 05/25/28	390,000.00	367,770.00	
		FRTR 0.75 05/25/52	180,000.00	97,437.60	
		FRTR 0.75 11/25/28	370,000.00	345,794.60	
		FRTR 1 05/25/27	320,000.00	308,809.60	
		FRTR 1 11/25/25	200,000.00	196,342.00	
		FRTR 1.25 05/25/34	110,000.00	95,871.60	
		FRTR 1.25 05/25/36	270,000.00	225,558.00	
		FRTR 1.25 05/25/38	460,000.00	367,535.40	
		FRTR 1.5 05/25/50	230,000.00	158,727.60	
		FRTR 1.75 05/25/66	120,000.00	78,997.20	
		FRTR 1.75 06/25/39	160,000.00	135,356.80	
		FRTR 2 11/25/32	530,000.00	504,374.50	
		FRTR 2.5 05/25/30	210,000.00	210,153.30	
		FRTR 2.5 05/25/43	940,000.00	844,326.80	
		FRTR 2.5 09/24/26	820,000.00	821,795.80	
		FRTR 2.5 09/24/27	150,000.00	150,531.00	
		FRTR 2.75 02/25/29	920,000.00	931,398.80	
		FRTR 2.75 02/25/30	450,000.00	455,224.50	
		FRTR 2.75 10/25/27	470,000.00	475,287.50	
		FRTR 3 05/25/33	500,000.00	511,295.00	
		FRTR 3 05/25/54	140,000.00	129,861.20	
		FRTR 3 06/25/49	380,000.00	361,695.40	

		FRTR 3.25 05/25/45	280,000.00	280,366.80	
		FRTR 3.25 05/25/55	390,000.00	377,796.90	
		FRTR 3.5 04/25/26	240,000.00	243,952.80	
		FRTR 3.5 11/25/33	590,000.00	625,801.20	
		FRTR 4 04/25/60	60,000.00	67,523.40	
		FRTR 4 10/25/38	210,000.00	232,719.90	
		FRTR 4.5 04/25/41	280,000.00	328,750.80	
		FRTR 4.75 04/25/35	100,000.00	117,269.00	
		FRTR 5.5 04/25/29	340,000.00	384,251.00	
		FRTR 5.75 10/25/32	140,000.00	171,173.80	
		FRTR 6 10/25/25	180,000.00	186,492.60	
		IRISH 0 10/18/31	50,000.00	42,540.50	
		IRISH 0.2 05/15/27	100,000.00	95,015.00	
		IRISH 0.2 10/18/30	120,000.00	106,312.80	
		IRISH 0.35 10/18/32	160,000.00	136,646.40	
		IRISH 0.9 05/15/28	170,000.00	162,673.00	
		IRISH 1 05/15/26	30,000.00	29,358.60	
		IRISH 1.1 05/15/29	50,000.00	47,578.50	
		IRISH 1.35 03/18/31	40,000.00	37,789.60	
		IRISH 1.5 05/15/50	100,000.00	76,083.00	
		IRISH 1.7 05/15/37	60,000.00	53,830.80	
		IRISH 2.4 05/15/30	80,000.00	80,630.40	
		IRISH 2.6 10/18/34	50,000.00	50,456.50	
		IRISH 3 10/18/43	120,000.00	123,705.60	
		IRISH GOVT 0.55 04/22/41	60,000.00	42,515.40	
		NETHER 0 01/15/26	100,000.00	96,940.00	
		NETHER 0 01/15/27	260,000.00	247,613.60	
		NETHER 0 01/15/29	330,000.00	300,864.30	
		NETHER 0 01/15/38	220,000.00	156,450.80	
		NETHER 0 01/15/52	80,000.00	40,334.40	
		NETHER 0 07/15/30	340,000.00	299,461.80	
		NETHER 0.25 07/15/29	60,000.00	54,790.80	
		NETHER 0.5 01/15/40	340,000.00	250,892.80	
		NETHER 0.5 07/15/26	100,000.00	97,010.00	
		NETHER 0.5 07/15/32	40,000.00	34,928.00	
		NETHER 0.75 07/15/27	190,000.00	182,979.50	
		NETHER 0.75 07/15/28	150,000.00	142,419.00	
		NETHER 2 01/15/54	140,000.00	122,617.60	
		NETHER 2.5 01/15/33	100,000.00	101,325.00	
		NETHER 2.5 07/15/33	380,000.00	384,385.20	
		NETHER 2.5 07/15/34	70,000.00	70,557.90	
		NETHER 2.75 01/15/47	80,000.00	81,850.40	

NETHER 3.25 01/15/44	290,000.00	316,883.00	
NETHER 4 01/15/37	110,000.00	126,965.30	
OBL 0 04/10/26	570,000.00	550,756.80	
OBL 0 04/16/27	360,000.00	341,834.40	
OBL 0 10/09/26	410,000.00	392,771.80	
OBL 0 10/10/25	100,000.00	97,432.00	
OBL 1.3 10/15/27	270,000.00	264,643.20	
OBL 1.3 10/15/27	70,000.00	68,615.40	
OBL 2.1 04/12/29	130,000.00	130,565.50	
OBL 2.1 04/12/29	380,000.00	381,805.00	
OBL 2.2 04/13/28	350,000.00	352,485.00	
OBL 2.4 10/19/28	350,000.00	355,488.00	
OBL 2.5 10/11/29	300,000.00	307,233.00	
RAGB 0 02/20/30	70,000.00	61,576.90	
RAGB 0 02/20/31	170,000.00	145,446.90	
RAGB 0 10/20/28	190,000.00	173,109.00	
RAGB 0 10/20/40	260,000.00	163,992.40	
RAGB 0.25 10/20/36	60,000.00	44,550.60	
RAGB 0.5 02/20/29	110,000.00	101,764.30	
RAGB 0.5 04/20/27	230,000.00	220,034.10	
RAGB 0.7 04/20/71	70,000.00	33,426.40	
RAGB 0.75 02/20/28	80,000.00	76,049.60	
RAGB 0.75 03/20/51	130,000.00	78,429.00	
RAGB 0.75 10/20/26	60,000.00	58,145.40	
RAGB 0.9 02/20/32	100,000.00	89,252.00	
RAGB 1.5 11/02/86	20,000.00	12,580.80	
RAGB 1.85 05/23/49	190,000.00	153,292.00	
RAGB 2.9 02/20/33	180,000.00	184,339.80	
RAGB 2.9 02/20/34	370,000.00	378,558.10	
RAGB 3.15 06/20/44	50,000.00	51,395.50	
RAGB 3.15 10/20/53	50,000.00	51,362.50	
RAGB 3.2 07/15/39	80,000.00	83,028.00	
RAGB 3.45 10/20/30	140,000.00	148,065.40	
RAGB 3.8 01/26/62	20,000.00	23,705.00	
RAGB 4.15 03/15/37	90,000.00	102,744.00	
RAGB 4.85 03/15/26	150,000.00	155,163.00	
RAGB 6.25 07/15/27	80,000.00	88,674.40	
RFGB 0 09/15/26	120,000.00	114,651.60	
RFGB 0 09/15/30	50,000.00	43,354.00	
RFGB 0.125 04/15/36	40,000.00	29,655.20	
RFGB 0.125 04/15/52	60,000.00	29,244.00	
RFGB 0.125 09/15/31	40,000.00	34,057.60	

		RFGB 0.25 09/15/40	70,000.00	46,546.50	
		RFGB 0.5 04/15/26	70,000.00	68,017.60	
		RFGB 0.5 04/15/43	10,000.00	6,563.30	
		RFGB 0.5 09/15/28	160,000.00	149,200.00	
		RFGB 0.5 09/15/29	50,000.00	45,662.00	
		RFGB 0.75 04/15/31	60,000.00	53,895.60	
		RFGB 1.125 04/15/34	100,000.00	87,534.00	
		RFGB 1.375 04/15/47	10,000.00	7,492.70	
		RFGB 1.5 09/15/32	260,000.00	240,929.00	
		RFGB 2.625 07/04/42	10,000.00	9,619.70	
		RFGB 2.75 04/15/38	100,000.00	98,884.00	
		RFGB 2.95 04/15/55	30,000.00	29,971.80	
		RFGB 3 09/15/34	70,000.00	72,125.90	
		SPGB 0 01/31/26	300,000.00	289,755.00	
		SPGB 0 01/31/27	440,000.00	416,015.60	
		SPGB 0 01/31/28	450,000.00	415,728.00	
		SPGB 0.1 04/30/31	310,000.00	263,887.50	
		SPGB 0.5 04/30/30	510,000.00	457,470.00	
		SPGB 0.5 10/31/31	200,000.00	172,870.00	
		SPGB 0.6 10/31/29	100,000.00	91,146.00	
		SPGB 0.7 04/30/32	540,000.00	468,045.00	
		SPGB 0.8 07/30/27	300,000.00	287,190.00	
		SPGB 0.8 07/30/29	100,000.00	92,449.00	
		SPGB 0.85 07/30/37	500,000.00	379,395.00	
		SPGB 1 07/30/42	370,000.00	253,949.50	
		SPGB 1 10/31/50	40,000.00	23,073.20	
		SPGB 1.2 10/31/40	400,000.00	294,588.00	
		SPGB 1.25 10/31/30	170,000.00	157,693.70	
		SPGB 1.4 04/30/28	370,000.00	357,675.30	
		SPGB 1.4 07/30/28	440,000.00	424,221.60	
		SPGB 1.45 04/30/29	420,000.00	402,309.60	
		SPGB 1.45 10/31/27	180,000.00	175,132.80	
		SPGB 1.45 10/31/71	140,000.00	73,336.20	
		SPGB 1.5 04/30/27	190,000.00	185,907.40	
		SPGB 1.85 07/30/35	20,000.00	17,964.60	
		SPGB 1.9 10/31/52	210,000.00	148,551.90	
		SPGB 1.95 04/30/26	180,000.00	178,592.40	
		SPGB 1.95 07/30/30	210,000.00	203,735.70	
		SPGB 2.35 07/30/33	100,000.00	96,664.00	
		SPGB 2.5 05/31/27	790,000.00	792,125.10	
		SPGB 2.55 10/31/32	110,000.00	108,730.60	
		SPGB 2.8 05/31/26	320,000.00	321,686.40	

		SPGB 3.15 04/30/33	200,000.00	205,846.00	
		SPGB 3.25 04/30/34	300,000.00	309,450.00	
		SPGB 3.45 07/30/43	270,000.00	269,900.10	
		SPGB 3.45 07/30/66	130,000.00	124,282.60	
		SPGB 3.45 10/31/34	150,000.00	156,910.50	
		SPGB 3.5 05/31/29	340,000.00	355,561.80	
		SPGB 3.55 10/31/33	260,000.00	275,043.60	
		SPGB 3.9 07/30/39	560,000.00	600,667.20	
		SPGB 4 10/31/54	250,000.00	265,695.00	
		SPGB 4.2 01/31/37	130,000.00	144,947.40	
		SPGB 4.7 07/30/41	50,000.00	58,747.00	
		SPGB 5.75 07/30/32	70,000.00	85,155.70	
		SPGB 6 01/31/29	70,000.00	80,361.40	
	ユーロ小計		73,960,000.00	69,811,481.90 (10,928,987,491)	
国債証券合計				35,995,014,946 (35,995,014,946)	
合　計				35,995,014,946 (35,995,014,946)	

(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	233 銘柄	44.6%	46.6%
カナダ・ドル	国債証券	34 銘柄	1.9%	2.0%
オーストラリア・ドル	国債証券	22 銘柄	1.3%	1.3%
シンガポール・ドル	国債証券	15 銘柄	0.9%	0.9%
ニュージーランド・ドル	国債証券	9 銘柄	0.3%	0.3%
イギリス・ポンド	国債証券	56 銘柄	5.3%	5.5%
イスラエル・シュケル	国債証券	11 銘柄	0.3%	0.3%
デンマーク・クローネ	国債証券	7 銘柄	0.3%	0.3%
ノルウェー・クローネ	国債証券	10 銘柄	0.1%	0.2%
スウェーデン・クローナ	国債証券	7 銘柄	0.1%	0.2%
メキシコ・ペソ	国債証券	13 銘柄	0.7%	0.7%
オフショア・人民元	国債証券	36 銘柄	10.4%	10.8%
ポーランド・ズロチ	国債証券	12 銘柄	0.5%	0.5%
ユーロ	国債証券	321 銘柄	29.1%	30.4%

②デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

三井住友・資産最適化ファンド（１安定重視型）

2024年9月30日現在

Ⅰ　資産総額	13,091,256,903円
Ⅱ　負債総額	9,527,525円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	13,081,729,378円
Ⅳ　発行済口数	12,340,742,420口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ） （１万口当たり純資産額）	1.0600円 （10,600円）

三井住友・資産最適化ファンド（２やや安定型）

2024年9月30日現在

Ⅰ　資産総額	7,068,946,620円
Ⅱ　負債総額	5,148,087円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	7,063,798,533円
Ⅳ　発行済口数	5,613,612,641口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ） （１万口当たり純資産額）	1.2583円 （12,583円）

三井住友・資産最適化ファンド（３バランス型）

2024年9月30日現在

Ⅰ　資産総額	20,808,522,883円
Ⅱ　負債総額	15,453,177円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	20,793,069,706円
Ⅳ　発行済口数	14,058,867,225口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ） （１万口当たり純資産額）	1.4790円 （14,790円）

三井住友・資産最適化ファンド（４やや成長型）

2024年9月30日現在

Ⅰ　資産総額	10,150,496,347円
Ⅱ　負債総額	8,438,478円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	10,142,057,869円
Ⅳ　発行済口数	6,034,675,959口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ） （１万口当たり純資産額）	1.6806円 （16,806円）

三井住友・資産最適化ファンド（５成長重視型）

2024年9月30日現在

Ⅰ　資産総額	11,039,626,426 円
Ⅱ　負債総額	22,364,999 円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	11,017,261,427 円
Ⅳ　発行済口数	5,871,730,135 口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ） （１万口当たり純資産額）	1.8763 円 （18,763 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たときまたはやむを得ない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

（ロ）受益権の譲渡制限および譲渡の対抗要件

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

ホ　受益権の再分割

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

ヘ　償還金

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

ト　質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

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

第三部【委託会社等の情報】

第１【委託会社等の概況】

１【委託会社等の概況】

イ　資本金の額および株式数

	2024年9月30日現在
資本金の額	20億円
会社が発行する株式の総数	60,000,000株
発行済株式総数	33,870,060株

ロ　最近５年間における資本金の額の増減

該当ありません。

ハ　会社の機構

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

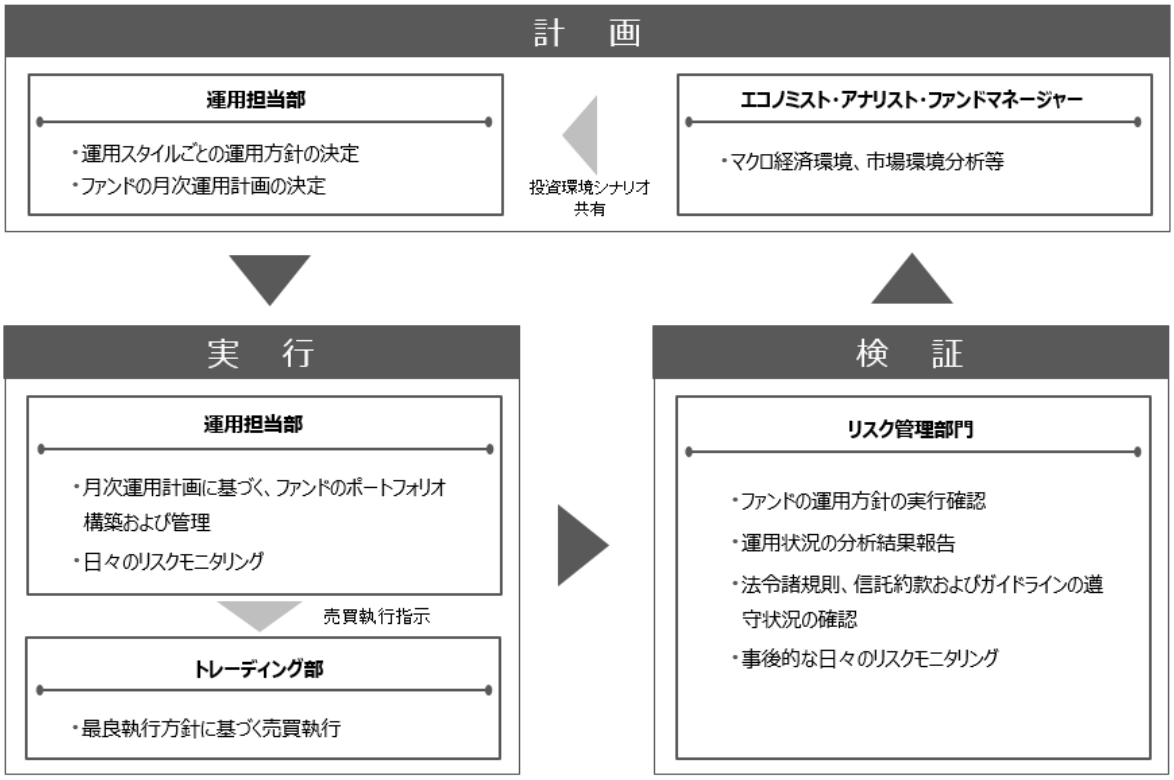
取締役の任期は、選任後１年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会の終結の時までとし、補欠または増員によって選任された取締役の任期は、他の現任取締役の任期の満了する時までとします。

委託会社の業務上重要な事項は、取締役会の決議により決定します。

取締役会は、取締役会の決議によって、代表取締役若干名を選定します。

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

ニ　投資信託の運用の流れ



2【事業の内容及び営業の概況】

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

2024 年 9 月 30 日現在、委託会社が運用を行っている投資信託（親投資信託は除きます）は、以下の通りです。

	本　数（本）	純資産総額（百万円）
追加型株式投資信託	656	12,573,982
単位型株式投資信託	85	656,370
追加型公社債投資信託	1	22,975
単位型公社債投資信託	146	233,812
合　計	888	13,487,141

3【委託会社等の経理状況】

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

2　当社は、当事業年度（2023 年 4 月 1 日から 2024 年 3 月 31 日まで）の財務諸表については、金融商品取引法第 193 条の 2 第 1 項の規定に基づき、有限責任 あずさ監査法人の監査を受けております。

独立監査人の監査報告書

2024年6月14日

三井住友DSアセットマネジメント株式会社
　取締役会　御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	佐　藤　栄　裕
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	深　井　康　治

監査意見

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

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

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

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

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

財務諸表に対する経営者並びに監査役及び監査役会の責任

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

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

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

ることにある。

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

・ 財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。

・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。

・ 経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、企業は継続企業として存続できなくなる可能性がある。

・ 財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

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

利害関係

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

以　上

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

（1）【貸借対照表】

（単位：千円）

		前事業年度 (2023年3月31日)	当事業年度 (2024年3月31日)
資産の部			
流動資産			
現金及び預金		37,742,400	66,540,261
金銭の信託		12,645,575	23,435,831
顧客分別金信託		300,046	300,051
前払費用		546,900	583,635
未収入金		437,880	193,837
未収委託者報酬		11,563,662	14,480,419
未収運用受託報酬		2,138,030	3,342,186
未収投資助言報酬		344,586	406,420
未収収益		35,477	84,166
その他の流動資産		8,423	43,391
流動資産合計		65,762,982	109,410,202
固定資産			
有形固定資産	※1		
建物		1,361,305	1,265,924
器具備品		559,057	516,485
土地		710	710
リース資産		4,114	1,782
建設仮勘定		81,240	－
有形固定資産合計		2,006,427	1,784,901
無形固定資産			
ソフトウェア		2,414,295	2,606,617
ソフトウェア仮勘定		508,956	101,101
のれん		3,045,409	2,740,868
顧客関連資産		11,445,340	9,332,065
電話加入権		12,706	12,706
商標権		36	30
無形固定資産合計		17,426,744	14,793,389
投資その他の資産			
投資有価証券		9,222,276	9,976,957
関係会社株式		11,850,598	1,927,221
長期差入保証金		1,388,987	1,361,654
長期前払費用		80,207	44,009
会員権		90,479	90,479
繰延税金資産		－	716,093
貸倒引当金		△ 20,750	△ 20,750
投資その他の資産合計		22,611,799	14,095,666
固定資産合計		42,044,971	30,673,957
資産合計		107,807,953	140,084,160

（単位：千円）

	前事業年度 (2023年3月31日)	当事業年度 (2024年3月31日)
負債の部		
流動負債		
リース債務	2,564	1,960
顧客からの預り金	11,094	21,728
その他の預り金	128,069	166,944
未払金		
未払収益分配金	2,013	1,927
未払償還金	1,312	1,253
未払手数料	5,194,011	6,580,971
その他未払金	259,542	642,514
未払費用	6,370,986	7,405,559
未払消費税等	406,770	937,155
未払法人税等	333,009	5,104,541
賞与引当金	1,801,492	2,854,060
資産除去債務	13,940	－
その他の流動負債	73,657	17,443
流動負債合計	14,598,465	23,736,060
固定負債		
リース債務	1,960	－
繰延税金負債	550,493	－
退職給付引当金	5,027,832	4,941,989
固定負債合計	5,580,287	4,941,989
負債合計	20,178,752	28,678,050
純資産の部		
株主資本		
資本金	2,000,000	2,000,000
資本剰余金		
資本準備金	8,628,984	8,628,984
その他資本剰余金	73,466,962	73,466,962
資本剰余金合計	82,095,946	82,095,946
利益剰余金		
利益準備金	284,245	284,245
その他利益剰余金		
繰越利益剰余金	3,391,568	27,075,963
利益剰余金合計	3,675,814	27,360,208
株主資本計	87,771,760	111,456,155
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	△ 142,558	△ 50,045
評価・換算差額等合計	△ 142,558	△ 50,045
純資産合計	87,629,201	111,406,109
負債・純資産合計	107,807,953	140,084,160

（2）【損益計算書】

（単位：千円）

	前事業年度 （自　2022年4月1日 至　2023年3月31日）	当事業年度 （自　2023年4月1日 至　2024年3月31日）
営業収益		
委託者報酬	61,471,271	69,953,226
運用受託報酬	8,978,419	11,147,187
投資助言報酬	1,273,386	1,302,916
その他営業収益		
サービス支援手数料	208,222	319,553
その他	22,995	8,758
営業収益計	71,954,296	82,731,642
営業費用		
支払手数料	28,036,456	32,014,851
広告宣伝費	294,588	320,694
調査費		
調査費	3,749,357	4,637,211
委託調査費	11,455,987	12,412,033
営業雑経費		
通信費	61,068	56,291
印刷費	452,951	457,187
協会費	38,701	38,305
諸会費	33,447	30,484
情報機器関連費	5,067,617	5,268,275
販売促進費	29,621	31,339
その他	197,696	253,344
営業費用合計	49,417,495	55,520,019
一般管理費		
給料		
役員報酬	219,872	232,329
給料・手当	7,807,797	8,043,456
賞与	1,042,472	1,073,375
賞与引当金繰入額	1,798,492	2,854,060
交際費	27,713	57,134
寄付金	25,518	26,400
事務委託費	1,727,189	2,022,734
旅費交通費	99,733	166,596
租税公課	352,030	600,468
不動産賃借料	1,268,303	1,249,392
退職給付費用	624,551	712,228
固定資産減価償却費	3,247,869	3,281,572
のれん償却費	304,540	304,540
諸経費	200,758	215,455
一般管理費合計	18,746,845	20,839,745
営業利益	3,789,956	6,371,877

（単位：千円）

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

（3）【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自　2022年4月1日　至　2023年3月31日）

（単位：千円）

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

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

当事業年度（自　2023年4月1日　至　2024年3月31日）

（単位：千円）

	株主資本					
	資本金	資本剰余金			利益剰余金	
		資本準備金	その他資本剰余金	資本剰余金合計	利益準備金	その他利益剰余金
						繰越利益剰余金
当期首残高	2,000,000	8,628,984	73,466,962	82,095,946	284,245	3,391,568
当期変動額						
剰余金の配当						△ 1,591,892
当期純利益						25,276,287
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）						
当期変動額合計	－	－	－	－	－	23,684,394
当期末残高	2,000,000	8,628,984	73,466,962	82,095,946	284,245	27,075,963

	株主資本		評価・換算差額等		純資産合計
	利益剰余金	株主資本合計	その他有価証券評価差額金	評価・換算差額等合計	
	利益剰余金合計				
当期首残高	3,675,814	87,771,760	△ 142,558	△ 142,558	87,629,201
当期変動額					
剰余金の配当	△ 1,591,892	△ 1,591,892			△ 1,591,892
当期純利益	25,276,287	25,276,287			25,276,287
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）			92,513	92,513	92,513
当期変動額合計	23,684,394	23,684,394	92,513	92,513	23,776,908
当期末残高	27,360,208	111,456,155	△ 50,045	△ 50,045	111,406,109

[注記事項]

(重要な会計方針)
1.重要な資産の評価基準及び評価方法
(1)有価証券
①子会社株式
移動平均法による原価法

②その他有価証券
市場価格のない株式等以外
決算日の市場価格等に基づく時価法
(評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定)
市場価格のない株式等
移動平均法による原価法
投資事業有限責任組合及びそれに類する組合への出資(金融商品取引法第2条第2項により有価証券とみなされるもの)
組合契約に規定される決算報告日に応じて入手可能な最近の決算書を基礎とし、持分相当額を純額で取り込む方法によっております。

(2)金銭の信託
運用目的の金銭の信託:時価法

2.固定資産の減価償却の方法
(1)有形固定資産(リース資産を除く)
定率法によっております。但し、建物(建物附属設備を除く)並びに2016年4月1日以降に取得した建物附属設備については、定額法によっております。
なお、主な耐用年数は次のとおりであります。

建物	8～30年
器具備品	4～15年

(2)無形固定資産(リース資産を除く)
定額法によっております。
なお、主な償却年数は次のとおりであります。

のれん	14年
顧客関連資産	6～19年
ソフトウェア(自社利用分)	5年

(3)リース資産
所有権移転外ファイナンス・リース取引に係るリース資産
リース期間を耐用年数とし、残存価額を零とする定額法を採用しております。

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

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

(3)退職給付引当金
従業員の退職金支給に備えるため、当事業年度末における退職給付債務の見込額に基づき、当事業年度において発生していると認められる額を計上しております。
①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。

②数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法
過去勤務費用については、その発生時において一時に費用処理しております。
数理計算上の差異については、その発生時において一時に費用処理しております。

4.収益及び費用の計上基準
当社の顧客との契約から生じる収益に関する主要な事業における主な履行義務の内容及び収益を認識する通常の時点は以下のとおりであります。
(1)委託者報酬
委託者報酬は、投資信託の信託約款に基づき日々の純資産額に対する一定割合として認識され、確定した報酬を受け取ります。当該報酬は投資信託の運用期間にわたり収益として認識しております。

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

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

(貸借対照表関係)
※1 有形固定資産の減価償却累計額

	前事業年度 (2023年3月31日)	当事業年度 (2024年3月31日)
建物	301,463千円	397,568千円
器具備品	1,499,284千円	1,493,885千円
リース資産	7,493千円	9,824千円

2 当座借越契約
当社は、運転資金の効率的な調達を行うため取引銀行1行と当座借越契約を締結しております。当座借越契約に係る借入金未実行残高等は次のとおりであります。

	前事業年度 (2023年3月31日)	当事業年度 (2024年3月31日)
当座借越極度額の総額	10,000,000千円	10,000,000千円
借入実行残高	－千円	－千円
差引額	10,000,000千円	10,000,000千円

3 保証債務
前事業年度は、当社は、子会社であるSumitomo Mitsui DS Asset Management(USA)Inc.における賃貸借契約に係る賃借料に対し、2023年6月までの賃借料総額の支払保証を行っております。
当事業年度は、該当事項はありません。

	前事業年度 (2023年3月31日)	当事業年度 (2024年3月31日)
Sumitomo Mitsui DS Asset Management (USA)Inc.	12,514千円	－千円

(損益計算書関係)
※1 子会社売却益
日興グローバルラップ株式会社の株式を譲渡したことによる売却益であります。

※2　固定資産除却損

	前事業年度 （自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）	当事業年度 （自 2023年4月1日 至 2024年3月31日）
建物	2,482千円	9,039千円
器具備品	4,273千円	2,987千円
リース資産	532千円	－千円
ソフトウェア	5,915千円	358千円

※3　早期退職費用

早期希望退職の募集等の実施に関連して発生する費用であります。

※4　支払補償費

受益者や販売会社に生じた損失の補償に伴い発生する費用であります。

（株主資本等変動計算書関係）

前事業年度（自 2022年4月1日　至 2023年3月31日）

1．発行済株式数に関する事項

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

2．剰余金の配当に関する事項

配当金支払額等

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

基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生が翌事業年度になるもの

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

当事業年度（自 2023年4月1日　至 2024年3月31日）

1．発行済株式数に関する事項

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

2．剰余金の配当に関する事項

配当金支払額等

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

基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生が翌事業年度になるもの

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

（リース取引関係）
オペレーティング・リース取引
（借主側）
オペレーティング・リース取引のうち解約不能のものに係る未経過リース料

（単位：千円）

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

（金融商品関係）
1．金融商品の状況に関する事項
(1)金融商品に対する取組方針
当社は、投資運用業及び投資助言業などの金融サービス事業を行っており、当社が設定する投資信託の事業推進等を目的として、直接または特定金外信託を通じて当該投資信託を保有しております。特定金外信託を通じ行っているデリバティブ取引については、保有する投資信託にかかる将来の為替及び価格の変動によるリスクの軽減を目的としているため、投資信託保有残高の範囲内で行うこととし、投機目的のためのデリバデ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、資金調達は行っておりません。

(2)金融商品の内容及びそのリスク
営業債権である未収運用受託報酬及び未収投資助言報酬は、顧客の信用リスクに晒されています。未収委託者報酬は、信託財産中から支弁されるものであり、信託財産については受託者である信託銀行において分別管理されているため、リスクは僅少となっています。
金銭の信託及び投資有価証券については、主に事業推進目的のために保有する当社が設定する投資信託等であり、市場価格の変動リスク及び発行体の信用リスクに晒されています。関係会社株式については、主に全額出資の子会社の株式であり、発行体の信用リスクに晒されています。
営業債務である未払手数料は、すべて1年以内の支払期日であります。

(3)金融商品に係るリスク管理体制
①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。
②市場リスクの管理
金銭の信託及び投資有価証券については、自己勘定資産の運用・管理に関する規程に従い、各所管部においては所管する有価証券について管理を、経営企画部においては総合的なリスク管理を行い、定期的に時価を把握しています。また、資産の自己査定及び償却・引当規程に従い、その状況について取締役会に報告しています。
なお、事業推進目的のために保有する当社が設定する投資信託等については、純資産額に対する保有制限を設けており、また、自社設定投信等の取得・処分に関する規則に従い、定期的に取締役会において報告し、投資家の資金性格、金額、および投資家数等の状況から検討した結果、目的が達成されたと判断した場合には速やかに処分することとしています。
また、特定金外信託を通じ保有している投資信託につきましては、市場価格の変動リスクについて為替予約、株価指数先物、債券先物、スワップ取引などのデリバティブ取引により一部リスクヘッジしております。

2．金融商品の時価等に関する事項

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

前事業年度（2023年3月31日）

(単位：千円)

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

当事業年度（2024年3月31日）

(単位：千円)

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

(注1)市場価格のない金融商品の貸借対照表計上額

(単位：千円)

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

3．金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項

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

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

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

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

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

時価で貸借対照表に計上している金融商品

前事業年度（2023年3月31日）

(単位：千円)

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

当事業年度（2024年3月31日）　　（単位：千円）

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

時価の算定に用いた評価技法及び時価の算定に係るインプットの説明

(1) 金銭の信託

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

(2) 投資有価証券①その他有価証券

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

（有価証券関係）

1．子会社株式

前事業年度（2023年3月31日）

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

当事業年度（2024年3月31日）

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

2．その他有価証券

前事業年度（2023年3月31日）

（単位：千円）

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

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

当事業年度（2024年3月31日）

（単位：千円）

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

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

３．事業年度中に売却したその他有価証券
前事業年度(自 2022 年４月１日　至 2023 年３月 31 日)

(単位：千円)

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

(単位：千円)

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

当事業年度(自 2023 年４月１日　至 2024 年３月 31 日)

(単位：千円)

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

(単位：千円)

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

(退職給付関係)
１．採用している退職給付制度の概要
当社は、確定給付型の制度として、退職一時金制度を設けております。また、確定拠出型の制度として、確定拠出年金制度を設けております。

２．確定給付制度
(1)退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

(単位：千円)

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

(2)退職給付債務の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金の調整表

(単位：千円)

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

(3)退職給付費用及びその内訳項目の金額

(単位：千円)

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

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

(4)数理計算上の計算基礎に関する事項

主要な数理計算上の計算基礎（加重平均で表わしております。）

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

3．確定拠出制度

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

(税効果会計関係)

1．繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

(単位：千円)

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

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

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

(収益認識関係)

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

(セグメント情報等)

前事業年度(自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)

1.セグメント情報

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

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

2.関連情報

(1)製品及びサービスごとの情報

(単位：千円)

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

(2)地域ごとの情報

①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。

②有形固定資産

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

(3)主要な顧客ごとの情報

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

3.報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

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

4.報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

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

5.報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

該当事項はありません。

当事業年度(自 2023年4月1日 至2024年3月31日)

1.セグメント情報

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

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

2.関連情報

(1)製品及びサービスごとの情報

(単位:千円)

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

(2)地域ごとの情報

①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。

②有形固定資産

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

(3)主要な顧客ごとの情報

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

3.報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

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

4.報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

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

5.報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

該当事項はありません。

(関連当事者情報)

前事業年度(自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)

1.関連当事者との取引

(1)兄弟会社等

(単位:千円)

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

(注) 取引条件及び取引条件の決定方針等

投信の販売委託については、一般取引条件を基に、協議の上決定しております。

2.親会社に関する注記

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

当事業年度(自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)

1．関連当事者との取引

(1)兄弟会社等

(単位：千円)

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金、出資金又は基金	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額	科目	期末残高
親会社の子会社	㈱三井住友銀行	東京都千代田区	1,770,996,505	銀行業	% ―	投信の販売委託 役員の兼任	委託販売手数料	6,642,605	未払手数料	1,630,250
親会社の子会社	SMBC 日興証券㈱	東京都千代田区	135,000,000	証券業	% ―	投信の販売委託 役員の兼任	委託販売手数料	6,960,278	未払手数料	1,200,878

(注) 取引条件及び取引条件の決定方針等

投信の販売委託については、一般取引条件を基に、協議の上決定しております。

2．親会社に関する注記

(単位：千円)

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

(注) 子会社株式の売却及び子会社株式売却益

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

(1株当たり情報)

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

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

2. 1株当たり当期純利益の算定上の基礎は、次のとおりであります。

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

4【利害関係人との取引制限】

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

イ　自己またはその取締役もしくは執行役との間における取引を行うことを内容とした運用を行うこと(投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。)。

ロ　運用財産相互間において取引を行うことを内容とした運用を行うこと(投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。)。

ハ　通常の取引の条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託会社の親法人等（委託会社の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。）または子法人等（委託会社が総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。）と有価証券の売買その他の取引または店頭デリバティブ取引を行うこと。

ニ　委託会社の親法人等または子法人等の利益を図るため、その行う投資運用業に関して運用の方針、運用財産の額もしくは市場の状況に照らして不必要な取引を行うことを内容とした運用を行うこと。

ホ　上記ハ、ニに掲げるもののほか、委託会社の親法人等または子法人等が関与する行為であって、投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのあるものとして内閣府令で定める行為。

5【その他】

イ　定款の変更、その他の重要事項

（イ）定款の変更

該当ありません。

（ロ）その他の重要事項

該当ありません。

ロ　訴訟事件その他会社に重要な影響を与えることが予想される事実

該当ありません。

追加型証券投資信託
三井住友・資産最適化ファンド（１安定重視型）
約款

三井住友ＤＳアセットマネジメント株式会社

〔運用の基本方針〕

信託約款第19条に基づき、委託者の定める運用の基本方針は以下の通りとします。

１．基本方針

この投資信託は、世界各国の債券、株式および不動産投資信託（リート）等に分散投資することにより、長期的な視点の基に安定的な収益の確保と信託財産の安定的な成長を目指して運用を行います。

２．運用方法

(1) 投資対象

別に定める投資信託証券を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

① 主として別に定める投資信託証券への投資を通じて、世界各国の債券、株式および不動産投資信託（リート）等に分散投資することにより、長期的な視点の基に安定的な収益の確保と信託財産の安定的な成長を目指して運用を行います。

・主として、国内株式、先進国株式（除く日本）、新興国株式、国内リート、外国リート、国内債券、先進国債券（除く日本）、為替ヘッジ付き先進国債券（除く日本）、新興国債券に投資します。

・別に定める投資信託証券は、継続的にモニタリングを行い必要な場合は追加・入替えも行います。

② イボットソン・アソシエイツ・ジャパン株式会社の助言に基づき、基本資産配分比率を決定します。

・基本資産配分比率は、各資産の期待収益率やリスク（標準偏差）および資産間の相関係数等を推計・最適化して算出します。

③ 実質組入外貨建資産については、別に定める投資信託証券内で対円での為替ヘッジを行っている場合を除き、原則として対円での為替ヘッジを行いません。

④ 投資信託証券の組入比率は、原則として高位を保ちます。

⑤ 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。

(3) 投資制限

① 投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。

② 投資信託証券とコマーシャル・ペーパーおよび短期社債等以外の有価証券への投資は、買い現先取引または債券貸借取引に限ります。

③ 外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。

④ 投資信託証券を組み入れる場合において、一般社団法人投資信託協会規則に定めるエクスポージャーがルックスルーできる場合に該当しないときは、当該投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。

⑤ 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．収益分配方針

年１回（原則として毎年９月15日。休業日の場合は翌営業日）決算を行い、原則として以下の方針に基づき収益分配を行います。

① 分配対象額は、経費控除後の利子、配当等収益と売買益（評価損益を含みます。）等の範囲内とします。

② 収益分配金額は、委託者が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合等には、委託者の判断により分配を行わないことがあります。

③ 留保益の運用については特に制限を定めず、委託者の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。

追加型証券投資信託
『三井住友・資産最適化ファンド（１安定重視型）』
〔信託約款〕

【信託の種類、委託者および受託者】

第１条　この信託は、証券投資信託であり、三井住友ＤＳアセットマネジメント株式会社を委託者とし、三井住友信託銀行株式会社を受託者とします。

②　この信託は、信託法（平成18年法律第108号）（以下「信託法」といいます。）の適用を受けます。

【信託事務の委託】

第２条　受託者は、信託法第28条第１号に基づく信託事務の委託として、信託事務の処理の一部について、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律第１条第１項の規定による信託業務の兼営の認可を受けた一の金融機関（受託者の利害関係人（金融機関の信託業務の兼営等に関する法律第２条第１項にて準用する信託業法第29条第２項第１号に規定する利害関係人をいいます。以下この条、第18条第１項および第２項、第23条において同じ。）を含みます。）と信託契約を締結し、これを委託することができます。

②　前項における利害関係人に対する業務の委託については、受益者の保護に支障を生じることがない場合に行うものとします。

【信託の目的および金額】

第３条　委託者は、金2,000,000円を受益者のために利殖の目的をもって信託し、受託者はこれを引き受けます。

【信託金の限度額】

第４条　委託者は、受託者と合意の上、金2,000億円を限度として信託金を追加することができます。

②　委託者は、受託者と合意の上、前項の限度額を変更することができます。

【信託期間】

第５条　この信託の期間は、信託契約締結日から第41条第１項、第42条第１項、第43条第１項、第45条第２項による信託終了の日までとします。

【受益権の取得申込みの勧誘の種類】

第６条　この信託にかかる受益権の取得申込みの勧誘は、金融商品取引法第２条第３項第１号に掲げる場合に該当し、投資信託及び投資法人に関する法律第２条第８項で定める公募により行われます。

【当初の受益者】

第７条　この信託契約締結当初および追加信託当初の受益者は、委託者の指定する受益権取得申込者とし、第８条の規定により分割された受益権は、その取得申込口数に応じて、取得申込者に帰属します。

【受益権の分割および再分割】

第８条　委託者は、第３条の規定による受益権については2,000,000口に、追加信託によって生じた受益権については、これを追加信託のつど第９条第１項の追加口数に、それぞれ均等に分割します。

②　委託者は、受託者と協議の上、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。

【追加信託の価額および口数、基準価額の計算方法】

第９条　追加信託金は、追加信託を行う日の前営業日の基準価額に、当該追加信託にかかる受益権の口数を乗じた額とします。

②　この信託約款において基準価額とは、信託財産に属する資産（第20条に規定する借入れ公社債を除きます。）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（以下「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。なお、外貨建資産（外国通貨表示の有価証券（以下「外貨建有価証券」といいます。）、預金その他の資産をいいます。以下同じ。）の円換算については、原則として、わが国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します。

③　第22条に規定する予約為替の評価は、原則としてわが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算します。

【信託日時の異なる受益権の内容】

第10条　この信託の受益権は、信託の日時を異にすることにより差異を生ずることはありません。

【受益権の帰属と受益証券の不発行】

第11条　この信託のすべての受益権は、社振法の規定の適用を受けることとし、受益権の帰属は、委託者があらかじめこの信託の受益権を取り扱うことについて同意した一の振替機関（社振法第２条に規定する「振替機関」をいい、以下「振替機関」といいます。）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。）。

② 委託者は、この信託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がある場合を除き、振替受益権を表示する受益証券を発行しません。なお、受益者は、委託者がやむを得ない事情等により受益証券を発行する場合を除き、無記名式受益証券から記名式受益証券への変更の請求、記名式受益証券から無記名式受益証券への変更の請求、受益証券の再発行の請求を行わないものとします。

③ 委託者は、第８条の規定により分割された受益権について、振替機関等の振替口座簿への新たな記載または記録をするため社振法に定める事項の振替機関への通知を行うものとします。振替機関等は、委託者から振替機関への通知があった場合、社振法の規定に従い、その備える振替口座簿への新たな記載または記録を行います。

【受益権の設定にかかる受託者の通知】

第12条　受託者は、第３条の規定による受益権については信託契約締結日に、また、追加信託により生じた受益権については追加信託のつど、振替機関の定める方法により、振替機関へ当該受益権にかかる信託を設定した旨の通知を行います。

【受益権の申込単位および価額】

第13条　指定販売会社（委託者の指定する金融商品取引法第28条第１項に規定する第一種金融商品取引業を行う者および委託者の指定する金融商品取引法第２条第11項に規定する登録金融機関をいいます。以下同じ。）は、第８条第１項の規定により分割される受益権を、その取得申込者に対し、当該指定販売会社がそれぞれ別に定める単位をもって取得申込みに応じることができるものとします。

② 前項の取得申込者は、指定販売会社に、取得申込みと同時にまたはあらかじめ、自己のために開設されたこの信託の受益権の振替を行うための振替機関等の口座を示すものとし、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。なお、指定販売会社は、当該取得申込みの代金（第３項の受益権の価額に当該取得申込みの口数を乗じて得た額をいいます。）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。

③ 第１項の受益権の価額は、取得申込日の翌営業日の基準価額に、指定販売会社がそれぞれ別に定める手数料および当該手数料にかかる消費税および地方消費税（以下「消費税等」といいます。）に相当する金額を加算した価額とします。ただし、この信託契約締結日前の取得申込みにかかる受益権の価額は、１口につき１円に、指定販売会社がそれぞれ別に定める手数料および当該手数料にかかる消費税等相当額を加算した価額とします。

④ 前項の規定にかかわらず、受益者が第37条第２項に基づいて収益分配金を再投資する場合の受益権の価額は、原則として、第31条に規定する各計算期間終了日の基準価額とします。

⑤ 前各項の規定にかかわらず、指定販売会社は、この信託契約締結日以降において、取得申込日が別に定める日のいずれかに当たる場合には、受益者が第37条第２項に基づいて収益分配金を再投資する場合を除き、当該取得申込みに応じません。

⑥ 前各項の規定にかかわらず、委託者は、取引所等における取引の停止、決済機能の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、受益権の取得申込みの受付けを中止することおよび既に受け付けた取得申込みの受付けを取り消すことができます。

⑦ この信託約款において取引所とは金融商品取引法第２条第17項に規定する取引所金融商品市場および金融商品取引法第２条第８項第３号ロに規定する外国金融商品市場をいいます。

【受益権の譲渡にかかる記載または記録】

第14条　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。

② 前項の申請のある場合には、前項の振替機関等は、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、前項の振替機関等が振替先口座を開設した者でない場合には、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。

③ 委託者は、第１項に規定する振替について、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、委託者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。

【受益権の譲渡の対抗要件】

第15条　受益権の譲渡は、前条の規定による振替口座簿への記載または記録によらなければ、委託者および受託者に対抗することができません。

【投資の対象とする資産の種類】

第16条　この信託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。

１．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。）

イ．有価証券

ロ．約束手形

ハ．金銭債権

２．特定資産以外の資産で、以下に掲げる資産

イ．為替手形

【運用の指図範囲等】

第17条　委託者は、信託金を、主として、別に定める投資信託証券または次の有価証券（金融商品取引法第２条第２項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図します。

１．コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等

２．外国または外国の者の発行する証券で、前号の性質を有するもの

３．国債証券、地方債証券、特別の法律により法人の発行する債券および社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券の新株引受権証券および短期社債等を除きます。）

なお、第３号の証券にかかる運用の指図は買い現先取引（売戻条件付の買入れ）および債券貸借取引（現金担保付債券借入れ）に限り行うことができるものとします。

② 委託者は、信託金を、前項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

③ 第１項の規定にかかわらず、この信託の設定、解約、償還、投資環境の変動等への対応等、委託者が運用上必要と認めるときは、委託者は、信託金を前項に掲げる金融商品により運用することの指図ができます。

【利害関係人等との取引等】

第18条　受託者は、受益者の保護に支障を生じることがないものであり、かつ信託業法、投資信託及び投資法人に関する法律ならびに関連法令に反しない場合には、委託者の指図により、信託財産と、受託者（第三者との間において信託財産のためにする取引その他の行為であって、受託者が当該第三者の代理人となって行うものを含みます。）および受託者の利害関係人、第23条第１項に定める信託業務の委託先およびその利害関係人または受託者における他の信託財産との間で、第

16条、第17条第１項および第２項に定める資産への投資等ならびに第20条、第22条および第26条から第28条までに掲げる取引その他これらに類する行為を行うことができます。

② 受託者は、受託者がこの信託の受託者としての権限に基づいて信託事務の処理として行うことができる取引その他の行為について、受託者または受託者の利害関係人の計算で行うことができるものとします。なお、受託者の利害関係人が当該利害関係人の計算で行う場合も同様とします。

③ 委託者は、金融商品取引法、投資信託及び投資法人に関する法律ならびに関連法令に反しない場合には、信託財産と、委託者、その取締役、執行役および委託者の利害関係人等（金融商品取引法第31条の４第３項および同条第４項に規定する親法人等または子法人等をいいます。）または委託者が運用の指図を行う他の信託財産との間で、第16条、第17条第１項および第２項に定める資産への投資等ならびに第20条、第22条および第26条から第28条までに掲げる取引その他これらに類する行為を行うことの指図をすることができ、受託者は、委託者の指図により、当該投資等ならびに当該取引、当該行為を行うことができます。

④ 前３項の場合、委託者および受託者は、受益者に対して信託法第31条第３項および同法第32条第３項の通知は行いません。

【運用の基本方針】

第19条 委託者は、信託財産の運用にあたっては、別に定める運用の基本方針に従って、その指図を行います。

【公社債の借入れの指図】

第20条 委託者は、信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。なお、当該公社債の借入れを行うにあたり担保の提供が必要と認めたときは、担保の提供の指図をするものとします。

② 前項の指図は、当該借入れにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えない範囲で行うものとします。

③ 信託財産の一部解約等の事由により、前項の借入れにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託者は速やかに、その超える額に相当する借り入れた公社債の一部を返還するための指図をするものとします。

④ 第１項の借入れにかかる品借料は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。

【特別の場合の外貨建有価証券への投資制限】

第21条 外貨建有価証券への投資については、わが国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。

【外国為替予約取引の指図】

第22条 委託者は、信託財産に属する外貨建資産（別に定める投資信託証券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。）について、当該外貨建資産の為替ヘッジのため、外国為替の売買の予約を指図することができます。

② 前項において、信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属する別に定める投資信託証券の時価総額に別に定める投資信託証券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。

【信託業務の委託等】

第23条 受託者は、委託者と協議の上、信託業務の一部について、信託業法第22条第１項に定める信託業務の委託をするときは、以下に掲げる基準のすべてに適合する者（受託者の利害関係人を含みます。）を委託先として選定します。

１．委託先の信用力に照らし、継続的に委託業務の遂行に懸念がないこと

２．委託先の委託業務にかかる実績等に照らし、委託業務を確実に処理する能力があると認められること

３．委託される信託財産に属する財産と自己の固有財産その他の財産とを区分する等の管理を行う体制が整備されていること

４．内部管理に関する業務を適正に遂行するための体制が整備されていること

② 受託者は、前項に定める委託先の選定にあたっては、当該委託先が前項各号に掲げる基準に適合していることを確認するものとします。

③ 前２項にかかわらず、受託者は、次の各号に掲げる業務を、受託者および委託者が適当と認める

者（受託者の利害関係人を含みます。）に委託することができるものとします。

１．信託財産の保存にかかる業務

２．信託財産の性質を変えない範囲内において、その利用または改良を目的とする業務

３．委託者のみの指図により信託財産の処分およびその他の信託の目的の達成のために必要な行為にかかる業務

４．受託者が行う業務の遂行にとって補助的な機能を有する行為

【混蔵寄託】

第24条　金融機関または金融商品取引業者（金融商品取引法第２条第９項に規定するものをいいます。本条においては、外国の法令に準拠して設立された法人でこの者に類する者を含みます。）から、売買代金および償還金等について円貨で約定し円貨で決済する取引により取得した外国において発行された譲渡性預金証書またはコマーシャル・ペーパーは、当該金融機関または金融商品取引業者が保管契約を締結した保管機関に当該金融機関または金融商品取引業者の名義で混蔵寄託することができるものとします。

【信託財産の登記等および記載等の留保等】

第25条　信託の登記または登録をすることができる信託財産については、信託の登記または登録をすることとします。ただし、受託者が認める場合は、信託の登記または登録を留保することがあります。

②　前項ただし書きにかかわらず、受益者保護のために委託者または受託者が必要と認めるときは、速やかに登記または登録をするものとします。

③　信託財産に属する旨の記載または記録をすることができる信託財産については、信託財産に属する旨の記載または記録をするとともに、その計算を明らかにする方法により分別して管理するものとします。ただし、受託者が認める場合は、その計算を明らかにする方法により分別して管理することがあります。

④　動産（金銭を除きます。）については、外形上区別することができる方法によるほか、その計算を明らかにする方法により分別して管理することがあります。

【一部解約の請求および有価証券の売却等の指図】

第26条　委託者は、信託財産に属する投資信託証券にかかる信託契約の一部解約の実行請求ならびに有価証券の売却等の指図ができます。

【再投資の指図】

第27条　委託者は、前条の規定による一部解約の代金、有価証券の売却代金、有価証券にかかる償還金等、有価証券等にかかる利子等およびその他の収入金を再投資することの指図ができます。

【資金の借入れ】

第28条　委託者は、信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性に資するため、一部解約に伴う支払資金の手当て（一部解約に伴う支払資金の手当てのために借り入れた資金の返済を含みます。）を目的として、または再投資にかかる収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金の借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。

②　一部解約に伴う支払資金の手当てにかかる借入期間は、有価証券等の売却代金、解約代金または償還金の入金日までに限るものとし、資金借入額は、次の各号に掲げる要件を満たす範囲内の額とします。

１．一部解約金の支払資金の手当てのために行った有価証券等の売却等による受取りの確定している資金の額の範囲内

２．一部解約金支払日の前営業日において確定した当該支払日における支払資金の不足額の範囲内

３．借入れ指図を行う日における信託財産の純資産総額の10％以内

③　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。

④　借入金の利息は受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。

【損益の帰属】

第29条　委託者の指図に基づく行為により信託財産に生じた利益および損失は、すべて受益者に帰属します。

【受託者による資金の立替え】

第30条　信託財産に属する有価証券について、借替がある場合で、委託者の申し出があるときは、受託者は資金の立替えをすることができます。

②　信託財産に属する有価証券にかかる償還金等、有価証券等にかかる利子等およびその他の未収入金で、信託終了日までにその金額を見積りうるものがあるときは、受託者がこれを立て替えて信託財産に繰り入れることができます。

③　前２項の立替金の決済および利息については、受託者と委託者との協議により、そのつど別にこれを定めます。

【信託の計算期間】

第31条　この信託の計算期間は、毎年９月16日から翌年９月15日までとすることを原則とします。ただし、第１計算期間は平成29年９月14日から平成30年９月18日までとします。

②　前項の規定にかかわらず、前項の原則により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されるものとします。ただし、最終計算期間の終了日は、第５条に規定する信託期間の終了日とします。

【信託財産に関する報告等】

第32条　受託者は、毎計算期末に損益計算を行い、信託財産に関する報告書を作成して、これを委託者に提出します。

②　受託者は、信託終了のときに最終計算を行い、信託財産に関する報告書を作成して、これを委託者に提出します。

③　受託者は、前２項の報告を行うことにより、受益者に対する信託法第37条第３項に定める報告は行わないこととします。

④　受益者は、受託者に対し、信託法第37条第２項に定める書類または電磁的記録の作成に欠くことのできない情報その他の信託に関する重要な情報および当該受益者以外の者の利益を害するおそれのない情報を除き、信託法第38条第１項に定める閲覧または謄写の請求をすることはできないものとします。

【信託事務等の諸費用】

第33条　信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産の財務諸表の監査費用の全部または一部（消費税等相当額を含みます。）および受託者の立て替えた立替金の利息等（以下「諸経費」といいます。）は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。

②　前項の信託財産の財務諸表の監査費用の全部または一部については、第31条に規定する計算期間を通じて毎日、固定率または固定金額にて計算した額を、毎計算期間の最初の６ヵ月終了日および毎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。

【信託報酬等の額】

第34条　委託者および受託者の信託報酬の総額は、第31条に規定する計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に年10,000分の88の率を乗じて得た額とします。

②　前項の信託報酬は、毎計算期間の最初の６ヵ月終了日および毎計算期末または信託終了のとき信託財産中から支弁するものとし、委託者と受託者との間の配分は別に定めます。

③　第１項の信託報酬にかかる消費税等に相当する金額を、信託報酬支弁のときに信託財産中から支弁します。

【収益の処理方法】

第35条　信託財産から生ずる毎計算期末における利益は、次の方法により処理します。

１．配当金、利子およびこれらに類する収益から支払利息を控除した額（以下「配当等収益」といいます。）は、諸経費、信託報酬および当該信託報酬にかかる消費税等に相当する金額を控除した後、その残額を受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配にあてるため、その一部を分配準備積立金として積み立てることができます。

２．売買損益に評価損益を加減した利益金額（以下「売買益」といいます。）は、諸経費、信託報酬および当該信託報酬にかかる消費税等に相当する金額を控除し、繰越欠損金のあるときは、その全額を売買益をもって補てんした後、受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配にあてるため、分配準備積立金として積み立てることができます。

②　毎計算期末において、信託財産につき生じた損失は、次期に繰り越します。

【収益分配金、償還金および一部解約金の払込みと支払いに関する受託者の免責】

第36条　受託者は、収益分配金については原則として毎計算期間終了日の翌営業日に、償還金（信託終了時における信託財産の純資産総額を受益権総口数で除した額をいいます。以下同じ。）については第37条第３項に規定する支払開始日までに、一部解約金については第37条第４項に規定する支払開始日までに、その全額を委託者の指定する預金口座等に払い込みます。

② 受託者は、前項の規定により委託者の指定する預金口座等に収益分配金、償還金および一部解約金を払い込んだ後は、受益者に対する支払いにつき、その責に任じません。

【収益分配金、償還金および一部解約金の支払いならびに収益分配金の再投資】

第37条　収益分配金は、毎計算期間終了日後１ヵ月以内の委託者の指定する日から、毎計算期間の末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（当該収益分配金にかかる計算期間の末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計算期間の末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指定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ます。）に支払います。

② 前項の規定にかかわらず、別に定める「累積投資約款」に従った契約（別の名称で同様の権利義務関係を規定する契約を含むものとし、その場合は、当該別の名称に読み替えるものとします。）に基づいて収益分配金を再投資する受益者に対しては、受託者が委託者の指定する預金口座等に払い込むことにより、原則として、毎計算期間終了日の翌営業日に、収益分配金が指定販売会社に交付されます。この場合、指定販売会社は、受益者に対し遅滞なく収益分配金の再投資にかかる受益権の売付けを行います。当該売付けにより増加した受益権は、第11条第３項の規定に従い、振替口座簿に記載または記録されます。

③ 償還金は、信託終了日後１ヵ月以内の委託者の指定する日から、信託終了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（信託終了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、当該信託終了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指定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ます。）に支払います。なお、当該受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して委託者がこの信託の償還をするのと引換えに、当該償還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。

④ 一部解約金は、第39条第１項の受益者の請求を受け付けた日から起算して、原則として６営業日目から当該受益者に支払います。

⑤ 前各項（第２項を除きます。）に規定する収益分配金、償還金および一部解約金の支払いは、指定販売会社の営業所等において行うものとします。

⑥ 収益分配金、償還金および一部解約金にかかる収益調整金は、原則として、各受益者毎の信託時の受益権の価額等に応じて計算されるものとします。なお、「収益調整金」は、所得税法施行令第27条の規定によるものとし、各受益者毎の信託時の受益権の価額と元本との差額をいい、原則として、追加信託のつど、当該口数により加重平均され、収益分配のつど、調整されるものとします。また、「各受益者毎の信託時の受益権の価額等」とは、原則として、各受益者毎の信託時の受益権の価額をいい、追加信託のつど、当該口数により加重平均され、収益分配のつど、調整されるものとします。

【収益分配金および償還金の時効】

第38条　受益者が、収益分配金については前条第１項に規定する支払開始日から５年間その支払いを請求しないとき、ならびに信託終了による償還金については前条第３項に規定する支払開始日から10年間その支払いを請求しないときは、その権利を失い、受託者から交付を受けた金銭は、委託者に帰属します。

【信託契約の一部解約】

第39条　受益者は、自己に帰属する受益権につき、委託者に１口単位をもって一部解約の実行を請求することができます。

② 前項の規定にかかわらず、委託者は、一部解約の実行の請求日が別に定める日のいずれかに当たる場合には、当該一部解約の実行の請求を受け付けません。

③ 委託者は、第１項の一部解約の実行の請求を受け付けた場合には、この信託契約の一部を解約します。なお、第１項の一部解約の実行の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この信託契約の一部解約を委託者が行うのと引換えに、当該一部解約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。

④ 前項の一部解約の価額は、一部解約の実行の請求日の翌営業日の基準価額とします。

⑤ 受益者が一部解約の実行の請求をするときは、指定販売会社に対し、振替受益権をもって行うものとします。

⑥ 委託者は、取引所等における取引の停止、決済機能の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、第１項による一部解約の実行の請求の受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の請求の受付けを取り消すことができます。

⑦ 前項により一部解約の実行の請求の受付けが中止された場合には、受益者は当該受付け中止前に行った実行されていない一部解約の実行の請求を撤回できます。ただし、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、当該受益権の一部解約の価額は、当該受付け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、第４項の規定に準じて算出した価額とします。

【質権口記載または記録の受益権の取扱い】

第40条 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、この信託約款によるほか、民法その他の法令等に従って取り扱われます。

【信託契約の解約】

第41条 委託者は、信託期間中において、この信託契約を解約することが受益者のため有利であると認めるとき、信託契約の一部を解約することにより受益権の口数が10億口を下回ることとなったとき、その他やむを得ない事情が発生したときは、受託者と合意の上、こ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、委託者は、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。

② 委託者は、前項の事項について、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、この信託契約にかかる知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発します。

③ 前項の書面決議において、受益者（委託者およびこの信託の信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権にかかる受益者としての受託者を除きます。以下本項において同じ。）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。

④ 第２項の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。

⑤ 第２項から前項までの規定は、委託者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、この信託契約にかかる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、第２項から前項までの手続きを行うことが困難な場合も同様とします。

【信託契約に関する監督官庁の命令】

第42条 委託者は、監督官庁よりこ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。

② 委託者は、監督官庁の命令に基づいてこの信託約款を変更しようとするときは、第46条の規定に従います。

【委託者の登録取消等に伴う取扱い】

第43条 委託者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、委託者は、この信託契約を解約し、信託を終了させます。

② 前項の規定にかかわらず、監督官庁がこの信託契約に関する委託者の業務を他の投資信託委託会社に引き継ぐことを命じたときは、この信託は、第46条第２項の書面決議で否決された場合を除き、当該投資信託委託会社と受託者との間において存続します。

【委託者の事業の譲渡および承継に伴う取扱い】

第44条　委託者は、事業の全部または一部を譲渡することがあり、これに伴い、この信託契約に関する事業を譲渡することがあります。

②　委託者は、分割により事業の全部または一部を承継させることがあり、これに伴い、この信託契約に関する事業を承継させることがあります。

【受託者の辞任および解任に伴う取扱い】

第45条　受託者は、委託者の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託者がその任務に違反して信託財産に著しい損害を与えたことその他重要な事由があるときは、委託者または受益者は、裁判所に受託者の解任を申し立てることができます。受託者が辞任した場合、または裁判所が受託者を解任した場合、委託者は、第46条の規定に従い、新受託者を選任します。なお、受益者は、上記によって行う場合を除き、受託者を解任することはできないものとします。

②　委託者が新受託者を選任できないときは、委託者はこの信託契約を解約し、信託を終了させます。

【信託約款の変更等】

第46条　委託者は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託者と合意の上、この信託約款を変更することまたはこの信託と他の信託との併合（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。以下同じ。）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その内容を監督官庁に届け出ます。なお、この信託約款は本条に定める以外の方法によって変更することができないものとします。

②　委託者は、前項の事項（前項の変更事項にあってはその変更の内容が重大なものに該当する場合に限り、併合事項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、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、この信託約款にかかる知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発します。

③　前項の書面決議において、受益者（委託者およびこの信託の信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権にかかる受益者としての受託者を除きます。以下本項において同じ。）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。

④　第２項の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。

⑤　書面決議の効力は、この信託のすべての受益者に対してその効力を生じます。

⑥　第２項から前項までの規定は、委託者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、この信託約款にかかる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。

⑦　前各項の規定にかかわらず、この投資信託において併合の書面決議が可決された場合にあっても、当該併合にかかる一または複数の他の投資信託において当該併合の書面決議が否決された場合は、当該他の投資信託との併合を行うことはできません。

【反対受益者の受益権買取請求の不適用】

第47条　この信託は、受益者が第39条の規定による一部解約の実行の請求を行ったときは、委託者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、第41条に規定する信託契約の解約または前条に規定する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。

【他の受益者の氏名等の開示の請求の制限】

第48条　この信託の受益者は、委託者または受託者に対し、次に掲げる事項の開示の請求を行うことはできません。

１．他の受益者の氏名または名称および住所

２．他の受益者が有する受益権の内容

【信託期間の延長】

第49条　＜削除＞

【運用報告書に記載すべき事項の提供】

第50条　委託者は、投資信託及び投資法人に関する法律第14条第１項に定める運用報告書の交付に代えて、運用報告書に記載すべき事項を電磁的方法により受益者に提供することができます。この場合において、委託者は、運用報告書を交付したものとみなします。

②　前項の規定にかかわらず、委託者は、受益者から運用報告書の交付の請求があった場合には、これを交付するものとします。

【公告】

第51条　委託者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

②　前項の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。

【信託約款に関する疑義の取扱い】

第52条　この信託約款の解釈について疑義を生じたときは、委託者と受託者との協議により定めます。

上記条項により信託契約を締結します。

平成29年９月14日（信託契約締結日）

委託者　　東京都港区愛宕二丁目５番１号
三井住友アセットマネジメント株式会社
代表取締役　　松下　隆史

受託者　　東京都千代田区丸の内一丁目４番１号
三井住友信託銀行株式会社
取締役社長　　橋本　勝

〔付表〕

１．運用の基本方針および信託約款第17条第１項に規定する「別に定める投資信託証券」は下記のものとします。

親投資信託　国内株式インデックス・マザーファンド（Ｂ号）
親投資信託　外国株式インデックス・マザーファンド
親投資信託　エマージング株式インデックス・マザーファンド
親投資信託　Ｊリート・インデックス・マザーファンド
親投資信託　外国リート・インデックス・マザーファンド
親投資信託　国内債券パッシブ・マザーファンド
親投資信託　外国債券パッシブ・マザーファンド
親投資信託　ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド
米国籍米ドル建て投資信託　ｉシェアーズ　Ｊ．Ｐ．モルガン・米ドル建てエマージング・マーケット債券ＥＴＦ

２．信託約款第13条第５項および第39条第２項に規定する「別に定める日」は下記のものとします。

・ニューヨークの取引所の休業日
・ニューヨークの銀行の休業日

追加型証券投資信託
三井住友・資産最適化ファンド（２やや安定型）
約款

三井住友ＤＳアセットマネジメント株式会社

〔運用の基本方針〕

信託約款第19条に基づき、委託者の定める運用の基本方針は以下の通りとします。

１．基本方針

この投資信託は、世界各国の債券、株式および不動産投資信託（リート）等に分散投資することにより、長期的な視点の基に安定的な収益の確保と信託財産の成長を目指して運用を行います。

２．運用方法

(1) 投資対象

別に定める投資信託証券を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

① 主として別に定める投資信託証券への投資を通じて、世界各国の債券、株式および不動産投資信託（リート）等に分散投資することにより、長期的な視点の基に安定的な収益の確保と信託財産の成長を目指して運用を行います。

・主として、国内株式、先進国株式（除く日本）、新興国株式、国内リート、外国リート、国内債券、先進国債券（除く日本）、為替ヘッジ付き先進国債券（除く日本）、新興国債券に投資します。

・別に定める投資信託証券は、継続的にモニタリングを行い必要な場合は追加・入替えも行います。

② イボットソン・アソシエイツ・ジャパン株式会社の助言に基づき、基本資産配分比率を決定します。

・基本資産配分比率は、各資産の期待収益率やリスク（標準偏差）および資産間の相関係数等を推計・最適化して算出します。

③ 実質組入外貨建資産については、別に定める投資信託証券内で対円での為替ヘッジを行っている場合を除き、原則として対円での為替ヘッジを行いません。

④ 投資信託証券の組入比率は、原則として高位を保ちます。

⑤ 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。

(3) 投資制限

① 投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。

② 投資信託証券とコマーシャル・ペーパーおよび短期社債等以外の有価証券への投資は、買い現先取引または債券貸借取引に限ります。

③ 外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。

④ 投資信託証券を組み入れる場合において、一般社団法人投資信託協会規則に定めるエクスポージャーがルックスルーできる場合に該当しないときは、当該投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。

⑤ 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．収益分配方針

年１回（原則として毎年９月15日。休業日の場合は翌営業日）決算を行い、原則として以下の方針に基づき収益分配を行います。

① 分配対象額は、経費控除後の利子、配当等収益と売買益（評価損益を含みます。）等の範囲内とします。

② 収益分配金額は、委託者が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合等には、委託者の判断により分配を行わないことがあります。

③ 留保益の運用については特に制限を定めず、委託者の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。

追加型証券投資信託
『三井住友・資産最適化ファンド（２やや安定型）』
〔信託約款〕

【信託の種類、委託者および受託者】

第１条　この信託は、証券投資信託であり、三井住友ＤＳアセットマネジメント株式会社を委託者とし、三井住友信託銀行株式会社を受託者とします。

②　この信託は、信託法（平成18年法律第108号）（以下「信託法」といいます。）の適用を受けます。

【信託事務の委託】

第２条　受託者は、信託法第28条第１号に基づく信託事務の委託として、信託事務の処理の一部について、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律第１条第１項の規定による信託業務の兼営の認可を受けた一の金融機関（受託者の利害関係人（金融機関の信託業務の兼営等に関する法律第２条第１項にて準用する信託業法第29条第２項第１号に規定する利害関係人をいいます。以下この条、第18条第１項および第２項、第23条において同じ。）を含みます。）と信託契約を締結し、これを委託することができます。

②　前項における利害関係人に対する業務の委託については、受益者の保護に支障を生じることがない場合に行うものとします。

【信託の目的および金額】

第３条　委託者は、金2,000,000円を受益者のために利殖の目的をもって信託し、受託者はこれを引き受けます。

【信託金の限度額】

第４条　委託者は、受託者と合意の上、金2,000億円を限度として信託金を追加することができます。

②　委託者は、受託者と合意の上、前項の限度額を変更することができます。

【信託期間】

第５条　この信託の期間は、信託契約締結日から第41条第１項、第42条第１項、第43条第１項、第45条第２項による信託終了の日までとします。

【受益権の取得申込みの勧誘の種類】

第６条　この信託にかかる受益権の取得申込みの勧誘は、金融商品取引法第２条第３項第１号に掲げる場合に該当し、投資信託及び投資法人に関する法律第２条第８項で定める公募により行われます。

【当初の受益者】

第７条　この信託契約締結当初および追加信託当初の受益者は、委託者の指定する受益権取得申込者とし、第８条の規定により分割された受益権は、その取得申込口数に応じて、取得申込者に帰属します。

【受益権の分割および再分割】

第８条　委託者は、第３条の規定による受益権については2,000,000口に、追加信託によって生じた受益権については、これを追加信託のつど第９条第１項の追加口数に、それぞれ均等に分割します。

②　委託者は、受託者と協議の上、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。

【追加信託の価額および口数、基準価額の計算方法】

第９条　追加信託金は、追加信託を行う日の前営業日の基準価額に、当該追加信託にかかる受益権の口数を乗じた額とします。

②　この信託約款において基準価額とは、信託財産に属する資産（第20条に規定する借入れ公社債を除きます。）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（以下「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。なお、外貨建資産（外国通貨表示の有価証券（以下「外貨建有価証券」といいます。）、預金その他の資産をいいます。以下同じ。）の円換算については、原則として、わが国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します。

③　第22条に規定する予約為替の評価は、原則としてわが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算します。

【信託日時の異なる受益権の内容】

第10条　この信託の受益権は、信託の日時を異にすることにより差異を生ずることはありません。

【受益権の帰属と受益証券の不発行】

第11条　この信託のすべての受益権は、社振法の規定の適用を受けることとし、受益権の帰属は、委託者があらかじめこの信託の受益権を取り扱うことについて同意した一の振替機関（社振法第２条に規定する「振替機関」をいい、以下「振替機関」といいます。）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。）。

② 委託者は、この信託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がある場合を除き、振替受益権を表示する受益証券を発行しません。なお、受益者は、委託者がやむを得ない事情等により受益証券を発行する場合を除き、無記名式受益証券から記名式受益証券への変更の請求、記名式受益証券から無記名式受益証券への変更の請求、受益証券の再発行の請求を行わないものとします。

③ 委託者は、第８条の規定により分割された受益権について、振替機関等の振替口座簿への新たな記載または記録をするため社振法に定める事項の振替機関への通知を行うものとします。振替機関等は、委託者から振替機関への通知があった場合、社振法の規定に従い、その備える振替口座簿への新たな記載または記録を行います。

【受益権の設定にかかる受託者の通知】

第12条　受託者は、第３条の規定による受益権については信託契約締結日に、また、追加信託により生じた受益権については追加信託のつど、振替機関の定める方法により、振替機関へ当該受益権にかかる信託を設定した旨の通知を行います。

【受益権の申込単位および価額】

第13条　指定販売会社（委託者の指定する金融商品取引法第28条第１項に規定する第一種金融商品取引業を行う者および委託者の指定する金融商品取引法第２条第11項に規定する登録金融機関をいいます。以下同じ。）は、第８条第１項の規定により分割される受益権を、その取得申込者に対し、当該指定販売会社がそれぞれ別に定める単位をもって取得申込みに応じることができるものとします。

② 前項の取得申込者は、指定販売会社に、取得申込みと同時にまたはあらかじめ、自己のために開設されたこの信託の受益権の振替を行うための振替機関等の口座を示すものとし、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。なお、指定販売会社は、当該取得申込みの代金（第３項の受益権の価額に当該取得申込みの口数を乗じて得た額をいいます。）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。

③ 第１項の受益権の価額は、取得申込日の翌営業日の基準価額に、指定販売会社がそれぞれ別に定める手数料および当該手数料にかかる消費税および地方消費税（以下「消費税等」といいます。）に相当する金額を加算した価額とします。ただし、この信託契約締結日前の取得申込みにかかる受益権の価額は、１口につき１円に、指定販売会社がそれぞれ別に定める手数料および当該手数料にかかる消費税等相当額を加算した価額とします。

④ 前項の規定にかかわらず、受益者が第37条第２項に基づいて収益分配金を再投資する場合の受益権の価額は、原則として、第31条に規定する各計算期間終了日の基準価額とします。

⑤ 前各項の規定にかかわらず、指定販売会社は、この信託契約締結日以降において、取得申込日が別に定める日のいずれかに当たる場合には、受益者が第37条第２項に基づいて収益分配金を再投資する場合を除き、当該取得申込みに応じません。

⑥ 前各項の規定にかかわらず、委託者は、取引所等における取引の停止、決済機能の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、受益権の取得申込みの受付けを中止することおよび既に受け付けた取得申込みの受付けを取り消すことができます。

⑦ この信託約款において取引所とは金融商品取引法第２条第17項に規定する取引所金融商品市場および金融商品取引法第２条第８項第３号ロに規定する外国金融商品市場をいいます。

【受益権の譲渡にかかる記載または記録】

第14条　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。

② 前項の申請のある場合には、前項の振替機関等は、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、前項の振替機関等が振替先口座を開設した者でない場合には、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。

③ 委託者は、第１項に規定する振替について、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、委託者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。

【受益権の譲渡の対抗要件】

第15条　受益権の譲渡は、前条の規定による振替口座簿への記載または記録によらなければ、委託者および受託者に対抗することができません。

【投資の対象とする資産の種類】

第16条　この信託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。

１．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。）

イ．有価証券

ロ．約束手形

ハ．金銭債権

２．特定資産以外の資産で、以下に掲げる資産

イ．為替手形

【運用の指図範囲等】

第17条　委託者は、信託金を、主として、別に定める投資信託証券または次の有価証券（金融商品取引法第２条第２項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図します。

１．コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等

２．外国または外国の者の発行する証券で、前号の性質を有するもの

３．国債証券、地方債証券、特別の法律により法人の発行する債券および社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券の新株引受権証券および短期社債等を除きます。）

なお、第３号の証券にかかる運用の指図は買い現先取引（売戻条件付の買入れ）および債券貸借取引（現金担保付債券借入れ）に限り行うことができるものとします。

② 委託者は、信託金を、前項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

③ 第１項の規定にかかわらず、この信託の設定、解約、償還、投資環境の変動等への対応等、委託者が運用上必要と認めるときは、委託者は、信託金を前項に掲げる金融商品により運用することの指図ができます。

【利害関係人等との取引等】

第18条　受託者は、受益者の保護に支障を生じることがないものであり、かつ信託業法、投資信託及び投資法人に関する法律ならびに関連法令に反しない場合には、委託者の指図により、信託財産と、受託者（第三者との間において信託財産のためにする取引その他の行為であって、受託者が当該第三者の代理人となって行うものを含みます。）および受託者の利害関係人、第23条第１項に定める信託業務の委託先およびその利害関係人または受託者における他の信託財産との間で、第

16条、第17条第１項および第２項に定める資産への投資等ならびに第20条、第22条および第26条から第28条までに掲げる取引その他これらに類する行為を行うことができます。

② 受託者は、受託者がこの信託の受託者としての権限に基づいて信託事務の処理として行うことができる取引その他の行為について、受託者または受託者の利害関係人の計算で行うことができるものとします。なお、受託者の利害関係人が当該利害関係人の計算で行う場合も同様とします。

③ 委託者は、金融商品取引法、投資信託及び投資法人に関する法律ならびに関連法令に反しない場合には、信託財産と、委託者、その取締役、執行役および委託者の利害関係人等（金融商品取引法第31条の４第３項および同条第４項に規定する親法人等または子法人等をいいます。）または委託者が運用の指図を行う他の信託財産との間で、第16条、第17条第１項および第２項に定める資産への投資等ならびに第20条、第22条および第26条から第28条までに掲げる取引その他これらに類する行為を行うことの指図をすることができ、受託者は、委託者の指図により、当該投資等ならびに当該取引、当該行為を行うことができます。

④ 前３項の場合、委託者および受託者は、受益者に対して信託法第31条第３項および同法第32条第３項の通知は行いません。

【運用の基本方針】

第19条 委託者は、信託財産の運用にあたっては、別に定める運用の基本方針に従って、その指図を行います。

【公社債の借入れの指図】

第20条 委託者は、信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。なお、当該公社債の借入れを行うにあたり担保の提供が必要と認めたときは、担保の提供の指図をするものとします。

② 前項の指図は、当該借入れにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えない範囲で行うものとします。

③ 信託財産の一部解約等の事由により、前項の借入れにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託者は速やかに、その超える額に相当する借り入れた公社債の一部を返還するための指図をするものとします。

④ 第１項の借入れにかかる品借料は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。

【特別の場合の外貨建有価証券への投資制限】

第21条 外貨建有価証券への投資については、わが国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。

【外国為替予約取引の指図】

第22条 委託者は、信託財産に属する外貨建資産（別に定める投資信託証券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。）について、当該外貨建資産の為替ヘッジのため、外国為替の売買の予約を指図することができます。

② 前項において、信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属する別に定める投資信託証券の時価総額に別に定める投資信託証券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。

【信託業務の委託等】

第23条 受託者は、委託者と協議の上、信託業務の一部について、信託業法第22条第１項に定める信託業務の委託をするときは、以下に掲げる基準のすべてに適合する者（受託者の利害関係人を含みます。）を委託先として選定します。

１．委託先の信用力に照らし、継続的に委託業務の遂行に懸念がないこと

２．委託先の委託業務にかかる実績等に照らし、委託業務を確実に処理する能力があると認められること

３．委託される信託財産に属する財産と自己の固有財産その他の財産とを区分する等の管理を行う体制が整備されていること

４．内部管理に関する業務を適正に遂行するための体制が整備されていること

② 受託者は、前項に定める委託先の選定にあたっては、当該委託先が前項各号に掲げる基準に適合していることを確認するものとします。

③ 前２項にかかわらず、受託者は、次の各号に掲げる業務を、受託者および委託者が適当と認める

者（受託者の利害関係人を含みます。）に委託することができるものとします。

１．信託財産の保存にかかる業務

２．信託財産の性質を変えない範囲内において、その利用または改良を目的とする業務

３．委託者のみの指図により信託財産の処分およびその他の信託の目的の達成のために必要な行為にかかる業務

４．受託者が行う業務の遂行にとって補助的な機能を有する行為

【混蔵寄託】

第24条　金融機関または金融商品取引業者（金融商品取引法第２条第９項に規定するものをいいます。本条においては、外国の法令に準拠して設立された法人でこの者に類する者を含みます。）から、売買代金および償還金等について円貨で約定し円貨で決済する取引により取得した外国において発行された譲渡性預金証書またはコマーシャル・ペーパーは、当該金融機関または金融商品取引業者が保管契約を締結した保管機関に当該金融機関または金融商品取引業者の名義で混蔵寄託することができるものとします。

【信託財産の登記等および記載等の留保等】

第25条　信託の登記または登録をすることができる信託財産については、信託の登記または登録をすることとします。ただし、受託者が認める場合は、信託の登記または登録を留保することがあります。

②　前項ただし書きにかかわらず、受益者保護のために委託者または受託者が必要と認めるときは、速やかに登記または登録をするものとします。

③　信託財産に属する旨の記載または記録をすることができる信託財産については、信託財産に属する旨の記載または記録をするとともに、その計算を明らかにする方法により分別して管理するものとします。ただし、受託者が認める場合は、その計算を明らかにする方法により分別して管理することがあります。

④　動産（金銭を除きます。）については、外形上区別することができる方法によるほか、その計算を明らかにする方法により分別して管理することがあります。

【一部解約の請求および有価証券の売却等の指図】

第26条　委託者は、信託財産に属する投資信託証券にかかる信託契約の一部解約の実行請求ならびに有価証券の売却等の指図ができます。

【再投資の指図】

第27条　委託者は、前条の規定による一部解約の代金、有価証券の売却代金、有価証券にかかる償還金等、有価証券等にかかる利子等およびその他の収入金を再投資することの指図ができます。

【資金の借入れ】

第28条　委託者は、信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性に資するため、一部解約に伴う支払資金の手当て（一部解約に伴う支払資金の手当てのために借り入れた資金の返済を含みます。）を目的として、または再投資にかかる収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金の借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。

②　一部解約に伴う支払資金の手当てにかかる借入期間は、有価証券等の売却代金、解約代金または償還金の入金日までに限るものとし、資金借入額は、次の各号に掲げる要件を満たす範囲内の額とします。

１．一部解約金の支払資金の手当てのために行った有価証券等の売却等による受取りの確定している資金の額の範囲内

２．一部解約金支払日の前営業日において確定した当該支払日における支払資金の不足額の範囲内

３．借入れ指図を行う日における信託財産の純資産総額の10％以内

③　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。

④　借入金の利息は受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。

【損益の帰属】

第29条　委託者の指図に基づく行為により信託財産に生じた利益および損失は、すべて受益者に帰属します。

【受託者による資金の立替え】

第30条　信託財産に属する有価証券について、借替がある場合で、委託者の申し出があるときは、受託者は資金の立替えをすることができます。

②　信託財産に属する有価証券にかかる償還金等、有価証券等にかかる利子等およびその他の未収入金で、信託終了日までにその金額を見積りうるものがあるときは、受託者がこれを立て替えて信託財産に繰り入れることができます。

③　前２項の立替金の決済および利息については、受託者と委託者との協議により、そのつど別にこれを定めます。

【信託の計算期間】

第31条　この信託の計算期間は、毎年９月16日から翌年９月15日までとすることを原則とします。ただし、第１計算期間は平成29年９月14日から平成30年９月18日までとします。

②　前項の規定にかかわらず、前項の原則により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されるものとします。ただし、最終計算期間の終了日は、第５条に規定する信託期間の終了日とします。

【信託財産に関する報告等】

第32条　受託者は、毎計算期末に損益計算を行い、信託財産に関する報告書を作成して、これを委託者に提出します。

②　受託者は、信託終了のときに最終計算を行い、信託財産に関する報告書を作成して、これを委託者に提出します。

③　受託者は、前２項の報告を行うことにより、受益者に対する信託法第37条第３項に定める報告は行わないこととします。

④　受益者は、受託者に対し、信託法第37条第２項に定める書類または電磁的記録の作成に欠くことのできない情報その他の信託に関する重要な情報および当該受益者以外の者の利益を害するおそれのない情報を除き、信託法第38条第１項に定める閲覧または謄写の請求をすることはできないものとします。

【信託事務等の諸費用】

第33条　信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産の財務諸表の監査費用の全部または一部（消費税等相当額を含みます。）および受託者の立て替えた立替金の利息等（以下「諸経費」といいます。）は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。

②　前項の信託財産の財務諸表の監査費用の全部または一部については、第31条に規定する計算期間を通じて毎日、固定率または固定金額にて計算した額を、毎計算期間の最初の６ヵ月終了日および毎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。

【信託報酬等の額】

第34条　委託者および受託者の信託報酬の総額は、第31条に規定する計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に年10,000分の88の率を乗じて得た額とします。

②　前項の信託報酬は、毎計算期間の最初の６ヵ月終了日および毎計算期末または信託終了のとき信託財産中から支弁するものとし、委託者と受託者との間の配分は別に定めます。

③　第１項の信託報酬にかかる消費税等に相当する金額を、信託報酬支弁のときに信託財産中から支弁します。

【収益の処理方法】

第35条　信託財産から生ずる毎計算期末における利益は、次の方法により処理します。

１．配当金、利子およびこれらに類する収益から支払利息を控除した額（以下「配当等収益」といいます。）は、諸経費、信託報酬および当該信託報酬にかかる消費税等に相当する金額を控除した後、その残額を受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配にあてるため、その一部を分配準備積立金として積み立てることができます。

２．売買損益に評価損益を加減した利益金額（以下「売買益」といいます。）は、諸経費、信託報酬および当該信託報酬にかかる消費税等に相当する金額を控除し、繰越欠損金のあるときは、その全額を売買益をもって補てんした後、受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配にあてるため、分配準備積立金として積み立てることができます。

②　毎計算期末において、信託財産につき生じた損失は、次期に繰り越します。

【収益分配金、償還金および一部解約金の払込みと支払いに関する受託者の免責】

第36条　受託者は、収益分配金については原則として毎計算期間終了日の翌営業日に、償還金（信託終了時における信託財産の純資産総額を受益権総口数で除した額をいいます。以下同じ。）については第37条第３項に規定する支払開始日までに、一部解約金については第37条第４項に規定する支払開始日までに、その全額を委託者の指定する預金口座等に払い込みます。

② 受託者は、前項の規定により委託者の指定する預金口座等に収益分配金、償還金および一部解約金を払い込んだ後は、受益者に対する支払いにつき、その責に任じません。

【収益分配金、償還金および一部解約金の支払いならびに収益分配金の再投資】

第37条　収益分配金は、毎計算期間終了日後１ヵ月以内の委託者の指定する日から、毎計算期間の末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（当該収益分配金にかかる計算期間の末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計算期間の末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指定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ます。）に支払います。

② 前項の規定にかかわらず、別に定める「累積投資約款」に従った契約（別の名称で同様の権利義務関係を規定する契約を含むものとし、その場合は、当該別の名称に読み替えるものとします。）に基づいて収益分配金を再投資する受益者に対しては、受託者が委託者の指定する預金口座等に払い込むことにより、原則として、毎計算期間終了日の翌営業日に、収益分配金が指定販売会社に交付されます。この場合、指定販売会社は、受益者に対し遅滞なく収益分配金の再投資にかかる受益権の売付けを行います。当該売付けにより増加した受益権は、第11条第３項の規定に従い、振替口座簿に記載または記録されます。

③ 償還金は、信託終了日後１ヵ月以内の委託者の指定する日から、信託終了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（信託終了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、当該信託終了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指定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ます。）に支払います。なお、当該受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して委託者がこの信託の償還をするのと引換えに、当該償還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。

④ 一部解約金は、第39条第１項の受益者の請求を受け付けた日から起算して、原則として６営業日目から当該受益者に支払います。

⑤ 前各項（第２項を除きます。）に規定する収益分配金、償還金および一部解約金の支払いは、指定販売会社の営業所等において行うものとします。

⑥ 収益分配金、償還金および一部解約金にかかる収益調整金は、原則として、各受益者毎の信託時の受益権の価額等に応じて計算されるものとします。なお、「収益調整金」は、所得税法施行令第27条の規定によるものとし、各受益者毎の信託時の受益権の価額と元本との差額をいい、原則として、追加信託のつど、当該口数により加重平均され、収益分配のつど、調整されるものとします。また、「各受益者毎の信託時の受益権の価額等」とは、原則として、各受益者毎の信託時の受益権の価額をいい、追加信託のつど、当該口数により加重平均され、収益分配のつど、調整されるものとします。

【収益分配金および償還金の時効】

第38条　受益者が、収益分配金については前条第１項に規定する支払開始日から５年間その支払いを請求しないとき、ならびに信託終了による償還金については前条第３項に規定する支払開始日から10年間その支払いを請求しないときは、その権利を失い、受託者から交付を受けた金銭は、委託者に帰属します。

【信託契約の一部解約】

第39条　受益者は、自己に帰属する受益権につき、委託者に１口単位をもって一部解約の実行を請求することができます。

② 前項の規定にかかわらず、委託者は、一部解約の実行の請求日が別に定める日のいずれかに当たる場合には、当該一部解約の実行の請求を受け付けません。

③ 委託者は、第１項の一部解約の実行の請求を受け付けた場合には、この信託契約の一部を解約します。なお、第１項の一部解約の実行の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この信託契約の一部解約を委託者が行うのと引換えに、当該一部解約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。

④ 前項の一部解約の価額は、一部解約の実行の請求日の翌営業日の基準価額とします。

⑤ 受益者が一部解約の実行の請求をするときは、指定販売会社に対し、振替受益権をもって行うものとします。

⑥ 委託者は、取引所等における取引の停止、決済機能の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、第１項による一部解約の実行の請求の受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の請求の受付けを取り消すことができます。

⑦ 前項により一部解約の実行の請求の受付けが中止された場合には、受益者は当該受付け中止前に行った実行されていない一部解約の実行の請求を撤回できます。ただし、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、当該受益権の一部解約の価額は、当該受付け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、第４項の規定に準じて算出した価額とします。

【質権口記載または記録の受益権の取扱い】

第40条 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、この信託約款によるほか、民法その他の法令等に従って取り扱われます。

【信託契約の解約】

第41条 委託者は、信託期間中において、この信託契約を解約することが受益者のため有利であると認めるとき、信託契約の一部を解約することにより受益権の口数が10億口を下回ることとなったとき、その他やむを得ない事情が発生したときは、受託者と合意の上、こ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、委託者は、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。

② 委託者は、前項の事項について、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、この信託契約にかかる知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発します。

③ 前項の書面決議において、受益者（委託者およびこの信託の信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権にかかる受益者としての受託者を除きます。以下本項において同じ。）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。

④ 第２項の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。

⑤ 第２項から前項までの規定は、委託者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、この信託契約にかかる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、第２項から前項までの手続きを行うことが困難な場合も同様とします。

【信託契約に関する監督官庁の命令】

第42条 委託者は、監督官庁よりこ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。

② 委託者は、監督官庁の命令に基づいてこの信託約款を変更しようとするときは、第46条の規定に従います。

【委託者の登録取消等に伴う取扱い】

第43条 委託者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、委託者は、この信託契約を解約し、信託を終了させます。

② 前項の規定にかかわらず、監督官庁がこの信託契約に関する委託者の業務を他の投資信託委託会社に引き継ぐことを命じたときは、この信託は、第46条第２項の書面決議で否決された場合を除き、当該投資信託委託会社と受託者との間において存続します。

【委託者の事業の譲渡および承継に伴う取扱い】

第44条　委託者は、事業の全部または一部を譲渡することがあり、これに伴い、この信託契約に関する事業を譲渡することがあります。

②　委託者は、分割により事業の全部または一部を承継させることがあり、これに伴い、この信託契約に関する事業を承継させることがあります。

【受託者の辞任および解任に伴う取扱い】

第45条　受託者は、委託者の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託者がその任務に違反して信託財産に著しい損害を与えたことその他重要な事由があるときは、委託者または受益者は、裁判所に受託者の解任を申し立てることができます。受託者が辞任した場合、または裁判所が受託者を解任した場合、委託者は、第46条の規定に従い、新受託者を選任します。なお、受益者は、上記によって行う場合を除き、受託者を解任することはできないものとします。

②　委託者が新受託者を選任できないときは、委託者はこの信託契約を解約し、信託を終了させます。

【信託約款の変更等】

第46条　委託者は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託者と合意の上、この信託約款を変更することまたはこの信託と他の信託との併合（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。以下同じ。）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その内容を監督官庁に届け出ます。なお、この信託約款は本条に定める以外の方法によって変更することができないものとします。

②　委託者は、前項の事項（前項の変更事項にあってはその変更の内容が重大なものに該当する場合に限り、併合事項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、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、この信託約款にかかる知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発します。

③　前項の書面決議において、受益者（委託者およびこの信託の信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権にかかる受益者としての受託者を除きます。以下本項において同じ。）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。

④　第２項の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。

⑤　書面決議の効力は、この信託のすべての受益者に対してその効力を生じます。

⑥　第２項から前項までの規定は、委託者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、この信託約款にかかる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。

⑦　前各項の規定にかかわらず、この投資信託において併合の書面決議が可決された場合にあっても、当該併合にかかる一または複数の他の投資信託において当該併合の書面決議が否決された場合は、当該他の投資信託との併合を行うことはできません。

【反対受益者の受益権買取請求の不適用】

第47条　この信託は、受益者が第39条の規定による一部解約の実行の請求を行ったときは、委託者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、第41条に規定する信託契約の解約または前条に規定する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。

【他の受益者の氏名等の開示の請求の制限】

第48条　この信託の受益者は、委託者または受託者に対し、次に掲げる事項の開示の請求を行うことはできません。

１．他の受益者の氏名または名称および住所

２．他の受益者が有する受益権の内容

【信託期間の延長】

第49条　＜削除＞

【運用報告書に記載すべき事項の提供】

第50条　委託者は、投資信託及び投資法人に関する法律第14条第１項に定める運用報告書の交付に代えて、運用報告書に記載すべき事項を電磁的方法により受益者に提供することができます。この場合において、委託者は、運用報告書を交付したものとみなします。

②　前項の規定にかかわらず、委託者は、受益者から運用報告書の交付の請求があった場合には、これを交付するものとします。

【公告】

第51条　委託者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

②　前項の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。

【信託約款に関する疑義の取扱い】

第52条　この信託約款の解釈について疑義を生じたときは、委託者と受託者との協議により定めます。

上記条項により信託契約を締結します。

平成29年９月14日（信託契約締結日）

委託者　　東京都港区愛宕二丁目５番１号
三井住友アセットマネジメント株式会社
代表取締役　　松下　隆史

受託者　　東京都千代田区丸の内一丁目４番１号
三井住友信託銀行株式会社
取締役社長　　橋本　勝

〔付表〕

１．運用の基本方針および信託約款第17条第１項に規定する「別に定める投資信託証券」は下記のものとします。

親投資信託　国内株式インデックス・マザーファンド（Ｂ号）
親投資信託　外国株式インデックス・マザーファンド
親投資信託　エマージング株式インデックス・マザーファンド
親投資信託　Ｊリート・インデックス・マザーファンド
親投資信託　外国リート・インデックス・マザーファンド
親投資信託　国内債券パッシブ・マザーファンド
親投資信託　外国債券パッシブ・マザーファンド
親投資信託　ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド
米国籍米ドル建て投資信託　ｉシェアーズ　Ｊ．Ｐ．モルガン・米ドル建てエマージング・マーケット債券ＥＴＦ

２．信託約款第13条第５項および第39条第２項に規定する「別に定める日」は下記のものとします。

・ニューヨークの取引所の休業日
・ニューヨークの銀行の休業日

追加型証券投資信託
三井住友・資産最適化ファンド（３バランス型）
約款

三井住友ＤＳアセットマネジメント株式会社

〔運用の基本方針〕

信託約款第19条に基づき、委託者の定める運用の基本方針は以下の通りとします。

１．基本方針

この投資信託は、世界各国の債券、株式および不動産投資信託（リート）等に分散投資することにより、長期的な視点の基に信託財産の成長と安定的な収益の確保の両方をバランスよく目指す運用を行います。

２．運用方法

(1) 投資対象

別に定める投資信託証券を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

① 主として別に定める投資信託証券への投資を通じて、世界各国の債券、株式および不動産投資信託（リート）等に分散投資することにより、長期的な視点の基に信託財産の成長と安定的な収益の確保の両方をバランスよく目指す運用を行います。

・主として、国内株式、先進国株式（除く日本）、新興国株式、国内リート、外国リート、国内債券、先進国債券（除く日本）、為替ヘッジ付き先進国債券（除く日本）、新興国債券に投資します。

・別に定める投資信託証券は、継続的にモニタリングを行い必要な場合は追加・入替えも行います。

② イボットソン・アソシエイツ・ジャパン株式会社の助言に基づき、基本資産配分比率を決定します。

・基本資産配分比率は、各資産の期待収益率やリスク（標準偏差）および資産間の相関係数等を推計・最適化して算出します。

③ 実質組入外貨建資産については、別に定める投資信託証券内で対円での為替ヘッジを行っている場合を除き、原則として対円での為替ヘッジを行いません。

④ 投資信託証券の組入比率は、原則として高位を保ちます。

⑤ 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。

(3) 投資制限

① 投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。

② 投資信託証券とコマーシャル・ペーパーおよび短期社債等以外の有価証券への投資は、買い現先取引または債券貸借取引に限ります。

③ 外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。

④ 投資信託証券を組み入れる場合において、一般社団法人投資信託協会規則に定めるエクスポージャーがルックスルーできる場合に該当しないときは、当該投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の10％以内とします。

⑤ 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．収益分配方針

年１回（原則として毎年９月15日。休業日の場合は翌営業日）決算を行い、原則として以下の方針に基づき収益分配を行います。

① 分配対象額は、経費控除後の利子、配当等収益と売買益（評価損益を含みます。）等の範囲内とします。

② 収益分配金額は、委託者が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合等には、委託者の判断により分配を行わないことがあります。

③ 留保益の運用については特に制限を定めず、委託者の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。

追加型証券投資信託
『三井住友・資産最適化ファンド（３バランス型)』
〔信託約款〕

【信託の種類、委託者および受託者】

第１条　この信託は、証券投資信託であり、三井住友ＤＳアセットマネジメント株式会社を委託者とし、三井住友信託銀行株式会社を受託者とします。

②　この信託は、信託法（平成18年法律第108号）（以下「信託法」といいます。）の適用を受けます。

【信託事務の委託】

第２条　受託者は、信託法第28条第１号に基づく信託事務の委託として、信託事務の処理の一部について、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律第１条第１項の規定による信託業務の兼営の認可を受けた一の金融機関（受託者の利害関係人（金融機関の信託業務の兼営等に関する法律第２条第１項にて準用する信託業法第29条第２項第１号に規定する利害関係人をいいます。以下この条、第18条第１項および第２項、第23条において同じ。）を含みます。）と信託契約を締結し、これを委託することができます。

②　前項における利害関係人に対する業務の委託については、受益者の保護に支障を生じることがない場合に行うものとします。

【信託の目的および金額】

第３条　委託者は、金2,000,000円を受益者のために利殖の目的をもって信託し、受託者はこれを引き受けます。

【信託金の限度額】

第４条　委託者は、受託者と合意の上、金2,000億円を限度として信託金を追加することができます。

②　委託者は、受託者と合意の上、前項の限度額を変更することができます。

【信託期間】

第５条　この信託の期間は、信託契約締結日から第41条第１項、第42条第１項、第43条第１項、第45条第２項による信託終了の日までとします。

【受益権の取得申込みの勧誘の種類】

第６条　この信託にかかる受益権の取得申込みの勧誘は、金融商品取引法第２条第３項第１号に掲げる場合に該当し、投資信託及び投資法人に関する法律第２条第８項で定める公募により行われます。

【当初の受益者】

第７条　この信託契約締結当初および追加信託当初の受益者は、委託者の指定する受益権取得申込者とし、第８条の規定により分割された受益権は、その取得申込口数に応じて、取得申込者に帰属します。

【受益権の分割および再分割】

第８条　委託者は、第３条の規定による受益権については2,000,000口に、追加信託によって生じた受益権については、これを追加信託のつど第９条第１項の追加口数に、それぞれ均等に分割します。

②　委託者は、受託者と協議の上、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。

【追加信託の価額および口数、基準価額の計算方法】

第９条　追加信託金は、追加信託を行う日の前営業日の基準価額に、当該追加信託にかかる受益権の口数を乗じた額とします。

②　この信託約款において基準価額とは、信託財産に属する資産（第20条に規定する借入れ公社債を除きます。）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（以下「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。なお、外貨建資産（外国通貨表示の有価証券（以下「外貨建有価証券」といいます。）、預金その他の資産をいいます。以下同じ。）の円換算については、原則として、わが国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します。

③　第22条に規定する予約為替の評価は、原則としてわが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算します。

【信託日時の異なる受益権の内容】

第10条　この信託の受益権は、信託の日時を異にすることにより差異を生ずることはありません。

【受益権の帰属と受益証券の不発行】

第11条　この信託のすべての受益権は、社振法の規定の適用を受けることとし、受益権の帰属は、委託者があらかじめこの信託の受益権を取り扱うことについて同意した一の振替機関（社振法第２条に規定する「振替機関」をいい、以下「振替機関」といいます。）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。）。

② 委託者は、この信託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がある場合を除き、振替受益権を表示する受益証券を発行しません。なお、受益者は、委託者がやむを得ない事情等により受益証券を発行する場合を除き、無記名式受益証券から記名式受益証券への変更の請求、記名式受益証券から無記名式受益証券への変更の請求、受益証券の再発行の請求を行わないものとします。

③ 委託者は、第８条の規定により分割された受益権について、振替機関等の振替口座簿への新たな記載または記録をするため社振法に定める事項の振替機関への通知を行うものとします。振替機関等は、委託者から振替機関への通知があった場合、社振法の規定に従い、その備える振替口座簿への新たな記載または記録を行います。

【受益権の設定にかかる受託者の通知】

第12条　受託者は、第３条の規定による受益権については信託契約締結日に、また、追加信託により生じた受益権については追加信託のつど、振替機関の定める方法により、振替機関へ当該受益権にかかる信託を設定した旨の通知を行います。

【受益権の申込単位および価額】

第13条　指定販売会社（委託者の指定する金融商品取引法第28条第１項に規定する第一種金融商品取引業を行う者および委託者の指定する金融商品取引法第２条第11項に規定する登録金融機関をいいます。以下同じ。）は、第８条第１項の規定により分割される受益権を、その取得申込者に対し、当該指定販売会社がそれぞれ別に定める単位をもって取得申込みに応じることができるものとします。

② 前項の取得申込者は、指定販売会社に、取得申込みと同時にまたはあらかじめ、自己のために開設されたこの信託の受益権の振替を行うための振替機関等の口座を示すものとし、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。なお、指定販売会社は、当該取得申込みの代金（第３項の受益権の価額に当該取得申込みの口数を乗じて得た額をいいます。）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。

③ 第１項の受益権の価額は、取得申込日の翌営業日の基準価額に、指定販売会社がそれぞれ別に定める手数料および当該手数料にかかる消費税および地方消費税（以下「消費税等」といいます。）に相当する金額を加算した価額とします。ただし、この信託契約締結日前の取得申込みにかかる受益権の価額は、１口につき１円に、指定販売会社がそれぞれ別に定める手数料および当該手数料にかかる消費税等相当額を加算した価額とします。

④ 前項の規定にかかわらず、受益者が第37条第２項に基づいて収益分配金を再投資する場合の受益権の価額は、原則として、第31条に規定する各計算期間終了日の基準価額とします。

⑤ 前各項の規定にかかわらず、指定販売会社は、この信託契約締結日以降において、取得申込日が別に定める日のいずれかに当たる場合には、受益者が第37条第２項に基づいて収益分配金を再投資する場合を除き、当該取得申込みに応じません。

⑥ 前各項の規定にかかわらず、委託者は、取引所等における取引の停止、決済機能の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、受益権の取得申込みの受付けを中止することおよび既に受け付けた取得申込みの受付けを取り消すことができます。

⑦ この信託約款において取引所とは金融商品取引法第２条第17項に規定する取引所金融商品市場および金融商品取引法第２条第８項第３号ロに規定する外国金融商品市場をいいます。

【受益権の譲渡にかかる記載または記録】

第14条　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。

② 前項の申請のある場合には、前項の振替機関等は、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、前項の振替機関等が振替先口座を開設した者でない場合には、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。

③ 委託者は、第１項に規定する振替について、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、委託者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。

【受益権の譲渡の対抗要件】

第15条　受益権の譲渡は、前条の規定による振替口座簿への記載または記録によらなければ、委託者および受託者に対抗することができません。

【投資の対象とする資産の種類】

第16条　この信託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。

１．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。）

イ．有価証券

ロ．約束手形

ハ．金銭債権

２．特定資産以外の資産で、以下に掲げる資産

イ．為替手形

【運用の指図範囲等】

第17条　委託者は、信託金を、主として、別に定める投資信託証券または次の有価証券（金融商品取引法第２条第２項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図します。

１．コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等

２．外国または外国の者の発行する証券で、前号の性質を有するもの

３．国債証券、地方債証券、特別の法律により法人の発行する債券および社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券の新株引受権証券および短期社債等を除きます。）

なお、第３号の証券にかかる運用の指図は買い現先取引（売戻条件付の買入れ）および債券貸借取引（現金担保付債券借入れ）に限り行うことができるものとします。

② 委託者は、信託金を、前項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

③ 第１項の規定にかかわらず、この信託の設定、解約、償還、投資環境の変動等への対応等、委託者が運用上必要と認めるときは、委託者は、信託金を前項に掲げる金融商品により運用することの指図ができます。

【利害関係人等との取引等】

第18条　受託者は、受益者の保護に支障を生じることがないものであり、かつ信託業法、投資信託及び投資法人に関する法律ならびに関連法令に反しない場合には、委託者の指図により、信託財産と、受託者（第三者との間において信託財産のためにする取引その他の行為であって、受託者が当該第三者の代理人となって行うものを含みます。）および受託者の利害関係人、第23条第１項に定める信託業務の委託先およびその利害関係人または受託者における他の信託財産との間で、第

16条、第17条第１項および第２項に定める資産への投資等ならびに第20条、第22条および第26条から第28条までに掲げる取引その他これらに類する行為を行うことができます。

② 受託者は、受託者がこの信託の受託者としての権限に基づいて信託事務の処理として行うことができる取引その他の行為について、受託者または受託者の利害関係人の計算で行うことができるものとします。なお、受託者の利害関係人が当該利害関係人の計算で行う場合も同様とします。

③ 委託者は、金融商品取引法、投資信託及び投資法人に関する法律ならびに関連法令に反しない場合には、信託財産と、委託者、その取締役、執行役および委託者の利害関係人等（金融商品取引法第31条の４第３項および同条第４項に規定する親法人等または子法人等をいいます。）または委託者が運用の指図を行う他の信託財産との間で、第16条、第17条第１項および第２項に定める資産への投資等ならびに第20条、第22条および第26条から第28条までに掲げる取引その他これらに類する行為を行うことの指図をすることができ、受託者は、委託者の指図により、当該投資等ならびに当該取引、当該行為を行うことができます。

④ 前３項の場合、委託者および受託者は、受益者に対して信託法第31条第３項および同法第32条第３項の通知は行いません。

【運用の基本方針】

第19条 委託者は、信託財産の運用にあたっては、別に定める運用の基本方針に従って、その指図を行います。

【公社債の借入れの指図】

第20条 委託者は、信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。なお、当該公社債の借入れを行うにあたり担保の提供が必要と認めたときは、担保の提供の指図をするものとします。

② 前項の指図は、当該借入れにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えない範囲で行うものとします。

③ 信託財産の一部解約等の事由により、前項の借入れにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託者は速やかに、その超える額に相当する借り入れた公社債の一部を返還するための指図をするものとします。

④ 第１項の借入れにかかる品借料は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。

【特別の場合の外貨建有価証券への投資制限】

第21条 外貨建有価証券への投資については、わが国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。

【外国為替予約取引の指図】

第22条 委託者は、信託財産に属する外貨建資産（別に定める投資信託証券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。）について、当該外貨建資産の為替ヘッジのため、外国為替の売買の予約を指図することができます。

② 前項において、信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属する別に定める投資信託証券の時価総額に別に定める投資信託証券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。

【信託業務の委託等】

第23条 受託者は、委託者と協議の上、信託業務の一部について、信託業法第22条第１項に定める信託業務の委託をするときは、以下に掲げる基準のすべてに適合する者（受託者の利害関係人を含みます。）を委託先として選定します。

１．委託先の信用力に照らし、継続的に委託業務の遂行に懸念がないこと

２．委託先の委託業務にかかる実績等に照らし、委託業務を確実に処理する能力があると認められること

３．委託される信託財産に属する財産と自己の固有財産その他の財産とを区分する等の管理を行う体制が整備されていること

４．内部管理に関する業務を適正に遂行するための体制が整備されていること

② 受託者は、前項に定める委託先の選定にあたっては、当該委託先が前項各号に掲げる基準に適合していることを確認するものとします。

③ 前２項にかかわらず、受託者は、次の各号に掲げる業務を、受託者および委託者が適当と認める

者（受託者の利害関係人を含みます。）に委託することができるものとします。

１．信託財産の保存にかかる業務

２．信託財産の性質を変えない範囲内において、その利用または改良を目的とする業務

３．委託者のみの指図により信託財産の処分およびその他の信託の目的の達成のために必要な行為にかかる業務

４．受託者が行う業務の遂行にとって補助的な機能を有する行為

【混蔵寄託】

第24条　金融機関または金融商品取引業者（金融商品取引法第２条第９項に規定するものをいいます。本条においては、外国の法令に準拠して設立された法人でこの者に類する者を含みます。）から、売買代金および償還金等について円貨で約定し円貨で決済する取引により取得した外国において発行された譲渡性預金証書またはコマーシャル・ペーパーは、当該金融機関または金融商品取引業者が保管契約を締結した保管機関に当該金融機関または金融商品取引業者の名義で混蔵寄託することができるものとします。

【信託財産の登記等および記載等の留保等】

第25条　信託の登記または登録をすることができる信託財産については、信託の登記または登録をすることとします。ただし、受託者が認める場合は、信託の登記または登録を留保することがあります。

②　前項ただし書きにかかわらず、受益者保護のために委託者または受託者が必要と認めるときは、速やかに登記または登録をするものとします。

③　信託財産に属する旨の記載または記録をすることができる信託財産については、信託財産に属する旨の記載または記録をするとともに、その計算を明らかにする方法により分別して管理するものとします。ただし、受託者が認める場合は、その計算を明らかにする方法により分別して管理することがあります。

④　動産（金銭を除きます。）については、外形上区別することができる方法によるほか、その計算を明らかにする方法により分別して管理することがあります。

【一部解約の請求および有価証券の売却等の指図】

第26条　委託者は、信託財産に属する投資信託証券にかかる信託契約の一部解約の実行請求ならびに有価証券の売却等の指図ができます。

【再投資の指図】

第27条　委託者は、前条の規定による一部解約の代金、有価証券の売却代金、有価証券にかかる償還金等、有価証券等にかかる利子等およびその他の収入金を再投資することの指図ができます。

【資金の借入れ】

第28条　委託者は、信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性に資するため、一部解約に伴う支払資金の手当て（一部解約に伴う支払資金の手当てのために借り入れた資金の返済を含みます。）を目的として、または再投資にかかる収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金の借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。

②　一部解約に伴う支払資金の手当てにかかる借入期間は、有価証券等の売却代金、解約代金または償還金の入金日までに限るものとし、資金借入額は、次の各号に掲げる要件を満たす範囲内の額とします。

１．一部解約金の支払資金の手当てのために行った有価証券等の売却等による受取りの確定している資金の額の範囲内

２．一部解約金支払日の前営業日において確定した当該支払日における支払資金の不足額の範囲内

３．借入れ指図を行う日における信託財産の純資産総額の10％以内

③　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。

④　借入金の利息は受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。

【損益の帰属】

第29条　委託者の指図に基づく行為により信託財産に生じた利益および損失は、すべて受益者に帰属します。

【受託者による資金の立替え】

第30条　信託財産に属する有価証券について、借替がある場合で、委託者の申し出があるときは、受託者は資金の立替えをすることができます。

②　信託財産に属する有価証券にかかる償還金等、有価証券等にかかる利子等およびその他の未収入金で、信託終了日までにその金額を見積りうるものがあるときは、受託者がこれを立て替えて信託財産に繰り入れることができます。

③　前２項の立替金の決済および利息については、受託者と委託者との協議により、そのつど別にこれを定めます。

【信託の計算期間】

第31条　この信託の計算期間は、毎年９月16日から翌年９月15日までとすることを原則とします。ただし、第１計算期間は平成29年９月14日から平成30年９月18日までとします。

②　前項の規定にかかわらず、前項の原則により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されるものとします。ただし、最終計算期間の終了日は、第５条に規定する信託期間の終了日とします。

【信託財産に関する報告等】

第32条　受託者は、毎計算期末に損益計算を行い、信託財産に関する報告書を作成して、これを委託者に提出します。

②　受託者は、信託終了のときに最終計算を行い、信託財産に関する報告書を作成して、これを委託者に提出します。

③　受託者は、前２項の報告を行うことにより、受益者に対する信託法第37条第３項に定める報告は行わないこととします。

④　受益者は、受託者に対し、信託法第37条第２項に定める書類または電磁的記録の作成に欠くことのできない情報その他の信託に関する重要な情報および当該受益者以外の者の利益を害するおそれのない情報を除き、信託法第38条第１項に定める閲覧または謄写の請求をすることはできないものとします。

【信託事務等の諸費用】

第33条　信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産の財務諸表の監査費用の全部または一部（消費税等相当額を含みます。）および受託者の立て替えた立替金の利息等（以下「諸経費」といいます。）は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。

②　前項の信託財産の財務諸表の監査費用の全部または一部については、第31条に規定する計算期間を通じて毎日、固定率または固定金額にて計算した額を、毎計算期間の最初の６ヵ月終了日および毎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。

【信託報酬等の額】

第34条　委託者および受託者の信託報酬の総額は、第31条に規定する計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に年10,000分の88の率を乗じて得た額とします。

②　前項の信託報酬は、毎計算期間の最初の６ヵ月終了日および毎計算期末または信託終了のとき信託財産中から支弁するものとし、委託者と受託者との間の配分は別に定めます。

③　第１項の信託報酬にかかる消費税等に相当する金額を、信託報酬支弁のときに信託財産中から支弁します。

【収益の処理方法】

第35条　信託財産から生ずる毎計算期末における利益は、次の方法により処理します。

１．配当金、利子およびこれらに類する収益から支払利息を控除した額（以下「配当等収益」といいます。）は、諸経費、信託報酬および当該信託報酬にかかる消費税等に相当する金額を控除した後、その残額を受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配にあてるため、その一部を分配準備積立金として積み立てることができます。

２．売買損益に評価損益を加減した利益金額（以下「売買益」といいます。）は、諸経費、信託報酬および当該信託報酬にかかる消費税等に相当する金額を控除し、繰越欠損金のあるときは、その全額を売買益をもって補てんした後、受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配にあてるため、分配準備積立金として積み立てることができます。

②　毎計算期末において、信託財産につき生じた損失は、次期に繰り越します。

【収益分配金、償還金および一部解約金の払込みと支払いに関する受託者の免責】

第36条　受託者は、収益分配金については原則として毎計算期間終了日の翌営業日に、償還金（信託終了時における信託財産の純資産総額を受益権総口数で除した額をいいます。以下同じ。）については第37条第３項に規定する支払開始日までに、一部解約金については第37条第４項に規定する支払開始日までに、その全額を委託者の指定する預金口座等に払い込みます。

② 受託者は、前項の規定により委託者の指定する預金口座等に収益分配金、償還金および一部解約金を払い込んだ後は、受益者に対する支払いにつき、その責に任じません。

【収益分配金、償還金および一部解約金の支払いならびに収益分配金の再投資】

第37条　収益分配金は、毎計算期間終了日後１ヵ月以内の委託者の指定する日から、毎計算期間の末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（当該収益分配金にかかる計算期間の末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計算期間の末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指定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ます。）に支払います。

② 前項の規定にかかわらず、別に定める「累積投資約款」に従った契約（別の名称で同様の権利義務関係を規定する契約を含むものとし、その場合は、当該別の名称に読み替えるものとします。）に基づいて収益分配金を再投資する受益者に対しては、受託者が委託者の指定する預金口座等に払い込むことにより、原則として、毎計算期間終了日の翌営業日に、収益分配金が指定販売会社に交付されます。この場合、指定販売会社は、受益者に対し遅滞なく収益分配金の再投資にかかる受益権の売付けを行います。当該売付けにより増加した受益権は、第11条第３項の規定に従い、振替口座簿に記載または記録されます。

③ 償還金は、信託終了日後１ヵ月以内の委託者の指定する日から、信託終了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（信託終了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、当該信託終了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指定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ます。）に支払います。なお、当該受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して委託者がこの信託の償還をするのと引換えに、当該償還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。

④ 一部解約金は、第39条第１項の受益者の請求を受け付けた日から起算して、原則として６営業日目から当該受益者に支払います。

⑤ 前各項（第２項を除きます。）に規定する収益分配金、償還金および一部解約金の支払いは、指定販売会社の営業所等において行うものとします。

⑥ 収益分配金、償還金および一部解約金にかかる収益調整金は、原則として、各受益者毎の信託時の受益権の価額等に応じて計算されるものとします。なお、「収益調整金」は、所得税法施行令第27条の規定によるものとし、各受益者毎の信託時の受益権の価額と元本との差額をいい、原則として、追加信託のつど、当該口数により加重平均され、収益分配のつど、調整されるものとします。また、「各受益者毎の信託時の受益権の価額等」とは、原則として、各受益者毎の信託時の受益権の価額をいい、追加信託のつど、当該口数により加重平均され、収益分配のつど、調整されるものとします。

【収益分配金および償還金の時効】

第38条　受益者が、収益分配金については前条第１項に規定する支払開始日から５年間その支払いを請求しないとき、ならびに信託終了による償還金については前条第３項に規定する支払開始日から10年間その支払いを請求しないときは、その権利を失い、受託者から交付を受けた金銭は、委託者に帰属します。

【信託契約の一部解約】

第39条　受益者は、自己に帰属する受益権につき、委託者に１口単位をもって一部解約の実行を請求することができます。

② 前項の規定にかかわらず、委託者は、一部解約の実行の請求日が別に定める日のいずれかに当たる場合には、当該一部解約の実行の請求を受け付けません。

③ 委託者は、第１項の一部解約の実行の請求を受け付けた場合には、この信託契約の一部を解約します。なお、第１項の一部解約の実行の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この信託契約の一部解約を委託者が行うのと引換えに、当該一部解約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。

④ 前項の一部解約の価額は、一部解約の実行の請求日の翌営業日の基準価額とします。

⑤ 受益者が一部解約の実行の請求をするときは、指定販売会社に対し、振替受益権をもって行うものとします。

⑥ 委託者は、取引所等における取引の停止、決済機能の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、第１項による一部解約の実行の請求の受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の請求の受付けを取り消すことができます。

⑦ 前項により一部解約の実行の請求の受付けが中止された場合には、受益者は当該受付け中止前に行った実行されていない一部解約の実行の請求を撤回できます。ただし、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、当該受益権の一部解約の価額は、当該受付け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、第４項の規定に準じて算出した価額とします。

【質権口記載または記録の受益権の取扱い】

第40条 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、この信託約款によるほか、民法その他の法令等に従って取り扱われます。

【信託契約の解約】

第41条 委託者は、信託期間中において、この信託契約を解約することが受益者のため有利であると認めるとき、信託契約の一部を解約することにより受益権の口数が10億口を下回ることとなったとき、その他やむを得ない事情が発生したときは、受託者と合意の上、こ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、委託者は、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。

② 委託者は、前項の事項について、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、この信託契約にかかる知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発します。

③ 前項の書面決議において、受益者（委託者およびこの信託の信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権にかかる受益者としての受託者を除きます。以下本項において同じ。）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。

④ 第２項の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。

⑤ 第２項から前項までの規定は、委託者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、この信託契約にかかる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、第２項から前項までの手続きを行うことが困難な場合も同様とします。

【信託契約に関する監督官庁の命令】

第42条 委託者は、監督官庁よりこ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。

② 委託者は、監督官庁の命令に基づいてこの信託約款を変更しようとするときは、第46条の規定に従います。

【委託者の登録取消等に伴う取扱い】

第43条 委託者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、委託者は、この信託契約を解約し、信託を終了させます。

② 前項の規定にかかわらず、監督官庁がこの信託契約に関する委託者の業務を他の投資信託委託会社に引き継ぐことを命じたときは、この信託は、第46条第２項の書面決議で否決された場合を除き、当該投資信託委託会社と受託者との間において存続します。

【委託者の事業の譲渡および承継に伴う取扱い】

第44条　委託者は、事業の全部または一部を譲渡することがあり、これに伴い、この信託契約に関する事業を譲渡することがあります。

②　委託者は、分割により事業の全部または一部を承継させることがあり、これに伴い、この信託契約に関する事業を承継させることがあります。

【受託者の辞任および解任に伴う取扱い】

第45条　受託者は、委託者の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託者がその任務に違反して信託財産に著しい損害を与えたことその他重要な事由があるときは、委託者または受益者は、裁判所に受託者の解任を申し立てることができます。受託者が辞任した場合、または裁判所が受託者を解任した場合、委託者は、第46条の規定に従い、新受託者を選任します。なお、受益者は、上記によって行う場合を除き、受託者を解任することはできないものとします。

②　委託者が新受託者を選任できないときは、委託者はこの信託契約を解約し、信託を終了させます。

【信託約款の変更等】

第46条　委託者は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託者と合意の上、この信託約款を変更することまたはこの信託と他の信託との併合（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。以下同じ。）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その内容を監督官庁に届け出ます。なお、この信託約款は本条に定める以外の方法によって変更することができないものとします。

②　委託者は、前項の事項（前項の変更事項にあってはその変更の内容が重大なものに該当する場合に限り、併合事項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、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、この信託約款にかかる知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発します。

③　前項の書面決議において、受益者（委託者およびこの信託の信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権にかかる受益者としての受託者を除きます。以下本項において同じ。）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。

④　第２項の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。

⑤　書面決議の効力は、この信託のすべての受益者に対してその効力を生じます。

⑥　第２項から前項までの規定は、委託者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、この信託約款にかかる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。

⑦　前各項の規定にかかわらず、この投資信託において併合の書面決議が可決された場合にあっても、当該併合にかかる一または複数の他の投資信託において当該併合の書面決議が否決された場合は、当該他の投資信託との併合を行うことはできません。

【反対受益者の受益権買取請求の不適用】

第47条　この信託は、受益者が第39条の規定による一部解約の実行の請求を行ったときは、委託者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、第41条に規定する信託契約の解約または前条に規定する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。

【他の受益者の氏名等の開示の請求の制限】

第48条　この信託の受益者は、委託者または受託者に対し、次に掲げる事項の開示の請求を行うことはできません。

１．他の受益者の氏名または名称および住所

２．他の受益者が有する受益権の内容

【信託期間の延長】

第49条　＜削除＞

【運用報告書に記載すべき事項の提供】

第50条　委託者は、投資信託及び投資法人に関する法律第14条第１項に定める運用報告書の交付に代えて、運用報告書に記載すべき事項を電磁的方法により受益者に提供することができます。この場合において、委託者は、運用報告書を交付したものとみなします。

②　前項の規定にかかわらず、委託者は、受益者から運用報告書の交付の請求があった場合には、これを交付するものとします。

【公告】

第51条　委託者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

②　前項の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。

【信託約款に関する疑義の取扱い】

第52条　この信託約款の解釈について疑義を生じたときは、委託者と受託者との協議により定めます。

上記条項により信託契約を締結します。

平成29年９月14日（信託契約締結日）

委託者　　東京都港区愛宕二丁目５番１号
三井住友アセットマネジメント株式会社
代表取締役　　松下　隆史

受託者　　東京都千代田区丸の内一丁目４番１号
三井住友信託銀行株式会社
取締役社長　　橋本　勝

〔付表〕

１．運用の基本方針および信託約款第17条第１項に規定する「別に定める投資信託証券」は下記のものとします。

親投資信託　国内株式インデックス・マザーファンド（Ｂ号）
親投資信託　外国株式インデックス・マザーファンド
親投資信託　エマージング株式インデックス・マザーファンド
親投資信託　Ｊリート・インデックス・マザーファンド
親投資信託　外国リート・インデックス・マザーファンド
親投資信託　国内債券パッシブ・マザーファンド
親投資信託　外国債券パッシブ・マザーファンド
親投資信託　ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド
米国籍米ドル建て投資信託　ｉシェアーズ　Ｊ．Ｐ．モルガン・米ドル建てエマージング・マーケット債券ＥＴＦ

２．信託約款第13条第５項および第39条第２項に規定する「別に定める日」は下記のものとします。

・ニューヨークの取引所の休業日
・ニューヨークの銀行の休業日

追加型証券投資信託
三井住友・資産最適化ファンド（４やや成長型）
約款

三井住友ＤＳアセットマネジメント株式会社

〔運用の基本方針〕

信託約款第19条に基づき、委託者の定める運用の基本方針は以下の通りとします。

１．基本方針

この投資信託は、世界各国の債券、株式および不動産投資信託（リート）等に分散投資することにより、長期的な視点の基に信託財産の成長と安定的な収益の確保を目指して積極的な運用を行います。

２．運用方法

(1) 投資対象

別に定める投資信託証券を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

① 主として別に定める投資信託証券への投資を通じて、世界各国の債券、株式および不動産投資信託（リート）等に分散投資することにより、長期的な視点の基に信託財産の成長と安定的な収益の確保を目指して積極的な運用を行います。

・主として、国内株式、先進国株式（除く日本）、新興国株式、国内リート、外国リート、国内債券、先進国債券（除く日本）、為替ヘッジ付き先進国債券（除く日本）、新興国債券に投資します。

・別に定める投資信託証券は、継続的にモニタリングを行い必要な場合は追加・入替えも行います。

② イボットソン・アソシエイツ・ジャパン株式会社の助言に基づき、基本資産配分比率を決定します。

・基本資産配分比率は、各資産の期待収益率やリスク（標準偏差）および資産間の相関係数等を推計・最適化して算出します。

③ 実質組入外貨建資産については、別に定める投資信託証券内で対円での為替ヘッジを行っている場合を除き、原則として対円での為替ヘッジを行いません。

④ 投資信託証券の組入比率は、原則として高位を保ちます。

⑤ 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。

(3) 投資制限

① 投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。

② 投資信託証券とコマーシャル・ペーパーおよび短期社債等以外の有価証券への投資は、買い現先取引または債券貸借取引に限ります。

③ 外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。

④ 投資信託証券を組み入れる場合において、一般社団法人投資信託協会規則に定めるエクスポージャーがルックスルーできる場合に該当しないときは、当該投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。

⑤ 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．収益分配方針

年１回（原則として毎年９月15日。休業日の場合は翌営業日）決算を行い、原則として以下の方針に基づき収益分配を行います。

① 分配対象額は、経費控除後の利子、配当等収益と売買益（評価損益を含みます。）等の範囲内とします。

② 収益分配金額は、委託者が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合等には、委託者の判断により分配を行わないことがあります。

③ 留保益の運用については特に制限を定めず、委託者の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。

追加型証券投資信託
『三井住友・資産最適化ファンド（４やや成長型)』
〔信託約款〕

【信託の種類、委託者および受託者】

第１条　この信託は、証券投資信託であり、三井住友ＤＳアセットマネジメント株式会社を委託者とし、三井住友信託銀行株式会社を受託者とします。

②　この信託は、信託法（平成18年法律第108号）（以下「信託法」といいます。）の適用を受けます。

【信託事務の委託】

第２条　受託者は、信託法第28条第１号に基づく信託事務の委託として、信託事務の処理の一部について、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律第１条第１項の規定による信託業務の兼営の認可を受けた一の金融機関（受託者の利害関係人（金融機関の信託業務の兼営等に関する法律第２条第１項にて準用する信託業法第29条第２項第１号に規定する利害関係人をいいます。以下この条、第18条第１項および第２項、第23条において同じ。）を含みます。）と信託契約を締結し、これを委託することができます。

②　前項における利害関係人に対する業務の委託については、受益者の保護に支障を生じることがない場合に行うものとします。

【信託の目的および金額】

第３条　委託者は、金2,000,000円を受益者のために利殖の目的をもって信託し、受託者はこれを引き受けます。

【信託金の限度額】

第４条　委託者は、受託者と合意の上、金2,000億円を限度として信託金を追加することができます。

②　委託者は、受託者と合意の上、前項の限度額を変更することができます。

【信託期間】

第５条　この信託の期間は、信託契約締結日から第41条第１項、第42条第１項、第43条第１項、第45条第２項による信託終了の日までとします。

【受益権の取得申込みの勧誘の種類】

第６条　この信託にかかる受益権の取得申込みの勧誘は、金融商品取引法第２条第３項第１号に掲げる場合に該当し、投資信託及び投資法人に関する法律第２条第８項で定める公募により行われます。

【当初の受益者】

第７条　この信託契約締結当初および追加信託当初の受益者は、委託者の指定する受益権取得申込者とし、第８条の規定により分割された受益権は、その取得申込口数に応じて、取得申込者に帰属します。

【受益権の分割および再分割】

第８条　委託者は、第３条の規定による受益権については2,000,000口に、追加信託によって生じた受益権については、これを追加信託のつど第９条第１項の追加口数に、それぞれ均等に分割します。

②　委託者は、受託者と協議の上、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。

【追加信託の価額および口数、基準価額の計算方法】

第９条　追加信託金は、追加信託を行う日の前営業日の基準価額に、当該追加信託にかかる受益権の口数を乗じた額とします。

②　この信託約款において基準価額とは、信託財産に属する資産（第20条に規定する借入れ公社債を除きます。）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（以下「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。なお、外貨建資産（外国通貨表示の有価証券（以下「外貨建有価証券」といいます。）、預金その他の資産をいいます。以下同じ。）の円換算については、原則として、わが国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します。

③　第22条に規定する予約為替の評価は、原則としてわが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算します。

【信託日時の異なる受益権の内容】

第10条　この信託の受益権は、信託の日時を異にすることにより差異を生ずることはありません。

【受益権の帰属と受益証券の不発行】

第11条　この信託のすべての受益権は、社振法の規定の適用を受けることとし、受益権の帰属は、委託者があらかじめこの信託の受益権を取り扱うことについて同意した一の振替機関（社振法第２条に規定する「振替機関」をいい、以下「振替機関」といいます。）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。）。

② 委託者は、この信託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がある場合を除き、振替受益権を表示する受益証券を発行しません。なお、受益者は、委託者がやむを得ない事情等により受益証券を発行する場合を除き、無記名式受益証券から記名式受益証券への変更の請求、記名式受益証券から無記名式受益証券への変更の請求、受益証券の再発行の請求を行わないものとします。

③ 委託者は、第８条の規定により分割された受益権について、振替機関等の振替口座簿への新たな記載または記録をするため社振法に定める事項の振替機関への通知を行うものとします。振替機関等は、委託者から振替機関への通知があった場合、社振法の規定に従い、その備える振替口座簿への新たな記載または記録を行います。

【受益権の設定にかかる受託者の通知】

第12条　受託者は、第３条の規定による受益権については信託契約締結日に、また、追加信託により生じた受益権については追加信託のつど、振替機関の定める方法により、振替機関へ当該受益権にかかる信託を設定した旨の通知を行います。

【受益権の申込単位および価額】

第13条　指定販売会社（委託者の指定する金融商品取引法第28条第１項に規定する第一種金融商品取引業を行う者および委託者の指定する金融商品取引法第２条第11項に規定する登録金融機関をいいます。以下同じ。）は、第８条第１項の規定により分割される受益権を、その取得申込者に対し、当該指定販売会社がそれぞれ別に定める単位をもって取得申込みに応じることができるものとします。

② 前項の取得申込者は、指定販売会社に、取得申込みと同時にまたはあらかじめ、自己のために開設されたこの信託の受益権の振替を行うための振替機関等の口座を示すものとし、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。なお、指定販売会社は、当該取得申込みの代金（第３項の受益権の価額に当該取得申込みの口数を乗じて得た額をいいます。）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。

③ 第１項の受益権の価額は、取得申込日の翌営業日の基準価額に、指定販売会社がそれぞれ別に定める手数料および当該手数料にかかる消費税および地方消費税（以下「消費税等」といいます。）に相当する金額を加算した価額とします。ただし、この信託契約締結日前の取得申込みにかかる受益権の価額は、１口につき１円に、指定販売会社がそれぞれ別に定める手数料および当該手数料にかかる消費税等相当額を加算した価額とします。

④ 前項の規定にかかわらず、受益者が第37条第２項に基づいて収益分配金を再投資する場合の受益権の価額は、原則として、第31条に規定する各計算期間終了日の基準価額とします。

⑤ 前各項の規定にかかわらず、指定販売会社は、この信託契約締結日以降において、取得申込日が別に定める日のいずれかに当たる場合には、受益者が第37条第２項に基づいて収益分配金を再投資する場合を除き、当該取得申込みに応じません。

⑥ 前各項の規定にかかわらず、委託者は、取引所等における取引の停止、決済機能の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、受益権の取得申込みの受付けを中止することおよび既に受け付けた取得申込みの受付けを取り消すことができます。

⑦ この信託約款において取引所とは金融商品取引法第２条第17項に規定する取引所金融商品市場および金融商品取引法第２条第８項第３号ロに規定する外国金融商品市場をいいます。

【受益権の譲渡にかかる記載または記録】

第14条　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。

② 前項の申請のある場合には、前項の振替機関等は、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、前項の振替機関等が振替先口座を開設した者でない場合には、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。

③ 委託者は、第１項に規定する振替について、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、委託者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。

【受益権の譲渡の対抗要件】

第15条　受益権の譲渡は、前条の規定による振替口座簿への記載または記録によらなければ、委託者および受託者に対抗することができません。

【投資の対象とする資産の種類】

第16条　この信託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。

１．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。）

イ．有価証券

ロ．約束手形

ハ．金銭債権

２．特定資産以外の資産で、以下に掲げる資産

イ．為替手形

【運用の指図範囲等】

第17条　委託者は、信託金を、主として、別に定める投資信託証券または次の有価証券（金融商品取引法第２条第２項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図します。

１．コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等

２．外国または外国の者の発行する証券で、前号の性質を有するもの

３．国債証券、地方債証券、特別の法律により法人の発行する債券および社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券の新株引受権証券および短期社債等を除きます。）

なお、第３号の証券にかかる運用の指図は買い現先取引（売戻条件付の買入れ）および債券貸借取引（現金担保付債券借入れ）に限り行うことができるものとします。

② 委託者は、信託金を、前項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

③ 第１項の規定にかかわらず、この信託の設定、解約、償還、投資環境の変動等への対応等、委託者が運用上必要と認めるときは、委託者は、信託金を前項に掲げる金融商品により運用することの指図ができます。

【利害関係人等との取引等】

第18条　受託者は、受益者の保護に支障を生じることがないものであり、かつ信託業法、投資信託及び投資法人に関する法律ならびに関連法令に反しない場合には、委託者の指図により、信託財産と、受託者（第三者との間において信託財産のためにする取引その他の行為であって、受託者が当該第三者の代理人となって行うものを含みます。）および受託者の利害関係人、第23条第１項に定める信託業務の委託先およびその利害関係人または受託者における他の信託財産との間で、第

16条、第17条第１項および第２項に定める資産への投資等ならびに第20条、第22条および第26条から第28条までに掲げる取引その他これらに類する行為を行うことができます。

② 受託者は、受託者がこの信託の受託者としての権限に基づいて信託事務の処理として行うことができる取引その他の行為について、受託者または受託者の利害関係人の計算で行うことができるものとします。なお、受託者の利害関係人が当該利害関係人の計算で行う場合も同様とします。

③ 委託者は、金融商品取引法、投資信託及び投資法人に関する法律ならびに関連法令に反しない場合には、信託財産と、委託者、その取締役、執行役および委託者の利害関係人等（金融商品取引法第31条の４第３項および同条第４項に規定する親法人等または子法人等をいいます。）または委託者が運用の指図を行う他の信託財産との間で、第16条、第17条第１項および第２項に定める資産への投資等ならびに第20条、第22条および第26条から第28条までに掲げる取引その他これらに類する行為を行うことの指図をすることができ、受託者は、委託者の指図により、当該投資等ならびに当該取引、当該行為を行うことができます。

④ 前３項の場合、委託者および受託者は、受益者に対して信託法第31条第３項および同法第32条第３項の通知は行いません。

【運用の基本方針】

第19条 委託者は、信託財産の運用にあたっては、別に定める運用の基本方針に従って、その指図を行います。

【公社債の借入れの指図】

第20条 委託者は、信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。なお、当該公社債の借入れを行うにあたり担保の提供が必要と認めたときは、担保の提供の指図をするものとします。

② 前項の指図は、当該借入れにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えない範囲で行うものとします。

③ 信託財産の一部解約等の事由により、前項の借入れにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託者は速やかに、その超える額に相当する借り入れた公社債の一部を返還するための指図をするものとします。

④ 第１項の借入れにかかる品借料は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。

【特別の場合の外貨建有価証券への投資制限】

第21条 外貨建有価証券への投資については、わが国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。

【外国為替予約取引の指図】

第22条 委託者は、信託財産に属する外貨建資産（別に定める投資信託証券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。）について、当該外貨建資産の為替ヘッジのため、外国為替の売買の予約を指図することができます。

② 前項において、信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属する別に定める投資信託証券の時価総額に別に定める投資信託証券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。

【信託業務の委託等】

第23条 受託者は、委託者と協議の上、信託業務の一部について、信託業法第22条第１項に定める信託業務の委託をするときは、以下に掲げる基準のすべてに適合する者（受託者の利害関係人を含みます。）を委託先として選定します。

１．委託先の信用力に照らし、継続的に委託業務の遂行に懸念がないこと

２．委託先の委託業務にかかる実績等に照らし、委託業務を確実に処理する能力があると認められること

３．委託される信託財産に属する財産と自己の固有財産その他の財産とを区分する等の管理を行う体制が整備されていること

４．内部管理に関する業務を適正に遂行するための体制が整備されていること

② 受託者は、前項に定める委託先の選定にあたっては、当該委託先が前項各号に掲げる基準に適合していることを確認するものとします。

③ 前２項にかかわらず、受託者は、次の各号に掲げる業務を、受託者および委託者が適当と認める

者（受託者の利害関係人を含みます。）に委託することができるものとします。

１．信託財産の保存にかかる業務

２．信託財産の性質を変えない範囲内において、その利用または改良を目的とする業務

３．委託者のみの指図により信託財産の処分およびその他の信託の目的の達成のために必要な行為にかかる業務

４．受託者が行う業務の遂行にとって補助的な機能を有する行為

【混蔵寄託】

第24条　金融機関または金融商品取引業者（金融商品取引法第２条第９項に規定するものをいいます。本条においては、外国の法令に準拠して設立された法人でこの者に類する者を含みます。）から、売買代金および償還金等について円貨で約定し円貨で決済する取引により取得した外国において発行された譲渡性預金証書またはコマーシャル・ペーパーは、当該金融機関または金融商品取引業者が保管契約を締結した保管機関に当該金融機関または金融商品取引業者の名義で混蔵寄託することができるものとします。

【信託財産の登記等および記載等の留保等】

第25条　信託の登記または登録をすることができる信託財産については、信託の登記または登録をすることとします。ただし、受託者が認める場合は、信託の登記または登録を留保することがあります。

②　前項ただし書きにかかわらず、受益者保護のために委託者または受託者が必要と認めるときは、速やかに登記または登録をするものとします。

③　信託財産に属する旨の記載または記録をすることができる信託財産については、信託財産に属する旨の記載または記録をするとともに、その計算を明らかにする方法により分別して管理するものとします。ただし、受託者が認める場合は、その計算を明らかにする方法により分別して管理することがあります。

④　動産（金銭を除きます。）については、外形上区別することができる方法によるほか、その計算を明らかにする方法により分別して管理することがあります。

【一部解約の請求および有価証券の売却等の指図】

第26条　委託者は、信託財産に属する投資信託証券にかかる信託契約の一部解約の実行請求ならびに有価証券の売却等の指図ができます。

【再投資の指図】

第27条　委託者は、前条の規定による一部解約の代金、有価証券の売却代金、有価証券にかかる償還金等、有価証券等にかかる利子等およびその他の収入金を再投資することの指図ができます。

【資金の借入れ】

第28条　委託者は、信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性に資するため、一部解約に伴う支払資金の手当て（一部解約に伴う支払資金の手当てのために借り入れた資金の返済を含みます。）を目的として、または再投資にかかる収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金の借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。

②　一部解約に伴う支払資金の手当てにかかる借入期間は、有価証券等の売却代金、解約代金または償還金の入金日までに限るものとし、資金借入額は、次の各号に掲げる要件を満たす範囲内の額とします。

１．一部解約金の支払資金の手当てのために行った有価証券等の売却等による受取りの確定している資金の額の範囲内

２．一部解約金支払日の前営業日において確定した当該支払日における支払資金の不足額の範囲内

３．借入れ指図を行う日における信託財産の純資産総額の10％以内

③　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。

④　借入金の利息は受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。

【損益の帰属】

第29条　委託者の指図に基づく行為により信託財産に生じた利益および損失は、すべて受益者に帰属します。

【受託者による資金の立替え】

第30条　信託財産に属する有価証券について、借替がある場合で、委託者の申し出があるときは、受託者は資金の立替えをすることができます。

②　信託財産に属する有価証券にかかる償還金等、有価証券等にかかる利子等およびその他の未収入金で、信託終了日までにその金額を見積りうるものがあるときは、受託者がこれを立て替えて信託財産に繰り入れることができます。

③　前２項の立替金の決済および利息については、受託者と委託者との協議により、そのつど別にこれを定めます。

【信託の計算期間】

第31条　この信託の計算期間は、毎年９月16日から翌年９月15日までとすることを原則とします。ただし、第１計算期間は平成29年９月14日から平成30年９月18日までとします。

②　前項の規定にかかわらず、前項の原則により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されるものとします。ただし、最終計算期間の終了日は、第５条に規定する信託期間の終了日とします。

【信託財産に関する報告等】

第32条　受託者は、毎計算期末に損益計算を行い、信託財産に関する報告書を作成して、これを委託者に提出します。

②　受託者は、信託終了のときに最終計算を行い、信託財産に関する報告書を作成して、これを委託者に提出します。

③　受託者は、前２項の報告を行うことにより、受益者に対する信託法第37条第３項に定める報告は行わないこととします。

④　受益者は、受託者に対し、信託法第37条第２項に定める書類または電磁的記録の作成に欠くことのできない情報その他の信託に関する重要な情報および当該受益者以外の者の利益を害するおそれのない情報を除き、信託法第38条第１項に定める閲覧または謄写の請求をすることはできないものとします。

【信託事務等の諸費用】

第33条　信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産の財務諸表の監査費用の全部または一部（消費税等相当額を含みます。）および受託者の立て替えた立替金の利息等（以下「諸経費」といいます。）は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。

②　前項の信託財産の財務諸表の監査費用の全部または一部については、第31条に規定する計算期間を通じて毎日、固定率または固定金額にて計算した額を、毎計算期間の最初の６ヵ月終了日および毎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。

【信託報酬等の額】

第34条　委託者および受託者の信託報酬の総額は、第31条に規定する計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に年10,000分の88の率を乗じて得た額とします。

②　前項の信託報酬は、毎計算期間の最初の６ヵ月終了日および毎計算期末または信託終了のとき信託財産中から支弁するものとし、委託者と受託者との間の配分は別に定めます。

③　第１項の信託報酬にかかる消費税等に相当する金額を、信託報酬支弁のときに信託財産中から支弁します。

【収益の処理方法】

第35条　信託財産から生ずる毎計算期末における利益は、次の方法により処理します。

１．配当金、利子およびこれらに類する収益から支払利息を控除した額（以下「配当等収益」といいます。）は、諸経費、信託報酬および当該信託報酬にかかる消費税等に相当する金額を控除した後、その残額を受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配にあてるため、その一部を分配準備積立金として積み立てることができます。

２．売買損益に評価損益を加減した利益金額（以下「売買益」といいます。）は、諸経費、信託報酬および当該信託報酬にかかる消費税等に相当する金額を控除し、繰越欠損金のあるときは、その全額を売買益をもって補てんした後、受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配にあてるため、分配準備積立金として積み立てることができます。

②　毎計算期末において、信託財産につき生じた損失は、次期に繰り越します。

【収益分配金、償還金および一部解約金の払込みと支払いに関する受託者の免責】

第36条　受託者は、収益分配金については原則として毎計算期間終了日の翌営業日に、償還金（信託終了時における信託財産の純資産総額を受益権総口数で除した額をいいます。以下同じ。）については第37条第３項に規定する支払開始日までに、一部解約金については第37条第４項に規定する支払開始日までに、その全額を委託者の指定する預金口座等に払い込みます。

② 受託者は、前項の規定により委託者の指定する預金口座等に収益分配金、償還金および一部解約金を払い込んだ後は、受益者に対する支払いにつき、その責に任じません。

【収益分配金、償還金および一部解約金の支払いならびに収益分配金の再投資】

第37条　収益分配金は、毎計算期間終了日後１ヵ月以内の委託者の指定する日から、毎計算期間の末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（当該収益分配金にかかる計算期間の末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計算期間の末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指定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ます。）に支払います。

② 前項の規定にかかわらず、別に定める「累積投資約款」に従った契約（別の名称で同様の権利義務関係を規定する契約を含むものとし、その場合は、当該別の名称に読み替えるものとします。）に基づいて収益分配金を再投資する受益者に対しては、受託者が委託者の指定する預金口座等に払い込むことにより、原則として、毎計算期間終了日の翌営業日に、収益分配金が指定販売会社に交付されます。この場合、指定販売会社は、受益者に対し遅滞なく収益分配金の再投資にかかる受益権の売付けを行います。当該売付けにより増加した受益権は、第11条第３項の規定に従い、振替口座簿に記載または記録されます。

③ 償還金は、信託終了日後１ヵ月以内の委託者の指定する日から、信託終了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（信託終了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、当該信託終了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指定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ます。）に支払います。なお、当該受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して委託者がこの信託の償還をするのと引換えに、当該償還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。

④ 一部解約金は、第39条第１項の受益者の請求を受け付けた日から起算して、原則として６営業日目から当該受益者に支払います。

⑤ 前各項（第２項を除きます。）に規定する収益分配金、償還金および一部解約金の支払いは、指定販売会社の営業所等において行うものとします。

⑥ 収益分配金、償還金および一部解約金にかかる収益調整金は、原則として、各受益者毎の信託時の受益権の価額等に応じて計算されるものとします。なお、「収益調整金」は、所得税法施行令第27条の規定によるものとし、各受益者毎の信託時の受益権の価額と元本との差額をいい、原則として、追加信託のつど、当該口数により加重平均され、収益分配のつど、調整されるものとします。また、「各受益者毎の信託時の受益権の価額等」とは、原則として、各受益者毎の信託時の受益権の価額をいい、追加信託のつど、当該口数により加重平均され、収益分配のつど、調整されるものとします。

【収益分配金および償還金の時効】

第38条　受益者が、収益分配金については前条第１項に規定する支払開始日から５年間その支払いを請求しないとき、ならびに信託終了による償還金については前条第３項に規定する支払開始日から10年間その支払いを請求しないときは、その権利を失い、受託者から交付を受けた金銭は、委託者に帰属します。

【信託契約の一部解約】

第39条　受益者は、自己に帰属する受益権につき、委託者に１口単位をもって一部解約の実行を請求することができます。

② 前項の規定にかかわらず、委託者は、一部解約の実行の請求日が別に定める日のいずれかに当たる場合には、当該一部解約の実行の請求を受け付けません。

③ 委託者は、第１項の一部解約の実行の請求を受け付けた場合には、この信託契約の一部を解約します。なお、第１項の一部解約の実行の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この信託契約の一部解約を委託者が行うのと引換えに、当該一部解約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。

④ 前項の一部解約の価額は、一部解約の実行の請求日の翌営業日の基準価額とします。

⑤ 受益者が一部解約の実行の請求をするときは、指定販売会社に対し、振替受益権をもって行うものとします。

⑥ 委託者は、取引所等における取引の停止、決済機能の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、第１項による一部解約の実行の請求の受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の請求の受付けを取り消すことができます。

⑦ 前項により一部解約の実行の請求の受付けが中止された場合には、受益者は当該受付け中止前に行った実行されていない一部解約の実行の請求を撤回できます。ただし、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、当該受益権の一部解約の価額は、当該受付け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、第４項の規定に準じて算出した価額とします。

【質権口記載または記録の受益権の取扱い】

第40条 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、この信託約款によるほか、民法その他の法令等に従って取り扱われます。

【信託契約の解約】

第41条 委託者は、信託期間中において、この信託契約を解約することが受益者のため有利であると認めるとき、信託契約の一部を解約することにより受益権の口数が10億口を下回ることとなったとき、その他やむを得ない事情が発生したときは、受託者と合意の上、こ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、委託者は、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。

② 委託者は、前項の事項について、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、この信託契約にかかる知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発します。

③ 前項の書面決議において、受益者（委託者およびこの信託の信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権にかかる受益者としての受託者を除きます。以下本項において同じ。）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。

④ 第２項の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。

⑤ 第２項から前項までの規定は、委託者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、この信託契約にかかる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、第２項から前項までの手続きを行うことが困難な場合も同様とします。

【信託契約に関する監督官庁の命令】

第42条 委託者は、監督官庁よりこ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。

② 委託者は、監督官庁の命令に基づいてこの信託約款を変更しようとするときは、第46条の規定に従います。

【委託者の登録取消等に伴う取扱い】

第43条 委託者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、委託者は、この信託契約を解約し、信託を終了させます。

② 前項の規定にかかわらず、監督官庁がこの信託契約に関する委託者の業務を他の投資信託委託会社に引き継ぐことを命じたときは、この信託は、第46条第２項の書面決議で否決された場合を除き、当該投資信託委託会社と受託者との間において存続します。

【委託者の事業の譲渡および承継に伴う取扱い】

第44条　委託者は、事業の全部または一部を譲渡することがあり、これに伴い、この信託契約に関する事業を譲渡することがあります。

②　委託者は、分割により事業の全部または一部を承継させることがあり、これに伴い、この信託契約に関する事業を承継させることがあります。

【受託者の辞任および解任に伴う取扱い】

第45条　受託者は、委託者の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託者がその任務に違反して信託財産に著しい損害を与えたことその他重要な事由があるときは、委託者または受益者は、裁判所に受託者の解任を申し立てることができます。受託者が辞任した場合、または裁判所が受託者を解任した場合、委託者は、第46条の規定に従い、新受託者を選任します。なお、受益者は、上記によって行う場合を除き、受託者を解任することはできないものとします。

②　委託者が新受託者を選任できないときは、委託者はこの信託契約を解約し、信託を終了させます。

【信託約款の変更等】

第46条　委託者は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託者と合意の上、この信託約款を変更することまたはこの信託と他の信託との併合（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。以下同じ。）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その内容を監督官庁に届け出ます。なお、この信託約款は本条に定める以外の方法によって変更することができないものとします。

②　委託者は、前項の事項（前項の変更事項にあってはその変更の内容が重大なものに該当する場合に限り、併合事項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、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、この信託約款にかかる知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発します。

③　前項の書面決議において、受益者（委託者およびこの信託の信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権にかかる受益者としての受託者を除きます。以下本項において同じ。）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。

④　第２項の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。

⑤　書面決議の効力は、この信託のすべての受益者に対してその効力を生じます。

⑥　第２項から前項までの規定は、委託者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、この信託約款にかかる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。

⑦　前各項の規定にかかわらず、この投資信託において併合の書面決議が可決された場合にあっても、当該併合にかかる一または複数の他の投資信託において当該併合の書面決議が否決された場合は、当該他の投資信託との併合を行うことはできません。

【反対受益者の受益権買取請求の不適用】

第47条　この信託は、受益者が第39条の規定による一部解約の実行の請求を行ったときは、委託者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、第41条に規定する信託契約の解約または前条に規定する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。

【他の受益者の氏名等の開示の請求の制限】

第48条　この信託の受益者は、委託者または受託者に対し、次に掲げる事項の開示の請求を行うことはできません。

１．他の受益者の氏名または名称および住所

２．他の受益者が有する受益権の内容

【信託期間の延長】

第49条　＜削除＞

【運用報告書に記載すべき事項の提供】

第50条　委託者は、投資信託及び投資法人に関する法律第14条第１項に定める運用報告書の交付に代えて、運用報告書に記載すべき事項を電磁的方法により受益者に提供することができます。この場合において、委託者は、運用報告書を交付したものとみなします。

②　前項の規定にかかわらず、委託者は、受益者から運用報告書の交付の請求があった場合には、これを交付するものとします。

【公告】

第51条　委託者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

②　前項の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。

【信託約款に関する疑義の取扱い】

第52条　この信託約款の解釈について疑義を生じたときは、委託者と受託者との協議により定めます。

上記条項により信託契約を締結します。

平成29年９月14日（信託契約締結日）

委託者　　東京都港区愛宕二丁目５番１号
三井住友アセットマネジメント株式会社
代表取締役　　松下　隆史

受託者　　東京都千代田区丸の内一丁目４番１号
三井住友信託銀行株式会社
取締役社長　　橋本　勝

〔付表〕

１．運用の基本方針および信託約款第17条第１項に規定する「別に定める投資信託証券」は下記のものとします。

親投資信託　国内株式インデックス・マザーファンド（Ｂ号）
親投資信託　外国株式インデックス・マザーファンド
親投資信託　エマージング株式インデックス・マザーファンド
親投資信託　Ｊリート・インデックス・マザーファンド
親投資信託　外国リート・インデックス・マザーファンド
親投資信託　国内債券パッシブ・マザーファンド
親投資信託　外国債券パッシブ・マザーファンド
親投資信託　ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド
米国籍米ドル建て投資信託　ｉシェアーズ　Ｊ．Ｐ．モルガン・米ドル建てエマージング・マーケット債券ＥＴＦ

２．信託約款第13条第５項および第39条第２項に規定する「別に定める日」は下記のものとします。

・ニューヨークの取引所の休業日
・ニューヨークの銀行の休業日

追加型証券投資信託
三井住友・資産最適化ファンド（５成長重視型）
約款

三井住友ＤＳアセットマネジメント株式会社

〔運用の基本方針〕

信託約款第19条に基づき、委託者の定める運用の基本方針は以下の通りとします。

１．基本方針

この投資信託は、世界各国の債券、株式および不動産投資信託（リート）等に分散投資することにより、長期的な視点の基に信託財産の成長を目指して積極的な運用を行います。

２．運用方法

(1) 投資対象

別に定める投資信託証券を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

① 主として別に定める投資信託証券への投資を通じて、世界各国の債券、株式および不動産投資信託（リート）等に分散投資することにより、長期的な視点の基に信託財産の成長を目指して積極的な運用を行います。

・主として、国内株式、先進国株式（除く日本）、新興国株式、国内リート、外国リート、国内債券、先進国債券（除く日本）、為替ヘッジ付き先進国債券（除く日本）、新興国債券に投資します。

・別に定める投資信託証券は、継続的にモニタリングを行い必要な場合は追加・入替えも行います。

② イボットソン・アソシエイツ・ジャパン株式会社の助言に基づき、基本資産配分比率を決定します。

・基本資産配分比率は、各資産の期待収益率やリスク（標準偏差）および資産間の相関係数等を推計・最適化して算出します。

③ 実質組入外貨建資産については、別に定める投資信託証券内で対円での為替ヘッジを行っている場合を除き、原則として対円での為替ヘッジを行いません。

④ 投資信託証券の組入比率は、原則として高位を保ちます。

⑤ 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。

(3) 投資制限

① 投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。

② 投資信託証券とコマーシャル・ペーパーおよび短期社債等以外の有価証券への投資は、買い現先取引または債券貸借取引に限ります。

③ 外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。

④ 投資信託証券を組み入れる場合において、一般社団法人投資信託協会規則に定めるエクスポージャーがルックスルーできる場合に該当しないときは、当該投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。

⑤ 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．収益分配方針

年１回（原則として毎年９月15日。休業日の場合は翌営業日）決算を行い、原則として以下の方針に基づき収益分配を行います。

① 分配対象額は、経費控除後の利子、配当等収益と売買益（評価損益を含みます。）等の範囲内とします。

② 収益分配金額は、委託者が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合等には、委託者の判断により分配を行わないことがあります。

③ 留保益の運用については特に制限を定めず、委託者の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。

追加型証券投資信託
『三井住友・資産最適化ファンド（５成長重視型）』
〔信託約款〕

【信託の種類、委託者および受託者】

第１条　この信託は、証券投資信託であり、三井住友ＤＳアセットマネジメント株式会社を委託者とし、三井住友信託銀行株式会社を受託者とします。

②　この信託は、信託法（平成18年法律第108号）（以下「信託法」といいます。）の適用を受けます。

【信託事務の委託】

第２条　受託者は、信託法第28条第１号に基づく信託事務の委託として、信託事務の処理の一部について、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律第１条第１項の規定による信託業務の兼営の認可を受けた一の金融機関（受託者の利害関係人（金融機関の信託業務の兼営等に関する法律第２条第１項にて準用する信託業法第29条第２項第１号に規定する利害関係人をいいます。以下この条、第18条第１項および第２項、第23条において同じ。）を含みます。）と信託契約を締結し、これを委託することができます。

②　前項における利害関係人に対する業務の委託については、受益者の保護に支障を生じることがない場合に行うものとします。

【信託の目的および金額】

第３条　委託者は、金2,000,000円を受益者のために利殖の目的をもって信託し、受託者はこれを引き受けます。

【信託金の限度額】

第４条　委託者は、受託者と合意の上、金2,000億円を限度として信託金を追加することができます。

②　委託者は、受託者と合意の上、前項の限度額を変更することができます。

【信託期間】

第５条　この信託の期間は、信託契約締結日から第41条第１項、第42条第１項、第43条第１項、第45条第２項による信託終了の日までとします。

【受益権の取得申込みの勧誘の種類】

第６条　この信託にかかる受益権の取得申込みの勧誘は、金融商品取引法第２条第３項第１号に掲げる場合に該当し、投資信託及び投資法人に関する法律第２条第８項で定める公募により行われます。

【当初の受益者】

第７条　この信託契約締結当初および追加信託当初の受益者は、委託者の指定する受益権取得申込者とし、第８条の規定により分割された受益権は、その取得申込口数に応じて、取得申込者に帰属します。

【受益権の分割および再分割】

第８条　委託者は、第３条の規定による受益権については2,000,000口に、追加信託によって生じた受益権については、これを追加信託のつど第９条第１項の追加口数に、それぞれ均等に分割します。

②　委託者は、受託者と協議の上、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。

【追加信託の価額および口数、基準価額の計算方法】

第９条　追加信託金は、追加信託を行う日の前営業日の基準価額に、当該追加信託にかかる受益権の口数を乗じた額とします。

②　この信託約款において基準価額とは、信託財産に属する資産（第20条に規定する借入れ公社債を除きます。）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（以下「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。なお、外貨建資産（外国通貨表示の有価証券（以下「外貨建有価証券」といいます。）、預金その他の資産をいいます。以下同じ。）の円換算については、原則として、わが国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します。

③　第22条に規定する予約為替の評価は、原則としてわが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算します。

【信託日時の異なる受益権の内容】

第10条　この信託の受益権は、信託の日時を異にすることにより差異を生ずることはありません。

【受益権の帰属と受益証券の不発行】

第11条　この信託のすべての受益権は、社振法の規定の適用を受けることとし、受益権の帰属は、委託者があらかじめこの信託の受益権を取り扱うことについて同意した一の振替機関（社振法第２条に規定する「振替機関」をいい、以下「振替機関」といいます。）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。）。

② 委託者は、この信託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がある場合を除き、振替受益権を表示する受益証券を発行しません。なお、受益者は、委託者がやむを得ない事情等により受益証券を発行する場合を除き、無記名式受益証券から記名式受益証券への変更の請求、記名式受益証券から無記名式受益証券への変更の請求、受益証券の再発行の請求を行わないものとします。

③ 委託者は、第８条の規定により分割された受益権について、振替機関等の振替口座簿への新たな記載または記録をするため社振法に定める事項の振替機関への通知を行うものとします。振替機関等は、委託者から振替機関への通知があった場合、社振法の規定に従い、その備える振替口座簿への新たな記載または記録を行います。

【受益権の設定にかかる受託者の通知】

第12条　受託者は、第３条の規定による受益権については信託契約締結日に、また、追加信託により生じた受益権については追加信託のつど、振替機関の定める方法により、振替機関へ当該受益権にかかる信託を設定した旨の通知を行います。

【受益権の申込単位および価額】

第13条　指定販売会社（委託者の指定する金融商品取引法第28条第１項に規定する第一種金融商品取引業を行う者および委託者の指定する金融商品取引法第２条第11項に規定する登録金融機関をいいます。以下同じ。）は、第８条第１項の規定により分割される受益権を、その取得申込者に対し、当該指定販売会社がそれぞれ別に定める単位をもって取得申込みに応じることができるものとします。

② 前項の取得申込者は、指定販売会社に、取得申込みと同時にまたはあらかじめ、自己のために開設されたこの信託の受益権の振替を行うための振替機関等の口座を示すものとし、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。なお、指定販売会社は、当該取得申込みの代金（第３項の受益権の価額に当該取得申込みの口数を乗じて得た額をいいます。）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。

③ 第１項の受益権の価額は、取得申込日の翌営業日の基準価額に、指定販売会社がそれぞれ別に定める手数料および当該手数料にかかる消費税および地方消費税（以下「消費税等」といいます。）に相当する金額を加算した価額とします。ただし、この信託契約締結日前の取得申込みにかかる受益権の価額は、１口につき１円に、指定販売会社がそれぞれ別に定める手数料および当該手数料にかかる消費税等相当額を加算した価額とします。

④ 前項の規定にかかわらず、受益者が第37条第２項に基づいて収益分配金を再投資する場合の受益権の価額は、原則として、第31条に規定する各計算期間終了日の基準価額とします。

⑤ 前各項の規定にかかわらず、指定販売会社は、この信託契約締結日以降において、取得申込日が別に定める日のいずれかに当たる場合には、受益者が第37条第２項に基づいて収益分配金を再投資する場合を除き、当該取得申込みに応じません。

⑥ 前各項の規定にかかわらず、委託者は、取引所等における取引の停止、決済機能の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、受益権の取得申込みの受付けを中止することおよび既に受け付けた取得申込みの受付けを取り消すことができます。

⑦ この信託約款において取引所とは金融商品取引法第２条第17項に規定する取引所金融商品市場および金融商品取引法第２条第８項第３号ロに規定する外国金融商品市場をいいます。

【受益権の譲渡にかかる記載または記録】

第14条　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。

② 前項の申請のある場合には、前項の振替機関等は、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、前項の振替機関等が振替先口座を開設した者でない場合には、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。

③ 委託者は、第１項に規定する振替について、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、委託者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。

【受益権の譲渡の対抗要件】

第15条　受益権の譲渡は、前条の規定による振替口座簿への記載または記録によらなければ、委託者および受託者に対抗することができません。

【投資の対象とする資産の種類】

第16条　この信託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。

１．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。）

イ．有価証券

ロ．約束手形

ハ．金銭債権

２．特定資産以外の資産で、以下に掲げる資産

イ．為替手形

【運用の指図範囲等】

第17条　委託者は、信託金を、主として、別に定める投資信託証券または次の有価証券（金融商品取引法第２条第２項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図します。

１．コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等

２．外国または外国の者の発行する証券で、前号の性質を有するもの

３．国債証券、地方債証券、特別の法律により法人の発行する債券および社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券の新株引受権証券および短期社債等を除きます。）

なお、第３号の証券にかかる運用の指図は買い現先取引（売戻条件付の買入れ）および債券貸借取引（現金担保付債券借入れ）に限り行うことができるものとします。

② 委託者は、信託金を、前項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

③ 第１項の規定にかかわらず、この信託の設定、解約、償還、投資環境の変動等への対応等、委託者が運用上必要と認めるときは、委託者は、信託金を前項に掲げる金融商品により運用することの指図ができます。

【利害関係人等との取引等】

第18条　受託者は、受益者の保護に支障を生じることがないものであり、かつ信託業法、投資信託及び投資法人に関する法律ならびに関連法令に反しない場合には、委託者の指図により、信託財産と、受託者（第三者との間において信託財産のためにする取引その他の行為であって、受託者が当該第三者の代理人となって行うものを含みます。）および受託者の利害関係人、第23条第１項に定める信託業務の委託先およびその利害関係人または受託者における他の信託財産との間で、第

16条、第17条第１項および第２項に定める資産への投資等ならびに第20条、第22条および第26条から第28条までに掲げる取引その他これらに類する行為を行うことができます。

② 受託者は、受託者がこの信託の受託者としての権限に基づいて信託事務の処理として行うことができる取引その他の行為について、受託者または受託者の利害関係人の計算で行うことができるものとします。なお、受託者の利害関係人が当該利害関係人の計算で行う場合も同様とします。

③ 委託者は、金融商品取引法、投資信託及び投資法人に関する法律ならびに関連法令に反しない場合には、信託財産と、委託者、その取締役、執行役および委託者の利害関係人等（金融商品取引法第31条の４第３項および同条第４項に規定する親法人等または子法人等をいいます。）または委託者が運用の指図を行う他の信託財産との間で、第16条、第17条第１項および第２項に定める資産への投資等ならびに第20条、第22条および第26条から第28条までに掲げる取引その他これらに類する行為を行うことの指図をすることができ、受託者は、委託者の指図により、当該投資等ならびに当該取引、当該行為を行うことができます。

④ 前３項の場合、委託者および受託者は、受益者に対して信託法第31条第３項および同法第32条第３項の通知は行いません。

【運用の基本方針】

第19条 委託者は、信託財産の運用にあたっては、別に定める運用の基本方針に従って、その指図を行います。

【公社債の借入れの指図】

第20条 委託者は、信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。なお、当該公社債の借入れを行うにあたり担保の提供が必要と認めたときは、担保の提供の指図をするものとします。

② 前項の指図は、当該借入れにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えない範囲で行うものとします。

③ 信託財産の一部解約等の事由により、前項の借入れにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託者は速やかに、その超える額に相当する借り入れた公社債の一部を返還するための指図をするものとします。

④ 第１項の借入れにかかる品借料は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。

【特別の場合の外貨建有価証券への投資制限】

第21条 外貨建有価証券への投資については、わが国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。

【外国為替予約取引の指図】

第22条 委託者は、信託財産に属する外貨建資産（別に定める投資信託証券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。）について、当該外貨建資産の為替ヘッジのため、外国為替の売買の予約を指図することができます。

② 前項において、信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属する別に定める投資信託証券の時価総額に別に定める投資信託証券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。

【信託業務の委託等】

第23条 受託者は、委託者と協議の上、信託業務の一部について、信託業法第22条第１項に定める信託業務の委託をするときは、以下に掲げる基準のすべてに適合する者（受託者の利害関係人を含みます。）を委託先として選定します。

１．委託先の信用力に照らし、継続的に委託業務の遂行に懸念がないこと

２．委託先の委託業務にかかる実績等に照らし、委託業務を確実に処理する能力があると認められること

３．委託される信託財産に属する財産と自己の固有財産その他の財産とを区分する等の管理を行う体制が整備されていること

４．内部管理に関する業務を適正に遂行するための体制が整備されていること

② 受託者は、前項に定める委託先の選定にあたっては、当該委託先が前項各号に掲げる基準に適合していることを確認するものとします。

③ 前２項にかかわらず、受託者は、次の各号に掲げる業務を、受託者および委託者が適当と認める

者（受託者の利害関係人を含みます。）に委託することができるものとします。

１．信託財産の保存にかかる業務

２．信託財産の性質を変えない範囲内において、その利用または改良を目的とする業務

３．委託者のみの指図により信託財産の処分およびその他の信託の目的の達成のために必要な行為にかかる業務

４．受託者が行う業務の遂行にとって補助的な機能を有する行為

【混蔵寄託】

第24条　金融機関または金融商品取引業者（金融商品取引法第２条第９項に規定するものをいいます。本条においては、外国の法令に準拠して設立された法人でこの者に類する者を含みます。）から、売買代金および償還金等について円貨で約定し円貨で決済する取引により取得した外国において発行された譲渡性預金証書またはコマーシャル・ペーパーは、当該金融機関または金融商品取引業者が保管契約を締結した保管機関に当該金融機関または金融商品取引業者の名義で混蔵寄託することができるものとします。

【信託財産の登記等および記載等の留保等】

第25条　信託の登記または登録をすることができる信託財産については、信託の登記または登録をすることとします。ただし、受託者が認める場合は、信託の登記または登録を留保することがあります。

②　前項ただし書きにかかわらず、受益者保護のために委託者または受託者が必要と認めるときは、速やかに登記または登録をするものとします。

③　信託財産に属する旨の記載または記録をすることができる信託財産については、信託財産に属する旨の記載または記録をするとともに、その計算を明らかにする方法により分別して管理するものとします。ただし、受託者が認める場合は、その計算を明らかにする方法により分別して管理することがあります。

④　動産（金銭を除きます。）については、外形上区別することができる方法によるほか、その計算を明らかにする方法により分別して管理することがあります。

【一部解約の請求および有価証券の売却等の指図】

第26条　委託者は、信託財産に属する投資信託証券にかかる信託契約の一部解約の実行請求ならびに有価証券の売却等の指図ができます。

【再投資の指図】

第27条　委託者は、前条の規定による一部解約の代金、有価証券の売却代金、有価証券にかかる償還金等、有価証券等にかかる利子等およびその他の収入金を再投資することの指図ができます。

【資金の借入れ】

第28条　委託者は、信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性に資するため、一部解約に伴う支払資金の手当て（一部解約に伴う支払資金の手当てのために借り入れた資金の返済を含みます。）を目的として、または再投資にかかる収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金の借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。

②　一部解約に伴う支払資金の手当てにかかる借入期間は、有価証券等の売却代金、解約代金または償還金の入金日までに限るものとし、資金借入額は、次の各号に掲げる要件を満たす範囲内の額とします。

１．一部解約金の支払資金の手当てのために行った有価証券等の売却等による受取りの確定している資金の額の範囲内

２．一部解約金支払日の前営業日において確定した当該支払日における支払資金の不足額の範囲内

３．借入れ指図を行う日における信託財産の純資産総額の10％以内

③　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。

④　借入金の利息は受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。

【損益の帰属】

第29条　委託者の指図に基づく行為により信託財産に生じた利益および損失は、すべて受益者に帰属します。

【受託者による資金の立替え】

第30条　信託財産に属する有価証券について、借替がある場合で、委託者の申し出があるときは、受託者は資金の立替えをすることができます。

②　信託財産に属する有価証券にかかる償還金等、有価証券等にかかる利子等およびその他の未収入金で、信託終了日までにその金額を見積りうるものがあるときは、受託者がこれを立て替えて信託財産に繰り入れることができます。

③　前２項の立替金の決済および利息については、受託者と委託者との協議により、そのつど別にこれを定めます。

【信託の計算期間】

第31条　この信託の計算期間は、毎年９月16日から翌年９月15日までとすることを原則とします。ただし、第１計算期間は平成29年９月14日から平成30年９月18日までとします。

②　前項の規定にかかわらず、前項の原則により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されるものとします。ただし、最終計算期間の終了日は、第５条に規定する信託期間の終了日とします。

【信託財産に関する報告等】

第32条　受託者は、毎計算期末に損益計算を行い、信託財産に関する報告書を作成して、これを委託者に提出します。

②　受託者は、信託終了のときに最終計算を行い、信託財産に関する報告書を作成して、これを委託者に提出します。

③　受託者は、前２項の報告を行うことにより、受益者に対する信託法第37条第３項に定める報告は行わないこととします。

④　受益者は、受託者に対し、信託法第37条第２項に定める書類または電磁的記録の作成に欠くことのできない情報その他の信託に関する重要な情報および当該受益者以外の者の利益を害するおそれのない情報を除き、信託法第38条第１項に定める閲覧または謄写の請求をすることはできないものとします。

【信託事務等の諸費用】

第33条　信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産の財務諸表の監査費用の全部または一部（消費税等相当額を含みます。）および受託者の立て替えた立替金の利息等（以下「諸経費」といいます。）は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。

②　前項の信託財産の財務諸表の監査費用の全部または一部については、第31条に規定する計算期間を通じて毎日、固定率または固定金額にて計算した額を、毎計算期間の最初の６ヵ月終了日および毎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。

【信託報酬等の額】

第34条　委託者および受託者の信託報酬の総額は、第31条に規定する計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に年10,000分の88の率を乗じて得た額とします。

②　前項の信託報酬は、毎計算期間の最初の６ヵ月終了日および毎計算期末または信託終了のとき信託財産中から支弁するものとし、委託者と受託者との間の配分は別に定めます。

③　第１項の信託報酬にかかる消費税等に相当する金額を、信託報酬支弁のときに信託財産中から支弁します。

【収益の処理方法】

第35条　信託財産から生ずる毎計算期末における利益は、次の方法により処理します。

１．配当金、利子およびこれらに類する収益から支払利息を控除した額（以下「配当等収益」といいます。）は、諸経費、信託報酬および当該信託報酬にかかる消費税等に相当する金額を控除した後、その残額を受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配にあてるため、その一部を分配準備積立金として積み立てることができます。

２．売買損益に評価損益を加減した利益金額（以下「売買益」といいます。）は、諸経費、信託報酬および当該信託報酬にかかる消費税等に相当する金額を控除し、繰越欠損金のあるときは、その全額を売買益をもって補てんした後、受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配にあてるため、分配準備積立金として積み立てることができます。

②　毎計算期末において、信託財産につき生じた損失は、次期に繰り越します。

【収益分配金、償還金および一部解約金の払込みと支払いに関する受託者の免責】

第36条　受託者は、収益分配金については原則として毎計算期間終了日の翌営業日に、償還金（信託終了時における信託財産の純資産総額を受益権総口数で除した額をいいます。以下同じ。）については第37条第３項に規定する支払開始日までに、一部解約金については第37条第４項に規定する支払開始日までに、その全額を委託者の指定する預金口座等に払い込みます。

② 受託者は、前項の規定により委託者の指定する預金口座等に収益分配金、償還金および一部解約金を払い込んだ後は、受益者に対する支払いにつき、その責に任じません。

【収益分配金、償還金および一部解約金の支払いならびに収益分配金の再投資】

第37条　収益分配金は、毎計算期間終了日後１ヵ月以内の委託者の指定する日から、毎計算期間の末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（当該収益分配金にかかる計算期間の末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計算期間の末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指定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ます。）に支払います。

② 前項の規定にかかわらず、別に定める「累積投資約款」に従った契約（別の名称で同様の権利義務関係を規定する契約を含むものとし、その場合は、当該別の名称に読み替えるものとします。）に基づいて収益分配金を再投資する受益者に対しては、受託者が委託者の指定する預金口座等に払い込むことにより、原則として、毎計算期間終了日の翌営業日に、収益分配金が指定販売会社に交付されます。この場合、指定販売会社は、受益者に対し遅滞なく収益分配金の再投資にかかる受益権の売付けを行います。当該売付けにより増加した受益権は、第11条第３項の規定に従い、振替口座簿に記載または記録されます。

③ 償還金は、信託終了日後１ヵ月以内の委託者の指定する日から、信託終了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（信託終了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、当該信託終了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指定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ます。）に支払います。なお、当該受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して委託者がこの信託の償還をするのと引換えに、当該償還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。

④ 一部解約金は、第39条第１項の受益者の請求を受け付けた日から起算して、原則として６営業日目から当該受益者に支払います。

⑤ 前各項（第２項を除きます。）に規定する収益分配金、償還金および一部解約金の支払いは、指定販売会社の営業所等において行うものとします。

⑥ 収益分配金、償還金および一部解約金にかかる収益調整金は、原則として、各受益者毎の信託時の受益権の価額等に応じて計算されるものとします。なお、「収益調整金」は、所得税法施行令第27条の規定によるものとし、各受益者毎の信託時の受益権の価額と元本との差額をいい、原則として、追加信託のつど、当該口数により加重平均され、収益分配のつど、調整されるものとします。また、「各受益者毎の信託時の受益権の価額等」とは、原則として、各受益者毎の信託時の受益権の価額をいい、追加信託のつど、当該口数により加重平均され、収益分配のつど、調整されるものとします。

【収益分配金および償還金の時効】

第38条　受益者が、収益分配金については前条第１項に規定する支払開始日から５年間その支払いを請求しないとき、ならびに信託終了による償還金については前条第３項に規定する支払開始日から10年間その支払いを請求しないときは、その権利を失い、受託者から交付を受けた金銭は、委託者に帰属します。

【信託契約の一部解約】

第39条　受益者は、自己に帰属する受益権につき、委託者に１口単位をもって一部解約の実行を請求することができます。

② 前項の規定にかかわらず、委託者は、一部解約の実行の請求日が別に定める日のいずれかに当たる場合には、当該一部解約の実行の請求を受け付けません。

③ 委託者は、第１項の一部解約の実行の請求を受け付けた場合には、この信託契約の一部を解約します。なお、第１項の一部解約の実行の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この信託契約の一部解約を委託者が行うのと引換えに、当該一部解約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。

④ 前項の一部解約の価額は、一部解約の実行の請求日の翌営業日の基準価額とします。

⑤ 受益者が一部解約の実行の請求をするときは、指定販売会社に対し、振替受益権をもって行うものとします。

⑥ 委託者は、取引所等における取引の停止、決済機能の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、第１項による一部解約の実行の請求の受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の請求の受付けを取り消すことができます。

⑦ 前項により一部解約の実行の請求の受付けが中止された場合には、受益者は当該受付け中止前に行った実行されていない一部解約の実行の請求を撤回できます。ただし、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、当該受益権の一部解約の価額は、当該受付け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、第４項の規定に準じて算出した価額とします。

【質権口記載または記録の受益権の取扱い】

第40条 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、この信託約款によるほか、民法その他の法令等に従って取り扱われます。

【信託契約の解約】

第41条 委託者は、信託期間中において、この信託契約を解約することが受益者のため有利であると認めるとき、信託契約の一部を解約することにより受益権の口数が10億口を下回ることとなったとき、その他やむを得ない事情が発生したときは、受託者と合意の上、こ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、委託者は、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。

② 委託者は、前項の事項について、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、この信託契約にかかる知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発します。

③ 前項の書面決議において、受益者（委託者およびこの信託の信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権にかかる受益者としての受託者を除きます。以下本項において同じ。）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。

④ 第２項の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。

⑤ 第２項から前項までの規定は、委託者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、この信託契約にかかる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、第２項から前項までの手続きを行うことが困難な場合も同様とします。

【信託契約に関する監督官庁の命令】

第42条 委託者は、監督官庁よりこ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。

② 委託者は、監督官庁の命令に基づいてこの信託約款を変更しようとするときは、第46条の規定に従います。

【委託者の登録取消等に伴う取扱い】

第43条 委託者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、委託者は、この信託契約を解約し、信託を終了させます。

② 前項の規定にかかわらず、監督官庁がこの信託契約に関する委託者の業務を他の投資信託委託会社に引き継ぐことを命じたときは、この信託は、第46条第２項の書面決議で否決された場合を除き、当該投資信託委託会社と受託者との間において存続します。

【委託者の事業の譲渡および承継に伴う取扱い】

第44条　委託者は、事業の全部または一部を譲渡することがあり、これに伴い、この信託契約に関する事業を譲渡することがあります。

②　委託者は、分割により事業の全部または一部を承継させることがあり、これに伴い、この信託契約に関する事業を承継させることがあります。

【受託者の辞任および解任に伴う取扱い】

第45条　受託者は、委託者の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託者がその任務に違反して信託財産に著しい損害を与えたことその他重要な事由があるときは、委託者または受益者は、裁判所に受託者の解任を申し立てることができます。受託者が辞任した場合、または裁判所が受託者を解任した場合、委託者は、第46条の規定に従い、新受託者を選任します。なお、受益者は、上記によって行う場合を除き、受託者を解任することはできないものとします。

②　委託者が新受託者を選任できないときは、委託者はこの信託契約を解約し、信託を終了させます。

【信託約款の変更等】

第46条　委託者は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託者と合意の上、この信託約款を変更することまたはこの信託と他の信託との併合（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。以下同じ。）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その内容を監督官庁に届け出ます。なお、この信託約款は本条に定める以外の方法によって変更することができないものとします。

②　委託者は、前項の事項（前項の変更事項にあってはその変更の内容が重大なものに該当する場合に限り、併合事項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、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、この信託約款にかかる知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発します。

③　前項の書面決議において、受益者（委託者およびこの信託の信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権にかかる受益者としての受託者を除きます。以下本項において同じ。）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。

④　第２項の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。

⑤　書面決議の効力は、この信託のすべての受益者に対してその効力を生じます。

⑥　第２項から前項までの規定は、委託者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、この信託約款にかかる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。

⑦　前各項の規定にかかわらず、この投資信託において併合の書面決議が可決された場合にあっても、当該併合にかかる一または複数の他の投資信託において当該併合の書面決議が否決された場合は、当該他の投資信託との併合を行うことはできません。

【反対受益者の受益権買取請求の不適用】

第47条　この信託は、受益者が第39条の規定による一部解約の実行の請求を行ったときは、委託者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、第41条に規定する信託契約の解約または前条に規定する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。

【他の受益者の氏名等の開示の請求の制限】

第48条　この信託の受益者は、委託者または受託者に対し、次に掲げる事項の開示の請求を行うことはできません。

１．他の受益者の氏名または名称および住所

２．他の受益者が有する受益権の内容

【信託期間の延長】

第49条　＜削除＞

【運用報告書に記載すべき事項の提供】

第50条　委託者は、投資信託及び投資法人に関する法律第14条第１項に定める運用報告書の交付に代えて、運用報告書に記載すべき事項を電磁的方法により受益者に提供することができます。この場合において、委託者は、運用報告書を交付したものとみなします。

②　前項の規定にかかわらず、委託者は、受益者から運用報告書の交付の請求があった場合には、これを交付するものとします。

【公告】

第51条　委託者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

②　前項の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。

【信託約款に関する疑義の取扱い】

第52条　この信託約款の解釈について疑義を生じたときは、委託者と受託者との協議により定めます。

上記条項により信託契約を締結します。

平成29年９月14日（信託契約締結日）

委託者　　東京都港区愛宕二丁目５番１号
三井住友アセットマネジメント株式会社
代表取締役　　松下　隆史

受託者　　東京都千代田区丸の内一丁目４番１号
三井住友信託銀行株式会社
取締役社長　　橋本　勝

〔付表〕

１．運用の基本方針および信託約款第17条第１項に規定する「別に定める投資信託証券」は下記のものとします。

親投資信託　国内株式インデックス・マザーファンド（Ｂ号）
親投資信託　外国株式インデックス・マザーファンド
親投資信託　エマージング株式インデックス・マザーファンド
親投資信託　Ｊリート・インデックス・マザーファンド
親投資信託　外国リート・インデックス・マザーファンド
親投資信託　国内債券パッシブ・マザーファンド
親投資信託　外国債券パッシブ・マザーファンド
親投資信託　ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド
米国籍米ドル建て投資信託　ｉシェアーズ　Ｊ．Ｐ．モルガン・米ドル建てエマージング・マーケット債券ＥＴＦ

２．信託約款第13条第５項および第39条第２項に規定する「別に定める日」は下記のものとします。

・ニューヨークの取引所の休業日
・ニューヨークの銀行の休業日