投資信託説明書
（請求目論見書）
使用開始日：2024年11月15日

三井住友・DC年金バランス

30（債券重点型）／50（標準型）／70（株式重点型）

追加型投信／内外／資産複合／インデックス型

【愛称】マイパッケージ

三井住友・ＤＣ年金バランス30（債券重点型）、三井住友・ＤＣ年金バランス50（標準型）および三井住友・ＤＣ年金バランス70（株式重点型）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11月14日に関東財務局長に提出しており、2024年11月15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・ＤＣ年金バランス30（債券重点型）
三井住友・ＤＣ年金バランス50（標準型）
三井住友・ＤＣ年金バランス70（株式重点型）
（上記３ファンドの愛称として「マイパッケージ」という名称を用いることがあります。）

以下上記３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・ＤＣ年金バランス 30（債券重点型）」を「マイパッケージ 30」、「三井住友・ＤＣ年金バランス 50（標準型）」を「マイパッケージ 50」、「三井住友・ＤＣ年金バランス 70（株式重点型）」を「マイパッケージ70」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2兆5,000億円を上限とします。

（4）【発行（売出）価格】

取得申込受付日の翌営業日の基準価額となります。
ただし、累積投資契約に基づく収益分配金の再投資の場合は、各計算期末の基準価額となります。
※「基準価額」とは、信託財産の純資産総額を計算日における受益権口数で除した価額をいいます（基準価額は、便宜上１万口単位で表示される場合があります。）。
基準価額は、組入有価証券の値動き等により日々変動します。
基準価額は、販売会社または委託会社にお問い合わせいただけるほか、原則として翌日付の日本経済新聞朝刊の証券欄「オープン基準価格」の紙面に、それぞれ「ＤＣマ 30」、「ＤＣマ 50」、「ＤＣマ 70」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11月15日から2025年5月15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　クーリング・オフ制度（金融商品取引法第 37 条の６）の適用

ありません。

ニ　振替受益権について

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

(参考：投資信託振替制度)

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

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

・ファンドの設定、解約等における決済リスクが削減されます。

・振替口座簿に記録されますので、受益権の所在が明確になります。

第二部【ファンド情報】

第１【ファンドの状況】

１【ファンドの性格】

（1）【ファンドの目的及び基本的性格】

イ　当ファンドは、「国内株式インデックス・マザーファンド（B号)」、「国内債券パッシブ・マザーファンド」、「外国株式インデックス・マザーファンド」、「外国債券パッシブ・マザーファンド」（以下「マザーファンド」といいます。）の受益証券の組入れを通じて、日本を含む世界各国の株式、公社債に分散投資することにより、信託財産の着実な成長を目指した運用を行います。

ロ　各ファンドの運用にあたっては、株式、債券、短期金融資産を各ファンド毎の基本資産配分の比率により独自に作成した合成指数をベンチマークとして、ベンチマークの動きに連動する投資成果を目指します。詳細については、後述の「２　投資方針」をご参照ください。

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

ニ　当ファンドが該当する商品分類、属性区分は次の通りです。

≪商品分類表≫

単位型･追加型	投資対象地域	投資対象資産 （収益の源泉）	補足分類
単位型 追加型	国内 海外 内外	株式 債券 不動産投信 その他資産 （　） 資産複合	インデックス型 特殊型

（注）当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

≪属性区分表≫

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	為替ヘッジ	対象インデックス
株式 一般 大型株 中小型株 債券 一般 公債 社債	年1回 年2回 年4回 年6回(隔月) 年 12 回(毎月)	グローバル （日本を含む） 日本 北米 欧州 アジア	ファミリーファンド	あり	日経 225

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

（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】

2005年9月30日　信託契約締結、設定、運用開始。

（3）【ファンドの仕組み】

イ　当ファンドの関係法人とその役割

（イ）委託会社　「三井住友ＤＳアセットマネジメント株式会社」

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

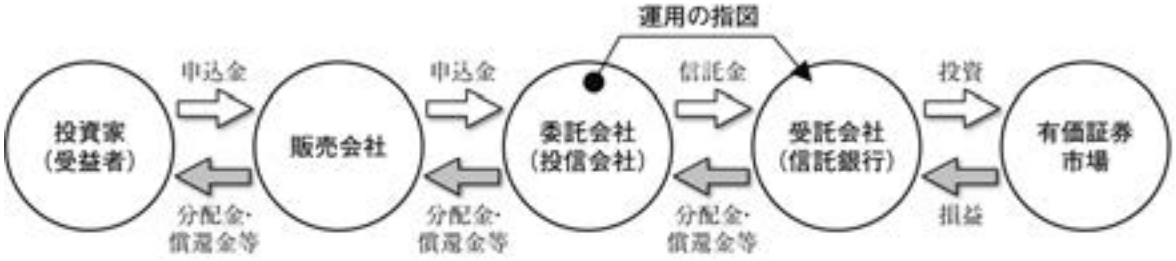
（ロ）受託会社　「三井住友信託銀行株式会社」

証券投資信託契約に基づき、信託財産の保管・管理・計算等を行います。なお、信託事務の一部につき、株式会社日本カストディ銀行に委託することがあります。また、外国における資産の保管は、その業務を行うに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。

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 8 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

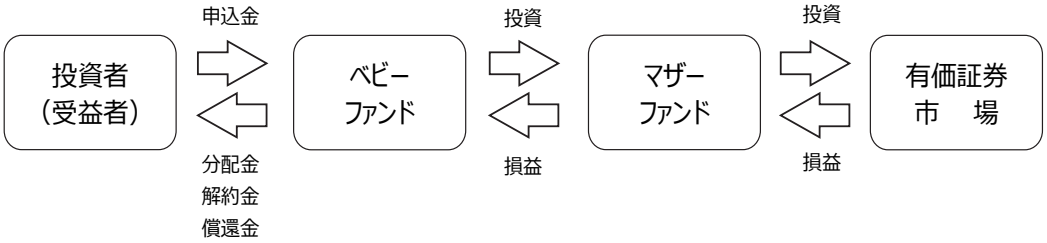
（ハ）大株主の状況

（2024 年 8 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（ファミリーファンド方式による運用）

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



２【投資方針】

（1）【投資方針】

イ　基本方針

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

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

ロ　投資態度

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

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

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

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

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

（ハ）実質外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行わないことを基本とします。

（ニ）非株式割合に関する制限

ａ．マイパッケージ30

制限はありません。

ｂ．マイパッケージ50

株式以外の資産（他の投資信託受益証券を通じて投資する場合は、当該他の投資信託の信託財産に属する株式以外の資産のうち、この投資信託の信託財産に属するとみなした部分を含みます。）への投資割合は、原則として信託財産総額の75%以下とします。

ｃ．マイパッケージ70

株式以外の資産（他の投資信託受益証券を通じて投資する場合は、当該他の投資信託の信託財産に属する株式以外の資産のうち、この投資信託の信託財産に属するとみなした部分を含みま

す。）への投資割合は、原則として信託財産総額の 50%以下とします。
（ホ）資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

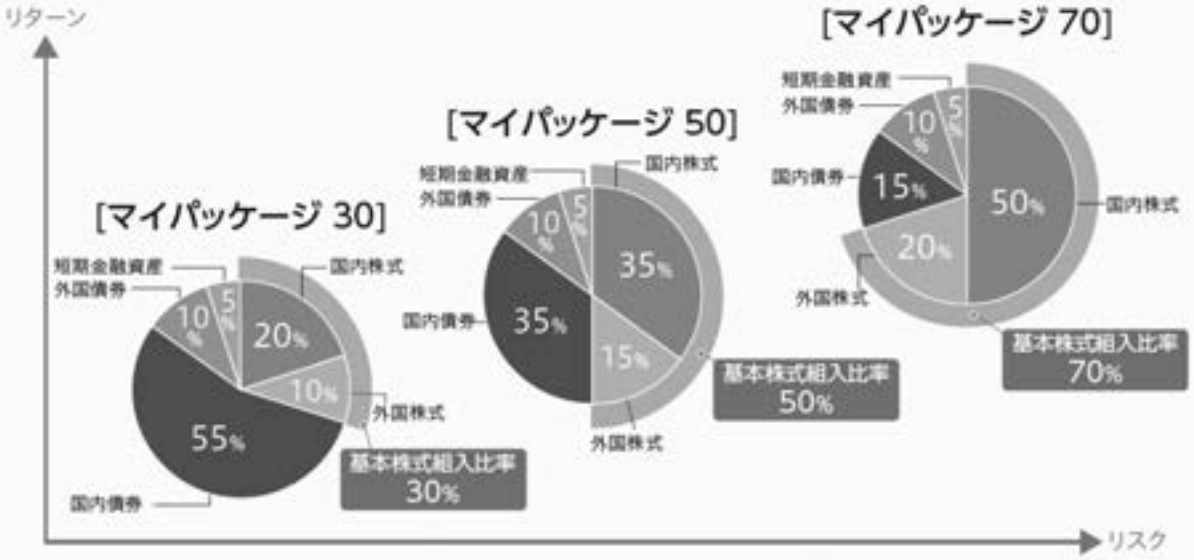
ファンドの特色

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

2 各ファンドにつき、国内株式、国内債券、外国株式、外国債券および短期金融資産への実質的な基本資産配分は下記の通りとします。

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

［基本資産配分とリスク・リターンのイメージ］



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

3 運用にあたっては、委託会社が独自に作成した合成指数をベンチマークとし、ベンチマークの動きに連動する投資成果を目指します。

［各ファンドのベンチマークの資産別合成比率］

	投資対象資産	マイパッケージ30	マイパッケージ50	マイパッケージ70
TOPIX（東証株価指数、配当込み）	国内株式	20%	35%	50%
NOMURA－BPI（総合）	国内債券	55%	35%	15%
MSCIコクサイ・インデックス（配当込み、円換算ベース）	外国株式	10%	15%	20%
FTSE世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）	外国債券	10%	10%	10%
有担保コール翌日物	短期金融資産	5%	5%	5%

4 実質外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行わないことを基本とします。

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

指数の著作権など

●TOPIX（東証株価指数）は株式会社JPX総研、NOMURA－BPIは野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社、MSCIコクサイ・インデックスはMSCI Inc.、FTSE世界国債インデックスはFTSE Fixed Income LLCが、それぞれ公表している指数です。

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

ファンドのしくみ

□ファミリーファンド方式で運用を行います。

各マザーファンドの投資方針等

▶国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

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

■TOPIX（東証株価指数）採用銘柄の中から、原則として投資不適格銘柄および低流動性銘柄を除外した上で、最適化法によりポートフォリオを構築します。

▶国内債券パッシブ・マザーファンド

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

■層化抽出法により、デュレーション、満期構成、債券種別配分、事業債の格付け構成および業種を可能な限りNOMURA−BPI（総合）に近づけたポートフォリオを構築します。

▶外国株式インデックス・マザーファンド

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

□MSCIコクサイ・インデックス構成銘柄の中から、原則として投資不適格銘柄および低流動性銘柄を除外した上で、最適化法によりポートフォリオを構築します。

▶外国債券パッシブ・マザーファンド

■主として日本を除く世界各国の債券に投資し、ＦＴＳＥ世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。

■層化抽出法により、通貨配分、国別配分、デュレーション、満期構成等を可能な限りＦＴＳＥ世界国債インデックス（除く日本）に近づけたポートフォリオを構築します。

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

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

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

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

（2）【投資対象】

イ　投資対象とする資産の種類

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

以下同じ。）

１．有価証券

２．デリバティブ取引にかかる権利

３．金銭債権

４．約束手形

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

１．株券または新株引受権証書

２．国債証券

３．地方債証券

４．特別の法律により法人の発行する債券

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

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

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

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

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

10．コマーシャル・ペーパー

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

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

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

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

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

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

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

18．外国法人が発行する譲渡性預金証書

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

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

21．外国の者に対する権利で前号の有価証券の性質を有するもの

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

人債券を除きます。）を以下「投資信託証券」といいます。

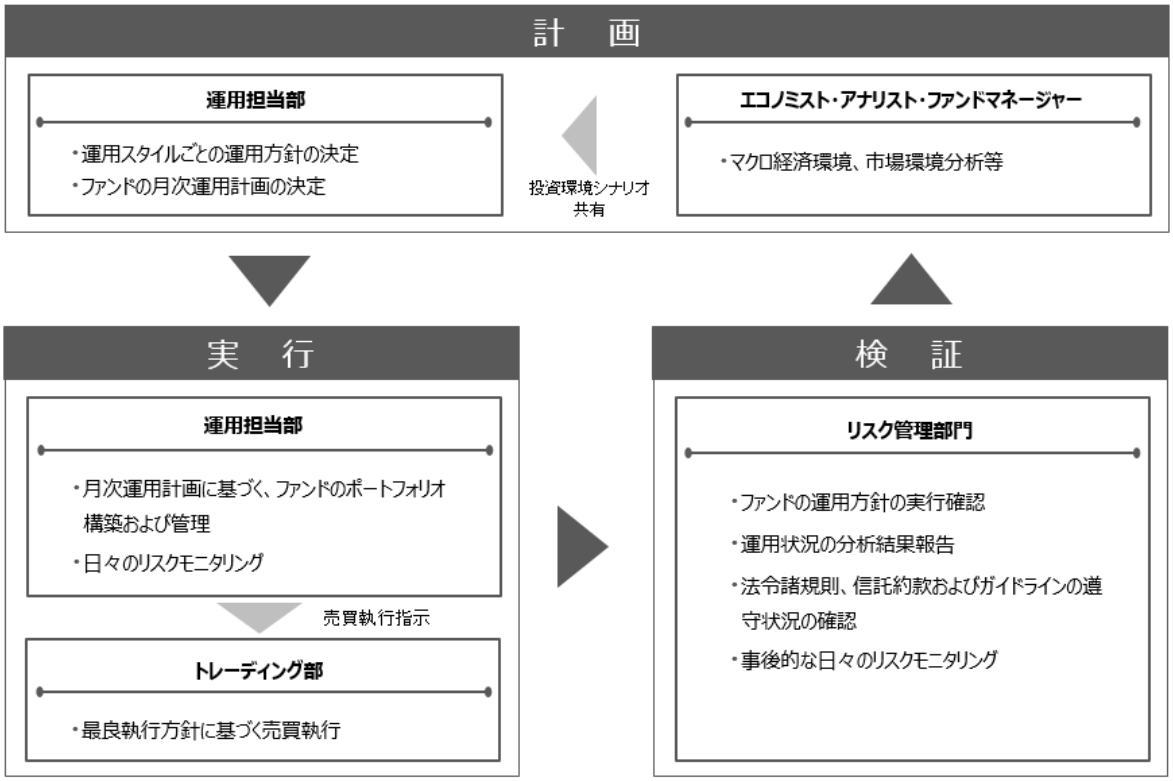
ハ　投資対象とする金融商品

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
５．貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第２条第２項第１号で定めるもの
６．外国の者に対する権利で前号の権利の性質を有するもの

（3）【運用体制】

イ　ファンドの運用体制



※リスク管理部門の人員数は、約 40 名です。
※ファンドの運用体制は、委託会社の組織変更等により、変更されることがあります。

ロ　委託会社によるファンドの関係法人（販売会社を除く）に対する管理体制

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

（4）【分配方針】

毎決算時（原則として毎年２月 18 日、ただし決算応当日が休業日の場合は翌営業日）に、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　分配対象額の範囲は、繰越分を含めた利子、配当収益と売買益（評価損益を含みます。）等の全額とします。

ロ　収益分配金額は、委託会社が基準価額水準等を勘案して決定します。ただし、分配対象収益が少額の場合等には委託会社の判断により収益分配を行わない場合もあるため、将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

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、前記「（1）投資方針」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主要な投資制限

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

マイパッケージ30　　50%未満
マイパッケージ50　　25%以上
マイパッケージ70　　50%以上

※実質投資割合とは、当ファンドが保有するある種類の資産の評価額が当ファンドの純資産総額に占める比率（「組入比率」といいます。）と、当該同一種類の資産のマザーファンドにおける組入比率に当該マザーファンド受益証券の当ファンドにおける組入比率を乗じて得た率を合計したものをいいます（以下同じ。）。

ロ　新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の 10%以内とします。

ハ　投資信託証券（マザーファンド受益証券を除きます。）への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の５%以内とします。

ニ　外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の 50%以下とします。

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

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

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

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

Ⅱ　ファンドの信託約款に基づくその他の投資制限

イ　投資する株式等の範囲

（イ）委託会社が投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、取引所に上場している株式の発行会社の発行するもの、取引所に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証

券および新株予約権証券については、この限りではありません。

（ロ）上記（イ）にかかわらず、上場予定または登録予定の株式、新株引受権証券および新株予約権証券で目論見書等において上場または登録することが確認できるものについては委託会社が投資することを指図することができるものとします。

ロ　信用取引の指図

（イ）委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売り付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、株券の引渡しまたは買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。

（ロ）信用取引の指図は、当該売付けにかかる建玉の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。

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

ハ　先物取引等の指図

（イ）委託会社は、日本の取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第 28 条第８項第３号イに掲げるものをいいます。以下同じ。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第 28 条第８項第３号ロに掲げるものをいいます。以下同じ。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第８項第３号ハに掲げるものをいいます。以下同じ。）ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めて取り扱うものとします（以下同じ。）。

（ロ）委託会社は、日本の取引所における通貨にかかる先物取引および通貨にかかるオプション取引ならびに外国の取引所における通貨にかかる先物取引およびオプション取引を行うことの指図をすることができます。

（ハ）委託会社は、日本の取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。

ニ　スワップ取引の指図

（イ）委託会社は、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行うことの指図をすることができます。

（ロ）スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこのかぎりではありません。

（ハ）スワップ取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の合計額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記純資産総額が減少して、スワップ取引の想定元本の合計額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は、速やかに、その超える額に相当するスワップ取引の一部の解約を指図するものとします。

（ニ）スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額により行うものとします。

（ホ）委託会社は、スワップ取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めたときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

ホ　金利先渡取引および為替先渡取引の指図

（イ）委託会社は、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことの指図をすることができます。

（ロ）金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。

（ハ）金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかる金利先渡取引および為替先渡取引の想定元本の合計額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産

の一部解約等の事由により、上記純資産総額が減少して、金利先渡取引および為替先渡取引の想定元本の合計額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は、速やかに、その超える額に相当する金利先渡取引および為替先渡取引の一部の解約を指図するものとします。

（ニ）金利先渡取引および為替先渡取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額により行うものとします。

（ホ）委託会社は、金利先渡取引および為替先渡取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めたときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

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

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

ヘ　有価証券の貸付けの指図

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

１．株式の貸付けは、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額を超えないものとします。

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

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

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

ト　有価証券の空売りの指図

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

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

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

チ　有価証券の借入れの指図

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

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

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

（ニ）有価証券の借入れにかかる品借料は、信託財産中から支弁します。

リ　特別の場合の外貨建有価証券への投資制限

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

ヌ　外国為替予約取引の指図

（イ）委託会社は、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。

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

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

ル　資金の借入れ

（イ）委託会社は、信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定に資するため、信託財産において一部解約金の支払資金の不足額が生じるときは、資金借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。

（ロ）上記（イ）の資金借入れ額は、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）上記（ロ）の借入期間は、有価証券等の売却代金または償還金の入金日までに限るものとします。

（ニ）借入金の利息は、信託財産中から支弁します。

ヲ　デリバティブ取引等にかかる投資制限

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

Ⅲ　法令に基づく投資制限

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

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

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

委託会社は、信託財産に関し、金利、通貨の価格、金融商品市場における相場その他の指標にかかる変動その他の理由により発生し得る危険に対応する額としてあらかじめ委託会社が定めた合理的な方法に

より算出した額が当該信託財産の純資産額を超えることとなる場合において、デリバティブ取引（新株予約権証券またはオプションを表示する証券もしくは証書にかかる取引および選択権付債券売買を含みます。）を行い、または継続することを受託会社に指図しないものとします。

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

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

（参考情報：マザーファンドの投資方針等）
（国内株式インデックス・マザーファンド（Ｂ号））

（１）投資方針等

イ　基本方針

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

ロ　投資態度

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

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

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

（２）投資対象

イ　投資対象とする資産の種類

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

ロ　投資対象とする有価証券

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

ハ　投資対象とする金融商品

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

（３）投資制限

イ　ファンドの信託約款に基づく主要な投資制限

（イ）外貨建資産への投資は行いません。

（ロ）株式への投資割合には制限を設けません。

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

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

（国内債券パッシブ・マザーファンド）

（１）投資方針等

イ　基本方針

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

ロ　投資態度

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

（ロ）公社債の組入比率は原則として高位を保ちます。

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

（２）投資対象

イ　投資対象とする資産の種類

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

ロ　投資対象とする有価証券

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

ハ　投資対象とする金融商品

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

（３）投資制限

イ　ファンドの信託約款に基づく主要な投資制限

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

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

（ハ）投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の５％以内とします。

（ニ）外貨建資産への投資は行いません。

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

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

（外国株式インデックス・マザーファンド）

（１）投資方針等

イ　基本方針

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

ロ　投資態度

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

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

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

（２）投資対象

イ　投資対象とする資産の種類

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

ロ　投資対象とする有価証券

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

ハ　投資対象とする金融商品

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

（３）投資制限

イ　ファンドの信託約款に基づく主要な投資制限

（イ）株式への投資割合には制限を設けません。

（ロ）外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

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

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

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

（外国債券パッシブ・マザーファンド）

（１）投資方針等

イ　基本方針

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

ロ　投資態度

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

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

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

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

（ホ）公社債の組入比率は原則として高位を保ちます。

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

（２）投資対象

イ　投資対象とする資産の種類

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

ロ　投資対象とする有価証券

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

ハ　投資対象とする金融商品

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

（３）投資制限

イ　ファンドの信託約款に基づく主要な投資制限

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

（ロ）投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の５％以内とします。

（ハ）外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

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

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

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

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

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

３【投資リスク】

イ　ファンドのもつリスクの特性

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

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

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

当ファンドの主要なリスクは以下の通りです。

（イ）株式市場リスク

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

（ロ）債券市場リスク

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

（ハ）信用リスク

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

（ニ）為替変動リスク

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

（ホ）カントリーリスク

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

（ヘ）流動性リスク

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

ロ　その他の留意点

（イ）ファンド固有の留意点

合成指数の動きと連動しない要因

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

・有価証券売買時のコスト、信託報酬やその他のファンド運営にかかる費用を負担すること

・追加設定・一部解約により組入有価証券の売買のタイミング差が生じること

・インデックス構成銘柄と組入有価証券との誤差が影響すること

・利用可能な指数先物とインデックスの動きに不一致が生じること

（ロ）投資信託に関する留意点

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

・ファンドのお申込みに関しては、クーリング・オフ制度の適用はありません。

・ファンドは、大量の解約が発生し短期間で解約資金を手当てする必要が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。

（ハ）分配金に関する留意事項

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

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

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

ハ　投資リスクの管理体制

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

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

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

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

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

（参考情報）投資リスクの定量的比較

［ ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移 ］

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

［ ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較 ］

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

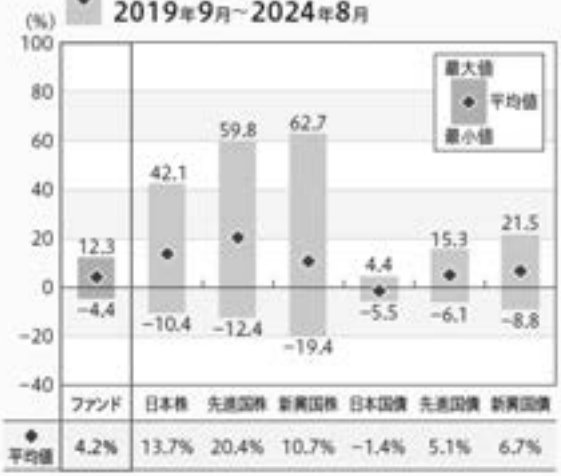
□マイパッケージ30

年間騰落率：
2019年9月～2024年8月

分配金再投資基準価額：
2019年9月～2024年8月

ファンド：
2019年9月～2024年8月

他の資産クラス：
2019年9月～2024年8月



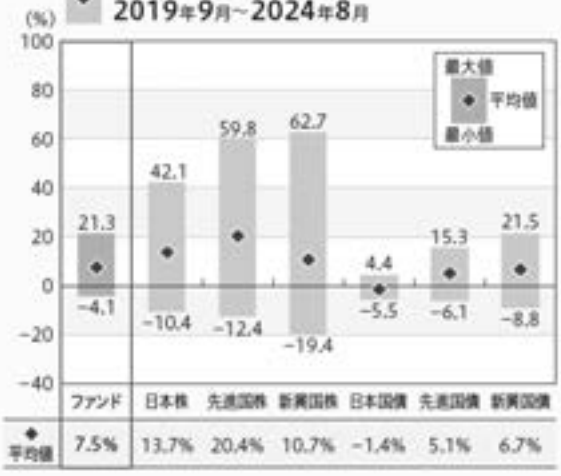
□マイパッケージ50

年間騰落率：
2019年9月～2024年8月

分配金再投資基準価額：
2019年9月～2024年8月

ファンド：
2019年9月～2024年8月

他の資産クラス：
2019年9月～2024年8月



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

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

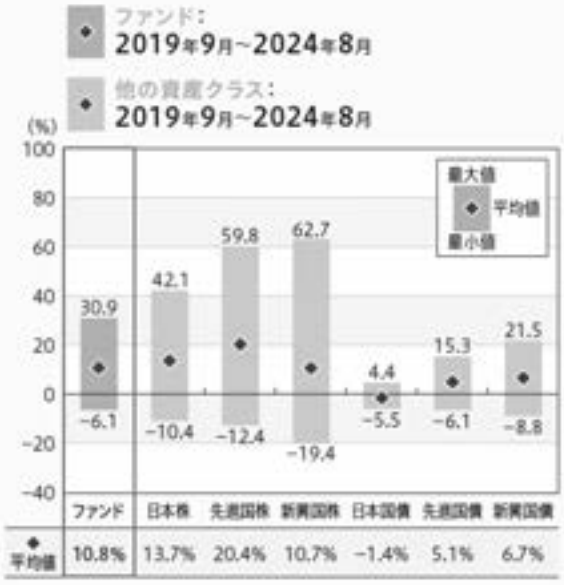
ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移

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。

ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較

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

□マイパッケージ70



※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。

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】

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

	信託報酬率	配分（税抜き）		
		委託会社	販売会社	受託会社
マイパッケージ30	年0.242% (税抜き0.22%)	年0.09%	年0.1%	年0.03%
マイパッケージ50	年0.253% (税抜き0.23%)	年0.10%	年0.1%	年0.03%
マイパッケージ70	年0.264% (税抜き0.24%)	年0.11%	年0.1%	年0.03%

※上記の配分には別途消費税等相当額がかかります。

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

（4）【その他の手数料等】

イ　信託財産の財務諸表の監査に要する費用（消費税等相当額を含みます。）は、原則として、計算期間を通じて毎日、信託財産の費用として計上され、毎計算期間の最初の６ヵ月終了日と各計算期末または信託終了のときに、信託財産中から支弁するものとします。

ロ　信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用および受託会社の立て替えた立替金の利息は、信託財産中から支弁します。

ハ　有価証券の売買時の手数料、デリバティブ取引等に要する費用、および外国における資産の保管等に要する費用等（それらにかかる消費税等相当額を含みます。）は、信託財産中から支弁するものとします。

※　上記にかかる費用に関しましては、変更される場合があるものや、その時々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。）

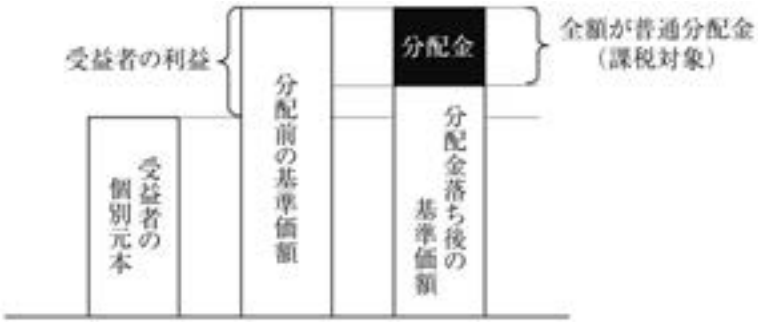
ロ　一部解約時および償還時の課税について

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。

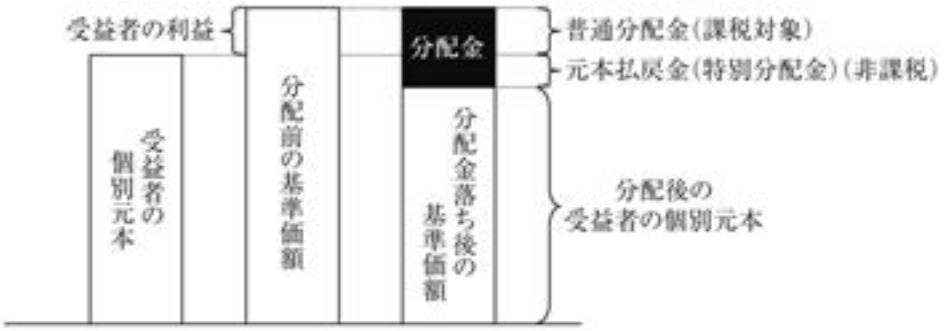
ハ　収益分配金の課税について

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。

＜配当控除および益金不算入制度の適用の可否＞

ａ．マイパッケージ30

配当控除および益金不算入制度の適用はありません。

ｂ．マイパッケージ50

配当控除の適用が可能です。益金不算入制度の適用はありません。

ｃ．マイパッケージ70

配当控除の適用が可能です。益金不算入制度の適用はありません。

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

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

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

※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「つみたて投資枠（特定累積投資勘定）」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 8 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2月21日～2024年2月19日）における当ファンドの総経費率（年率換算）は以下の通りです。

	総経費率（①+②）	①運用管理費用の比率	②その他費用の比率
マイパッケージ30	0.25%	0.24%	0.01%
マイパッケージ50	0.27%	0.25%	0.01%
マイパッケージ70	0.28%	0.26%	0.02%

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

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

※計算方法等の詳細は、対象期間の運用報告書（全体版）をご覧ください。なお、新たな対象期間にかかる運用報告書が作成され、上記の総経費率が更新されている場合があります。
運用報告書は、委託会社のホームページ（https://www.smd-am.co.jp/fund/unpo/）から検索いただけます。

５【運用状況】

（１）【投資状況】

三井住友・ＤＣ年金バランス３０（債券重点型）

2024 年 8 月 30 日現在

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（%）
親投資信託受益証券	日本	21,384,776,731	95.32
現金・預金・その他の資産（負債控除後）	-	1,048,956,965	4.68
合計（純資産総額）		22,433,733,696	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・ＤＣ年金バランス５０（標準型）

2024 年 8 月 30 日現在

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（%）
親投資信託受益証券	日本	54,852,550,045	95.31
現金・預金・その他の資産（負債控除後）	-	2,701,930,621	4.69
合計（純資産総額）		57,554,480,666	100.00

三井住友・ＤＣ年金バランス７０（株式重点型）

2024 年 8 月 30 日現在

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（%）
親投資信託受益証券	日本	33,273,844,939	95.37
現金・預金・その他の資産（負債控除後）	-	1,616,991,873	4.63
合計（純資産総額）		34,890,836,812	100.00

（２）【投資資産】

①【投資有価証券の主要銘柄】

三井住友・ＤＣ年金バランス３０（債券重点型）

イ　主要投資銘柄

2024 年 8 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	親投資信託受益証券	国内債券パッシブ・マザーファンド	10,354,883,927	1.2115	12,544,460,725	1.1963	12,387,547,641	55.22
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）	937,680,680	4.6567	4,366,455,336	4.8407	4,539,030,867	20.23
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	247,135,379	8.3747	2,069,672,988	9.0286	2,231,286,482	9.95
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	988,596,174	2.2217	2,196,393,821	2.2526	2,226,911,741	9.93

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8月30日現在

種類	投資比率（%）
親投資信託受益証券	95.32
合　計	95.32

三井住友・ＤＣ年金バランス５０（標準型）

イ　主要投資銘柄

2024年8月30日現在

国／地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価（円）	帳簿価額（円）	評価額単価（円）	評価額（円）	投資比率（%）
日本	親投資信託受益証券	国内株式インデックス・マザーファンド（B号）	4,196,073,140	4.6587	19,548,156,100	4.8407	20,311,931,248	35.29
日本	親投資信託受益証券	国内債券パッシブ・マザーファンド	16,920,819,847	1.2112	20,493,976,909	1.1963	20,242,376,782	35.17
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	956,054,621	8.3530	7,985,924,262	9.0286	8,631,834,751	15.00
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	2,515,496,433	2.2220	5,589,429,033	2.2526	5,666,407,264	9.85

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8月30日現在

種類	投資比率（%）

親投資信託受益証券	95.31
合　計	95.31

三井住友・ＤＣ年金バランス７０（株式重点型）

イ　主要投資銘柄

2024年8月30日現在

国／地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価（円）	帳簿価額（円）	評価額単価（円）	評価額（円）	投資比率（%）
日本	親投資信託受益証券	国内株式インデックス・マザーファンド（Ｂ号）	3,629,023,778	4.6638	16,925,124,218	4.8407	17,567,015,402	50.35
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	766,046,541	8.3633	6,406,657,042	9.0286	6,916,327,800	19.82
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	4,466,984,829	1.2107	5,408,171,275	1.1963	5,343,853,950	15.32
日本	親投資信託受益証券	外国債券パッシブ・マザーファンド	1,530,075,374	2.2230	3,401,349,421	2.2526	3,446,647,787	9.88

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8月30日現在

種類	投資比率（%）
親投資信託受益証券	95.37
合　計	95.37

②【投資不動産物件】

三井住友・ＤＣ年金バランス３０（債券重点型）

該当事項はありません。

三井住友・ＤＣ年金バランス５０（標準型）

該当事項はありません。

三井住友・ＤＣ年金バランス７０（株式重点型）

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・ＤＣ年金バランス３０（債券重点型）

該当事項はありません。

三井住友・ＤＣ年金バランス５０（標準型）

該当事項はありません。

三井住友・ＤＣ年金バランス７０（株式重点型）

該当事項はありません。

（３）【運用実績】

①【純資産の推移】

三井住友・ＤＣ年金バランス３０（債券重点型）

年月日	純資産総額（円）		１万口当たりの純資産額（円）	
	（分配落）	（分配付）	（分配落）	（分配付）
第 10 期　（2015 年 2 月 18 日）	4,426,547,408	4,426,547,408	13,381	13,381
第 11 期　（2016 年 2 月 18 日）	4,963,496,383	4,963,496,383	13,158	13,158
第 12 期　（2017 年 2 月 20 日）	6,522,850,554	6,522,850,554	13,891	13,891
第 13 期　（2018 年 2 月 19 日）	8,363,355,544	8,363,355,544	14,611	14,611
第 14 期　（2019 年 2 月 18 日）	10,162,610,006	10,162,610,006	14,609	14,609
第 15 期　（2020 年 2 月 18 日）	12,218,579,866	12,218,579,866	15,268	15,268
第 16 期　（2021 年 2 月 18 日）	13,771,738,370	13,771,738,370	16,001	16,001
第 17 期　（2022 年 2 月 18 日）	15,215,352,368	15,215,352,368	16,223	16,223
第 18 期　（2023 年 2 月 20 日）	17,640,339,749	17,640,339,749	16,280	16,280
第 19 期　（2024 年 2 月 19 日）	21,439,623,924	21,439,623,924	18,068	18,068
2023 年 8 月末日	19,855,771,680	－	17,327	－
9 月末日	19,817,407,654	－	17,205	－
10 月末日	19,633,198,000	－	16,883	－
11 月末日	20,491,674,711	－	17,457	－
12 月末日	20,710,476,281	－	17,520	－
2024 年 1 月末日	21,161,827,743	－	17,860	－
2 月末日	21,603,056,230	－	18,176	－
3 月末日	22,032,333,562	－	18,426	－
4 月末日	21,947,428,183	－	18,332	－
5 月末日	22,001,169,823	－	18,265	－

6月末日	22,458,236,189	－	18,518	－
7月末日	22,335,444,418	－	18,312	－
8月末日	22,433,733,696	－	18,247	－

三井住友・ＤＣ年金バランス５０（標準型）

年月日	純資産総額（円）		１万口当たりの純資産額（円）	
	（分配落）	（分配付）	（分配落）	（分配付）
第10期　（2015年 2月18日）	13,231,559,031	13,231,559,031	13,865	13,865
第11期　（2016年 2月18日）	14,015,482,569	14,015,482,569	13,215	13,215
第12期　（2017年 2月20日）	17,864,219,936	17,864,219,936	14,480	14,480
第13期　（2018年 2月19日）	23,340,195,738	23,340,195,738	15,652	15,652
第14期　（2019年 2月18日）	27,693,471,936	27,693,471,936	15,452	15,452
第15期　（2020年 2月18日）	32,984,628,394	32,984,628,394	16,411	16,411
第16期　（2021年 2月18日）	38,347,699,126	38,347,699,126	17,886	17,886
第17期　（2022年 2月18日）	40,992,366,746	40,992,366,746	18,381	18,381
第18期　（2023年 2月20日）	44,847,548,745	44,847,548,745	18,848	18,848
第19期　（2024年 2月19日）	55,235,853,937	55,235,853,937	22,239	22,239
2023年 8月末日	51,045,922,230	－	20,746	－
9月末日	50,855,014,919	－	20,621	－
10月末日	49,976,732,246	－	20,167	－
11月末日	52,174,821,321	－	21,016	－
12月末日	52,458,068,368	－	21,086	－
2024年 1月末日	54,421,501,361	－	21,839	－
2月末日	55,855,556,491	－	22,429	－
3月末日	57,215,510,684	－	22,943	－
4月末日	56,977,819,547	－	22,865	－
5月末日	57,221,280,551	－	22,927	－
6月末日	58,557,172,550	－	23,357	－
7月末日	58,015,818,021	－	23,010	－
8月末日	57,554,480,666	－	22,744	－

三井住友・ＤＣ年金バランス７０（株式重点型）

年月日	純資産総額（円）		１万口当たりの純資産額（円）	
	（分配落）	（分配付）	（分配落）	（分配付）
第10期　（2015年 2月18日）	7,091,879,077	7,091,879,077	14,104	14,104
第11期　（2016年 2月18日）	7,026,639,080	7,026,639,080	13,019	13,019
第12期　（2017年 2月20日）	9,067,400,207	9,067,400,207	14,788	14,788
第13期　（2018年 2月19日）	12,058,838,561	12,058,838,561	16,422	16,422

第 14 期　（2019 年 2 月 18 日）	14,023,320,486	14,023,320,486	15,991	15,991
第 15 期　（2020 年 2 月 18 日）	16,535,371,261	16,535,371,261	17,255	17,255
第 16 期　（2021 年 2 月 18 日）	19,855,236,393	19,855,236,393	19,459	19,459
第 17 期　（2022 年 2 月 18 日）	21,789,845,477	21,789,845,477	20,265	20,265
第 18 期　（2023 年 2 月 20 日）	24,761,805,444	24,761,805,444	21,244	21,244
第 19 期　（2024 年 2 月 19 日）	33,012,419,763	33,012,419,763	26,579	26,579
2023 年 8 月末日	29,474,183,252	－	24,137	－
9 月末日	29,441,030,396	－	24,017	－
10 月末日	28,893,716,484	－	23,424	－
11 月末日	30,428,401,883	－	24,586	－
12 月末日	30,589,895,728	－	24,662	－
2024 年 1 月末日	32,318,684,884	－	25,938	－
2 月末日	33,519,085,302	－	26,871	－
3 月末日	34,618,077,871	－	27,720	－
4 月末日	34,562,695,121	－	27,667	－
5 月末日	34,923,727,763	－	27,902	－
6 月末日	35,982,267,551	－	28,549	－
7 月末日	35,474,639,690	－	28,033	－
8 月末日	34,890,836,812	－	27,507	－

②【分配の推移】

三井住友・ＤＣ年金バランス３０（債券重点型）

	計算期間	１万口当たり分配金（円）
第 10 期	2014 年 2 月 19 日～2015 年 2 月 18 日	0
第 11 期	2015 年 2 月 19 日～2016 年 2 月 18 日	0
第 12 期	2016 年 2 月 19 日～2017 年 2 月 20 日	0
第 13 期	2017 年 2 月 21 日～2018 年 2 月 19 日	0
第 14 期	2018 年 2 月 20 日～2019 年 2 月 18 日	0
第 15 期	2019 年 2 月 19 日～2020 年 2 月 18 日	0
第 16 期	2020 年 2 月 19 日～2021 年 2 月 18 日	0
第 17 期	2021 年 2 月 19 日～2022 年 2 月 18 日	0
第 18 期	2022 年 2 月 19 日～2023 年 2 月 20 日	0
第 19 期	2023 年 2 月 21 日～2024 年 2 月 19 日	0

三井住友・ＤＣ年金バランス５０（標準型）

	計算期間	１万口当たり分配金（円）
第 10 期	2014 年 2 月 19 日～2015 年 2 月 18 日	0
第 11 期	2015 年 2 月 19 日～2016 年 2 月 18 日	0
第 12 期	2016 年 2 月 19 日～2017 年 2 月 20 日	0

第 13 期	2017 年 2 月 21 日～2018 年 2 月 19 日	0
第 14 期	2018 年 2 月 20 日～2019 年 2 月 18 日	0
第 15 期	2019 年 2 月 19 日～2020 年 2 月 18 日	0
第 16 期	2020 年 2 月 19 日～2021 年 2 月 18 日	0
第 17 期	2021 年 2 月 19 日～2022 年 2 月 18 日	0
第 18 期	2022 年 2 月 19 日～2023 年 2 月 20 日	0
第 19 期	2023 年 2 月 21 日～2024 年 2 月 19 日	0

三井住友・ＤＣ年金バランス７０（株式重点型）

	計算期間	１万口当たり分配金（円）
第 10 期	2014 年 2 月 19 日～2015 年 2 月 18 日	0
第 11 期	2015 年 2 月 19 日～2016 年 2 月 18 日	0
第 12 期	2016 年 2 月 19 日～2017 年 2 月 20 日	0
第 13 期	2017 年 2 月 21 日～2018 年 2 月 19 日	0
第 14 期	2018 年 2 月 20 日～2019 年 2 月 18 日	0
第 15 期	2019 年 2 月 19 日～2020 年 2 月 18 日	0
第 16 期	2020 年 2 月 19 日～2021 年 2 月 18 日	0
第 17 期	2021 年 2 月 19 日～2022 年 2 月 18 日	0
第 18 期	2022 年 2 月 19 日～2023 年 2 月 20 日	0
第 19 期	2023 年 2 月 21 日～2024 年 2 月 19 日	0

③【収益率の推移】

三井住友・ＤＣ年金バランス３０（債券重点型）

	収益率（%）
第 10 期	9.7
第 11 期	△1.7
第 12 期	5.6
第 13 期	5.2
第 14 期	△0.0
第 15 期	4.5
第 16 期	4.8
第 17 期	1.4
第 18 期	0.4
第 19 期	11.0
第 20 期（中間期）	0.7

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

三井住友・ＤＣ年金バランス５０（標準型）

	収益率（%）
第 10 期	14.1
第 11 期	△4.7
第 12 期	9.6
第 13 期	8.1
第 14 期	△1.3
第 15 期	6.2
第 16 期	9.0
第 17 期	2.8
第 18 期	2.5
第 19 期	18.0
第 20 期（中間期）	1.6

（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・ＤＣ年金バランス７０（株式重点型）

	収益率（%）
第 10 期	18.6
第 11 期	△7.7
第 12 期	13.6
第 13 期	11.0
第 14 期	△2.6
第 15 期	7.9
第 16 期	12.8
第 17 期	4.1
第 18 期	4.8
第 19 期	25.1
第 20 期（中間期）	2.5

（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・ＤＣ年金バランス３０（債券重点型）

	設定口数（口）	解約口数（口）
第 10 期	556,143,284	317,096,474
第 11 期	866,745,890	402,710,540
第 12 期	1,313,785,041	390,304,402
第 13 期	1,682,239,634	653,756,318

第 14 期	1,810,013,111	577,755,487
第 15 期	1,987,132,976	940,632,408
第 16 期	1,921,029,947	1,317,075,172
第 17 期	2,501,268,886	1,729,323,900
第 18 期	2,480,385,852	1,023,908,278
第 19 期	2,308,715,920	1,277,939,131
第 20 期（中間期）	1,259,553,448	873,135,101

（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・ＤＣ年金バランス５０（標準型）

	設定口数（口）	解約口数（口）
第 10 期	1,157,116,236	626,892,999
第 11 期	2,020,562,533	958,102,870
第 12 期	2,542,481,389	811,014,755
第 13 期	3,756,094,069	1,181,645,961
第 14 期	4,241,062,383	1,230,606,145
第 15 期	3,858,242,258	1,681,339,977
第 16 期	3,799,534,526	2,458,479,101
第 17 期	3,694,800,844	2,833,401,975
第 18 期	3,238,900,411	1,746,275,205
第 19 期	3,113,993,768	2,070,113,792
第 20 期（中間期）	1,677,835,635	1,308,778,053

（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・ＤＣ年金バランス７０（株式重点型）

	設定口数（口）	解約口数（口）
第 10 期	858,360,534	601,602,705
第 11 期	1,106,054,113	737,015,945
第 12 期	1,323,647,752	589,291,932
第 13 期	2,006,562,694	794,980,782
第 14 期	2,171,658,591	745,653,991
第 15 期	1,941,614,023	1,127,746,929
第 16 期	2,221,930,705	1,601,426,611
第 17 期	2,220,916,085	1,672,205,130
第 18 期	2,034,266,079	1,130,918,821
第 19 期	2,086,350,077	1,321,514,627
第 20 期（中間期）	1,050,643,220	844,303,640

（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 8 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	334,406,933,620	98.64
現金・預金・その他の資産（負債控除後）	－	4,617,373,721	1.36
合計（純資産総額）		339,024,307,341	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	4,371,955,000	1.29
合計	買建	－	4,371,955,000	1.29

国内債券パッシブ・マザーファンド

2024 年 8 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	107,903,196,450	78.42
地方債証券	日本	11,066,317,400	8.04
特殊債券	日本	10,138,687,820	7.37
社債券	日本	7,823,439,400	5.69
現金・預金・その他の資産（負債控除後）	－	669,730,994	0.48
合計（純資産総額）		137,601,372,064	100.00

外国株式インデックス・マザーファンド

2024 年 8 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	561,049,647,688	69.94
	イギリス	30,071,718,928	3.75
	カナダ	25,982,122,912	3.24
	スイス	24,288,241,702	3.03
	フランス	22,022,256,637	2.75
	ドイツ	18,440,068,984	2.30
	オランダ	14,645,286,007	1.83
	アイルランド	14,325,079,310	1.79
	オーストラリア	14,092,110,734	1.76
	デンマーク	7,882,178,140	0.98
	スウェーデン	6,844,031,223	0.85
	スペイン	5,548,780,272	0.69
	イタリア	4,469,695,542	0.56

	香港	2,849,549,969	0.36
	シンガポール	2,256,577,287	0.28
	フィンランド	2,157,164,450	0.27
	ジャージィー	1,789,837,603	0.22
	ベルギー	1,693,447,856	0.21
	イスラエル	1,641,299,884	0.20
	ノルウェー	1,230,806,508	0.15
	バミューダ	1,017,891,493	0.13
	ケイマン諸島	932,192,933	0.12
	オランダ領キュラソー	777,267,576	0.10
	ニュージーランド	559,743,015	0.07
	リベリア	523,489,063	0.07
	オーストリア	403,647,623	0.05
	ルクセンブルグ	398,561,375	0.05
	ポルトガル	338,565,286	0.04
	パナマ	203,131,246	0.03
	マン島	50,809,833	0.01
	小計	768,485,201,079	95.80
新株予約権証券	カナダ	-	0.00
投資証券	アメリカ	13,453,740,741	1.68
	オーストラリア	1,406,469,480	0.18
	フランス	286,126,969	0.04
	イギリス	259,867,357	0.03
	シンガポール	198,732,856	0.02
	香港	162,985,176	0.02
	ケイマン諸島	81,637,805	0.01
	カナダ	60,423,706	0.01
	ベルギー	53,696,736	0.01
	小計	15,963,680,826	1.99
現金・預金・その他の資産（負債控除後）	-	17,753,743,556	2.21
合計（純資産総額）		802,202,625,461	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	736,996,383	0.09
株価指数先物取引	買建	ドイツ	2,490,349,680	0.31
株価指数先物取引	買建	アメリカ	14,175,123,600	1.77
株価指数先物取引	買建	オーストラリア	512,463,874	0.06
合計	買建	-	17,914,933,537	2.23

種類	買建／	国／地域	時価合計（円）	投資比率

	売建			(%)
為替予約取引	買建	-	2,885,047,006	0.36

外国債券パッシブ・マザーファンド

2024年8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	84,266,838,940	46.13
	中国	18,694,441,711	10.23
	フランス	13,630,002,480	7.46
	イタリア	12,454,871,107	6.82
	ドイツ	10,962,962,025	6.00
	イギリス	9,628,458,542	5.27
	スペイン	8,062,697,531	4.41
	カナダ	3,601,703,427	1.97
	ベルギー	2,879,342,893	1.58
	オランダ	2,440,384,653	1.34
	オーストラリア	2,386,005,405	1.31
	オーストリア	2,087,147,835	1.14
	メキシコ	1,271,246,466	0.70
	ポーランド	942,598,414	0.52
	マレーシア	942,587,416	0.52
	フィンランド	906,275,021	0.50
	アイルランド	883,893,882	0.48
	シンガポール	743,854,702	0.41
	イスラエル	561,687,780	0.31
	デンマーク	480,762,782	0.26
	ニュージーランド	480,175,399	0.26
	スウェーデン	288,623,742	0.16
	ノルウェー	288,369,557	0.16
	小計	178,884,931,710	97.92
現金・預金・その他の資産（負債控除後）	-	3,794,961,359	2.08
合計（純資産総額）		182,679,893,069	100.00

（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8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	4,655,300	2,809.16	13,077,471,695	2,759.50	12,846,300,350	3.79
日本	株式	ソニーグループ	電気機器	613,400	12,847.30	7,880,531,662	14,200.00	8,710,280,000	2.57
日本	株式	三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	銀行業	5,251,700	1,268.32	6,660,837,494	1,528.00	8,024,597,600	2.37
日本	株式	日立製作所	電気機器	2,125,600	2,102.84	4,469,803,098	3,572.00	7,592,643,200	2.24
日本	株式	キーエンス	電気機器	87,600	63,628.49	5,573,855,442	69,610.00	6,097,836,000	1.80
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	648,400	5,601.37	3,631,931,146	9,047.00	5,866,074,800	1.73
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	603,900	7,340.93	4,433,187,607	9,550.00	5,767,245,000	1.70
日本	株式	三菱商事	卸売業	1,778,800	2,325.61	4,136,786,662	3,013.00	5,359,524,400	1.58
日本	株式	信越化学工業	化学	786,700	5,260.71	4,138,602,463	6,422.00	5,052,187,400	1.49
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	622,800	5,807.04	3,616,623,417	7,706.00	4,799,296,800	1.42
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	185,300	24,422.56	4,525,500,001	25,805.00	4,781,666,500	1.41
日本	株式	第一三共	医薬品	765,000	4,067.18	3,111,393,721	6,108.00	4,672,620,000	1.38
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	841,900	3,709.98	3,123,428,451	5,506.00	4,635,501,400	1.37
日本	株式	任天堂	その他製品	553,000	6,972.92	3,856,027,147	7,902.00	4,369,806,000	1.29
日本	株式	三井物産	卸売業	1,387,600	2,726.49	3,783,271,552	3,123.00	4,333,474,800	1.28
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	26,116,700	172.60	4,507,661,243	155.70	4,066,370,190	1.20
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	433,300	6,152.72	2,665,971,486	8,405.00	3,641,886,500	1.07
日本	株式	ＨＯＹＡ	精密機器	172,400	16,786.12	2,893,927,628	20,595.00	3,550,578,000	1.05
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	1,163,400	2,534.94	2,949,151,696	3,009.00	3,500,670,600	1.03
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	777,400	4,167.65	3,239,931,612	4,333.00	3,368,474,200	0.99
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	2,072,600	1,516.17	3,142,406,344	1,588.00	3,291,288,800	0.97
日本	株式	ＫＤＤＩ	情報・通信業	645,900	4,620.05	2,984,089,821	4,911.00	3,172,014,900	0.94
日本	株式	三菱重工業	機械	1,546,700	858.50	1,327,841,556	1,942.50	3,004,464,750	0.89
日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	1,404,200	1,805.79	2,535,687,648	2,038.00	2,861,759,600	0.84
日本	株式	ファーストリテイリング	小売業	52,100	38,515.81	2,006,673,557	46,650.00	2,430,465,000	0.72
日本	株式	村田製作所	電気機器	782,400	2,888.34	2,259,837,662	3,033.00	2,373,019,200	0.70
日本	株式	三菱電機	電気機器	969,400	2,028.19	1,966,129,324	2,441.00	2,366,305,400	0.70
日本	株式	日本たばこ産業	食料品	524,100	3,819.37	2,001,732,940	4,203.00	2,202,792,300	0.65
日本	株式	キヤノン	電気機器	436,900	3,841.93	1,678,539,044	5,017.00	2,191,927,300	0.65
日本	株式	富士通	電気機器	814,300	2,128.13	1,732,935,444	2,677.50	2,180,288,250	0.64

ロ　種類別・業種別投資比率

2024年8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	0.29
	建設業	2.12
	食料品	3.11
	繊維製品	0.36
	パルプ・紙	0.15
	化学	5.62
	医薬品	5.03
	石油・石炭製品	0.54
	ゴム製品	0.59
	ガラス・土石製品	0.66
	鉄鋼	0.85
	非鉄金属	0.76
	金属製品	0.49
	機械	5.27
	電気機器	17.31
	輸送用機器	7.41
	精密機器	2.38
	その他製品	2.43
	電気・ガス業	1.41
	陸運業	2.30
	海運業	0.80
	空運業	0.36
	倉庫・運輸関連業	0.14
	情報・通信業	7.37
	卸売業	7.21
	小売業	4.25
	銀行業	7.47
	証券、商品先物取引業	0.86
	保険業	3.08
	その他金融業	1.19
	不動産業	2.02
	サービス業	4.71
合　計		98.64

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8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）	利率（%）	償還期限	投資比率

						(円)				(%)
日本	国債証券	１５０　５年国債	2,590,000,000	99.03	2,564,877,000	99.18	2,568,736,100	0.005	2026/12/20	1.87
日本	国債証券	４６１　２年国債	2,000,000,000	100.16	2,003,216,000	100.11	2,002,240,000	0.400	2026/06/01	1.46
日本	国債証券	４５９　２年国債	1,960,000,000	99.75	1,955,100,000	99.80	1,955,982,000	0.200	2026/04/01	1.42
日本	国債証券	１５６　５年国債	1,280,000,000	99.11	1,268,544,000	99.38	1,272,076,800	0.200	2027/12/20	0.92
日本	国債証券	１５４　５年国債	1,220,000,000	98.91	1,206,641,000	99.16	1,209,691,000	0.100	2027/09/20	0.88
日本	国債証券	３７１　１０年国債	1,240,000,000	95.53	1,184,534,500	96.83	1,200,704,400	0.400	2033/06/20	0.87
日本	国債証券	３６９　１０年国債	1,220,000,000	96.98	1,183,156,000	98.20	1,198,040,000	0.500	2032/12/20	0.87
日本	国債証券	３７０　１０年国債	1,220,000,000	96.62	1,178,813,900	97.95	1,195,026,600	0.500	2033/03/20	0.87
日本	国債証券	３７５　１０年国債	1,170,000,000	101.34	1,185,620,300	101.89	1,192,136,400	1.100	2034/06/20	0.87
日本	国債証券	１４８　５年国債	1,180,000,000	99.27	1,171,421,400	99.39	1,172,825,600	0.005	2026/06/20	0.85
日本	国債証券	３６２　１０年国債	1,200,000,000	96.05	1,152,625,600	97.03	1,164,408,000	0.100	2031/03/20	0.85
日本	国債証券	３６３　１０年国債	1,190,000,000	95.76	1,139,532,200	96.77	1,151,515,400	0.100	2031/06/20	0.84
日本	国債証券	３６６　１０年国債	1,180,000,000	95.42	1,125,930,800	96.69	1,140,977,400	0.200	2032/03/20	0.83
日本	国債証券	３６１　１０年国債	1,160,000,000	96.34	1,117,544,000	97.26	1,128,216,000	0.100	2030/12/20	0.82
日本	国債証券	３６５　１０年国債	1,160,000,000	94.96	1,101,581,600	96.20	1,115,931,600	0.100	2031/12/20	0.81
日本	国債証券	３６７　１０年国債	1,150,000,000	95.09	1,093,535,000	96.37	1,108,301,000	0.200	2032/06/20	0.81
日本	国債証券	３５８　１０年国債	1,130,000,000	97.07	1,096,836,000	97.79	1,105,004,400	0.100	2030/03/20	0.80
日本	国債証券	３５９　１０年国債	1,130,000,000	96.82	1,094,066,000	97.64	1,103,286,800	0.100	2030/06/20	0.80
日本	国債証券	１４９　５年国債	1,090,000,000	99.16	1,080,844,000	99.28	1,082,119,300	0.005	2026/09/20	0.79
日本	国債証券	３６８　１０年国債	1,110,000,000	95.04	1,054,963,400	96.08	1,066,488,000	0.200	2032/09/20	0.78
日本	国債証券	３７２　１０年国債	1,050,000,000	98.61	1,035,356,500	100.00	1,050,000,000	0.800	2033/09/20	0.76
日本	国債証券	３５７　１０年国債	1,050,000,000	97.31	1,021,755,000	97.94	1,028,317,500	0.100	2029/12/20	0.75
日本	国債証券	３７３　１０年国債	1,040,000,000	96.50	1,003,600,000	97.93	1,018,472,000	0.600	2033/12/20	0.74
日本	国債証券	３７４　１０年国債	1,000,000,000	97.71	977,141,600	99.43	994,260,000	0.800	2034/03/20	0.72

日本	国債証券	３６４　１０年国債	1,010,000,000	95.36	963,121,700	96.49	974,518,700	0.100	2031/09/20	0.71
日本	国債証券	１７０　２０年国債	1,065,000,000	84.21	896,796,250	84.95	904,749,450	0.300	2039/09/20	0.66
日本	国債証券	１４７　２０年国債	840,000,000	105.61	887,090,400	106.88	897,766,800	1.600	2033/12/20	0.65
日本	国債証券	１６８　５年国債	870,000,000	99.83	868,521,000	100.56	874,837,200	0.600	2029/03/20	0.64
日本	国債証券	１５８　５年国債	880,000,000	98.59	867,595,000	98.95	870,768,800	0.100	2028/03/20	0.63
日本	国債証券	１６５　５年国債	840,000,000	98.79	829,836,000	99.35	834,506,400	0.300	2028/12/20	0.61

ロ　種類別投資比率

2024年8月30日現在

種類	投資比率（%）
国債証券	78.42
地方債証券	8.04
特殊債券	7.37
社債券	5.69
合　計	99.51

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8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	1,232,020	27,459.73	33,830,940,786	33,273.59	40,993,730,815	5.11
アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導体・半導体製造装置	2,099,584	7,713.59	16,195,329,783	17,027.03	35,749,683,954	4.46
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	592,832	55,447.71	32,871,179,303	59,819.78	35,463,077,445	4.42
アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	一般消費財・サービス流通・小	785,529	21,685.78	17,034,811,559	24,922.98	19,577,720,414	2.44

			売り						
アメリカ	株式	META PLATFORMS INC-CLASS A	メディア・娯楽	184,335	50,068.40	9,229,358,541	75,038.26	13,832,176,919	1.72
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	495,319	19,885.76	9,849,793,040	23,425.74	11,603,216,092	1.45
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	428,643	20,067.63	8,601,848,226	23,660.32	10,141,830,545	1.26
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	67,871	88,696.65	6,019,930,347	136,140.96	9,240,023,096	1.15
アメリカ	株式	BROADCOM INC	半導体・半導体製造装置	369,452	14,184.11	5,240,349,228	22,723.46	8,395,229,221	1.05
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	241,208	22,852.89	5,512,300,456	32,176.01	7,761,110,537	0.97
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	金融サービス	110,102	52,668.10	5,798,863,462	67,819.98	7,467,114,997	0.93
アメリカ	株式	TESLA INC	自動車・自動車部品	240,722	34,629.91	8,336,180,345	29,869.34	7,190,208,226	0.90
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	77,434	77,028.87	5,964,653,869	85,659.34	6,632,945,023	0.83
アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORP	エネルギー	376,744	14,853.56	5,595,988,250	17,105.22	6,444,290,510	0.80
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	15,260.20	4,200,918,098	19,836.52	5,460,716,795	0.68
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	金融サービス	132,827	37,033.33	4,919,026,668	39,721.54	5,276,092,462	0.66
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO/THE	家庭用品・パーソナ	198,509	22,032.39	4,373,628,055	24,620.34	4,887,359,867	0.61

			ル用品						
アメリカ	株式	MASTERCARD INC - A	金融サービス	69,971	59,886.42	4,190,312,504	69,619.84	4,871,369,824	0.61
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	202,381	22,060.88	4,464,703,281	23,780.50	4,812,722,180	0.60
アメリカ	株式	COSTCO WHOLESALE CORP	生活必需品流通・小売り	37,350	88,018.43	3,287,488,210	128,384.02	4,795,143,296	0.60
オランダ	株式	ASML HOLDING NV	半導体・半導体製造装置	33,679	104,626.01	3,523,699,302	132,042.12	4,447,046,559	0.55
アメリカ	株式	HOME DEPOT INC	一般消費財・サービス流通・小売り	82,799	45,524.43	3,769,376,868	53,150.29	4,400,790,696	0.55
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	148,850	20,570.71	3,061,950,006	28,262.06	4,206,808,226	0.52
アメリカ	株式	WALMART INC	生活必需品流通・小売り	374,433	7,686.24	2,877,980,088	11,065.62	4,143,331,795	0.52
アメリカ	株式	NETFLIX INC	メディア・娯楽	36,363	70,647.49	2,568,954,614	100,271.10	3,646,158,154	0.45
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	212,700	15,043.34	3,199,718,238	17,008.21	3,617,645,841	0.45
アメリカ	株式	COCA-COLA CO/THE	食品・飲料・	346,173	8,484.66	2,937,160,025	10,432.84	3,611,567,521	0.45

			タバコ						
スイス	株式	NESTLE SA-REG	食品・飲料・タバコ	224,024	16,872.17	3,779,771,703	15,563.52	3,486,602,900	0.43
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	596,414	4,497.03	2,682,093,532	5,816.62	3,469,111,215	0.43
イギリス	株式	ASTRAZENECA PLC	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	129,514	19,374.91	2,509,321,628	25,313.52	3,278,454,970	0.41

ロ　種類別・業種別投資比率

2024年8月30日現在

種類	業種	投資比率（%）
株式（外国）	エネルギー	4.25
	素材	3.57
	資本財	6.86
	商業・専門サービス	1.60
	運輸	1.53
	自動車・自動車部品	1.54
	耐久消費財・アパレル	1.30
	消費者サービス	1.81
	一般消費財・サービス流通・小売り	4.52
	生活必需品流通・小売り	1.76
	食品・飲料・タバコ	3.16
	家庭用品・パーソナル用品	1.57
	ヘルスケア機器・サービス	4.12
	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	8.13
	銀行	5.54
	金融サービス	6.64
	保険	3.08
	ソフトウェア・サービス	9.40
	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	6.57
	半導体・半導体製造装置	8.73
	電気通信サービス	1.13
	公益事業	2.62
	メディア・娯楽	6.09
	不動産管理・開発	0.28
新株予約権証券	－	0.00

投資証券	－	1.99
合　計		97.79

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8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	13,613.37	1,558,731,094	13,914.56	1,593,216,662	1.625	2026/05/15	0.87
中国	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	72,000,000	2,051.27	1,476,911,809	2,071.26	1,491,310,494	2.390	2026/11/15	0.82
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,200,000	13,841.29	1,134,985,550	14,080.64	1,154,612,611	2.250	2026/03/31	0.63
中国	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	50,000,000	2,054.32	1,027,157,541	2,082.58	1,041,292,316	2.690	2026/08/12	0.57
中国	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	38,700,000	2,328.00	900,934,189	2,582.81	999,547,003	3.720	2051/04/12	0.55
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,000,000	14,423.60	865,416,024	14,501.43	870,085,824	3.875	2033/08/15	0.48
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,800,000	14,427.46	836,792,684	14,492.31	840,553,864	4.250	2025/12/31	0.46
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,600,000	14,685.18	822,370,169	14,798.42	828,711,251	4.125	2032/11/15	0.45
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,500,000	14,556.70	800,618,458	15,063.69	828,502,884	4.375	2034/05/15	0.45
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,500,000	14,311.59	787,137,393	14,579.48	801,871,268	4.125	2027/02/15	0.44
中国	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	39,000,000	2,031.88	792,432,784	2,052.36	800,419,237	2.180	2025/08/25	0.44
中国	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	38,000,000	2,032.74	772,439,522	2,082.81	791,467,417	2.400	2028/07/15	0.43
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,700,000	13,386.04	763,004,052	13,591.07	774,691,149	2.875	2032/05/15	0.42
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,900,000	12,711.56	749,981,898	13,099.19	772,852,044	0.750	2028/01/31	0.42
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,500,000	13,862.28	762,425,576	13,982.18	769,019,768	3.375	2033/05/15	0.42
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,300,000	14,332.88	759,642,809	14,429.61	764,769,308	3.875	2026/01/15	0.42
中国	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	34,400,000	2,098.58	721,909,968	2,169.11	746,172,665	3.020	2031/05/27	0.41

アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,100,000	14,138.94	721,086,189	14,625.81	745,916,493	4.000	2034/02/15	0.41
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,300,000	13,790.75	730,909,856	14,012.15	742,644,013	2.750	2028/02/15	0.41
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,600,000	12,678.98	710,022,745	13,074.28	732,159,769	0.625	2027/12/31	0.40
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,000,000	14,483.91	724,195,480	14,604.38	730,219,160	4.000	2028/02/29	0.40
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,800,000	15,126.29	726,061,856	15,193.43	729,284,620	4.500	2033/11/15	0.40
中国	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	35,000,000	2,047.33	716,565,962	2,054.48	719,067,389	1.990	2026/03/15	0.39
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,900,000	14,451.08	708,103,019	14,533.14	712,123,938	4.000	2027/01/15	0.39
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,800,000	14,611.78	701,365,443	14,710.38	706,098,086	4.625	2026/11/15	0.39
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,700,000	12,035.05	685,997,964	12,343.04	703,553,371	1.125	2031/02/15	0.39
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,500,000	12,376.35	680,699,008	12,653.49	695,942,104	1.625	2031/05/15	0.38
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,000,000	13,395.30	669,765,160	13,664.63	683,231,560	2.375	2029/03/31	0.37
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,800,000	13,813.63	663,054,259	14,044.44	674,133,196	2.625	2027/05/31	0.37
中国	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	32,000,000	2,040.45	652,942,548	2,105.22	673,671,919	2.600	2030/09/15	0.37

ロ　種類別投資比率

2024年8月30日現在

種類	投資比率（%）
国債証券	97.92
合　計	97.92

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。

国内債券パッシブ・マザーファンド

該当事項はありません。

外国株式インデックス・マザーファンド

該当事項はありません。

外国債券パッシブ・マザーファンド

該当事項はありません。

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 8 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　０６０９月　２０２４年９月	買建	161	日本・円	4,218,112,100	4,371,955,000	1.29

（注）主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。

国内債券パッシブ・マザーファンド

該当事項はありません。

外国株式インデックス・マザーファンド

2024 年 8 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	ＦＴＳＥ１００ＩＤＸＦＵＴＳＥＰ２４ 2024 年 9 月	買建	46	イギリス・ポンド	3,793,172.00	723,357,900	3,864,690.00	736,996,383	0.09
	ドイツ	ＥＵＲＥＸ	ＥＵＲＯＳＴＯＸＸ　５０ＳＥＰ２４ 2024 年 9 月	買建	312	ユーロ	14,888,774.00	2,388,754,900	15,522,000.00	2,490,349,680	0.31
	アメリカ	シカゴ商品取引所	Ｓ＆Ｐ５００ＥＭＩＮＩ　ＦＵＴ　ＳＥＰ２４ 2024 年 9 月	買建	349	アメリカ・ドル	95,752,309.50	13,864,934,415	97,894,500.00	14,175,123,600	1.77
	オーストラリア	シドニー先物取引所	ＳＰＩ２００ＦＵＴＵＲＥＳＳＥＰ２４ 2024 年 9 月	買建	26	オーストラリア・ドル	5,086,792.00	500,743,804	5,205,850.00	512,463,874	0.06

（注）主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。

2024年8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	15,668,000.00	2,260,410,870	2,267,338,896	0.28
	ユーロ	買建	1,572,000.00	253,313,180	252,108,242	0.03
	イギリス・ポンド	買建	637,000.00	121,721,782	121,408,505	0.02
	カナダ・ドル	買建	953,000.00	102,194,573	102,248,323	0.01
	スイス・フラン	買建	571,000.00	97,798,253	97,536,392	0.01
	スウェーデン・クローナ	買建	3,135,000.00	44,538,945	44,406,648	0.01

（注）日本における対顧客先物相場の仲値で評価しております。

外国債券パッシブ・マザーファンド

該当事項はありません。

≪参考情報≫

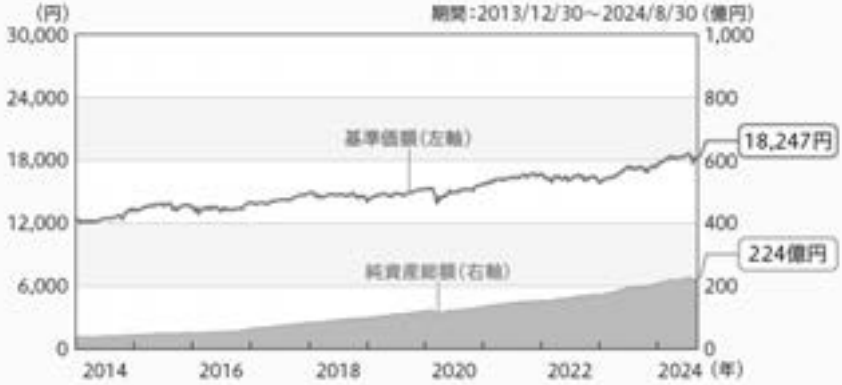
基準日:2024年8月30日

※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

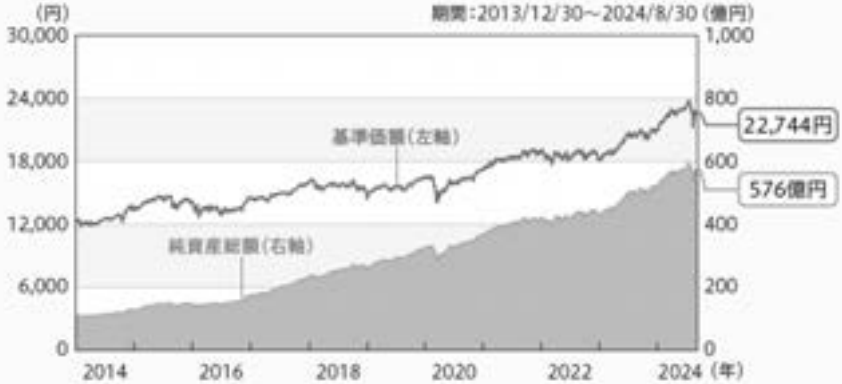
□マイパッケージ30



決算期	分配金
2024年2月	0円
2023年2月	0円
2022年2月	0円
2021年2月	0円
2020年2月	0円
設定来累計	0円

※分配金は1万口当たり、税引前です。
※直近5計算期間を記載しています。

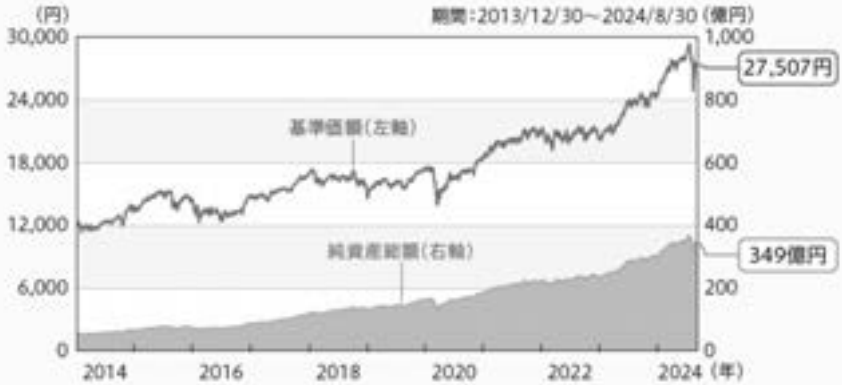
□マイパッケージ50



決算期	分配金
2024年2月	0円
2023年2月	0円
2022年2月	0円
2021年2月	0円
2020年2月	0円
設定来累計	0円

※分配金は1万口当たり、税引前です。
※直近5計算期間を記載しています。

□マイパッケージ70



決算期	分配金
2024年2月	0円
2023年2月	0円
2022年2月	0円
2021年2月	0円
2020年2月	0円
設定来累計	0円

※分配金は1万口当たり、税引前です。
※直近5計算期間を記載しています。

※基準価額は、1万口当たり、信託報酬控除後です。

主要な資産の状況

□マイパッケージ30

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	95.32
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		4.68
合計(純資産総額)		100.00

主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	比率(%)
日本	親投資信託受益証券	国内債券パッシブ・マザーファンド	55.22
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)	20.23
日本	親投資信託受益証券	外国株式インデックス・マザーファンド	9.95
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	9.93

□マイパッケージ50

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	95.31
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		4.69
合計(純資産総額)		100.00

主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	比率(%)
日本	親投資信託受益証券	国内株式インデックス・マザーファンド(B号)	35.29
日本	親投資信託受益証券	国内債券パッシブ・マザーファンド	35.17
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	15.00
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	9.85

□マイパッケージ70

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	95.37
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		4.63
合計(純資産総額)		100.00

主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	比率(%)
日本	親投資信託受益証券	国内株式インデックス・マザーファンド(B号)	50.35
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	19.82
日本	親投資信託受益証券	国内債券パッシブ・マザーファンド	15.32
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	9.88

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

□国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
株式	日本	98.64
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		1.36
合計（純資産総額）		100.00

※株価指数先物取引の買建て　1.29%

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	3.79
日本	株式	ソニーグループ	電気機器	2.57
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	2.37
日本	株式	日立製作所	電気機器	2.24
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	1.73
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	1.70
日本	株式	三菱商事	卸売業	1.58
日本	株式	信越化学工業	化学	1.49
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	1.42

□国内債券パッシブ・マザーファンド

資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
国債証券	日本	78.42
地方債証券	日本	8.04
特殊債券	日本	7.37
社債券	日本	5.69
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		0.48
合計（純資産総額）		100.00

主要投資銘柄（上位10銘柄）

国・地域	種類	銘柄名	利率(%)	償還期限	比率(%)
日本	国債証券	150　5年国債	0.005	2026/12/20	1.87
日本	国債証券	461　2年国債	0.400	2026/06/01	1.46
日本	国債証券	459　2年国債	0.200	2026/04/01	1.42
日本	国債証券	156　5年国債	0.200	2027/12/20	0.92
日本	国債証券	154　5年国債	0.100	2027/09/20	0.88
日本	国債証券	371　10年国債	0.400	2033/06/20	0.87
日本	国債証券	369　10年国債	0.500	2032/12/20	0.87
日本	国債証券	370　10年国債	0.500	2033/03/20	0.87
日本	国債証券	375　10年国債	1.100	2034/06/20	0.87
日本	国債証券	148　5年国債	0.005	2026/06/20	0.85

□外国株式インデックス・マザーファンド

資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
株式	アメリカ	69.94
	イギリス	3.75
	カナダ	3.24
	スイス	3.03
	フランス	2.75
	ドイツ	2.30
	その他	10.80
投資証券	アメリカ・その他	1.99
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		2.21
合計（純資産総額）		100.00

※株価指数先物取引の買建て　2.23%

主要投資銘柄（上位10銘柄）

国・地域	種類	銘柄名	業種	比率(%)
アメリカ	株式	APPLE INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	5.11
アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導体・半導体製造装置	4.46
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	4.42
アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	一般消費財・サービス流通・小売り	2.44
アメリカ	株式	META PLATFORMS INC-CLASS A	メディア・娯楽	1.72
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	1.45
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	1.26
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	1.15
アメリカ	株式	BROADCOM INC	半導体・半導体製造装置	1.05
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	0.97

※比率は、マザーファンドのそれぞれの純資産総額に対する時価の比率です。

■外国債券パッシブ・マザーファンド

資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
国債証券	アメリカ	46.13
	中国	10.23
	フランス	7.46
	イタリア	6.82
	ドイツ	6.00
	イギリス	5.27
	スペイン	4.41
	その他	11.60
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		2.08
合計(純資産総額)		100.00

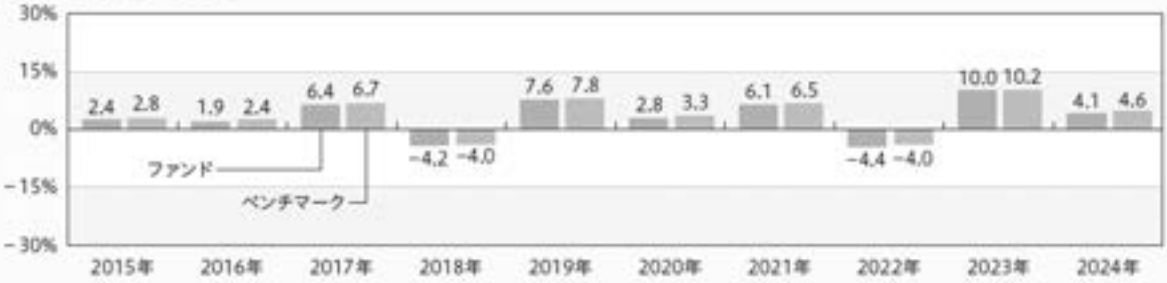
主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	利率(%)	償還期限	比率(%)
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1.625	2026/05/15	0.87
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	0.55
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3.875	2033/08/15	0.48
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	4.125	2032/11/15	0.45
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	2027/02/15	0.44

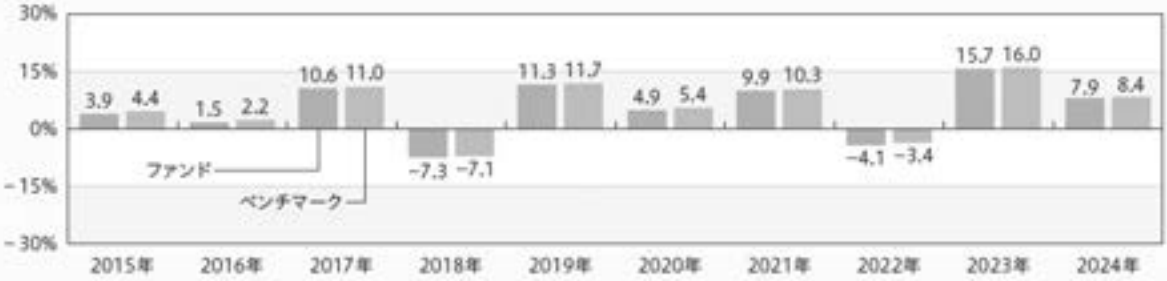
※比率は、マザーファンドの純資産総額に対する時価の比率です。

年間収益率の推移(暦年ベース)

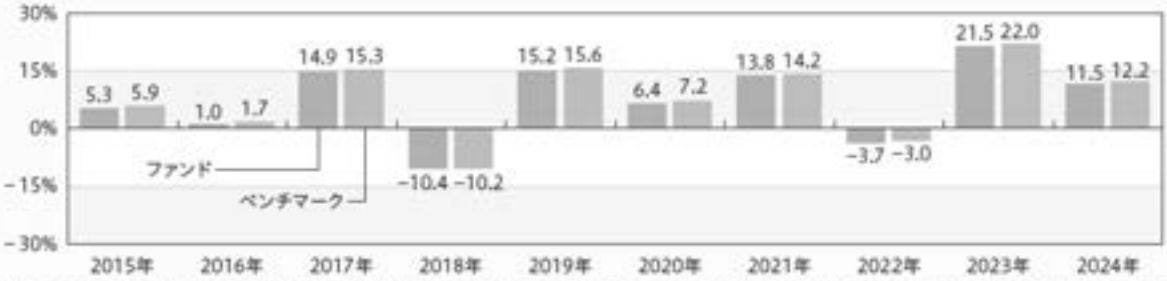
■マイパッケージ30



■マイパッケージ 50



■マイパッケージ70



※ファンドの収益率は、分配金(税引前)を分配時に再投資したものと仮定して計算しています。分配実績がない場合は、基準価額の騰落率です。
※2024年の収益率は、年初から基準日までの騰落率です。
※ベンチマーク(合成指数)の情報は参考情報であり、ファンドの運用実績ではありません。

第２【管理及び運営】

１【申込（販売）手続等】

イ　申込方法

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

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

（ロ）原則として午後３時 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）定時定額で取得申込みをする「定時定額購入サービス」（販売会社によっては、名称が異なる場合があります。）を利用する場合は、販売会社との間で「定時定額購入サービス」に関する契約を締結します。詳細については、お申込みの販売会社にお問い合わせください。

ロ　申込価額

取得申込受付日の翌営業日の基準価額となります。

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

ハ　申込手数料

ありません。

ニ　申込単位

お申込単位の詳細は、取扱いの販売会社にお問い合わせください。

ホ　照会先

手続き等のご不明な点についての委託会社に対する照会は下記においてできます。

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

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

ヘ　申込取扱場所・払込取扱場所

販売会社において申込み・払込みを取り扱います。

ト　払込期日

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

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

2【換金（解約）手続等】

受益者は、自己に帰属する受益権につき、解約請求（一部解約の実行請求）により換金することができます。
お買付けの販売会社にお申し出ください。
解約請求のお申込みに関しては、原則として午後３時 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５営業日目からお支払いします。
一部解約価額は、解約請求受付日の翌営業日の基準価額となります。
解約単位の詳細および一部解約価額につきましては、お申込みの販売会社にお問い合わせください。
委託会社は、取引所等における取引の停止、決済機能の停止、その他やむを得ない事情があるときは、一部解約の実行の請求の受付けを中止すること、および既に受け付けた一部解約の実行請求を取り消すことがあります。この場合、受益者は当該受付中止以前に行った当日の一部解約の実行の請求を撤回できます。受益者がその一部解約の実行の請求を撤回しない場合には、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に一部解約の実行の請求を受け付けたものとして、上記に準じた取扱いとなります。

3【資産管理等の概要】

（1）【資産の評価】

イ　基準価額の算出方法

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

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

市場デリバティブ取引	原則として、金融商品取引所、外国金融商品市場の発表する清算値段または最終相場で評価します。

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

ロ　基準価額の算出頻度・照会方法

基準価額は、委託会社の営業日において日々算出されます。

基準価額は、販売会社または委託会社にお問い合わせいただけるほか、原則として翌日付の日本経済新聞朝刊の証券欄「オープン基準価格」の紙面に、それぞれ「ＤＣマ 30」、「ＤＣマ 50」、「ＤＣマ 70」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】

2005 年９月 30 日から下記「（5）その他 イ　信託の終了」に記載された各事由が生じた場合における信託終了の日までとなります。

（4）【計算期間】

毎年２月 19 日から翌年２月 18 日までとすることを原則としますが、各計算期間終了日に該当する日（以下「該当日」といいます。）が休業日のとき、各計算期間終了日は、該当日の翌営業日とし、その翌日より次の計算期間が開始するものとします。なお、最終計算期間の終了日は、信託期間の終了日とします。

（5）【その他】

イ　信託の終了

（イ）信託契約の解約

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

ｂ．委託会社は、上記ａの事項について、あらかじめ、解約しようとする旨を公告し、かつ、その旨を記載した書面を当ファンドの知られたる受益者に対して交付します。ただし、当ファンドのすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として公告を行いません。

ｃ．上記ｂの公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託会社に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。

d．上記ｃの一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の２分の１を超えるときは、信託契約の解約をしません。

e．委託会社は、当ファンドの信託契約の解約をしないこととしたときは、解約しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を知られたる受益者に対して交付します。ただし、すべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。

f．上記ｃ～ｅまでの取扱いは、信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、上記ｃの一定の期間が一月を下らずにその公告および書面の交付を行うことが困難な場合には適用しません。

（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背いた場合、その他重要な事由が生じたときは、委託会社または受益者は、裁判所に受託会社の解任を請求することができます。

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、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

（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ができるものとし、あらかじめ、変更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）の変更事項のうち、その内容が重大なものについては、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を当ファンドの知られたる受益者に交付します。ただし、当ファンドのすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として公告を行いません。

（ハ）上記（ロ）の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託会社に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。

（ニ）上記（ハ）の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の２分の１を超えるときは、（イ）の信託約款の変更をしません。

（ホ）委託会社は、信託約款の変更をしないこととしたときは、変更しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を知られたる受益者に対して交付します。ただし、すべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。

ニ　反対者の買取請求権

当ファンドの信託契約の解約または重大な信託約款の変更が行われる場合において、それぞれの手続きにおいて設けられる異議申立期間内に委託会社に異議を述べた受益者は、自己に帰属する受益権を、受託会社に信託財産をもって買い取るよう請求をすることができます。

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　信託約款変更等に対する異議申立権および受益権の買取請求権

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を行おうとする場合において、当該解約または信託約款変更に異議のある受益者は、それぞれの手続きにおいて設けられる異議申立期間中に異議を申し立てることができます。異議を申し立てた受益者の受益権の口数が、受益権の総口数の過半数となるときは、当該解約または信託約款変更は行われません。

当該解約または信託約款変更が行われる場合において、前述の異議を申し立てた受益者は、受託会社に対し、自己に帰属する受益権を、信託財産をもって買い取るべき旨の請求ができます。

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 19 期（2023 年 2 月 21 日から 2024 年 2 月 19 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5月1日

三井住友DSアセットマネジメント株式会社
　取　締　役　会　御　中

PwC Japan有限責任監査法人
東京事務所
指定有限責任社員
業務執行社員　　公認会計士　山口 健志

指定有限責任社員
業務執行社員　　公認会計士　榊原 康太

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている三井住友・ＤＣ年金バランス３０（債券重点型）の2023年2月21日から2024年2月19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・ＤＣ年金バランス３０（債券重点型）の2024年2月19日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の事項

ファンドの2023年2月20日をもって終了した前計算期間の財務諸表は、前任監査人によって監査されている。前任監査人は、当該財務諸表に対して2023年5月2日付けで無限定適正意見を表明している。

その他の記載内容

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

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

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

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

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

財務諸表に対する経営者の責任

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

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを

評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

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

以　上

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

１【財務諸表】

【三井住友・ＤＣ年金バランス３０（債券重点型）】

（１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第18期 (2023年 2月20日現在)	第19期 (2024年 2月19日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	42,169,556	25,043,329
コール・ローン	833,920,755	1,013,237,330
親投資信託受益証券	16,793,999,678	20,436,285,548
未収入金	－	13,770,000
流動資産合計	17,670,089,989	21,488,336,207
資産合計	17,670,089,989	21,488,336,207
負債の部		
流動負債		
未払解約金	8,249,679	23,470,532
未払受託者報酬	2,866,444	3,365,367
未払委託者報酬	18,154,461	21,314,211
その他未払費用	479,656	562,173
流動負債合計	29,750,240	48,712,283
負債合計	29,750,240	48,712,283
純資産の部		
元本等		
元本	10,835,317,736	11,866,094,525
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	6,805,022,013	9,573,529,399
(分配準備積立金)	1,700,333,862	3,295,449,785
元本等合計	17,640,339,749	21,439,623,924
純資産合計	17,640,339,749	21,439,623,924
負債純資産合計	17,670,089,989	21,488,336,207

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第18期 自　2022年 2月19日 至　2023年 2月20日	第19期 自　2023年 2月21日 至　2024年 2月19日
営業収益		
受取利息	6,992	11,416
有価証券売買等損益	94,874,242	2,089,135,870
営業収益合計	94,881,234	2,089,147,286
営業費用		
支払利息	338,924	377,222
受託者報酬	5,468,014	6,433,074
委託者報酬	34,631,364	40,743,263
その他費用	942,151	1,102,648
営業費用合計	41,380,453	48,656,207
営業利益又は営業損失（△）	53,500,781	2,040,491,079
経常利益又は経常損失（△）	53,500,781	2,040,491,079
当期純利益又は当期純損失（△）	53,500,781	2,040,491,079
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（△）	5,347,580	110,825,805
期首剰余金又は期首欠損金（△）	5,836,512,206	6,805,022,013
剰余金増加額又は欠損金減少額	1,558,498,489	1,650,367,482
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	1,558,498,489	1,650,367,482
剰余金減少額又は欠損金増加額	638,141,883	811,525,370
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	638,141,883	811,525,370
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（△）	6,805,022,013	9,573,529,399

（３）【注記表】

（重要な会計方針の注記）

項　目	第 19 期 自 2023 年 2 月 21 日 至 2024 年 2 月 19 日
１．　有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。 (1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。 (2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。 (3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。
２．　その他財務諸表作成のための基礎となる事項	計算期間の取扱い 当計算期間は前期末および当期末が休日のため、2023 年 2 月 21 日から 2024 年 2 月 19 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 18 期 （2023 年 2 月 20 日現在）	第 19 期 （2024 年 2 月 19 日現在）
１．　当計算期間の末日における受益権の総数	10,835,317,736 口	11,866,094,525 口
２．　１単位当たり純資産の額	１口当たり純資産額　1.6280 円 （１万口当たりの純資産額 16,280 円）	１口当たり純資産額　1.8068 円 （１万口当たりの純資産額 18,068 円）

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

項　目	第 18 期 自 2022 年 2 月 19 日 至 2023 年 2 月 20 日	第 19 期 自 2023 年 2 月 21 日 至 2024 年 2 月 19 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（191,726,682 円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（0 円）、収益調整金	計算期間末における費用控除後の配当等収益（265,653,346 円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（1,509,369,858

	(6,181,038,540円)、および分配準備積立金(1,508,607,180円)より、分配対象収益は7,881,372,402円(1万口当たり7,273.78円)でありますが、分配を行っておりません。	円)、収益調整金(7,113,164,449円)、および分配準備積立金(1,520,426,581円)より、分配対象収益は10,408,614,234円(1万口当たり8,771.73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19期 自 2023年2月21日 至 2024年2月19日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	(1) 金融商品の内容 1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、親投資信託受益証券を組み入れております。 2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。 3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 (2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する会議をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。 また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限値、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19期 (2024年2月19日現在)
1．　貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2．　時価の算定方法	(1) 有価証券（親投資信託受益証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。
3．　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

第18期（自 2022年2月19日　至 2023年2月20日）

種　類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	68,071,569円
合計	68,071,569円

第19期（自 2023年2月21日　至 2024年2月19日）

種　類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	1,931,433,563円
合計	1,931,433,563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19期

自 2023年2月21日 至 2024年2月19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18期 （2023年2月20日現在）	第19期 （2024年2月19日現在）
期首元本額	9,378,840,162円	10,835,317,736円
期中追加設定元本額	2,480,385,852円	2,308,715,920円
期中一部解約元本額	1,023,908,278円	1,277,939,131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

（単位：円）

種　類	銘　柄	券面総額	評価額	備考
親投資信託受益証券	国内株式インデックス・マザーファンド（Ｂ号）	949,961,119	4,421,974,012	
	外国株式インデックス・マザーファンド	262,630,320	2,193,751,062	
	外国債券パッシブ・マザーファンド	969,291,403	2,152,214,631	
	国内債券パッシブ・マザーファンド	9,620,997,562	11,668,345,843	
	親投資信託受益証券　小計		20,436,285,548	
合　計			20,436,285,548	

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5月1日

三井住友DSアセットマネジメント株式会社
　取　締　役　会　御　中

PwC Japan有限責任監査法人
東京事務所
指定有限責任社員
業務執行社員　　公認会計士　山口 健志

指定有限責任社員
業務執行社員　　公認会計士　榊原 康太

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている三井住友・ＤＣ年金バランス５０（標準型）の2023年2月21日から2024年2月19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・ＤＣ年金バランス５０（標準型）の2024年2月19日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の事項

ファンドの2023年2月20日をもって終了した前計算期間の財務諸表は、前任監査人によって監査されている。前任監査人は、当該財務諸表に対して2023年5月2日付けで無限定適正意見を表明している。

その他の記載内容

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

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

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

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

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

財務諸表に対する経営者の責任

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

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを

評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

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

以　上

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

【三井住友・ＤＣ年金バランス５０（標準型）】

（１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第18期 (2023年 2月20日現在)	第19期 (2024年 2月19日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	105,131,265	65,748,233
コール・ローン	2,079,015,120	2,660,132,086
親投資信託受益証券	42,735,520,056	52,598,478,792
未収入金	－	29,420,000
流動資産合計	44,919,666,441	55,353,779,111
資産合計	44,919,666,441	55,353,779,111
負債の部		
流動負債		
未払解約金	14,433,075	50,659,070
未払受託者報酬	7,363,342	8,586,685
未払委託者報酬	49,089,162	57,244,869
その他未払費用	1,232,117	1,434,550
流動負債合計	72,117,696	117,925,174
負債合計	72,117,696	117,925,174
純資産の部		
元本等		
元本	23,793,955,246	24,837,835,222
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	21,053,593,499	30,398,018,715
(分配準備積立金)	8,612,558,096	15,891,947,981
元本等合計	44,847,548,745	55,235,853,937
純資産合計	44,847,548,745	55,235,853,937
負債純資産合計	44,919,666,441	55,353,779,111

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第18期 自　2022年 2月19日 至　2023年 2月20日	第19期 自　2023年 2月21日 至　2024年 2月19日
営業収益		
受取利息	17,938	28,098
有価証券売買等損益	1,191,314,636	8,435,248,736
営業収益合計	1,191,332,574	8,435,276,834
営業費用		
支払利息	859,675	931,779
受託者報酬	14,252,850	16,394,053
委託者報酬	95,019,525	109,294,211
その他費用	2,454,574	2,808,172
営業費用合計	112,586,624	129,428,215
営業利益又は営業損失（△）	1,078,745,950	8,305,848,619
経常利益又は経常損失（△）	1,078,745,950	8,305,848,619
当期純利益又は当期純損失（△）	1,078,745,950	8,305,848,619
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（△）	32,996,703	328,009,048
期首剰余金又は期首欠損金（△）	18,691,036,706	21,053,593,499
剰余金増加額又は欠損金減少額	2,782,696,323	3,213,444,068
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	2,782,696,323	3,213,444,068
剰余金減少額又は欠損金増加額	1,465,888,777	1,846,858,423
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	1,465,888,777	1,846,858,423
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	－	－
分配金	－	－
期末剰余金又は期末欠損金（△）	21,053,593,499	30,398,018,715

（３）【注記表】

（重要な会計方針の注記）

項　目	第 19 期 自 2023 年 2 月 21 日 至 2024 年 2 月 19 日
１．　有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。 (1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。 (2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。 (3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。
２．　その他財務諸表作成のための基礎となる事項	計算期間の取扱い 当計算期間は前期末および当期末が休日のため、2023 年 2 月 21 日から 2024 年 2 月 19 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 18 期 （2023 年 2 月 20 日現在）	第 19 期 （2024 年 2 月 19 日現在）
１．　当計算期間の末日における受益権の総数	23,793,955,246 口	24,837,835,222 口
２．　１単位当たり純資産の額	１口当たり純資産額　1.8848 円 （１万口当たりの純資産額 18,848 円）	１口当たり純資産額　2.2239 円 （１万口当たりの純資産額 22,239 円）

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

項　目	第 18 期 自 2022 年 2 月 19 日 至 2023 年 2 月 20 日	第 19 期 自 2023 年 2 月 21 日 至 2024 年 2 月 19 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（668,748,466 円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（377,000,781 円）、	計算期間末における費用控除後の配当等収益（822,859,377 円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（7,154,980,194

	収益調整金（16,637,991,532円）、および分配準備積立金（7,566,808,849円）より、分配対象収益は25,250,549,628円（１万口当たり10,612.17円）でありますが、分配を行っておりません。	円）、収益調整金（18,449,753,086円）、および分配準備積立金（7,914,108,410円）より、分配対象収益は34,341,701,067円（１万口当たり13,826.37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19期 自 2023年2月21日 至 2024年2月19日
１．　金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
２．　金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	(1) 金融商品の内容 1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、親投資信託受益証券を組み入れております。 2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。 3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 (2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。
３．　金融商品に係るリスク管理体制	リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する会議をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。 また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限値、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19期 (2024年2月19日現在)
1．　貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2．　時価の算定方法	(1) 有価証券（親投資信託受益証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。
3．　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

第18期（自 2022年2月19日　至 2023年2月20日）

種　類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	1,131,954,295円
合計	1,131,954,295円

第19期（自 2023年2月21日　至 2024年2月19日）

種　類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	7,974,795,644円
合計	7,974,795,644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19期

自 2023年2月21日 至 2024年2月19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18期 （2023年2月20日現在）	第19期 （2024年2月19日現在）
期首元本額	22,301,330,040円	23,793,955,246円
期中追加設定元本額	3,238,900,411円	3,113,993,768円
期中一部解約元本額	1,746,275,205円	2,070,113,792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

（単位：円）

種　類	銘　柄	券面総額	評価額	備考
親投資信託受益証券	国内株式インデックス・マザーファンド（Ｂ号）	4,265,977,635	19,857,699,293	
	外国株式インデックス・マザーファンド	1,017,359,735	8,498,005,866	
	外国債券パッシブ・マザーファンド	2,437,524,335	5,412,279,033	
	国内債券パッシブ・マザーファンド	15,526,463,226	18,830,494,600	
	親投資信託受益証券　小計		52,598,478,792	
合　計			52,598,478,792	

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5月1日

三井住友DSアセットマネジメント株式会社
　取　締　役　会　御　中

PwC Japan有限責任監査法人
東京事務所
指定有限責任社員
業務執行社員　　公認会計士　山口 健志

指定有限責任社員
業務執行社員　　公認会計士　榊原 康太

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている三井住友・ＤＣ年金バランス７０（株式重点型）の2023年2月21日から2024年2月19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・ＤＣ年金バランス７０（株式重点型）の2024年2月19日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の事項

ファンドの2023年2月20日をもって終了した前計算期間の財務諸表は、前任監査人によって監査されている。前任監査人は、当該財務諸表に対して2023年5月2日付けで無限定適正意見を表明している。

その他の記載内容

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

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

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

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

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

財務諸表に対する経営者の責任

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

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを

評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

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

以　上

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

【三井住友・ＤＣ年金バランス７０（株式重点型）】

（１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第18期 (2023年 2月20日現在)	第19期 (2024年 2月19日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	58,537,512	39,206,921
コール・ローン	1,157,603,997	1,586,287,305
親投資信託受益証券	23,602,771,720	31,448,373,289
未収入金	9,890,000	73,100,000
流動資産合計	24,828,803,229	33,146,967,515
資産合計	24,828,803,229	33,146,967,515
負債の部		
流動負債		
未払解約金	34,312,837	93,663,640
未払受託者報酬	4,001,878	5,005,939
未払委託者報酬	28,013,411	35,041,829
その他未払費用	669,659	836,344
流動負債合計	66,997,785	134,547,752
負債合計	66,997,785	134,547,752
純資産の部		
元本等		
元本	11,655,750,413	12,420,585,863
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	13,106,055,031	20,591,833,900
(分配準備積立金)	5,524,632,710	11,137,227,128
元本等合計	24,761,805,444	33,012,419,763
純資産合計	24,761,805,444	33,012,419,763
負債純資産合計	24,828,803,229	33,146,967,515

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第18期 自　2022年 2月19日 至　2023年 2月20日	第19期 自　2023年 2月21日 至　2024年 2月19日
営業収益		
受取利息	9,774	15,801
有価証券売買等損益	1,166,705,680	6,571,651,569
営業収益合計	1,166,715,454	6,571,667,370
営業費用		
支払利息	464,351	525,300
受託者報酬	7,680,087	9,397,461
委託者報酬	53,761,128	65,782,767
その他費用	1,322,620	1,608,994
営業費用合計	63,228,186	77,314,522
営業利益又は営業損失（△）	1,103,487,268	6,494,352,848
経常利益又は経常損失（△）	1,103,487,268	6,494,352,848
当期純利益又は当期純損失（△）	1,103,487,268	6,494,352,848
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（△）	39,608,180	312,064,319
期首剰余金又は期首欠損金（△）	11,037,442,322	13,106,055,031
剰余金増加額又は欠損金減少額	2,168,484,192	2,807,903,351
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	2,168,484,192	2,807,903,351
剰余金減少額又は欠損金増加額	1,163,750,571	1,504,413,011
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	1,163,750,571	1,504,413,011
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（△）	13,106,055,031	20,591,833,900

（３）【注記表】

（重要な会計方針の注記）

項　目	第 19 期 自 2023 年 2 月 21 日 至 2024 年 2 月 19 日
１．　有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。 (1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。 (2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。 (3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。
２．　その他財務諸表作成のための基礎となる事項	計算期間の取扱い 当計算期間は前期末および当期末が休日のため、2023 年 2 月 21 日から 2024 年 2 月 19 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 18 期 （2023 年 2 月 20 日現在）	第 19 期 （2024 年 2 月 19 日現在）
１．　当計算期間の末日における受益権の総数	11,655,750,413 口	12,420,585,863 口
２．　１単位当たり純資産の額	１口当たり純資産額　2.1244 円 （１万口当たりの純資産額 21,244 円）	１口当たり純資産額　2.6579 円 （１万口当たりの純資産額 26,579 円）

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

項　目	第 18 期 自 2022 年 2 月 19 日 至 2023 年 2 月 20 日	第 19 期 自 2023 年 2 月 21 日 至 2024 年 2 月 19 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（441,412,833 円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（622,466,255 円）、	計算期間末における費用控除後の配当等収益（546,852,838 円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（5,635,435,691

	収益調整金（10,719,473,764円）、および分配準備積立金（4,460,753,622円）より、分配対象収益は16,244,106,474円（１万口当たり13,936.56円）でありますが、分配を行っておりません。	円）、収益調整金（12,359,840,796円）、および分配準備積立金（4,954,938,599円）より、分配対象収益は23,497,067,924円（１万口当たり18,917.84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19期 自 2023年2月21日 至 2024年2月19日
１．　金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
２．　金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	(1) 金融商品の内容 1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、親投資信託受益証券を組み入れております。 2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。 3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 (2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。
３．　金融商品に係るリスク管理体制	リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する会議をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。 また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限値、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19期 (2024年2月19日現在)
1．　貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2．　時価の算定方法	(1) 有価証券（親投資信託受益証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。
3．　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

第18期（自 2022年2月19日　至 2023年2月20日）

種　類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	1,125,932,962円
合計	1,125,932,962円

第19期（自 2023年2月21日　至 2024年2月19日）

種　類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	6,329,248,420円
合計	6,329,248,420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19期

自 2023年2月21日 至 2024年2月19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18期 （2023年2月20日現在）	第19期 （2024年2月19日現在）
期首元本額	10,752,403,155円	11,655,750,413円
期中追加設定元本額	2,034,266,079円	2,086,350,077円
期中一部解約元本額	1,130,918,821円	1,321,514,627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

（単位：円）

種　類	銘　柄	券面総額	評価額	備考
親投資信託受益証券	国内株式インデックス・マザーファンド（Ｂ号）	3,595,634,334	16,737,318,261	
	外国株式インデックス・マザーファンド	793,921,765	6,631,628,503	
	外国債券パッシブ・マザーファンド	1,460,646,470	3,243,219,421	
	国内債券パッシブ・マザーファンド	3,987,637,784	4,836,207,104	
	親投資信託受益証券　小計		31,448,373,289	
合　計			31,448,373,289	

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

なお、以下に記載した状況は、監査の対象外です。

国内株式インデックス・マザーファンド（Ｂ号）

（１）貸借対照表

（単位：円）

	(2023 年 2 月 20 日現在)	(2024 年 2 月 19 日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	91,354,068	151,525,799
コール・ローン	1,806,565,228	6,130,638,350
株式	227,099,948,860	312,887,275,500
派生商品評価勘定	71,296,200	337,272,800
未収配当金	386,632,074	448,456,093
差入委託証拠金	85,050,000	318,139,266
流動資産合計	229,540,846,430	320,273,307,808
資産合計	229,540,846,430	320,273,307,808
負債の部		
流動負債		
前受金	60,195,000	299,540,000
未払解約金	207,364,628	401,163,556
その他未払費用	4,022	6,296
流動負債合計	267,563,650	700,709,852
負債合計	267,563,650	700,709,852
純資産の部		
元本等		
元本	66,694,933,603	68,652,536,502
剰余金		
剰余金又は欠損金（△）	162,578,349,177	250,920,061,454
元本等合計	229,273,282,780	319,572,597,956
純資産合計	229,273,282,780	319,572,597,956
負債純資産合計	229,540,846,430	320,273,307,808

（２）注記表

（重要な会計方針の注記）

項　目	自 2023 年 2 月 21 日 至 2024 年 2 月 19 日

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

（重要な会計上の見積りに関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

項　目	(2023年2月20日現在)	(2024年2月19日現在)
1．　当計算期間の末日における受益権の総数	66,694,933,603口	68,652,536,502口
2．　1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額　3.4376円 （1万口当たりの純資産額34,376円）	1口当たり純資産額　4.6549円 （1万口当たりの純資産額46,549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2月21日 至 2024年2月19日
1．　金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2．　金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	(1) 金融商品の内容 1) 有価証券 　当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、株式を組み入れております。 2) デリバティブ取引 　当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。

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

Ⅱ．金融商品の時価等に関する事項

項　目	(2024 年 2 月 19 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	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

事項についての補足説明	前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。

(デリバティブ取引に関する注記)

(2023 年 2 月 20 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 0503 月	2,087,623,800	－	2,158,920,000	71,296,200
	小計	2,087,623,800	－	2,158,920,000	71,296,200
合　計		2,087,623,800	－	2,158,920,000	71,296,200

(2024 年 2 月 19 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 0603 月	6,331,907,200	－	6,669,180,000	337,272,800
	小計	6,331,907,200	－	6,669,180,000	337,272,800
合　計		6,331,907,200	－	6,669,180,000	337,272,800

(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 2 月 21 日 至 2024 年 2 月 19 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）

（2023 年 2 月 20 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	62,902,449,020 円
同期中における追加設定元本額	11,516,103,947 円
同期中における一部解約元本額	7,723,619,364 円
2023 年 2 月 20 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	9,538,705,047 円
三井住友・ＤＣ年金バランス３０（債券重点型）	1,046,654,371 円
三井住友・ＤＣ年金バランス５０（標準型）	4,623,835,621 円
三井住友・ＤＣ年金バランス７０（株式重点型）	3,605,644,771 円
ＳＭＡＭ・グローバルバランスファンド（機動的資産配分型）	147,761,638 円
三井住友・ＤＣターゲットイヤーファンド２０２０（４資産タイプ）	4,345,488 円
三井住友・ＤＣターゲットイヤーファンド２０２５（４資産タイプ）	20,012,677 円
三井住友・ＤＣターゲットイヤーファンド２０３０（４資産タイプ）	64,767,362 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）	167,250,433 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）	153,122,393 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）	269,345,967 円
国内株式指数ファンド（ＴＯＰＩＸ）	1,348,113,012 円
三井住友・ＤＣつみたてＮＩＳＡ・日本株インデックスファンド	23,030,551,462 円
アセットアロケーション・ファンド（安定型）	299,747,190 円
アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）	374,945,391 円
アセットアロケーション・ファンド（成長型）	240,188,472 円
イオン・バランス戦略ファンド	76,636,609 円
三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０５０	46,120,874 円
三井住友・資産最適化ファンド（１安定重視型）	202,062,283 円
三井住友・資産最適化ファンド（２やや安定型）	189,680,711 円
三井住友・資産最適化ファンド（３バランス型）	708,126,037 円
三井住友・資産最適化ファンド（４やや成長型）	397,110,891 円
三井住友・資産最適化ファンド（５成長重視型）	452,733,238 円
三井住友・ＤＣつみたてＮＩＳＡ・世界分散ファンド	52,873,871 円
三井住友ＤＳ・国内株式インデックス年金ファンド	864,398,532 円
三井住友ＤＳ・年金バランス３０（債券重点型）	40,587,104 円
三井住友ＤＳ・年金バランス５０（標準型）	218,482,974 円
三井住友ＤＳ・年金バランス７０（株式重点型）	213,292,698 円
三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０６０	5,969,579 円
日興ＦＷＳ・日本株インデックス	1,480,422,415 円
三井住友ＤＳ・ＴＯＰＩＸインデックス・ファンド	23,888,431 円
三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０３５	48,704 円
三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０４０	55,576 円
三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０４５	66,034 円
三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０５５	75,894 円
三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０６５	75,894 円

ＳＭＡＭ・国内株式パッシブ・ファンド（適格機関投資家専用）	2,474,878,301 円
バランスファンドＶＡ（安定運用型）＜適格機関投資家限定＞	10,250,775 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＞	66,570,035 円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ２５＜適格機関投資家専用＞	1,343,208,711 円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ３７．５＜適格機関投資家専用＞	1,399,810,680 円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ５０＜適格機関投資家専用＞	5,379,538,379 円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＬ３０＜適格機関投資家限定＞	35,485,948 円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＬ５０＜適格機関投資家限定＞	129,345,747 円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ７５＜適格機関投資家専用＞	649,463,451 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＞	44,118,775 円
ＳＭＡＭ・インデックス・バランスＶＡ２５＜適格機関投資家専用＞	235,268,102 円
ＳＭＡＭ・インデックス・バランスＶＡ５０＜適格機関投資家専用＞	755,439,439 円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ４０＜適格機関投資家専用＞	516,776,916 円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ３５＜適格機関投資家専用＞	1,580,224,876 円
ＳＭＡＭ・バランスＶＡ株４０Ｔ＜適格機関投資家限定＞	352,709 円
ＳＭＡＭ・グローバルバランス４０ＶＡ＜適格機関投資家限定＞	34,600,904 円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２０Ａ＜適格機関投資家専用＞	39,166,060 円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ３５Ａ＜適格機関投資家専用＞	30,431,766 円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ５０Ａ＜適格機関投資家専用＞	16,165,009 円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２０Ｌ＜適格機関投資家専用＞	93,119,594 円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２５Ｌ＜適格機関投資家専用＞	217,333,061 円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２０Ａ２＜適格機関投資家専用＞	50,002,197 円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ３５Ａ２＜適格機関投資家専用＞	37,859,485 円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ５０Ａ２＜適格機関投資家専用＞	7,534,461 円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ３０Ｌ２＜適格機関投資家専用＞	38,647,210 円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２５Ｌ２＜適格機関投資家専用＞	509,415,497 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）	161,677,856 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＞	195,183,336 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＞	81,328,537 円
ＳＭＡＭ・世界バランスファンドＶＡ＜適格機関投資家限定＞	88,233,756 円
ＳＭＡＭ・世界バランスファンドＶＡ２＜適格機関投資家限定＞	41,808,540 円
ＳＭＡＭ・年金Ｗリスクコントロールファンド＜適格機関投資家限定＞	38,301,054 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＞	25,100,514 円
ＳＭＡＭ・マルチアセットストラテジー・オープン＜適格機関投資家限定＞	32,264,198 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＞	411,569,060 円
ＳＭＤＡＭ・日米３資産バランスオープン＜適格機関投資家限定＞	16,759,020 円
合　計	66,694,933,603 円

（2024 年 2 月 19 日現在）	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	66,694,933,603 円
同期中における追加設定元本額	12,224,638,562 円

同期中における一部解約元本額	10,267,035,663 円
2024 年 2 月 19 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	9,610,932,403 円
三井住友・ＤＣ年金バランス３０（債券重点型）	949,961,119 円
三井住友・ＤＣ年金バランス５０（標準型）	4,265,977,635 円
三井住友・ＤＣ年金バランス７０（株式重点型）	3,595,634,334 円
ＳＭＡＭ・グローバルバランスファンド（機動的資産配分型）	130,598,984 円
三井住友・ＤＣターゲットイヤーファンド２０２０（４資産タイプ）	3,203,821 円
三井住友・ＤＣターゲットイヤーファンド２０２５（４資産タイプ）	14,229,977 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）	53,239,517 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）	153,254,108 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）	144,511,849 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）	269,291,771 円
国内株式指数ファンド（ＴＯＰＩＸ）	1,309,758,991 円
三井住友・ＤＣつみたてＮＩＳＡ・日本株インデックスファンド	27,132,737,932 円
アセットアロケーション・ファンド（安定型）	221,601,247 円
アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）	300,520,430 円
アセットアロケーション・ファンド（成長型）	171,090,572 円
イオン・バランス戦略ファンド	39,912,446 円
三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０５０	54,537,428 円
三井住友・資産最適化ファンド（１安定重視型）	204,850,244 円
三井住友・資産最適化ファンド（２やや安定型）	199,716,157 円
三井住友・資産最適化ファンド（３バランス型）	785,479,676 円
三井住友・資産最適化ファンド（４やや成長型）	464,369,199 円
三井住友・資産最適化ファンド（５成長重視型）	549,442,592 円
三井住友・ＤＣつみたてＮＩＳＡ・世界分散ファンド	56,885,557 円
三井住友ＤＳ・国内株式インデックス年金ファンド	1,250,531,612 円
三井住友ＤＳ・年金バランス３０（債券重点型）	40,309,273 円
三井住友ＤＳ・年金バランス５０（標準型）	242,913,662 円
三井住友ＤＳ・年金バランス７０（株式重点型）	260,765,250 円
三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０６０	5,166,142 円
日興ＦＷＳ・日本株インデックス	2,145,052,179 円
三井住友ＤＳ・ＴＯＰＩＸインデックス・ファンド	93,785,449 円
三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０３５	6,322,843 円
三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０４０	3,764,569 円
三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０４５	5,202,001 円
三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０５５	1,447,722 円
三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０６５	954,679 円
三井住友ＤＳ・ＦＷ専用ポートフォリオ・レベル１（保守型）	554,713 円
三井住友ＤＳ・ＦＷ専用ポートフォリオ・レベル２（安定型）	9,305,882 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）	44,390,170 円
三井住友ＤＳ・ＦＷ専用ポートフォリオ・レベル４（成長型）	28,782,101 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）	13,003,454 円

ＳＭＡＭ・国内株式パッシブ・ファンド（適格機関投資家専用）	2,256,076,772 円
バランスファンドＶＡ（安定運用型）＜適格機関投資家限定＞	9,688,938 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＞	41,808,833 円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ２５＜適格機関投資家専用＞	849,339,497 円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ３７．５＜適格機関投資家専用＞	1,104,911,885 円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ５０＜適格機関投資家専用＞	4,280,490,537 円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＬ３０＜適格機関投資家限定＞	28,176,463 円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＬ５０＜適格機関投資家限定＞	103,031,751 円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ７５＜適格機関投資家専用＞	579,227,237 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＞	32,471,530 円
ＳＭＡＭ・インデックス・バランスＶＡ２５＜適格機関投資家専用＞	180,897,773 円
ＳＭＡＭ・インデックス・バランスＶＡ５０＜適格機関投資家専用＞	613,786,918 円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ４０＜適格機関投資家専用＞	397,985,143 円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ３５＜適格機関投資家専用＞	1,181,339,430 円
ＳＭＡＭ・グローバルバランス４０ＶＡ＜適格機関投資家限定＞	25,855,907 円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２０Ａ＜適格機関投資家専用＞	28,373,066 円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ３５Ａ＜適格機関投資家専用＞	24,833,310 円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ５０Ａ＜適格機関投資家専用＞	13,994,879 円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２０Ｌ＜適格機関投資家専用＞	63,823,970 円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２５Ｌ＜適格機関投資家専用＞	163,440,585 円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２０Ａ２＜適格機関投資家専用＞	35,139,781 円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ３５Ａ２＜適格機関投資家専用＞	30,414,882 円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ５０Ａ２＜適格機関投資家専用＞	6,584,711 円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ３０Ｌ２＜適格機関投資家専用＞	28,852,126 円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２５Ｌ２＜適格機関投資家専用＞	382,031,267 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）	153,717,263 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＞	145,695,201 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＞	59,423,376 円
ＳＭＡＭ・世界バランスファンドＶＡ＜適格機関投資家限定＞	44,183,537 円
ＳＭＡＭ・世界バランスファンドＶＡ２＜適格機関投資家限定＞	28,268,521 円
ＳＭＡＭ・年金Ｗリスクコントロールファンド＜適格機関投資家限定＞	38,577,357 円
ＳＭＡＭ・マルチアセットストラテジーファンド２０１６－０４＜適格機関投資家限定＞	16,635,173 円
ＳＭＡＭ・マルチアセットストラテジー・オープン＜適格機関投資家限定＞	26,525,958 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＞	737,175,410 円
ＳＭＤＡＭ・日米３資産バランスオープン＜適格機関投資家限定＞	9,891,604 円
ＳＭＤＡＭ・年金Ｗリスクコントロールファンド（リスク３％）＜適格機関投資家限定＞	95,876,221 円
合　計	68,652,536,502 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	4,100	3,595.000	14,739,500	
ニッスイ	115,600	944.100	109,137,960	
マルハニチロ	17,100	2,958.000	50,581,800	
雪国まいたけ	11,400	952.000	10,852,800	
カネコ種苗	4,700	1,436.000	6,749,200	
サカタのタネ	13,200	3,830.000	50,556,000	
ホクト	10,100	1,838.000	18,563,800	
住石ホールディングス	14,400	2,131.000	30,686,400	
日鉄鉱業	4,500	5,150.000	23,175,000	
三井松島ホールディングス	6,700	3,000.000	20,100,000	
ＩＮＰＥＸ	434,300	2,033.500	883,149,050	
石油資源開発	13,300	6,200.000	82,460,000	
Ｋ＆Ｏエナジーグループ	5,500	2,499.000	13,744,500	
ショーボンドホールディングス	15,700	6,242.000	97,999,400	
ミライト・ワン	38,100	1,751.000	66,713,100	
タマホーム	7,600	3,965.000	30,134,000	
日本アクア	5,000	1,017.000	5,085,000	
安藤・間	66,300	1,239.000	82,145,700	
東急建設	32,300	808.000	26,098,400	
コムシスホールディングス	37,500	3,339.000	125,212,500	
ビーアールホールディングス	21,600	374.000	8,078,400	
高松コンストラクショングループ	7,200	2,723.000	19,605,600	
東建コーポレーション	3,200	9,600.000	30,720,000	
ヤマウラ	6,900	1,504.000	10,377,600	
オリエンタル白石	44,000	390.000	17,160,000	
大成建設	76,900	4,859.000	373,657,100	
大林組	293,400	1,440.500	422,642,700	
清水建設	233,600	914.800	213,697,280	
飛島建設	9,600	1,482.000	14,227,200	
長谷工コーポレーション	83,000	1,886.000	156,538,000	
松井建設	8,200	858.000	7,035,600	
錢高組	1,500	4,150.000	6,225,000	
鹿島建設	182,000	2,843.500	517,517,000	
不動テトラ	5,600	2,228.000	12,476,800	
鉄建建設	6,700	2,561.000	17,158,700	
西松建設	15,700	4,587.000	72,015,900	
三井住友建設	65,600	443.000	29,060,800	
大豊建設	3,600	3,140.000	11,304,000	
奥村組	12,900	5,080.000	65,532,000	
東鉄工業	10,900	3,035.000	33,081,500	
淺沼組	6,400	4,150.000	26,560,000	

戸田建設	109,300	958.000	104,709,400	
熊谷組	13,400	3,865.000	51,791,000	
北野建設	1,900	3,095.000	5,880,500	
矢作建設工業	11,500	1,585.000	18,227,500	
ピーエス三菱	10,900	1,057.000	11,521,300	
日本ハウスホールディングス	19,500	306.000	5,967,000	
新日本建設	11,500	1,242.000	14,283,000	
東亜道路工業	3,400	6,420.000	21,828,000	
日本道路	8,500	2,038.000	17,323,000	
東亜建設工業	7,100	4,675.000	33,192,500	
日本国土開発	24,300	521.000	12,660,300	
若築建設	3,900	3,140.000	12,246,000	
東洋建設	26,300	1,322.000	34,768,600	
五洋建設	114,800	764.400	87,753,120	
世紀東急工業	10,800	1,938.000	20,930,400	
福田組	3,100	5,330.000	16,523,000	
住友林業	71,600	4,109.000	294,204,400	
日本基礎技術	2,500	453.000	1,132,500	
巴コーポレーション	11,500	655.000	7,532,500	
大和ハウス工業	225,400	4,337.000	977,559,800	
ライト工業	14,400	1,895.000	27,288,000	
積水ハウス	247,400	3,292.000	814,440,800	
日特建設	8,200	1,152.000	9,446,400	
ユアテック	17,800	1,260.000	22,428,000	
日本リーテック	7,700	1,243.000	9,571,100	
四電工	3,500	4,000.000	14,000,000	
中電工	11,500	2,953.000	33,959,500	
関電工	49,000	1,593.000	78,057,000	
きんでん	56,500	2,650.000	149,725,000	
東京エネシス	8,700	1,165.000	10,135,500	
トーエネック	2,900	5,190.000	15,051,000	
住友電設	7,400	3,075.000	22,755,000	
日本電設工業	13,200	2,091.000	27,601,200	
エクシオグループ	38,000	3,117.000	118,446,000	
新日本空調	5,300	2,862.000	15,168,600	
九電工	19,700	5,710.000	112,487,000	
三機工業	16,900	1,913.000	32,329,700	
日揮ホールディングス	81,600	1,412.000	115,219,200	
中外炉工業	3,300	2,829.000	9,335,700	
ヤマト	7,000	974.000	6,818,000	
太平電業	5,000	4,460.000	22,300,000	
高砂熱学工業	19,600	4,390.000	86,044,000	
三晃金属工業	1,300	4,955.000	6,441,500	
朝日工業社	4,000	2,986.000	11,944,000	

明星工業	16,000	1,230.000	19,680,000	
大氣社	9,200	4,885.000	44,942,000	
ダイダン	10,600	1,811.000	19,196,600	
日比谷総合設備	6,900	2,560.000	17,664,000	
テスホールディングス	18,200	448.000	8,153,600	
インフロニア・ホールディングス	94,300	1,500.000	141,450,000	
東洋エンジニアリング	11,300	848.000	9,582,400	
レイズネクスト	11,400	2,349.000	26,778,600	
ニップン	21,400	2,399.000	51,338,600	
日清製粉グループ本社	76,500	2,137.000	163,480,500	
日東富士製粉	1,700	5,370.000	9,129,000	
昭和産業	6,700	3,455.000	23,148,500	
鳥越製粉	10,700	730.000	7,811,000	
中部飼料	11,300	1,280.000	14,464,000	
フィード・ワン	12,900	1,015.000	13,093,500	
日本甜菜製糖	5,200	2,120.000	11,024,000	
ＤＭ三井製糖ホールディングス	7,900	3,280.000	25,912,000	
ウェルネオシュガー	4,700	2,282.000	10,725,400	
森永製菓	34,800	2,748.000	95,630,400	
中村屋	2,800	3,130.000	8,764,000	
江崎グリコ	23,200	4,697.000	108,970,400	
井村屋グループ	4,800	2,459.000	11,803,200	
不二家	5,700	2,507.000	14,289,900	
山崎製パン	55,500	3,907.000	216,838,500	
モロゾフ	2,800	4,150.000	11,620,000	
亀田製菓	5,100	4,430.000	22,593,000	
寿スピリッツ	43,000	1,928.000	82,904,000	
カルビー	37,300	3,155.000	117,681,500	
森永乳業	29,600	3,156.000	93,417,600	
六甲バター	6,300	1,379.000	8,687,700	
ヤクルト本社	118,000	3,158.000	372,644,000	
明治ホールディングス	100,900	3,461.000	349,214,900	
雪印メグミルク	19,500	2,219.000	43,270,500	
プリマハム	10,600	2,283.000	24,199,800	
日本ハム	35,600	5,284.000	188,110,400	
丸大食品	8,400	1,652.000	13,876,800	
Ｓ　Ｆｏｏｄｓ	8,900	3,195.000	28,435,500	
柿安本店	3,300	2,592.000	8,553,600	
伊藤ハム米久ホールディングス	12,100	4,150.000	50,215,000	
サッポロホールディングス	27,600	7,051.000	194,607,600	
アサヒグループホールディングス	189,900	5,327.000	1,011,597,300	
キリンホールディングス	340,400	2,148.500	731,349,400	
宝ホールディングス	54,800	1,187.000	65,047,600	
オエノンホールディングス	26,200	351.000	9,196,200	

コカ・コーラ　ボトラーズジャパンホールディングス	65,100	1,907.500	124,178,250	
ライフドリンク　カンパニー	1,700	5,110.000	8,687,000	
サントリー食品インターナショナル	57,700	4,737.000	273,324,900	
ダイドーグループホールディングス	9,000	3,030.000	27,270,000	
伊藤園	28,100	4,254.000	119,537,400	
キーコーヒー	8,400	2,047.000	17,194,800	
日清オイリオグループ	11,300	5,100.000	57,630,000	
不二製油グループ本社	18,900	2,399.000	45,341,100	
かどや製油	1,800	3,810.000	6,858,000	
Ｊ－オイルミルズ	8,300	1,942.000	16,118,600	
キッコーマン	54,500	9,336.000	508,812,000	
味の素	195,800	5,670.000	1,110,186,000	
ブルドックソース	4,700	2,123.000	9,978,100	
キユーピー	43,800	2,726.500	119,420,700	
ハウス食品グループ本社	26,800	3,146.000	84,312,800	
カゴメ	36,400	3,604.000	131,185,600	
アリアケジャパン	7,200	5,700.000	41,040,000	
エバラ食品工業	2,800	2,921.000	8,178,800	
ニチレイ	37,700	3,747.000	141,261,900	
東洋水産	41,800	8,549.000	357,348,200	
イートアンドホールディングス	4,100	2,132.000	8,741,200	
ヨシムラ・フード・ホールディングス	5,800	1,268.000	7,354,400	
日清食品ホールディングス	87,000	4,442.000	386,454,000	
永谷園ホールディングス	4,200	2,205.000	9,261,000	
フジッコ	7,600	1,945.000	14,782,000	
ロック・フィールド	9,100	1,675.000	15,242,500	
日本たばこ産業	499,800	3,912.000	1,955,217,600	
ケンコーマヨネーズ	6,300	2,120.000	13,356,000	
わらべや日洋ホールディングス	6,200	2,832.000	17,558,400	
なとり	5,400	2,153.000	11,626,200	
ファーマフーズ	11,800	989.000	11,670,200	
ユーグレナ	51,500	640.000	32,960,000	
紀文食品	7,100	1,191.000	8,456,100	
ピックルスホールディングス	5,200	1,258.000	6,541,600	
ミヨシ油脂	5,200	1,250.000	6,500,000	
理研ビタミン	7,200	2,430.000	17,496,000	
片倉工業	9,000	1,800.000	16,200,000	
グンゼ	5,900	5,650.000	33,335,000	
東洋紡	36,100	1,081.000	39,024,100	
ユニチカ	30,500	158.000	4,819,000	
富士紡ホールディングス	3,500	4,465.000	15,627,500	
倉敷紡績	6,600	3,100.000	20,460,000	
シキボウ	6,100	1,200.000	7,320,000	

日本毛織	21,800	1,371.000	29,887,800	
帝国繊維	9,300	2,137.000	19,874,100	
帝人	81,200	1,259.500	102,271,400	
東レ	561,800	695.100	390,507,180	
ダイニック	6,300	761.000	4,794,300	
セーレン	16,000	2,429.000	38,864,000	
小松マテーレ	13,300	781.000	10,387,300	
ワコールホールディングス	16,700	3,639.000	60,771,300	
ホギメディカル	11,200	3,555.000	39,816,000	
ＴＳＩホールディングス	28,500	702.000	20,007,000	
ワールド	10,800	1,970.000	21,276,000	
三陽商会	2,800	2,736.000	7,660,800	
オンワードホールディングス	54,600	527.000	28,774,200	
ルックホールディングス	3,700	2,455.000	9,083,500	
ゴールドウイン	14,800	9,057.000	134,043,600	
デサント	14,300	3,200.000	45,760,000	
特種東海製紙	4,000	3,835.000	15,340,000	
王子ホールディングス	344,800	570.000	196,536,000	
日本製紙	44,400	1,165.000	51,726,000	
北越コーポレーション	49,600	1,322.000	65,571,200	
大王製紙	37,000	1,091.500	40,385,500	
レンゴー	75,900	1,015.500	77,076,450	
トーモク	5,400	2,297.000	12,403,800	
ザ・パック	6,200	3,815.000	23,653,000	
北の達人コーポレーション	37,700	229.000	8,633,300	
クラレ	122,300	1,519.500	185,834,850	
旭化成	558,400	1,049.500	586,040,800	
レゾナック・ホールディングス	80,900	3,260.000	263,734,000	
住友化学	622,100	313.600	195,090,560	
住友精化	3,500	5,070.000	17,745,000	
日産化学	40,000	6,237.000	249,480,000	
ラサ工業	3,500	2,321.000	8,123,500	
クレハ	20,400	2,677.000	54,610,800	
多木化学	3,300	3,755.000	12,391,500	
テイカ	5,900	1,386.000	8,177,400	
石原産業	14,800	1,513.000	22,392,400	
日本曹達	8,800	5,960.000	52,448,000	
東ソー	113,000	1,999.000	225,887,000	
トクヤマ	26,600	2,339.500	62,230,700	
セントラル硝子	13,300	2,905.000	38,636,500	
東亜合成	41,100	1,520.000	62,472,000	
大阪ソーダ	5,800	11,480.000	66,584,000	
関東電化工業	16,400	943.000	15,465,200	
デンカ	30,100	2,528.000	76,092,800	

信越化学工業	758,200	6,178.000	4,684,159,600	
堺化学工業	6,300	1,994.000	12,562,200	
第一稀元素化学工業	8,000	927.000	7,416,000	
エア・ウォーター	80,000	2,202.000	176,160,000	
日本酸素ホールディングス	82,000	4,159.000	341,038,000	
日本化学工業	3,000	2,150.000	6,450,000	
日本パーカライジング	39,800	1,270.000	50,546,000	
高圧ガス工業	12,800	878.000	11,238,400	
四国化成ホールディングス	11,000	1,760.000	19,360,000	
戸田工業	2,100	1,640.000	3,444,000	
ステラ　ケミファ	5,000	3,890.000	19,450,000	
保土谷化学工業	2,400	3,540.000	8,496,000	
日本触媒	12,600	5,702.000	71,845,200	
大日精化工業	5,800	2,757.000	15,990,600	
カネカ	21,000	3,718.000	78,078,000	
三菱瓦斯化学	63,000	2,642.500	166,477,500	
三井化学	69,000	4,067.000	280,623,000	
ＪＳＲ	77,200	4,060.000	313,432,000	
東京応化工業	39,900	4,140.000	165,186,000	
大阪有機化学工業	6,800	3,005.000	20,434,000	
三菱ケミカルグループ	604,200	862.000	520,820,400	
ＫＨネオケム	13,300	2,279.000	30,310,700	
ダイセル	117,400	1,438.000	168,821,200	
住友ベークライト	12,200	8,136.000	99,259,200	
積水化学工業	169,000	2,092.000	353,548,000	
日本ゼオン	59,000	1,284.500	75,785,500	
アイカ工業	22,000	3,535.000	77,770,000	
ＵＢＥ	42,300	2,582.000	109,218,600	
積水樹脂	11,300	2,518.000	28,453,400	
タキロンシーアイ	18,900	639.000	12,077,100	
旭有機材	5,500	3,965.000	21,807,500	
ニチバン	5,700	1,871.000	10,664,700	
リケンテクノス	18,200	960.000	17,472,000	
大倉工業	4,000	3,135.000	12,540,000	
群栄化学工業	2,100	3,660.000	7,686,000	
ミライアル	2,700	1,462.000	3,947,400	
ダイキョーニシカワ	18,600	733.000	13,633,800	
森六ホールディングス	4,400	2,782.000	12,240,800	
恵和	6,100	1,209.000	7,374,900	
日本化薬	64,000	1,306.500	83,616,000	
カーリットホールディングス	8,700	993.000	8,639,100	
日本精化	4,800	2,647.000	12,705,600	
扶桑化学工業	7,500	4,665.000	34,987,500	
トリケミカル研究所	11,000	4,180.000	45,980,000	

ＡＤＥＫＡ	30,000	3,004.000	90,120,000	
日油	25,500	7,160.000	182,580,000	
ハリマ化成グループ	5,800	899.000	5,214,200	
花王	188,100	5,651.000	1,062,953,100	
第一工業製薬	3,300	3,170.000	10,461,000	
石原ケミカル	4,200	1,882.000	7,904,400	
三洋化成工業	4,800	4,185.000	20,088,000	
大日本塗料	10,800	1,087.000	11,739,600	
日本ペイントホールディングス	446,000	1,105.000	492,830,000	
関西ペイント	83,000	2,296.500	190,609,500	
中国塗料	14,500	2,100.000	30,450,000	
日本特殊塗料	5,200	1,368.000	7,113,600	
藤倉化成	12,900	453.000	5,843,700	
太陽ホールディングス	12,300	3,205.000	39,421,500	
ＤＩＣ	33,000	3,020.000	99,660,000	
サカタインクス	18,300	1,390.000	25,437,000	
ａｒｔｉｅｎｃｅ	17,200	2,904.000	49,948,800	
富士フイルムホールディングス	156,400	9,441.000	1,476,572,400	
資生堂	174,600	4,175.000	728,955,000	
ライオン	111,000	1,317.000	146,187,000	
高砂香料工業	5,600	3,430.000	19,208,000	
マンダム	17,900	1,311.000	23,466,900	
ミルボン	11,700	3,499.000	40,938,300	
ファンケル	36,300	2,125.000	77,137,500	
コーセー	17,000	8,436.000	143,412,000	
コタ	8,000	1,584.000	12,672,000	
ポーラ・オルビスホールディングス	42,600	1,464.000	62,366,400	
ノエビアホールディングス	7,300	5,240.000	38,252,000	
新日本製薬	5,000	1,723.000	8,615,000	
Ｉ－ｎｅ	1,100	2,093.000	2,302,300	
アクシージア	4,800	851.000	4,084,800	
エステー	7,100	1,549.000	10,997,900	
アグロ　カネショウ	3,900	1,267.000	4,941,300	
コニシ	27,400	1,386.000	37,976,400	
長谷川香料	15,800	3,190.000	50,402,000	
小林製薬	25,000	6,099.000	152,475,000	
荒川化学工業	7,700	1,121.000	8,631,700	
メック	6,700	4,180.000	28,006,000	
日本高純度化学	2,400	2,741.000	6,578,400	
タカラバイオ	22,200	1,069.000	23,731,800	
ＪＣＵ	9,200	4,040.000	37,168,000	
新田ゼラチン	6,000	678.000	4,068,000	
ＯＡＴアグリオ	2,800	1,690.000	4,732,000	
デクセリアルズ	23,000	5,976.000	137,448,000	

アース製薬	7,400	4,175.000	30,895,000	
北興化学工業	9,600	1,074.000	10,310,400	
大成ラミック	3,500	3,075.000	10,762,500	
クミアイ化学工業	33,100	831.000	27,506,100	
日本農薬	15,900	715.000	11,368,500	
アキレス	5,700	1,483.000	8,453,100	
有沢製作所	14,400	1,158.000	16,675,200	
日東電工	55,900	14,045.000	785,115,500	
レック	12,800	1,097.000	14,041,600	
三光合成	11,700	642.000	7,511,400	
きもと	21,600	207.000	4,471,200	
藤森工業	6,300	3,870.000	24,381,000	
前澤化成工業	5,900	1,574.000	9,286,600	
未来工業	3,200	5,260.000	16,832,000	
ＪＳＰ	6,000	2,182.000	13,092,000	
エフピコ	15,900	2,870.000	45,633,000	
天馬	6,400	2,414.000	15,449,600	
信越ポリマー	14,800	1,619.000	23,961,200	
東リ	20,000	400.000	8,000,000	
ニフコ	29,200	3,749.000	109,470,800	
バルカー	6,800	4,450.000	30,260,000	
ユニ・チャーム	173,300	5,174.000	896,654,200	
協和キリン	104,500	2,858.000	298,661,000	
武田薬品工業	743,800	4,435.000	3,298,753,000	
アステラス製薬	739,900	1,682.500	1,244,881,750	
住友ファーマ	71,500	368.000	26,312,000	
塩野義製薬	106,600	7,135.000	760,591,000	
日本新薬	23,200	4,962.000	115,118,400	
中外製薬	263,100	5,779.000	1,520,454,900	
科研製薬	17,500	3,588.000	62,790,000	
エーザイ	102,600	6,297.000	646,072,200	
ロート製薬	83,400	2,944.500	245,571,300	
小野薬品工業	181,300	2,418.000	438,383,400	
久光製薬	19,900	4,030.000	80,197,000	
持田製薬	11,000	3,175.000	34,925,000	
参天製薬	157,900	1,539.000	243,008,100	
扶桑薬品工業	4,000	2,212.000	8,848,000	
ツムラ	29,500	2,766.500	81,611,750	
キッセイ薬品工業	15,500	3,320.000	51,460,000	
生化学工業	15,900	760.000	12,084,000	
栄研化学	17,000	1,896.000	32,232,000	
鳥居薬品	5,000	4,030.000	20,150,000	
ＪＣＲファーマ	30,000	928.000	27,840,000	
東和薬品	14,500	3,065.000	44,442,500	

富士製薬工業	7,900	1,796.000	14,188,400	
ゼリア新薬工業	11,300	2,173.000	24,554,900	
そーせいグループ	29,300	1,382.000	40,492,600	
第一三共	730,700	4,873.000	3,560,701,100	
杏林製薬	17,400	1,772.000	30,832,800	
大幸薬品	18,100	336.000	6,081,600	
ダイト	8,000	1,987.000	15,896,000	
大塚ホールディングス	175,700	5,512.000	968,458,400	
ペプチドリーム	45,000	1,550.000	69,750,000	
セルソース	2,800	1,312.000	3,673,600	
あすか製薬ホールディングス	9,700	2,045.000	19,836,500	
サワイグループホールディングス	20,800	5,900.000	122,720,000	
日本コークス工業	83,300	118.000	9,829,400	
ニチレキ	9,600	2,439.000	23,414,400	
ユシロ化学工業	6,100	2,168.000	13,224,800	
富士石油	22,100	339.000	7,491,900	
出光興産	468,000	927.500	434,070,000	
ＥＮＥＯＳホールディングス	1,320,500	653.900	863,474,950	
コスモエネルギーホールディングス	25,400	6,552.000	166,420,800	
横浜ゴム	42,700	4,052.000	173,020,400	
ＴＯＹＯ　ＴＩＲＥ	48,700	2,872.000	139,866,400	
ブリヂストン	244,700	6,288.000	1,538,673,600	
住友ゴム工業	83,000	1,754.000	145,582,000	
オカモト	4,100	4,855.000	19,905,500	
フコク	5,000	1,550.000	7,750,000	
ニッタ	8,200	3,740.000	30,668,000	
住友理工	13,800	1,115.000	15,387,000	
三ツ星ベルト	11,300	4,920.000	55,596,000	
バンドー化学	12,700	1,717.000	21,805,900	
日東紡績	10,800	4,905.000	52,974,000	
ＡＧＣ	74,000	5,420.000	401,080,000	
日本山村硝子	2,600	1,480.000	3,848,000	
日本電気硝子	33,500	3,589.000	120,231,500	
オハラ	5,300	1,176.000	6,232,800	
住友大阪セメント	12,900	3,665.000	47,278,500	
太平洋セメント	52,600	3,254.000	171,160,400	
日本ヒューム	9,800	878.000	8,604,400	
日本コンクリート工業	21,500	456.000	9,804,000	
三谷セキサン	4,000	5,680.000	22,720,000	
アジアパイルホールディングス	17,400	791.000	13,763,400	
東海カーボン	76,300	1,030.500	78,627,150	
日本カーボン	4,900	5,440.000	26,656,000	
東洋炭素	6,100	6,820.000	41,602,000	
ノリタケカンパニーリミテド	4,800	7,990.000	38,352,000	

ＴＯＴＯ	54,500	3,747.000	204,211,500	
日本碍子	95,900	1,923.500	184,463,650	
日本特殊陶業	68,700	4,319.000	296,715,300	
ダントーホールディングス	5,000	949.000	4,745,000	
ＭＡＲＵＷＡ	3,200	31,500.000	100,800,000	
品川リフラクトリーズ	13,000	2,103.000	27,339,000	
黒崎播磨	2,000	13,760.000	27,520,000	
ヨータイ	6,200	1,445.000	8,959,000	
東京窯業	13,600	472.000	6,419,200	
フジミインコーポレーテッド	22,800	3,270.000	74,556,000	
ニチアス	22,000	3,745.000	82,390,000	
ニチハ	10,800	3,500.000	37,800,000	
日本製鉄	385,800	3,585.000	1,383,093,000	
神戸製鋼所	175,800	2,035.500	357,840,900	
中山製鋼所	18,000	933.000	16,794,000	
合同製鐵	4,500	6,020.000	27,090,000	
ＪＦＥホールディングス	240,500	2,332.500	560,966,250	
東京製鐵	24,100	1,720.000	41,452,000	
共英製鋼	9,600	2,292.000	22,003,200	
大和工業	15,800	8,533.000	134,821,400	
東京鐵鋼	4,300	5,370.000	23,091,000	
大阪製鐵	5,300	2,369.000	12,555,700	
淀川製鋼所	9,300	4,280.000	39,804,000	
中部鋼鈑	7,300	2,524.000	18,425,200	
丸一鋼管	25,700	3,994.000	102,645,800	
モリ工業	2,000	4,785.000	9,570,000	
大同特殊鋼	53,500	1,770.500	94,721,750	
日本冶金工業	6,200	4,550.000	28,210,000	
山陽特殊製鋼	8,200	2,230.000	18,286,000	
愛知製鋼	5,100	3,530.000	18,003,000	
日本金属	3,600	857.000	3,085,200	
大平洋金属	6,300	1,404.000	8,845,200	
新日本電工	50,900	304.000	15,473,600	
栗本鐵工所	4,600	3,300.000	15,180,000	
三菱製鋼	5,800	1,436.000	8,328,800	
日本精線	1,300	5,720.000	7,436,000	
新家工業	2,000	3,530.000	7,060,000	
大紀アルミニウム工業所	12,200	1,240.000	15,128,000	
日本軽金属ホールディングス	23,900	1,737.000	41,514,300	
三井金属鉱業	25,700	4,385.000	112,694,500	
三菱マテリアル	62,300	2,622.000	163,350,600	
住友金属鉱山	100,600	4,105.000	412,963,000	
ＤＯＷＡホールディングス	21,100	5,616.000	118,497,600	
古河機械金属	12,900	1,777.000	22,923,300	

大阪チタニウムテクノロジーズ	15,100	2,756.000	41,615,600	
東邦チタニウム	17,900	1,756.000	31,432,400	
ＵＡＣＪ	12,000	4,175.000	50,100,000	
ＣＫサンエツ	2,400	3,840.000	9,216,000	
古河電気工業	29,500	2,899.500	85,535,250	
住友電気工業	321,000	2,151.500	690,631,500	
フジクラ	103,300	1,759.500	181,756,350	
ＳＷＣＣ	9,700	3,340.000	32,398,000	
平河ヒューテック	5,500	1,358.000	7,469,000	
リョービ	9,300	2,660.000	24,738,000	
アーレスティ	8,500	786.000	6,681,000	
ＡＲＥホールディングス	34,600	1,958.000	67,746,800	
稲葉製作所	6,200	1,515.000	9,393,000	
宮地エンジニアリンググループ	4,800	3,965.000	19,032,000	
トーカロ	22,100	1,618.000	35,757,800	
アルファ	4,200	1,643.000	6,900,600	
ＳＵＭＣＯ	154,200	2,210.000	340,782,000	
川田テクノロジーズ	2,300	9,110.000	20,953,000	
ＲＳ　ＴＥＣＨＮＯＬＯＧＩＥＳ	5,900	2,591.000	15,286,900	
信和	9,900	745.000	7,375,500	
東洋製罐グループホールディングス	51,100	2,495.500	127,520,050	
ホッカンホールディングス	5,500	1,850.000	10,175,000	
横河ブリッジホールディングス	10,500	2,766.000	29,043,000	
三和ホールディングス	85,400	2,656.000	226,822,400	
文化シヤッター	24,000	1,606.000	38,544,000	
三協立山	10,700	886.000	9,480,200	
アルインコ	7,600	1,046.000	7,949,600	
ＬＩＸＩＬ	136,100	1,961.000	266,892,100	
ノーリツ	13,800	1,654.000	22,825,200	
長府製作所	8,400	2,103.000	17,665,200	
リンナイ	46,200	3,527.000	162,947,400	
日東精工	13,700	580.000	7,946,000	
岡部	16,500	826.000	13,629,000	
ジーテクト	9,300	2,007.000	18,665,100	
東プレ	14,900	2,295.000	34,195,500	
高周波熱錬	14,000	1,080.000	15,120,000	
東京製綱	5,700	1,555.000	8,863,500	
パイオラックス	11,600	2,685.000	31,146,000	
エイチワン	9,600	690.000	6,624,000	
日本発条	75,100	1,472.500	110,584,750	
立川ブラインド工業	4,600	1,466.000	6,743,600	
三益半導体工業	6,400	3,160.000	20,224,000	
日本製鋼所	22,900	2,497.000	57,181,300	
三浦工業	34,600	2,961.000	102,450,600	

タクマ	25,200	1,911.000	48,157,200	
ツガミ	18,000	1,149.000	20,682,000	
オークマ	8,100	7,060.000	57,186,000	
芝浦機械	8,300	3,400.000	28,220,000	
アマダ	132,300	1,605.000	212,341,500	
アイダエンジニアリング	16,400	846.000	13,874,400	
ＦＵＪＩ	38,100	2,616.500	99,688,650	
牧野フライス製作所	9,100	5,770.000	52,507,000	
オーエスジー	38,200	2,105.500	80,430,100	
旭ダイヤモンド工業	23,100	865.000	19,981,500	
ＤＭＧ森精機	51,000	3,377.000	172,227,000	
ソディック	22,400	723.000	16,195,200	
ディスコ	40,700	43,540.000	1,772,078,000	
日東工器	4,400	1,915.000	8,426,000	
日進工具	7,100	1,000.000	7,100,000	
豊和工業	5,500	765.000	4,207,500	
石川製作所	3,100	1,199.000	3,716,900	
リケンＮＰＲ	7,000	2,998.000	20,986,000	
島精機製作所	13,500	1,405.000	18,967,500	
オプトラン	13,700	1,790.000	24,523,000	
ＮＣホールディングス	2,000	1,512.000	3,024,000	
イワキ	6,300	2,343.000	14,760,900	
フリュー	9,200	1,234.000	11,352,800	
ヤマシンフィルタ	21,800	361.000	7,869,800	
日阪製作所	8,800	985.000	8,668,000	
やまびこ	13,300	1,830.000	24,339,000	
野村マイクロ・サイエンス	3,000	14,280.000	42,840,000	
平田機工	4,000	7,520.000	30,080,000	
ＰＥＧＡＳＵＳ	11,000	464.000	5,104,000	
マルマエ	4,300	1,930.000	8,299,000	
タツモ	5,200	3,845.000	19,994,000	
ナブテスコ	52,500	2,442.500	128,231,250	
三井海洋開発	10,600	3,035.000	32,171,000	
レオン自動機	9,100	1,398.000	12,721,800	
ＳＭＣ	25,200	82,860.000	2,088,072,000	
ホソカワミクロン	5,700	4,250.000	24,225,000	
ユニオンツール	3,600	3,785.000	13,626,000	
瑞光	6,500	1,827.000	11,875,500	
オイレス工業	11,100	2,054.000	22,799,400	
日精エー・エス・ビー機械	3,400	4,360.000	14,824,000	
サトーホールディングス	11,600	2,243.000	26,018,800	
技研製作所	8,100	2,098.000	16,993,800	
日本エアーテック	5,400	1,157.000	6,247,800	
日精樹脂工業	6,900	1,132.000	7,810,800	

ワイエイシイホールディングス	2,700	2,294.000	6,193,800	
小松製作所	394,400	4,319.000	1,703,413,600	
住友重機械工業	48,900	4,489.000	219,512,100	
日立建機	33,400	4,219.000	140,914,600	
日工	12,800	761.000	9,740,800	
巴工業	3,800	3,730.000	14,174,000	
井関農機	8,400	1,009.000	8,475,600	
ＴＯＷＡ	9,700	7,830.000	75,951,000	
ローツェ	4,500	19,860.000	89,370,000	
クボタ	440,400	2,182.500	961,173,000	
荏原実業	4,500	3,170.000	14,265,000	
三菱化工機	2,900	3,850.000	11,165,000	
月島ホールディングス	11,500	1,327.000	15,260,500	
帝国電機製作所	5,900	2,704.000	15,953,600	
新東工業	16,700	1,150.000	19,205,000	
澁谷工業	8,000	3,135.000	25,080,000	
アイチコーポレーション	11,800	1,113.000	13,133,400	
小森コーポレーション	19,300	1,305.000	25,186,500	
鶴見製作所	6,300	3,315.000	20,884,500	
酒井重工業	1,400	6,480.000	9,072,000	
荏原製作所	34,700	11,000.000	381,700,000	
酉島製作所	7,600	2,500.000	19,000,000	
北越工業	8,700	2,493.000	21,689,100	
ダイキン工業	100,600	21,420.000	2,154,852,000	
オルガノ	11,500	6,760.000	77,740,000	
トーヨーカネツ	3,400	4,500.000	15,300,000	
栗田工業	47,200	5,881.000	277,583,200	
椿本チエイン	11,500	4,695.000	53,992,500	
大同工業	6,300	753.000	4,743,900	
木村化工機	8,700	721.000	6,272,700	
アネスト岩田	14,100	1,331.000	18,767,100	
ダイフク	142,200	3,332.000	473,810,400	
サムコ	2,300	5,020.000	11,546,000	
加藤製作所	4,300	1,425.000	6,127,500	
タダノ	47,500	1,300.500	61,773,750	
フジテック	24,600	3,699.000	90,995,400	
ＣＫＤ	23,900	2,767.000	66,131,300	
平和	27,700	2,070.000	57,339,000	
理想科学工業	7,200	3,275.000	23,580,000	
ＳＡＮＫＹＯ	19,600	9,089.000	178,144,400	
日本金銭機械	9,900	1,424.000	14,097,600	
マースグループホールディングス	5,100	2,826.000	14,412,600	
フクシマガリレイ	6,100	5,780.000	35,258,000	
ダイコク電機	4,700	4,390.000	20,633,000	

竹内製作所	15,100	5,120.000	77,312,000	
アマノ	23,600	3,732.000	88,075,200	
ＪＵＫＩ	13,700	502.000	6,877,400	
ジャノメ	9,400	683.000	6,420,200	
マックス	10,500	3,100.000	32,550,000	
グローリー	20,100	2,905.000	58,390,500	
新晃工業	8,200	3,085.000	25,297,000	
大和冷機工業	12,400	1,470.000	18,228,000	
セガサミーホールディングス	75,500	1,795.500	135,560,250	
ＴＰＲ	9,300	2,121.000	19,725,300	
ツバキ・ナカシマ	19,100	765.000	14,611,500	
ホシザキ	49,700	5,436.000	270,169,200	
大豊工業	8,300	832.000	6,905,600	
日本精工	152,800	790.900	120,849,520	
ＮＴＮ	182,300	289.000	52,684,700	
ジェイテクト	73,400	1,350.000	99,090,000	
不二越	6,300	3,325.000	20,947,500	
日本トムソン	20,600	607.000	12,504,200	
ＴＨＫ	48,100	3,092.000	148,725,200	
ユーシン精機	7,700	674.000	5,189,800	
前澤給装工業	6,300	1,299.000	8,183,700	
イーグル工業	9,300	1,806.000	16,795,800	
前澤工業	5,600	1,063.000	5,952,800	
日本ピラー工業	7,800	5,530.000	43,134,000	
キッツ	30,000	1,288.000	38,640,000	
マキタ	97,900	3,857.000	377,600,300	
三井Ｅ＆Ｓ	35,800	1,241.000	44,427,800	
日立造船	71,500	1,039.000	74,288,500	
三菱重工業	147,600	11,270.000	1,663,452,000	
ＩＨＩ	63,700	3,138.000	199,890,600	
スター精密	15,100	1,646.000	24,854,600	
日清紡ホールディングス	64,000	1,257.500	80,480,000	
イビデン	43,700	7,157.000	312,760,900	
コニカミノルタ	180,000	473.600	85,248,000	
ブラザー工業	111,300	2,502.500	278,528,250	
ミネベアミツミ	145,400	3,039.000	441,870,600	
日立製作所	405,600	12,185.000	4,942,236,000	
三菱電機	939,100	2,276.000	2,137,391,600	
富士電機	50,900	9,064.000	461,357,600	
東洋電機製造	5,000	1,062.000	5,310,000	
安川電機	91,000	5,439.000	494,949,000	
シンフォニア　テクノロジー	10,000	2,510.000	25,100,000	
明電舎	14,700	2,730.000	40,131,000	
オリジン	3,500	1,223.000	4,280,500	

山洋電気	3,600	6,070.000	21,852,000	
デンヨー	6,900	2,342.000	16,159,800	
ＰＨＣホールディングス	13,400	1,327.000	17,781,800	
ＫＯＫＵＳＡＩ　ＥＬＥＣＴＲＩＣ	32,500	4,710.000	153,075,000	
ソシオネクスト	60,000	3,842.000	230,520,000	
東芝テック	11,300	3,040.000	34,352,000	
芝浦メカトロニクス	5,200	6,710.000	34,892,000	
マブチモーター	41,400	2,831.500	117,224,100	
ニデック	186,500	5,724.000	1,067,526,000	
トレックス・セミコンダクター	4,100	1,836.000	7,527,600	
東光高岳	5,300	2,393.000	12,682,900	
ダブル・スコープ	25,300	756.000	19,126,800	
ダイヘン	8,100	7,070.000	57,267,000	
ヤーマン	15,200	1,019.000	15,488,800	
ＪＶＣケンウッド	69,200	715.000	49,478,000	
ミマキエンジニアリング	9,000	1,003.000	9,027,000	
Ｉ－ＰＥＸ	6,200	1,785.000	11,067,000	
大崎電気工業	21,500	673.000	14,469,500	
オムロン	64,500	5,535.000	357,007,500	
日東工業	11,200	4,250.000	47,600,000	
ＩＤＥＣ	12,300	2,807.000	34,526,100	
ジーエス・ユアサ　コーポレーション	31,800	2,722.500	86,575,500	
サクサホールディングス	2,000	3,170.000	6,340,000	
メルコホールディングス	3,000	3,220.000	9,660,000	
日本電気	111,000	9,958.000	1,105,338,000	
富士通	77,700	23,455.000	1,822,453,500	
沖電気工業	37,500	1,112.000	41,700,000	
電気興業	3,700	2,114.000	7,821,800	
サンケン電気	7,700	7,872.000	60,614,400	
アイホン	4,900	2,810.000	13,769,000	
ルネサスエレクトロニクス	551,900	2,402.000	1,325,663,800	
セイコーエプソン	106,700	2,420.000	258,214,000	
ワコム	63,400	631.000	40,005,400	
アルバック	19,700	8,742.000	172,217,400	
アクセル	4,600	1,968.000	9,052,800	
ＥＩＺＯ	6,100	5,110.000	31,171,000	
日本信号	19,000	965.000	18,335,000	
京三製作所	19,500	458.000	8,931,000	
能美防災	11,200	2,280.000	25,536,000	
ホーチキ	6,700	2,239.000	15,001,300	
エレコム	19,900	1,613.000	32,098,700	
パナソニック　ホールディングス	997,400	1,419.500	1,415,809,300	
シャープ	138,500	820.000	113,570,000	
アンリツ	59,000	1,161.500	68,528,500	

富士通ゼネラル	23,800	1,986.500	47,278,700	
ソニーグループ	590,900	13,475.000	7,962,377,500	
ＴＤＫ	133,200	7,779.000	1,036,162,800	
帝国通信工業	4,100	1,876.000	7,691,600	
タムラ製作所	36,200	570.000	20,634,000	
アルプスアルパイン	74,600	1,032.000	76,987,200	
日本電波工業	10,800	1,374.000	14,839,200	
鈴木	5,500	1,155.000	6,352,500	
メイコー	9,100	4,410.000	40,131,000	
日本トリム	2,200	3,230.000	7,106,000	
ローランド　ディー．ジー．	4,600	5,020.000	23,092,000	
フォスター電機	8,700	1,126.000	9,796,200	
ＳＭＫ	2,500	2,443.000	6,107,500	
ヨコオ	7,300	1,556.000	11,358,800	
ホシデン	19,300	1,988.000	38,368,400	
ヒロセ電機	12,500	16,075.000	200,937,500	
日本航空電子工業	19,200	2,750.000	52,800,000	
ＴＯＡ	10,100	1,128.000	11,392,800	
マクセル	17,400	1,565.000	27,231,000	
古野電気	11,500	2,181.000	25,081,500	
スミダコーポレーション	11,300	1,194.000	13,492,200	
アイコム	3,600	3,455.000	12,438,000	
リオン	3,800	2,653.000	10,081,400	
横河電機	91,100	3,070.000	279,677,000	
新電元工業	3,400	3,090.000	10,506,000	
アズビル	57,600	4,578.000	263,692,800	
東亜ディーケーケー	6,000	987.000	5,922,000	
日本光電工業	35,000	4,182.000	146,370,000	
チノー	4,000	2,305.000	9,220,000	
日本電子材料	7,800	2,055.000	16,029,000	
堀場製作所	15,900	14,130.000	224,667,000	
アドバンテスト	240,300	6,796.000	1,633,078,800	
エスペック	7,100	2,662.000	18,900,200	
キーエンス	83,500	68,780.000	5,743,130,000	
日置電機	4,100	6,820.000	27,962,000	
シスメックス	72,000	8,170.000	588,240,000	
日本マイクロニクス	15,400	6,000.000	92,400,000	
メガチップス	6,800	4,265.000	29,002,000	
ＯＢＡＲＡ　ＧＲＯＵＰ	6,400	3,705.000	23,712,000	
コーセル	10,600	1,535.000	16,271,000	
イリソ電子工業	7,600	3,070.000	23,332,000	
オプテックスグループ	15,100	1,820.000	27,482,000	
千代田インテグレ	3,800	2,650.000	10,070,000	
レーザーテック	38,400	40,440.000	1,552,896,000	

スタンレー電気	52,000	2,553.500	132,782,000	
ウシオ電機	41,800	2,027.500	84,749,500	
ヘリオス　テクノ　ホールディング	7,800	554.000	4,321,200	
日本セラミック	8,000	2,545.000	20,360,000	
遠藤照明	4,500	1,560.000	7,020,000	
古河電池	6,500	974.000	6,331,000	
山一電機	7,300	2,213.000	16,154,900	
図研	7,200	4,265.000	30,708,000	
日本電子	20,600	6,519.000	134,291,400	
カシオ計算機	61,300	1,199.500	73,529,350	
ファナック	407,300	4,085.000	1,663,820,500	
日本シイエムケイ	19,800	607.000	12,018,600	
エンプラス	2,600	8,790.000	22,854,000	
大真空	11,200	887.000	9,934,400	
ローム	153,400	2,623.000	402,368,200	
浜松ホトニクス	66,000	5,270.000	347,820,000	
三井ハイテック	7,400	7,839.000	58,008,600	
新光電気工業	29,100	5,475.000	159,322,500	
京セラ	519,200	2,205.500	1,145,095,600	
太陽誘電	40,100	3,365.000	134,936,500	
村田製作所	759,700	2,981.000	2,264,665,700	
双葉電子工業	17,400	516.000	8,978,400	
北陸電気工業	3,200	1,400.000	4,480,000	
ニチコン	20,800	1,206.000	25,084,800	
ＫＯＡ	12,600	1,508.000	19,000,800	
市光工業	15,900	539.000	8,570,100	
小糸製作所	91,000	1,962.500	178,587,500	
ミツバ	16,200	1,348.000	21,837,600	
ＳＣＲＥＥＮホールディングス	28,500	18,350.000	522,975,000	
キヤノン電子	9,100	2,275.000	20,702,500	
キヤノン	416,800	4,196.000	1,748,892,800	
リコー	206,900	1,278.500	264,521,650	
象印マホービン	23,500	1,417.000	33,299,500	
東京エレクトロン	177,000	34,800.000	6,159,600,000	
イノテック	6,100	1,860.000	11,346,000	
トヨタ紡織	34,500	2,439.000	84,145,500	
ユニプレス	15,100	1,066.000	16,096,600	
豊田自動織機	71,200	14,715.000	1,047,708,000	
モリタホールディングス	14,600	1,628.000	23,768,800	
三櫻工業	14,000	1,007.000	14,098,000	
デンソー	687,100	2,683.500	1,843,832,850	
東海理化電機製作所	22,700	2,358.000	53,526,600	
川崎重工業	68,500	3,794.000	259,889,000	
名村造船所	19,900	1,863.000	37,073,700	

日本車輌製造	5,000	2,299.000	11,495,000	
三菱ロジスネクスト	15,200	1,463.000	22,237,600	
日産自動車	1,120,000	564.300	632,016,000	
いすゞ自動車	241,500	2,147.500	518,621,250	
トヨタ自動車	4,587,000	3,430.000	15,733,410,000	
日野自動車	124,800	472.700	58,992,960	
三菱自動車工業	326,400	454.600	148,381,440	
ＧＭＢ	2,500	1,181.000	2,952,500	
武蔵精密工業	19,800	1,639.000	32,452,200	
日産車体	16,000	977.000	15,632,000	
新明和工業	25,900	1,185.000	30,691,500	
極東開発工業	13,300	2,426.000	32,265,800	
トピー工業	7,100	2,910.000	20,661,000	
ティラド	3,000	3,855.000	11,565,000	
タチエス	13,200	2,020.000	26,664,000	
ＮＯＫ	32,200	2,089.500	67,281,900	
フタバ産業	24,000	998.000	23,952,000	
カヤバ	7,800	4,880.000	38,064,000	
大同メタル工業	19,500	550.000	10,725,000	
プレス工業	36,200	654.000	23,674,800	
ミクニ	10,000	465.000	4,650,000	
太平洋工業	18,400	1,457.000	26,808,800	
アイシン	64,100	5,266.000	337,550,600	
マツダ	277,000	1,741.500	482,395,500	
今仙電機製作所	6,300	687.000	4,328,100	
本田技研工業	2,033,500	1,744.000	3,546,424,000	
スズキ	152,700	6,712.000	1,024,922,400	
ＳＵＢＡＲＵ	260,900	3,358.000	876,102,200	
安永	4,400	748.000	3,291,200	
ヤマハ発動機	360,000	1,362.500	490,500,000	
エクセディ	13,000	2,852.000	37,076,000	
豊田合成	23,800	2,932.000	69,781,600	
愛三工業	14,000	1,434.000	20,076,000	
日本プラスト	11,000	519.000	5,709,000	
ヨロズ	10,000	918.000	9,180,000	
エフ・シー・シー	14,200	2,100.000	29,820,000	
シマノ	33,800	20,175.000	681,915,000	
テイ・エス　テック	34,000	1,949.500	66,283,000	
ジャムコ	4,000	1,352.000	5,408,000	
テルモ	233,000	5,633.000	1,312,489,000	
日機装	19,100	1,176.000	22,461,600	
日本エム・ディ・エム	5,400	720.000	3,888,000	
島津製作所	110,300	3,828.000	422,228,400	
長野計器	6,200	2,181.000	13,522,200	

ブイ・テクノロジー	4,400	2,650.000	11,660,000	
東京計器	6,900	2,326.000	16,049,400	
愛知時計電機	3,800	2,510.000	9,538,000	
インターアクション	4,500	1,152.000	5,184,000	
オーバル	8,400	510.000	4,284,000	
東京精密	17,800	9,696.000	172,588,800	
マニー	33,200	2,086.000	69,255,200	
ニコン	121,700	1,553.000	189,000,100	
トプコン	43,500	1,753.000	76,255,500	
オリンパス	514,200	2,195.000	1,128,669,000	
理研計器	5,500	7,900.000	43,450,000	
タムロン	5,400	6,410.000	34,614,000	
ＨＯＹＡ	164,300	18,445.000	3,030,513,500	
ノーリツ鋼機	7,900	3,050.000	24,095,000	
Ａ＆Ｄホロンホールディングス	11,900	2,134.000	25,394,600	
朝日インテック	101,000	2,880.000	290,880,000	
シチズン時計	78,100	1,066.000	83,254,600	
リズム	1,700	3,640.000	6,188,000	
メニコン	29,000	1,714.000	49,706,000	
松風	4,000	2,690.000	10,760,000	
セイコーグループ	12,800	3,135.000	40,128,000	
ニプロ	69,000	1,265.500	87,319,500	
スノーピーク	12,300	988.000	12,152,400	
パラマウントベッドホールディングス	18,900	2,490.000	47,061,000	
トランザクション	5,200	2,557.000	13,296,400	
ニホンフラッシュ	8,600	960.000	8,256,000	
前田工繊	7,000	3,355.000	23,485,000	
永大産業	17,800	281.000	5,001,800	
アートネイチャー	9,800	790.000	7,742,000	
バンダイナムコホールディングス	232,000	2,910.000	675,120,000	
ＳＨＯＥＩ	18,700	2,057.000	38,465,900	
フランスベッドホールディングス	10,500	1,312.000	13,776,000	
パイロットコーポレーション	12,400	3,845.000	47,678,000	
萩原工業	6,300	1,500.000	9,450,000	
フジシールインターナショナル	16,700	1,985.000	33,149,500	
タカラトミー	37,700	2,331.000	87,878,700	
広済堂ホールディングス	19,000	671.000	12,749,000	
プロネクサス	7,700	1,221.000	9,401,700	
ＴＯＰＰＡＮホールディングス	103,000	3,518.000	362,354,000	
大日本印刷	91,300	4,556.000	415,962,800	
共同印刷	2,800	3,180.000	8,904,000	
ＮＩＳＳＨＡ	15,100	1,530.000	23,103,000	
ＴＡＫＡＲＡ　＆　ＣＯＭＰＡＮＹ	5,700	2,818.000	16,062,600	
アシックス	71,500	5,758.000	411,697,000	

ツツミ	2,000	2,119.000	4,238,000	
ローランド	6,200	4,810.000	29,822,000	
小松ウオール工業	3,300	3,395.000	11,203,500	
ヤマハ	52,600	3,325.000	174,895,000	
河合楽器製作所	2,400	3,405.000	8,172,000	
クリナップ	10,500	761.000	7,990,500	
ピジョン	53,000	1,573.500	83,395,500	
キングジム	9,000	879.000	7,911,000	
リンテック	16,300	3,085.000	50,285,500	
イトーキ	17,100	2,070.000	35,397,000	
任天堂	528,000	8,356.000	4,411,968,000	
三菱鉛筆	11,800	2,474.000	29,193,200	
タカラスタンダード	15,200	1,868.000	28,393,600	
コクヨ	36,500	2,466.000	90,009,000	
グローブライド	6,800	2,020.000	13,736,000	
オカムラ	24,900	2,173.000	54,107,700	
美津濃	8,300	5,170.000	42,911,000	
東京電力ホールディングス	757,200	789.000	597,430,800	
中部電力	307,200	1,917.500	589,056,000	
関西電力	322,700	1,943.000	627,006,100	
中国電力	144,800	990.000	143,352,000	
北陸電力	85,000	730.000	62,050,000	
東北電力	218,500	1,004.000	219,374,000	
四国電力	75,300	1,042.500	78,500,250	
九州電力	190,200	1,140.000	216,828,000	
北海道電力	80,400	635.100	51,062,040	
沖縄電力	20,600	1,093.000	22,515,800	
電源開発	68,800	2,489.000	171,243,200	
エフオン	8,600	413.000	3,551,800	
イーレックス	15,100	761.000	11,491,100	
レノバ	22,200	1,241.000	27,550,200	
東京瓦斯	176,700	3,216.000	568,267,200	
大阪瓦斯	169,500	3,064.000	519,348,000	
東邦瓦斯	35,600	2,944.500	104,824,200	
北海道瓦斯	5,100	2,281.000	11,633,100	
広島ガス	19,100	385.000	7,353,500	
西部ガスホールディングス	7,800	1,887.000	14,718,600	
静岡ガス	18,000	964.000	17,352,000	
メタウォーター	9,800	2,219.000	21,746,200	
ＳＢＳホールディングス	7,200	2,325.000	16,740,000	
東武鉄道	90,400	3,881.000	350,842,400	
相鉄ホールディングス	27,300	2,732.500	74,597,250	
東急	231,200	1,773.500	410,033,200	
京浜急行電鉄	98,600	1,285.000	126,701,000	

小田急電鉄	136,900	2,129.000	291,460,100	
京王電鉄	43,600	4,227.000	184,297,200	
京成電鉄	53,800	7,580.000	407,804,000	
富士急行	10,200	3,960.000	40,392,000	
東日本旅客鉄道	152,900	9,051.000	1,383,897,900	
西日本旅客鉄道	102,300	6,283.000	642,750,900	
東海旅客鉄道	320,200	3,786.000	1,212,277,200	
西武ホールディングス	101,300	2,169.500	219,770,350	
鴻池運輸	14,000	1,822.000	25,508,000	
西日本鉄道	21,600	2,438.000	52,660,800	
ハマキョウレックス	6,300	3,900.000	24,570,000	
サカイ引越センター	7,800	2,576.000	20,092,800	
近鉄グループホールディングス	82,700	4,476.000	370,165,200	
阪急阪神ホールディングス	110,200	4,378.000	482,455,600	
南海電気鉄道	39,300	2,932.000	115,227,600	
京阪ホールディングス	45,400	3,504.000	159,081,600	
神戸電鉄	2,800	2,855.000	7,994,000	
名古屋鉄道	90,800	2,182.500	198,171,000	
山陽電気鉄道	6,700	2,128.000	14,257,600	
アルプス物流	6,700	1,911.000	12,803,700	
ヤマトホールディングス	106,900	2,419.500	258,644,550	
山九	21,000	5,381.000	113,001,000	
丸全昭和運輸	5,000	4,465.000	22,325,000	
センコーグループホールディングス	42,900	1,129.000	48,434,100	
トナミホールディングス	1,900	4,440.000	8,436,000	
ニッコンホールディングス	26,100	3,229.000	84,276,900	
福山通運	8,400	4,250.000	35,700,000	
セイノーホールディングス	47,300	2,316.000	109,546,800	
神奈川中央交通	2,600	3,015.000	7,839,000	
ＡＺ－ＣＯＭ丸和ホールディングス	20,500	1,423.000	29,171,500	
Ｃ＆Ｆロジホールディングス	8,300	1,777.000	14,749,100	
九州旅客鉄道	58,100	3,363.000	195,390,300	
ＳＧホールディングス	145,500	1,907.000	277,468,500	
ＮＩＰＰＯＮ　ＥＸＰＲＥＳＳホールディングス	28,400	8,068.000	229,131,200	
日本郵船	238,300	4,772.000	1,137,167,600	
商船三井	181,000	5,262.000	952,422,000	
川崎汽船	67,000	7,035.000	471,345,000	
ＮＳユナイテッド海運	4,600	5,210.000	23,966,000	
明海グループ	7,400	795.000	5,883,000	
飯野海運	30,600	1,334.000	40,820,400	
乾汽船	11,600	1,049.000	12,168,400	
日本航空	206,700	2,787.000	576,072,900	
ＡＮＡホールディングス	224,700	3,232.000	726,230,400	
トランコム	2,400	6,390.000	15,336,000	

日新	6,500	2,911.000	18,921,500	
三菱倉庫	20,000	4,581.000	91,620,000	
三井倉庫ホールディングス	7,500	4,665.000	34,987,500	
住友倉庫	21,500	2,610.000	56,115,000	
澁澤倉庫	3,300	3,065.000	10,114,500	
東陽倉庫	3,700	1,524.000	5,638,800	
日本トランスシティ	16,800	616.000	10,348,800	
川西倉庫	5,200	1,152.000	5,990,400	
安田倉庫	6,500	1,189.000	7,728,500	
上組	39,000	3,444.000	134,316,000	
キムラユニティー	4,300	1,554.000	6,682,200	
キユーソー流通システム	6,300	933.000	5,877,900	
エーアイテイー	5,400	1,844.000	9,957,600	
内外トランスライン	3,500	2,411.000	8,438,500	
日本コンセプト	3,300	1,914.000	6,316,200	
ＮＥＣネッツエスアイ	29,400	2,358.000	69,325,200	
クロスキャット	5,200	1,194.000	6,208,800	
システナ	138,200	280.000	38,696,000	
デジタルアーツ	5,200	4,555.000	23,686,000	
日鉄ソリューションズ	14,000	4,950.000	69,300,000	
キューブシステム	5,600	1,108.000	6,204,800	
コア	4,400	1,817.000	7,994,800	
手間いらず	1,800	2,774.000	4,993,200	
ラクーンホールディングス	8,100	694.000	5,621,400	
ソリトンシステムズ	4,800	1,384.000	6,643,200	
ソフトクリエイトホールディングス	7,100	1,909.000	13,553,900	
ＴＩＳ	91,000	3,396.000	309,036,000	
グリー	23,300	528.000	12,302,400	
コーエーテクモホールディングス	51,800	1,856.000	96,140,800	
三菱総合研究所	3,900	4,865.000	18,973,500	
ファインデックス	8,200	1,169.000	9,585,800	
ブレインパッド	6,600	1,435.000	9,471,000	
ＫＬａｂ	18,400	379.000	6,973,600	
ポールトゥウィンホールディングス	15,000	526.000	7,890,000	
ネクソン	187,500	2,550.000	478,125,000	
アイスタイル	26,400	435.000	11,484,000	
エムアップホールディングス	10,800	1,029.000	11,113,200	
エイチーム	6,700	584.000	3,912,800	
エニグモ	12,700	355.000	4,508,500	
コロプラ	31,500	598.000	18,837,000	
ブロードリーフ	42,900	576.000	24,710,400	
クロス・マーケティンググループ	5,000	603.000	3,015,000	
デジタルハーツホールディングス	5,700	1,091.000	6,218,700	
メディアドゥ	3,700	1,247.000	4,613,900	

じげん	24,900	507.000	12,624,300	
フィックスターズ	9,800	1,836.000	17,992,800	
ＣＡＲＴＡ　ＨＯＬＤＩＮＧＳ	4,400	1,461.000	6,428,400	
オプティム	7,200	1,093.000	7,869,600	
セレス	3,800	1,625.000	6,175,000	
ＳＨＩＦＴ	5,700	26,900.000	153,330,000	
ティーガイア	9,000	2,136.000	19,224,000	
テクマトリックス	15,200	2,050.000	31,160,000	
プロシップ	4,300	1,475.000	6,342,500	
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	22,000	2,320.500	51,051,000	
ＧＭＯペイメントゲートウェイ	16,800	8,467.000	142,245,600	
システムリサーチ	2,800	3,410.000	9,548,000	
インターネットイニシアティブ	41,600	2,851.000	118,601,600	
さくらインターネット	9,600	5,240.000	50,304,000	
ＧＭＯグローバルサイン・ホールディングス	2,700	2,750.000	7,425,000	
ＳＲＡホールディングス	4,400	3,940.000	17,336,000	
朝日ネット	9,600	632.000	6,067,200	
ｅＢＡＳＥ	12,200	735.000	8,967,000	
アバントグループ	10,700	1,331.000	14,241,700	
アドソル日進	3,800	1,684.000	6,399,200	
フリービット	5,100	1,658.000	8,455,800	
コムチュア	11,000	1,898.000	20,878,000	
アイル	4,000	3,535.000	14,140,000	
マークラインズ	4,700	3,200.000	15,040,000	
メディカル・データ・ビジョン	12,600	580.000	7,308,000	
ｇｕｍｉ	13,100	406.000	5,318,600	
テラスカイ	3,900	1,545.000	6,025,500	
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	5,200	1,900.000	9,880,000	
ＰＲ　ＴＩＭＥＳ	2,700	2,064.000	5,572,800	
ラクス	39,900	2,199.500	87,760,050	
ダブルスタンダード	3,700	1,901.000	7,033,700	
オープンドア	6,300	821.000	5,172,300	
アカツキ	4,400	2,494.000	10,973,600	
ＵＢＩＣＯＭホールディングス	3,100	1,428.000	4,426,800	
カナミックネットワーク	12,600	525.000	6,615,000	
チェンジホールディングス	19,600	1,554.000	30,458,400	
オークネット	4,500	1,981.000	8,914,500	
マクロミル	17,000	784.000	13,328,000	
オロ	3,700	2,805.000	10,378,500	
ユーザーローカル	3,200	2,382.000	7,622,400	
マネーフォワード	18,900	5,816.000	109,922,400	
ＳＵＮ　ＡＳＴＥＲＩＳＫ	6,200	997.000	6,181,400	
プラスアルファ・コンサルティング	4,900	2,462.000	12,063,800	
電算システムホールディングス	4,200	2,672.000	11,222,400	

ＡＰＰＩＥＲ　ＧＲＯＵＰ	28,400	1,844.000	52,369,600	
ビジョナル	6,000	9,440.000	56,640,000	
プロトコーポレーション	10,500	1,292.000	13,566,000	
野村総合研究所	185,400	4,088.000	757,915,200	
日本システム技術	2,800	3,240.000	9,072,000	
インテージホールディングス	9,500	1,776.000	16,872,000	
インフォコム	10,600	2,258.000	23,934,800	
シンプレクス・ホールディングス	13,500	2,550.000	34,425,000	
ＨＥＲＯＺ	3,500	1,935.000	6,772,500	
ラクスル	20,100	1,075.000	21,607,500	
メルカリ	51,400	2,192.000	112,668,800	
ＩＰＳ	3,000	2,280.000	6,840,000	
システムサポート	3,400	1,885.000	6,409,000	
イーソル	7,500	1,007.000	7,552,500	
ウイングアーク１ｓｔ	8,700	3,030.000	26,361,000	
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	2,600	1,178.000	3,062,800	
サーバーワークス	2,000	4,105.000	8,210,000	
Ｓａｎｓａｎ	27,300	1,512.000	41,277,600	
ギフティ	7,600	1,460.000	11,096,000	
メドレー	11,300	4,765.000	53,844,500	
ベース	3,100	3,560.000	11,036,000	
ＪＭＤＣ	14,400	3,734.000	53,769,600	
フォーカスシステムズ	6,800	1,065.000	7,242,000	
クレスコ	7,000	1,898.000	13,286,000	
フジ・メディア・ホールディングス	80,000	1,950.500	156,040,000	
オービック	27,900	22,185.000	618,961,500	
ジャストシステム	11,900	2,558.000	30,440,200	
ＴＤＣソフト	7,200	2,238.000	16,113,600	
ＬＩＮＥヤフー	1,191,800	423.200	504,369,760	
トレンドマイクロ	39,600	7,183.000	284,446,800	
ＩＤホールディングス	6,100	1,640.000	10,004,000	
日本オラクル	16,600	11,585.000	192,311,000	
アルファシステムズ	3,000	3,475.000	10,425,000	
フューチャー	18,500	1,674.000	30,969,000	
ＣＡＣ　ＨＯＬＤＩＮＧＳ	5,300	1,799.000	9,534,700	
ＳＢテクノロジー	3,700	2,128.000	7,873,600	
オービックビジネスコンサルタント	12,300	7,010.000	86,223,000	
アイティフォー	11,500	1,395.000	16,042,500	
東計電算	2,800	3,495.000	9,786,000	
大塚商会	41,300	6,303.000	260,313,900	
サイボウズ	11,600	2,046.000	23,733,600	
電通総研	10,000	5,450.000	54,500,000	
ＡＣＣＥＳＳ	10,400	940.000	9,776,000	
デジタルガレージ	14,700	3,325.000	48,877,500	

イーエムシステムズ	14,500	740.000	10,730,000	
ウェザーニューズ	2,500	5,110.000	12,775,000	
ＣＩＪ	14,700	712.000	10,466,400	
ビジネスエンジニアリング	1,500	3,930.000	5,895,000	
WOWOW	7,000	1,134.000	7,938,000	
スカラ	8,700	717.000	6,237,900	
ＡＮＹＣＯＬＯＲ	3,000	3,150.000	9,450,000	
ＩＭＡＧＩＣＡ　ＧＲＯＵＰ	8,000	732.000	5,856,000	
ネットワンシステムズ	34,200	2,580.000	88,236,000	
アルゴグラフィックス	7,500	4,225.000	31,687,500	
マーベラス	14,200	746.000	10,593,200	
エイベックス	14,200	1,293.000	18,360,600	
ＢＩＰＲＯＧＹ	27,000	4,599.000	124,173,000	
都築電気	4,500	2,365.000	10,642,500	
ＴＢＳホールディングス	42,300	4,300.000	181,890,000	
日本テレビホールディングス	73,300	2,221.000	162,799,300	
朝日放送グループホールディングス	9,600	691.000	6,633,600	
テレビ朝日ホールディングス	19,900	2,106.000	41,909,400	
スカパーＪＳＡＴホールディングス	73,700	914.000	67,361,800	
テレビ東京ホールディングス	6,000	3,030.000	18,180,000	
日本ＢＳ放送	6,500	898.000	5,837,000	
ビジョン	12,600	1,114.000	14,036,400	
ＵＳＥＮ－ＮＥＸＴ　ＨＯＬＤＩＮＧＳ	9,300	4,495.000	41,803,500	
日本通信	78,500	218.000	17,113,000	
日本電信電話	24,885,900	181.300	4,511,813,670	
ＫＤＤＩ	646,100	4,601.000	2,972,706,100	
ソフトバンク	1,342,700	1,958.000	2,629,006,600	
光通信	8,600	25,210.000	216,806,000	
エムティーアイ	8,200	763.000	6,256,600	
ＧＭＯインターネットグループ	30,600	2,657.500	81,319,500	
ファイバーゲート	5,000	1,032.000	5,160,000	
ＫＡＤＯＫＡＷＡ	44,800	3,024.000	135,475,200	
学研ホールディングス	14,400	992.000	14,284,800	
ゼンリン	14,500	858.000	12,441,000	
アイネット	5,700	2,277.000	12,978,900	
松竹	4,700	9,956.000	46,793,200	
東宝	46,000	4,795.000	220,570,000	
東映	2,400	19,850.000	47,640,000	
ＮＴＴデータグループ	222,500	2,364.000	525,990,000	
ピー・シー・エー	5,200	1,626.000	8,455,200	
ビジネスブレイン太田昭和	3,900	2,296.000	8,954,400	
ＤＴＳ	17,200	3,905.000	67,166,000	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	39,200	6,670.000	261,464,000	
シーイーシー	11,700	1,792.000	20,966,400	

カプコン	75,300	5,830.000	438,999,000	
アイ・エス・ビー	4,600	1,371.000	6,306,600	
ジャステック	5,500	1,358.000	7,469,000	
ＳＣＳＫ	58,000	2,697.500	156,455,000	
ＮＳＷ	3,300	2,962.000	9,774,600	
アイネス	6,300	1,492.000	9,399,600	
ＴＫＣ	12,700	3,685.000	46,799,500	
富士ソフト	17,200	6,210.000	106,812,000	
ＮＳＤ	29,000	2,723.000	78,967,000	
コナミグループ	32,100	9,795.000	314,419,500	
福井コンピュータホールディングス	6,500	2,623.000	17,049,500	
ＪＢＣＣホールディングス	6,200	3,890.000	24,118,000	
ミロク情報サービス	7,900	1,979.000	15,634,100	
ソフトバンクグループ	413,400	8,548.000	3,533,743,200	
高千穂交易	2,700	3,915.000	10,570,500	
伊藤忠食品	2,000	7,750.000	15,500,000	
エレマテック	8,000	1,789.000	14,312,000	
あらた	13,200	3,190.000	42,108,000	
トーメンデバイス	1,400	5,120.000	7,168,000	
東京エレクトロン　デバイス	9,600	6,740.000	64,704,000	
円谷フィールズホールディングス	15,700	1,621.000	25,449,700	
双日	98,600	3,812.000	375,863,200	
アルフレッサ　ホールディングス	87,600	2,323.500	203,538,600	
横浜冷凍	24,300	1,089.000	26,462,700	
ラサ商事	5,000	1,648.000	8,240,000	
アルコニックス	12,000	1,393.000	16,716,000	
神戸物産	68,900	3,759.000	258,995,100	
あい　ホールディングス	13,800	2,442.000	33,699,600	
ダイワボウホールディングス	38,700	2,708.000	104,799,600	
マクニカホールディングス	21,200	8,168.000	173,161,600	
ラクト・ジャパン	3,800	2,214.000	8,413,200	
グリムス	3,800	1,929.000	7,330,200	
バイタルケーエスケー・ホールディングス	13,400	1,295.000	17,353,000	
八洲電機	7,700	1,330.000	10,241,000	
メディアスホールディングス	7,000	742.000	5,194,000	
レスターホールディングス	8,000	2,990.000	23,920,000	
ジオリーブグループ	3,000	1,320.000	3,960,000	
大光	8,900	626.000	5,571,400	
ＴＯＫＡＩホールディングス	42,300	1,003.000	42,426,900	
三洋貿易	10,100	1,335.000	13,483,500	
ビューティガレージ	3,000	2,251.000	6,753,000	
ウイン・パートナーズ	6,800	1,282.000	8,717,600	
シップヘルスケアホールディングス	31,500	2,149.500	67,709,250	
コメダホールディングス	21,600	2,762.000	59,659,200	

フルサト・マルカホールディングス	8,300	2,267.000	18,816,100	
ヤマエグループホールディングス	5,000	2,583.000	12,915,000	
小野建	8,700	1,753.000	15,251,100	
南陽	2,500	2,429.000	6,072,500	
佐鳥電機	4,600	2,266.000	10,423,600	
エコートレーディング	2,500	1,270.000	3,175,000	
伯東	5,000	5,900.000	29,500,000	
コンドーテック	7,600	1,216.000	9,241,600	
ナガイレーベン	11,000	2,332.000	25,652,000	
三菱食品	9,300	5,080.000	47,244,000	
松田産業	6,800	2,423.000	16,476,400	
第一興商	33,800	1,921.000	64,929,800	
メディパルホールディングス	89,200	2,380.000	212,296,000	
ＳＰＫ	4,400	2,049.000	9,015,600	
萩原電気ホールディングス	4,500	4,700.000	21,150,000	
アズワン	13,000	5,239.000	68,107,000	
スズデン	3,800	2,210.000	8,398,000	
尾家産業	2,500	1,707.000	4,267,500	
シモジマ	6,700	1,275.000	8,542,500	
ドウシシャ	9,000	2,127.000	19,143,000	
高速	6,000	2,373.000	14,238,000	
たけびし	3,700	1,969.000	7,285,300	
リックス	2,000	3,695.000	7,390,000	
丸文	8,300	1,530.000	12,699,000	
ハピネット	7,900	3,200.000	25,280,000	
日本ライフライン	25,700	1,267.000	32,561,900	
タカショー	9,600	515.000	4,944,000	
ＩＤＯＭ	26,800	883.000	23,664,400	
進和	5,800	2,433.000	14,111,400	
ダイトロン	3,600	2,896.000	10,425,600	
シークス	12,300	1,550.000	19,065,000	
オーハシテクニカ	4,700	1,761.000	8,276,700	
白銅	3,400	2,479.000	8,428,600	
伊藤忠商事	593,300	6,620.000	3,927,646,000	
丸紅	735,800	2,458.500	1,808,964,300	
長瀬産業	39,500	2,466.000	97,407,000	
蝶理	6,000	2,996.000	17,976,000	
豊田通商	77,300	9,342.000	722,136,600	
三共生興	14,600	771.000	11,256,600	
兼松	33,700	2,375.000	80,037,500	
三井物産	665,500	6,512.000	4,333,736,000	
日本紙パルプ商事	4,600	4,975.000	22,885,000	
カメイ	9,500	1,884.000	17,898,000	
ＯＵＧホールディングス	600	2,620.000	1,572,000	

スターゼン	6,600	2,758.000	18,202,800	
山善	22,400	1,290.000	28,896,000	
椿本興業	2,500	6,810.000	17,025,000	
住友商事	532,900	3,605.000	1,921,104,500	
内田洋行	3,500	7,930.000	27,755,000	
三菱商事	1,749,900	3,196.000	5,592,680,400	
第一実業	9,300	1,967.000	18,293,100	
キヤノンマーケティングジャパン	20,200	4,251.000	85,870,200	
西華産業	4,000	2,992.000	11,968,000	
佐藤商事	6,300	1,771.000	11,157,300	
菱洋エレクトロ	7,500	3,900.000	29,250,000	
東京産業	8,900	740.000	6,586,000	
ユアサ商事	7,500	5,050.000	37,875,000	
神鋼商事	2,300	7,290.000	16,767,000	
阪和興業	15,500	5,790.000	89,745,000	
正栄食品工業	5,800	4,675.000	27,115,000	
カナデン	6,700	1,570.000	10,519,000	
ＲＹＯＤＥＮ	7,100	2,625.000	18,637,500	
岩谷産業	19,900	7,383.000	146,921,700	
ナイス	2,600	1,601.000	4,162,600	
極東貿易	5,900	2,130.000	12,567,000	
アステナホールディングス	18,300	475.000	8,692,500	
三愛オブリ	22,900	1,925.000	44,082,500	
稲畑産業	16,900	3,185.000	53,826,500	
ＧＳＩクレオス	5,400	2,417.000	13,051,800	
明和産業	12,500	707.000	8,837,500	
ワキタ	16,100	1,594.000	25,663,400	
東邦ホールディングス	23,300	3,268.000	76,144,400	
サンゲツ	22,000	3,610.000	79,420,000	
ミツウロコグループホールディングス	12,800	1,535.000	19,648,000	
シナネンホールディングス	3,000	4,175.000	12,525,000	
伊藤忠エネクス	21,100	1,532.000	32,325,200	
サンリオ	25,200	7,433.000	187,311,600	
サンワ　テクノス	4,600	2,265.000	10,419,000	
リョーサン	8,800	5,080.000	44,704,000	
新光商事	12,300	1,224.000	15,055,200	
トーホー	4,000	2,905.000	11,620,000	
三信電気	3,900	2,293.000	8,942,700	
東陽テクニカ	9,200	1,493.000	13,735,600	
モスフードサービス	12,600	3,480.000	43,848,000	
加賀電子	7,000	6,400.000	44,800,000	
ソーダニッカ	8,000	1,185.000	9,480,000	
立花エレテック	6,400	3,085.000	19,744,000	
ＰＡＬＴＡＣ	13,800	4,333.000	59,795,400	

三谷産業	18,600	392.000	7,291,200	
太平洋興発	6,400	836.000	5,350,400	
西本Ｗｉｓｍｅｔｔａｃホールディングス	2,300	6,970.000	16,031,000	
ＫＰＰグループホールディングス	25,000	632.000	15,800,000	
ヤマタネ	4,500	2,549.000	11,470,500	
泉州電業	4,800	3,700.000	17,760,000	
トラスコ中山	18,200	2,380.000	43,316,000	
オートバックスセブン	30,100	1,649.500	49,649,950	
モリト	7,300	1,419.000	10,358,700	
加藤産業	10,600	4,810.000	50,986,000	
イエローハット	15,000	1,909.000	28,635,000	
ＪＫホールディングス	7,200	1,020.000	7,344,000	
日伝	6,500	2,888.000	18,772,000	
杉本商事	5,000	2,244.000	11,220,000	
因幡電機産業	21,900	3,510.000	76,869,000	
東テク	3,000	6,820.000	20,460,000	
ミスミグループ本社	132,700	2,094.500	277,940,150	
タキヒヨー	2,900	1,206.000	3,497,400	
スズケン	33,200	4,929.000	163,642,800	
ジェコス	6,100	1,161.000	7,082,100	
ローソン	19,100	10,250.000	195,775,000	
サンエー	6,600	4,550.000	30,030,000	
カワチ薬品	7,000	2,728.000	19,096,000	
エービーシー・マート	38,600	2,560.500	98,835,300	
ハードオフコーポレーション	3,800	1,779.000	6,760,200	
アスクル	18,200	2,050.000	37,310,000	
ゲオホールディングス	9,500	2,116.000	20,102,000	
アダストリア	10,600	3,530.000	37,418,000	
くら寿司	10,300	4,100.000	42,230,000	
キャンドゥ	4,200	2,718.000	11,415,600	
パルグループホールディングス	17,200	2,252.000	38,734,400	
エディオン	34,700	1,523.000	52,848,100	
サーラコーポレーション	18,900	808.000	15,271,200	
ハローズ	4,000	4,315.000	17,260,000	
フジオフードグループ本社	10,600	1,365.000	14,469,000	
あみやき亭	2,400	4,440.000	10,656,000	
大黒天物産	2,700	8,810.000	23,787,000	
ハニーズホールディングス	7,200	1,622.000	11,678,400	
アルペン	7,300	2,005.000	14,636,500	
クオールホールディングス	12,200	1,643.000	20,044,600	
ジンズホールディングス	5,300	3,815.000	20,219,500	
ビックカメラ	46,200	1,331.000	61,492,200	
ＤＣＭホールディングス	50,000	1,396.000	69,800,000	
ＭｏｎｏｔａＲＯ	125,400	1,564.000	196,125,600	

Ｊ．フロント　リテイリング	104,200	1,577.000	164,323,400	
ドトール・日レスホールディングス	15,400	2,095.000	32,263,000	
マツキヨココカラ＆カンパニー	161,200	2,613.500	421,296,200	
ブロンコビリー	5,200	3,270.000	17,004,000	
ＺＯＺＯ	57,700	3,434.000	198,141,800	
トレジャー・ファクトリー	4,200	1,512.000	6,350,400	
物語コーポレーション	14,600	4,695.000	68,547,000	
三越伊勢丹ホールディングス	149,600	2,129.500	318,573,200	
ウエルシアホールディングス	46,200	2,632.500	121,621,500	
クリエイトＳＤホールディングス	14,100	3,175.000	44,767,500	
チムニー	3,500	1,437.000	5,029,500	
シュッピン	7,200	1,057.000	7,610,400	
オイシックス・ラ・大地	11,800	1,433.000	16,909,400	
ネクステージ	20,700	2,157.000	44,649,900	
ジョイフル本田	25,000	2,013.000	50,325,000	
鳥貴族ホールディングス	3,700	4,120.000	15,244,000	
ホットランド	7,100	1,862.000	13,220,200	
すかいらーくホールディングス	120,500	2,224.000	267,992,000	
ＳＦＰホールディングス	4,600	2,090.000	9,614,000	
綿半ホールディングス	7,100	1,480.000	10,508,000	
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	1,000.000	32,800,000	
ＢＥＥＮＯＳ	3,800	1,397.000	5,308,600	
あさひ	7,600	1,277.000	9,705,200	
日本調剤	6,400	1,431.000	9,158,400	
コスモス薬品	7,500	15,150.000	113,625,000	
セブン＆アイ・ホールディングス	304,400	6,263.000	1,906,457,200	
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	59,700	1,095.000	65,371,500	
ツルハホールディングス	18,600	10,980.000	204,228,000	
サンマルクホールディングス	7,300	2,217.000	16,184,100	
フェリシモ	4,000	925.000	3,700,000	
トリドールホールディングス	25,000	4,220.000	105,500,000	
ＴＯＫＹＯ　ＢＡＳＥ	10,400	296.000	3,078,400	
ＪＭホールディングス	6,900	2,433.000	16,787,700	
アレンザホールディングス	7,300	1,163.000	8,489,900	
串カツ田中ホールディングス	3,800	1,797.000	6,828,600	
クスリのアオキホールディングス	23,600	3,088.000	72,876,800	
力の源ホールディングス	3,800	1,637.000	6,220,600	
ＦＯＯＤ　＆　ＬＩＦＥ　ＣＯＭＰＡＮＩＥＳ	47,800	3,068.000	146,650,400	
メディカルシステムネットワーク	11,700	611.000	7,148,700	
ノジマ	28,300	1,741.000	49,270,300	
カッパ・クリエイト	13,700	1,670.000	22,879,000	
良品計画	97,300	2,373.000	230,892,900	
アドヴァングループ	10,500	1,165.000	12,232,500	

アルビス	3,100	2,639.000	8,180,900	
Ｇ－７ホールディングス	9,600	1,446.000	13,881,600	
イオン北海道	31,800	930.000	29,574,000	
コジマ	15,600	755.000	11,778,000	
コーナン商事	11,800	3,930.000	46,374,000	
エコス	3,700	2,370.000	8,769,000	
ワタミ	10,300	1,033.000	10,639,900	
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	178,700	3,516.000	628,309,200	
西松屋チェーン	17,500	2,137.000	37,397,500	
ゼンショーホールディングス	45,300	6,741.000	305,367,300	
サイゼリヤ	13,100	5,000.000	65,500,000	
ＶＴホールディングス	34,500	520.000	17,940,000	
フジ・コーポレーション	3,800	1,739.000	6,608,200	
ユナイテッドアローズ	9,400	1,790.000	16,826,000	
ハイデイ日高	13,100	2,752.000	36,051,200	
コロワイド	39,700	2,267.000	89,999,900	
壱番屋	6,800	6,110.000	41,548,000	
スギホールディングス	17,600	7,095.000	124,872,000	
薬王堂ホールディングス	4,600	2,811.000	12,930,600	
スクロール	13,200	946.000	12,487,200	
ヨンドシーホールディングス	7,700	1,956.000	15,061,200	
木曽路	12,800	2,627.000	33,625,600	
ＳＲＳホールディングス	15,700	1,182.000	18,557,400	
リテールパートナーズ	12,900	1,755.000	22,639,500	
上新電機	7,600	2,370.000	18,012,000	
日本瓦斯	46,500	2,376.000	110,484,000	
ロイヤルホールディングス	16,500	2,454.000	40,491,000	
いなげや	8,600	1,226.000	10,543,600	
チヨダ	9,500	884.000	8,398,000	
ライフコーポレーション	7,800	3,735.000	29,133,000	
リンガーハット	11,100	2,377.000	26,384,700	
ＭｒＭａｘＨＤ	13,200	629.000	8,302,800	
ＡＯＫＩホールディングス	16,900	1,156.000	19,536,400	
オークワ	14,700	860.000	12,642,000	
コメリ	13,400	3,305.000	44,287,000	
青山商事	18,900	1,671.000	31,581,900	
しまむら	20,800	8,498.000	176,758,400	
高島屋	64,100	2,293.500	147,013,350	
松屋	15,300	988.000	15,116,400	
エイチ・ツー・オー　リテイリング	41,600	1,810.000	75,296,000	
近鉄百貨店	4,800	2,522.000	12,105,600	
丸井グループ	60,400	2,478.000	149,671,200	
アクシアル　リテイリング	5,900	4,010.000	23,659,000	

イオン	298,000	3,602.000	1,073,396,000	
イズミ	14,300	3,605.000	51,551,500	
平和堂	14,800	2,195.000	32,486,000	
フジ	13,200	1,969.000	25,990,800	
ヤオコー	9,800	8,145.000	79,821,000	
ゼビオホールディングス	12,200	972.000	11,858,400	
ケーズホールディングス	61,500	1,238.500	76,167,750	
ＯＬＹＭＰＩＣグループ	3,200	555.000	1,776,000	
Ｇｅｎｋｙ　ＤｒｕｇＳｔｏｒｅｓ	3,700	6,380.000	23,606,000	
ブックオフグループホールディングス	5,300	1,229.000	6,513,700	
ギフトホールディングス	3,900	2,949.000	11,501,100	
アインホールディングス	12,300	4,655.000	57,256,500	
元気寿司	6,000	3,455.000	20,730,000	
ヤマダホールディングス	289,700	437.700	126,801,690	
アークランズ	27,100	1,676.000	45,419,600	
ニトリホールディングス	32,200	22,155.000	713,391,000	
グルメ杵屋	8,300	1,106.000	9,179,800	
ケーユーホールディングス	5,900	1,171.000	6,908,900	
吉野家ホールディングス	34,000	3,296.000	112,064,000	
松屋フーズホールディングス	4,100	5,630.000	23,083,000	
サガミホールディングス	13,800	1,504.000	20,755,200	
関西フードマーケット	7,700	1,582.000	12,181,400	
王将フードサービス	5,800	7,750.000	44,950,000	
ミニストップ	6,700	1,630.000	10,921,000	
アークス	16,100	3,065.000	49,346,500	
バローホールディングス	16,900	2,461.000	41,590,900	
ベルク	4,300	6,590.000	28,337,000	
大　庄	5,000	1,324.000	6,620,000	
ファーストリテイリング	39,800	42,060.000	1,673,988,000	
サンドラッグ	30,500	4,505.000	137,402,500	
サックスバー　ホールディングス	7,700	859.000	6,614,300	
やまや	2,000	3,390.000	6,780,000	
ベルーナ	21,200	618.000	13,101,600	
いよぎんホールディングス	97,100	1,090.000	105,839,000	
しずおかフィナンシャルグループ	180,800	1,450.000	262,160,000	
ちゅうぎんフィナンシャルグループ	68,300	1,122.500	76,666,750	
楽天銀行	28,800	2,698.000	77,702,400	
京都フィナンシャルグループ	102,800	2,532.000	260,289,600	
じもとホールディングス	11,000	571.000	6,281,000	
めぶきフィナンシャルグループ	403,700	438.900	177,183,930	
東京きらぼしフィナンシャルグループ	10,500	4,190.000	43,995,000	
九州フィナンシャルグループ	149,900	972.500	145,777,750	
ゆうちょ銀行	900,800	1,545.500	1,392,186,400	
富山第一銀行	25,000	885.000	22,125,000	

コンコルディア・フィナンシャルグループ	436,200	732.000	319,298,400	
西日本フィナンシャルホールディングス	50,600	1,623.000	82,123,800	
三十三フィナンシャルグループ	7,500	1,950.000	14,625,000	
第四北越フィナンシャルグループ	12,600	4,305.000	54,243,000	
ひろぎんホールディングス	117,000	1,040.500	121,738,500	
おきなわフィナンシャルグループ	6,900	2,457.000	16,953,300	
十六フィナンシャルグループ	10,500	4,295.000	45,097,500	
北國フィナンシャルホールディングス	8,500	4,770.000	40,545,000	
プロクレアホールディングス	10,100	1,845.000	18,634,500	
あいちフィナンシャルグループ	11,400	2,640.000	30,096,000	
あおぞら銀行	56,700	2,136.000	121,111,200	
三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	5,031,400	1,497.500	7,534,521,500	
りそなホールディングス	970,600	836.500	811,906,900	
三井住友トラスト・ホールディングス	293,200	2,988.000	876,081,600	
三井住友フィナンシャルグループ	584,500	8,185.000	4,784,132,500	
千葉銀行	226,400	1,161.500	262,963,600	
群馬銀行	157,700	779.500	122,927,150	
武蔵野銀行	10,200	2,800.000	28,560,000	
千葉興業銀行	13,000	826.000	10,738,000	
筑波銀行	32,000	247.000	7,904,000	
七十七銀行	26,000	3,760.000	97,760,000	
秋田銀行	4,800	2,040.000	9,792,000	
山形銀行	9,000	1,105.000	9,945,000	
岩手銀行	5,800	2,537.000	14,714,600	
東邦銀行	60,000	312.000	18,720,000	
東北銀行	4,600	1,208.000	5,556,800	
ふくおかフィナンシャルグループ	69,700	3,735.000	260,329,500	
スルガ銀行	72,600	799.000	58,007,400	
八十二銀行	170,800	870.000	148,596,000	
山梨中央銀行	7,900	1,739.000	13,738,100	
大垣共立銀行	15,400	2,083.000	32,078,200	
福井銀行	7,500	1,790.000	13,425,000	
清水銀行	3,600	1,575.000	5,670,000	
富山銀行	900	1,787.000	1,608,300	
滋賀銀行	13,600	3,990.000	54,264,000	
南都銀行	12,300	2,726.000	33,529,800	
百五銀行	76,000	620.000	47,120,000	
紀陽銀行	28,900	1,885.000	54,476,500	
ほくほくフィナンシャルグループ	51,400	1,708.000	87,791,200	
山陰合同銀行	50,500	1,026.000	51,813,000	
鳥取銀行	3,800	1,421.000	5,399,800	
百十四銀行	7,600	2,734.000	20,778,400	
四国銀行	13,300	1,070.000	14,231,000	
阿波銀行	11,500	2,462.000	28,313,000	

大分銀行	5,100	2,660.000	13,566,000	
宮崎銀行	5,200	2,753.000	14,315,600	
佐賀銀行	5,100	1,903.000	9,705,300	
琉球銀行	19,200	1,144.000	21,964,800	
セブン銀行	292,900	299.000	87,577,100	
みずほフィナンシャルグループ	1,108,400	2,766.500	3,066,388,600	
高知銀行	4,500	994.000	4,473,000	
山口フィナンシャルグループ	79,000	1,527.500	120,672,500	
名古屋銀行	5,300	5,990.000	31,747,000	
北洋銀行	123,000	348.000	42,804,000	
大光銀行	5,500	1,424.000	7,832,000	
愛媛銀行	11,600	1,120.000	12,992,000	
トマト銀行	5,100	1,214.000	6,191,400	
京葉銀行	37,400	719.000	26,890,600	
栃木銀行	39,200	307.000	12,034,400	
北日本銀行	2,600	2,143.000	5,571,800	
東和銀行	15,200	661.000	10,047,200	
大東銀行	8,500	750.000	6,375,000	
トモニホールディングス	72,200	403.000	29,096,600	
フィデアホールディングス	8,500	1,600.000	13,600,000	
池田泉州ホールディングス	100,000	358.000	35,800,000	
ＦＰＧ	27,600	1,864.000	51,446,400	
ジャパンインベストメントアドバイザー	6,800	901.000	6,126,800	
マーキュリアホールディングス	5,700	780.000	4,446,000	
ＳＢＩホールディングス	119,000	4,055.000	482,545,000	
ジャフコ　グループ	27,500	1,747.000	48,042,500	
大和証券グループ本社	627,800	1,093.500	686,499,300	
野村ホールディングス	1,395,500	841.800	1,174,731,900	
岡三証券グループ	72,600	753.000	54,667,800	
丸三証券	28,000	983.000	27,524,000	
東洋証券	29,400	372.000	10,936,800	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	87,000	584.000	50,808,000	
水戸証券	23,800	478.000	11,376,400	
いちよし証券	14,800	808.000	11,958,400	
松井証券	47,900	854.000	40,906,600	
マネックスグループ	83,500	884.000	73,814,000	
極東証券	10,900	1,031.000	11,237,900	
岩井コスモホールディングス	9,400	2,210.000	20,774,000	
アイザワ証券グループ	12,200	1,242.000	15,152,400	
スパークス・グループ	9,200	1,848.000	17,001,600	
かんぽ生命保険	90,200	2,694.500	243,043,900	
ＦＰパートナー	1,400	6,600.000	9,240,000	
ＳＯＭＰＯホールディングス	126,800	9,016.000	1,143,228,800	
アニコム　ホールディングス	28,500	590.000	16,815,000	

ＭＳ＆ＡＤインシュアランスグループホールディングス	179,400	7,558.000	1,355,905,200	
第一生命ホールディングス	399,200	3,445.000	1,375,244,000	
東京海上ホールディングス	809,000	4,517.000	3,654,253,000	
Ｔ＆Ｄホールディングス	226,500	2,570.500	582,218,250	
アドバンスクリエイト	6,300	1,040.000	6,552,000	
全国保証	21,400	5,545.000	118,663,000	
ジェイリース	2,400	2,565.000	6,156,000	
イントラスト	3,900	825.000	3,217,500	
日本モーゲージサービス	10,100	535.000	5,403,500	
ＣＡＳＡ	4,000	819.000	3,276,000	
ＳＢＩアルヒ	11,000	917.000	10,087,000	
プレミアグループ	13,900	1,749.000	24,311,100	
ネットプロテクションズホールディングス	28,400	189.000	5,367,600	
クレディセゾン	51,400	2,791.000	143,457,400	
芙蓉総合リース	7,400	13,700.000	101,380,000	
みずほリース	11,900	5,390.000	64,141,000	
東京センチュリー	60,400	1,612.500	97,395,000	
日本証券金融	30,100	1,656.000	49,845,600	
アイフル	135,400	433.000	58,628,200	
リコーリース	7,600	5,100.000	38,760,000	
イオンフィナンシャルサービス	46,500	1,349.000	62,728,500	
アコム	162,500	404.300	65,698,750	
ジャックス	8,600	5,580.000	47,988,000	
オリエントコーポレーション	21,300	1,078.000	22,961,400	
オリックス	501,500	3,105.000	1,557,157,500	
三菱ＨＣキャピタル	357,300	1,043.000	372,663,900	
九州リースサービス	6,100	1,271.000	7,753,100	
日本取引所グループ	214,800	3,870.000	831,276,000	
イー・ギャランティ	13,700	1,929.000	26,427,300	
アサックス	5,400	749.000	4,044,600	
ＮＥＣキャピタルソリューション	3,900	3,715.000	14,488,500	
Ｒｏｂｏｔ　Ｈｏｍｅ	25,800	166.000	4,282,800	
大東建託	29,800	17,040.000	507,792,000	
いちご	100,700	409.000	41,186,300	
日本駐車場開発	94,300	182.000	17,162,600	
スター・マイカ・ホールディングス	11,000	543.000	5,973,000	
ＳＲＥホールディングス	4,200	3,300.000	13,860,000	
ヒューリック	188,500	1,512.500	285,106,250	
野村不動産ホールディングス	50,500	3,699.000	186,799,500	
三重交通グループホールディングス	19,100	603.000	11,517,300	
サムティ	10,100	2,510.000	25,351,000	
ディア・ライフ	15,000	919.000	13,785,000	
地主	7,100	2,156.000	15,307,600	

プレサンスコーポレーション	14,300	1,704.000	24,367,200	
ＪＰＭＣ	5,600	1,213.000	6,792,800	
フージャースホールディングス	13,400	1,064.000	14,257,600	
オープンハウスグループ	29,900	4,886.000	146,091,400	
東急不動産ホールディングス	243,300	982.200	238,969,260	
飯田グループホールディングス	77,000	1,941.500	149,495,500	
ムゲンエステート	4,300	1,423.000	6,118,900	
シーアールイー	5,300	1,324.000	7,017,200	
ケイアイスター不動産	4,200	3,735.000	15,687,000	
グッドコムアセット	8,900	757.000	6,737,300	
ジェイ・エス・ビー	4,400	2,755.000	12,122,000	
ロードスターキャピタル	5,900	2,272.000	13,404,800	
霞ヶ関キャピタル	2,300	13,800.000	31,740,000	
パーク２４	53,500	1,775.000	94,962,500	
パラカ	3,900	1,955.000	7,624,500	
宮越ホールディングス	4,600	1,115.000	5,129,000	
三井不動産	377,600	4,074.000	1,538,342,400	
三菱地所	533,000	2,113.500	1,126,495,500	
平和不動産	13,900	3,990.000	55,461,000	
東京建物	72,700	2,166.000	157,468,200	
京阪神ビルディング	15,700	1,584.000	24,868,800	
住友不動産	122,900	4,686.000	575,909,400	
テーオーシー	17,700	682.000	12,071,400	
レオパレス２１	92,500	428.000	39,590,000	
スターツコーポレーション	12,600	3,030.000	38,178,000	
フジ住宅	12,700	719.000	9,131,300	
空港施設	12,000	606.000	7,272,000	
ゴールドクレスト	8,200	2,288.000	18,761,600	
エスリード	4,200	3,345.000	14,049,000	
日神グループホールディングス	15,200	507.000	7,706,400	
日本エスコン	19,600	988.000	19,364,800	
ＭＩＲＡＲＴＨホールディングス	47,200	492.000	23,222,400	
イオンモール	41,900	1,826.000	76,509,400	
毎日コムネット	6,300	758.000	4,775,400	
カチタス	22,400	1,932.000	43,276,800	
トーセイ	14,600	2,060.000	30,076,000	
穴吹興産	2,900	2,104.000	6,101,600	
サンフロンティア不動産	15,500	1,711.000	26,520,500	
ＦＪネクストホールディングス	9,600	1,183.000	11,356,800	
日本空港ビルデング	28,800	5,845.000	168,336,000	
ＬＩＦＵＬＬ	32,400	167.000	5,410,800	
ＭＩＸＩ	19,100	2,426.000	46,336,600	
ジェイエイシーリクルートメント	30,000	744.000	22,320,000	
日本M&Aセンターホールディングス	144,000	1,007.500	145,080,000	

メンバーズ	3,100	945.000	2,929,500	
ＵＴグループ	12,300	3,225.000	39,667,500	
アイティメディア	3,500	1,987.000	6,954,500	
ケアネット	14,500	668.000	9,686,000	
Ｅ・Ｊホールディングス	5,400	1,680.000	9,072,000	
オープンアップグループ	25,700	2,141.000	55,023,700	
コシダカホールディングス	26,500	927.000	24,565,500	
アルトナー	2,000	2,394.000	4,788,000	
パソナグループ	10,900	2,664.000	29,037,600	
リンクアンドモチベーション	26,100	617.000	16,103,700	
エス・エム・エス	30,700	2,632.500	80,817,750	
パーソルホールディングス	884,400	219.200	193,860,480	
リニカル	7,600	449.000	3,412,400	
学情	4,500	1,849.000	8,320,500	
スタジオアリス	4,800	2,065.000	9,912,000	
ＮＪＳ	2,000	2,743.000	5,486,000	
綜合警備保障	150,000	804.700	120,705,000	
カカクコム	57,600	1,725.000	99,360,000	
アイロムグループ	3,500	1,823.000	6,380,500	
セントケア・ホールディング	7,500	938.000	7,035,000	
サイネックス	2,000	828.000	1,656,000	
ルネサンス	6,600	1,087.000	7,174,200	
ディップ	13,500	2,704.000	36,504,000	
デジタルホールディングス	5,500	1,173.000	6,451,500	
新日本科学	8,100	1,600.000	12,960,000	
キャリアデザインセンター	1,400	1,781.000	2,493,400	
ベネフィット・ワン	31,000	2,167.500	67,192,500	
エムスリー	170,800	2,096.000	357,996,800	
ウェルネット	12,900	539.000	6,953,100	
ワールドホールディングス	3,900	2,455.000	9,574,500	
ディー・エヌ・エー	33,800	1,266.000	42,790,800	
博報堂ＤＹホールディングス	115,000	1,447.500	166,462,500	
タカミヤ	14,000	522.000	7,308,000	
ファンコミュニケーションズ	15,000	403.000	6,045,000	
ライク	3,800	1,568.000	5,958,400	
エスプール	25,600	310.000	7,936,000	
ＷＤＢホールディングス	4,500	2,317.000	10,426,500	
アドウェイズ	12,200	465.000	5,673,000	
バリューコマース	7,900	1,169.000	9,235,100	
インフォマート	90,300	393.000	35,487,900	
ＪＰホールディングス	27,100	472.000	12,791,200	
プレステージ・インターナショナル	42,000	605.000	25,410,000	
アミューズ	5,000	1,517.000	7,585,000	
ドリームインキュベータ	2,800	3,170.000	8,876,000	

クイック	5,800	2,409.000	13,972,200	
電通グループ	84,500	4,305.000	363,772,500	
ぴあ	3,100	3,170.000	9,827,000	
イオンファンタジー	3,500	2,530.000	8,855,000	
シーティーエス	10,600	730.000	7,738,000	
Ｈ．Ｕ．グループホールディングス	27,000	2,749.500	74,236,500	
アルプス技研	7,800	2,924.000	22,807,200	
日本空調サービス	10,200	890.000	9,078,000	
オリエンタルランド	454,900	5,553.000	2,526,059,700	
ダスキン	22,000	3,373.000	74,206,000	
明光ネットワークジャパン	13,800	731.000	10,087,800	
ファルコホールディングス	6,500	2,298.000	14,937,000	
ラウンドワン	82,900	687.000	56,952,300	
リゾートトラスト	39,000	2,547.000	99,333,000	
ビー・エム・エル	10,300	2,734.000	28,160,200	
リソー教育	47,000	233.000	10,951,000	
早稲田アカデミー	5,500	1,647.000	9,058,500	
ユー・エス・エス	97,000	2,643.500	256,419,500	
東京個別指導学院	17,900	447.000	8,001,300	
サイバーエージェント	200,000	1,069.500	213,900,000	
楽天グループ	730,000	792.500	578,525,000	
クリーク・アンド・リバー社	5,100	1,921.000	9,797,100	
ＳＢＩグローバルアセットマネジメント	18,000	732.000	13,176,000	
テー・オー・ダブリュー	33,800	363.000	12,269,400	
山田コンサルティンググループ	4,000	1,711.000	6,844,000	
セントラルスポーツ	3,700	2,445.000	9,046,500	
フルキャストホールディングス	8,000	1,476.000	11,808,000	
エン・ジャパン	15,200	2,782.000	42,286,400	
テクノプロ・ホールディングス	52,000	3,256.000	169,312,000	
アイ・アールジャパンホールディングス	4,700	1,421.000	6,678,700	
ＫｅｅＰｅｒ技研	5,800	6,620.000	38,396,000	
Ｇｕｎｏｓｙ	8,100	721.000	5,840,100	
イー・ガーディアン	3,700	1,390.000	5,143,000	
ジャパンマテリアル	26,400	2,676.000	70,646,400	
ベクトル	11,700	1,240.000	14,508,000	
チャーム・ケア・コーポレーション	7,400	1,383.000	10,234,200	
キャリアリンク	3,600	2,589.000	9,320,400	
ＩＢＪ	7,100	609.000	4,323,900	
アサンテ	5,200	1,680.000	8,736,000	
バリューＨＲ	8,000	1,380.000	11,040,000	
Ｍ＆Ａキャピタルパートナーズ	7,500	2,520.000	18,900,000	
ライドオンエクスプレスホールディングス	6,200	1,083.000	6,714,600	
ＥＲＩホールディングス	3,600	1,865.000	6,714,000	
シグマクシス・ホールディングス	12,300	1,668.000	20,516,400	

ウィルグループ	7,000	1,140.000	7,980,000	
メドピア	7,700	792.000	6,098,400	
レアジョブ	5,100	946.000	4,824,600	
リクルートホールディングス	636,100	6,008.000	3,821,688,800	
エラン	11,500	979.000	11,258,500	
日本郵政	1,015,300	1,413.000	1,434,618,900	
ベルシステム２４ホールディングス	11,600	1,794.000	20,810,400	
鎌倉新書	7,400	582.000	4,306,800	
エアトリ	6,500	1,645.000	10,692,500	
アトラエ	5,900	515.000	3,038,500	
ストライク	3,800	5,250.000	19,950,000	
ソラスト	23,700	538.000	12,750,600	
セラク	5,300	1,131.000	5,994,300	
インソース	18,500	791.000	14,633,500	
ベイカレント・コンサルティング	65,000	3,178.000	206,570,000	
アイモバイル	14,100	461.000	6,500,100	
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	28,200	2,275.000	64,155,000	
ウェルビー	5,400	1,085.000	5,859,000	
エル・ティー・エス	1,300	2,687.000	3,493,100	
ミダックホールディングス	5,500	1,626.000	8,943,000	
キュービーネットホールディングス	4,700	1,327.000	6,236,900	
ＲＰＡホールディングス	13,400	265.000	3,551,000	
マネジメントソリューションズ	4,000	3,030.000	12,120,000	
フロンティア・マネジメント	2,300	1,940.000	4,462,000	
アンビスホールディングス	8,600	2,569.000	22,093,400	
カーブスホールディングス	23,200	742.000	17,214,400	
フォーラムエンジニアリング	13,000	927.000	12,051,000	
ＦＡＳＴ　ＦＩＴＮＥＳＳ　ＪＡＰＡＮ	3,400	1,015.000	3,451,000	
ダイレクトマーケティングミックス	10,900	319.000	3,477,100	
ポピンズ	3,800	1,493.000	5,673,400	
ＬＩＴＡＬＩＣＯ	6,700	2,152.000	14,418,400	
リログループ	45,700	1,289.000	58,907,300	
東祥	10,900	792.000	8,632,800	
ＩＤ＆Ｅ　ホールディングス	5,100	3,660.000	18,666,000	
ビーウィズ	2,400	1,779.000	4,269,600	
ＴＲＥホールディングス	17,900	1,208.000	21,623,200	
人・夢・技術グループ	3,600	1,748.000	6,292,800	
ＮＩＳＳＯホールディングス	9,000	800.000	7,200,000	
大栄環境	16,000	2,674.000	42,784,000	
日本管財ホールディングス	8,400	2,576.000	21,638,400	
Ｍ＆Ａ総研ホールディングス	4,300	6,490.000	27,907,000	
エイチ・アイ・エス	24,700	1,737.000	42,903,900	
ラックランド	4,100	2,576.000	10,561,600	
共立メンテナンス	14,300	6,306.000	90,175,800	

イチネンホールディングス	9,100	1,684.000	15,324,400	
建設技術研究所	4,600	5,740.000	26,404,000	
スペース	7,100	975.000	6,922,500	
燦ホールディングス	8,500	1,057.000	8,984,500	
スバル興業	4,000	3,090.000	12,360,000	
東京テアトル	7,000	1,138.000	7,966,000	
ナガワ	2,900	7,190.000	20,851,000	
東京都競馬	7,200	4,280.000	30,816,000	
カナモト	14,400	2,938.000	42,307,200	
ニシオホールディングス	7,600	3,880.000	29,488,000	
トランス・コスモス	10,400	2,953.000	30,711,200	
乃村工藝社	36,600	879.000	32,171,400	
藤田観光	3,800	6,850.000	26,030,000	
ＫＮＴ－ＣＴホールディングス	7,200	1,241.000	8,935,200	
トーカイ	7,500	2,149.000	16,117,500	
セコム	87,800	10,995.000	965,361,000	
セントラル警備保障	4,700	2,598.000	12,210,600	
丹青社	17,000	802.000	13,634,000	
メイテックグループホールディングス	32,500	3,004.000	97,630,000	
応用地質	8,500	2,346.000	19,941,000	
船井総研ホールディングス	17,600	2,669.000	46,974,400	
いであ	3,500	2,347.000	8,214,500	
学究社	4,200	2,108.000	8,853,600	
イオンディライト	9,200	3,535.000	32,522,000	
ダイセキ	17,600	4,000.000	70,400,000	
ステップ	3,200	2,034.000	6,508,800	
合　計	128,014,400		312,887,275,500	

(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。

国内債券パッシブ・マザーファンド

（１）貸借対照表

（単位：円）

	(2023年2月20日現在)	(2024年2月19日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	19,179,591	11,026,563
コール・ローン	379,284,508	446,127,786
国債証券	93,914,832,360	104,594,011,690
地方債証券	9,327,354,900	9,117,443,700
特殊債券	8,983,279,483	10,570,047,833

社債券	6,536,207,600	7,069,628,000
未収入金	83,000,000	－
未収利息	306,540,887	326,962,421
前払費用	8,217,910	15,202,553
流動資産合計	119,557,897,239	132,150,450,546
資産合計	119,557,897,239	132,150,450,546
負債の部		
流動負債		
未払金	－	184,409,400
未払解約金	35,371,000	32,592,689
その他未払費用	1,034	613
流動負債合計	35,372,034	217,002,702
負債合計	35,372,034	217,002,702
純資産の部		
元本等		
元本	98,468,499,154	108,788,622,566
剰余金		
剰余金又は欠損金（△）	21,054,026,051	23,144,825,278
元本等合計	119,522,525,205	131,933,447,844
純資産合計	119,522,525,205	131,933,447,844
負債純資産合計	119,557,897,239	132,150,450,546

（２）注記表

（重要な会計方針の注記）

項　目	自 2023年2月21日 至 2024年2月19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	（2023年2月20日現在）	（2024年2月19日現在）
１．　当計算期間の末日における受益権の総数	98,468,499,154口	108,788,622,566口
２．　１単位当たり純資産の額	１口当たり純資産額　1.2138円 （１万口当たりの純資産額12,138円）	１口当たり純資産額　1.2128円 （１万口当たりの純資産額12,128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2月21日 至 2024年2月19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 2 月 19 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 2 月 21 日 至 2024 年 2 月 19 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）

（2023 年 2 月 20 日現在）	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	102,053,846,373 円
同期中における追加設定元本額	27,964,043,892 円
同期中における一部解約元本額	31,549,391,111 円
2023 年 2 月 20 日現在の元本の内訳	
三井住友・ＤＣ年金バランス３０（債券重点型）	7,923,460,658 円
三井住友・ＤＣ年金バランス５０（標準型）	12,755,531,327 円

三井住友・ＤＣ年金バランス７０（株式重点型）	3,025,477,132 円
ＳＭＡＭ・グローバルバランスファンド（機動的資産配分型）	722,058,897 円
三井住友・ＤＣターゲットイヤーファンド２０２０（４資産タイプ）	41,625,383 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）	198,031,820 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）	548,196,469 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）	939,015,409 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）	497,124,584 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）	629,401,805 円
三井住友・ＤＣ年金バランスゼロ（債券型）	142,965,910 円
アセットアロケーション・ファンド（安定型）	988,245,910 円
アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）	334,157,236 円
アセットアロケーション・ファンド（成長型）	13,049,588 円
三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０５０	67,640,670 円
三井住友・資産最適化ファンド（１安定重視型）	2,175,938,455 円
三井住友・資産最適化ファンド（２やや安定型）	745,900,911 円
三井住友・資産最適化ファンド（３バランス型）	1,138,229,302 円
三井住友・資産最適化ファンド（４やや成長型）	256,092,408 円
三井住友・資産最適化ファンド（５成長重視型）	41,823,338 円
三井住友・ＤＣつみたてＮＩＳＡ・世界分散ファンド	221,791,251 円
三井住友ＤＳ・年金バランス３０（債券重点型）	314,254,587 円
三井住友ＤＳ・年金バランス５０（標準型）	614,543,782 円
三井住友ＤＳ・年金バランス７０（株式重点型）	178,682,271 円
三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０６０	8,810,148 円
三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０３５	363,085 円
三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０４０	298,337 円
三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０４５	201,623 円
三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０５５	109,828 円
三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０６５	109,828 円
ＳＭＡＭ・年金グローバル債券ファンド＜適格機関投資家限定＞	1,165,585,383 円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ２５＜適格機関投資家専用＞	10,131,272,966 円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ３７．５＜適格機関投資家専用＞	5,883,975,871 円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ５０＜適格機関投資家専用＞	14,827,042,772 円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＬ３０＜適格機関投資家限定＞	299,804,746 円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＬ５０＜適格機関投資家限定＞	469,103,658 円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ７５＜適格機関投資家専用＞	252,747,789 円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＬ国際分散型＜適格機関投資家限定＞	120,221,118 円
ＳＭＡＭ・インデックス・バランスＶＡ２５＜適格機関投資家専用＞	1,758,891,118 円
ＳＭＡＭ・インデックス・バランスＶＡ５０＜適格機関投資家専用＞	2,036,392,293 円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ４０＜適格機関投資家専用＞	2,141,556,909 円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ３５＜適格機関投資家専用＞	7,715,877,192 円
ＳＭＡＭ・バランスＶＡ株４０Ｔ＜適格機関投資家限定＞	961,967 円
三井住友・国内債券インデックスファンド・ＶＡＳ（適格機関投資家専用）	1,077,378,938 円
ＳＭＡＭ・グローバルバランス４０ＶＡ＜適格機関投資家限定＞	385,918,055 円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２０Ａ＜適格機関投資家専用＞	476,420,978 円

ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ３５Ａ＜適格機関投資家専用＞	165,177,003 円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ５０Ａ＜適格機関投資家専用＞	44,327,528 円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２０Ｌ＜適格機関投資家専用＞	1,259,376,954 円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２５Ｌ＜適格機関投資家専用＞	1,957,126,760 円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２０Ａ２＜適格機関投資家専用＞	615,082,574 円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ３５Ａ２＜適格機関投資家専用＞	209,309,392 円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ５０Ａ２＜適格機関投資家専用＞	20,824,733 円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ３０Ｌ２＜適格機関投資家専用＞	256,032,422 円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２５Ｌ２＜適格機関投資家専用＞	4,751,028,753 円
ＳＭＡＭ・年金Wリスクコントロールファンド＜適格機関投資家限定＞	1,287,393,245 円
ＳＭＡＭ・マルチアセットストラテジーファンド２０１６－０４＜適格機関投資家限定＞	1,232,850,854 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＞	1,576,598,738 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＞	1,827,086,493 円
合　計	98,468,499,154 円

（2024 年 2 月 19 日現在）	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	98,468,499,154 円
同期中における追加設定元本額	31,977,575,692 円
同期中における一部解約元本額	21,657,452,280 円
2024 年 2 月 19 日現在の元本の内訳	
三井住友・ＤＣ年金バランス３０（債券重点型）	9,620,997,562 円
三井住友・ＤＣ年金バランス５０（標準型）	15,526,463,226 円
三井住友・ＤＣ年金バランス７０（株式重点型）	3,987,637,784 円
ＳＭＡＭ・グローバルバランスファンド（機動的資産配分型）	925,911,090 円
三井住友・ＤＣターゲットイヤーファンド２０２０（４資産タイプ）	42,583,404 円
三井住友・ＤＣターゲットイヤーファンド２０２５（４資産タイプ）	194,230,025 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）	628,023,020 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）	1,240,587,184 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）	696,136,829 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）	851,343,826 円
三井住友・ＤＣ年金バランスゼロ（債券型）	136,777,668 円
アセットアロケーション・ファンド（安定型）	841,690,788 円
アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）	273,793,027 円
アセットアロケーション・ファンド（成長型）	13,534,979 円
三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０５０	108,294,373 円
三井住友・資産最適化ファンド（１安定重視型）	5,009,516,485 円
三井住友・資産最適化ファンド（２やや安定型）	1,674,585,928 円
三井住友・資産最適化ファンド（３バランス型）	2,772,557,793 円
三井住友・資産最適化ファンド（４やや成長型）	670,079,799 円
三井住友・資産最適化ファンド（５成長重視型）	72,948,387 円

三井住友・ＤＣつみたてＮＩＳＡ・世界分散ファンド	318,746,820 円
三井住友ＤＳ・年金バランス３０（債券重点型）	407,797,339 円
三井住友ＤＳ・年金バランス５０（標準型）	900,506,313 円
三井住友ＤＳ・年金バランス７０（株式重点型）	297,658,115 円
三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０６０	10,241,979 円
三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０３５	69,656,857 円
三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０４０	30,812,144 円
三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０４５	24,772,459 円
三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０５５	2,841,646 円
三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０６５	1,872,876 円
三井住友ＤＳ・ＦＷ専用ポートフォリオ・レベル１（保守型）	6,216,899 円
三井住友ＤＳ・ＦＷ専用ポートフォリオ・レベル２（安定型）	46,249,188 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）	123,009,451 円
三井住友ＤＳ・ＦＷ専用ポートフォリオ・レベル４（成長型）	39,781,654 円
三井住友ＤＳ・ＦＷ専用ポートフォリオ・レベル５（積極成長型）	4,230,505 円
ＳＭＡＭ・年金グローバル債券ファンド＜適格機関投資家限定＞	1,045,988,493 円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ２５＜適格機関投資家専用＞	8,589,514,042 円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ３７．５＜適格機関投資家専用＞	5,753,629,689 円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ５０＜適格機関投資家専用＞	15,309,103,584 円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＬ３０＜適格機関投資家限定＞	306,375,000 円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＬ５０＜適格機関投資家限定＞	497,670,273 円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ７５＜適格機関投資家専用＞	274,074,334 円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＬ国際分散型＜適格機関投資家限定＞	118,270,332 円
ＳＭＡＭ・インデックス・バランスＶＡ２５＜適格機関投資家専用＞	1,730,943,889 円
ＳＭＡＭ・インデックス・バランスＶＡ５０＜適格機関投資家専用＞	2,201,314,761 円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ４０＜適格機関投資家専用＞	2,108,318,347 円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ３５＜適格機関投資家専用＞	7,442,323,334 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）	942,125,331 円
ＳＭＡＭ・グローバルバランス４０ＶＡ＜適格機関投資家限定＞	370,979,799 円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２０Ａ＜適格機関投資家専用＞	444,025,322 円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ３５Ａ＜適格機関投資家専用＞	176,362,458 円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ５０Ａ＜適格機関投資家専用＞	49,904,999 円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２０Ｌ＜適格機関投資家専用＞	1,111,885,167 円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２５Ｌ＜適格機関投資家専用＞	1,902,733,061 円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２０Ａ２＜適格機関投資家専用＞	574,222,087 円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ３５Ａ２＜適格機関投資家専用＞	219,051,405 円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ５０Ａ２＜適格機関投資家専用＞	23,223,787 円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ３０Ｌ２＜適格機関投資家専用＞	247,758,985 円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２５Ｌ２＜適格機関投資家専用＞	4,559,946,725 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＞	1,281,133,219 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＞	826,818,499 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＞	1,318,888,290 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	887,713,018 円

＜適格機関投資家限定＞	
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＞	902,236,914 円
合　計	108,788,622,566 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	４５１　２年国債	1,160,000,000	1,158,990,800	
	４５２　２年国債	180,000,000	179,778,600	
	４５３　２年国債	800,000,000	798,776,000	
	４５４　２年国債	60,000,000	59,989,800	
	４５５　２年国債	1,030,000,000	1,027,806,100	
	４５６　２年国債	230,000,000	229,848,200	
	４５７　２年国債	460,000,000	459,595,200	
	１４５　５年国債	1,180,000,000	1,180,365,800	
	１４６　５年国債	1,000,000,000	999,720,000	
	１４７　５年国債	1,310,000,000	1,306,738,100	
	１４８　５年国債	1,180,000,000	1,176,566,200	
	１４９　５年国債	1,290,000,000	1,285,846,200	
	１５０　５年国債	3,130,000,000	3,118,512,900	
	１５１　５年国債	300,000,000	298,665,000	
	１５２　５年国債	730,000,000	728,875,800	
	１５３　５年国債	1,200,000,000	1,193,244,000	
	１５４　５年国債	1,180,000,000	1,175,799,200	
	１５６　５年国債	1,090,000,000	1,088,964,500	
	１５７　５年国債	370,000,000	369,252,600	
	１５８　５年国債	930,000,000	924,364,200	
	１５９　５年国債	100,000,000	99,251,000	
	１６０　５年国債	1,190,000,000	1,186,180,100	
	１６１　５年国債	370,000,000	370,314,500	
	１６２　５年国債	220,000,000	219,850,400	
	１６３　５年国債	770,000,000	772,949,100	
	１６４　５年国債	280,000,000	278,070,800	
	１６５　５年国債	40,000,000	39,904,800	
	１　４０年国債	40,000,000	46,244,800	
	２　４０年国債	242,000,000	269,430,700	
	３　４０年国債	185,000,000	205,422,150	
	４　４０年国債	247,000,000	273,703,170	

５　４０年国債	235,000,000	249,821,450	
６　４０年国債	240,000,000	249,338,400	
７　４０年国債	265,000,000	262,130,050	
８　４０年国債	300,000,000	274,716,000	
９　４０年国債	523,000,000	349,578,430	
１０　４０年国債	470,000,000	368,545,800	
１１　４０年国債	370,000,000	278,328,800	
１２　４０年国債	390,000,000	260,020,800	
１３　４０年国債	495,000,000	325,744,650	
１４　４０年国債	505,000,000	354,661,500	
１５　４０年国債	560,000,000	433,792,800	
１６　４０年国債	460,000,000	390,655,000	
３４０　１０年国債	770,000,000	773,888,500	
３４１　１０年国債	557,000,000	558,877,090	
３４２　１０年国債	350,000,000	349,818,000	
３４３　１０年国債	310,000,000	309,783,000	
３４４　１０年国債	811,000,000	810,367,420	
３４５　１０年国債	258,000,000	257,744,580	
３４６　１０年国債	340,000,000	339,476,400	
３４７　１０年国債	100,000,000	99,751,000	
３４８　１０年国債	145,000,000	144,483,800	
３４９　１０年国債	650,000,000	646,912,500	
３５０　１０年国債	510,000,000	506,909,400	
３５１　１０年国債	350,000,000	347,378,500	
３５２　１０年国債	150,000,000	148,543,500	
３５３　１０年国債	180,000,000	177,987,600	
３５４　１０年国債	565,000,000	558,090,050	
３５５　１０年国債	660,000,000	651,367,200	
３５６　１０年国債	130,000,000	128,185,200	
３５７　１０年国債	710,000,000	699,257,700	
３５８　１０年国債	1,040,000,000	1,022,694,400	
３５９　１０年国債	1,150,000,000	1,128,702,000	
３６０　１０年国債	1,240,000,000	1,214,580,000	
３６１　１０年国債	1,160,000,000	1,133,842,000	
３６２　１０年国債	1,030,000,000	1,004,579,600	
３６３　１０年国債	1,030,000,000	1,001,572,000	
３６４　１０年国債	710,000,000	688,245,600	
３６５　１０年国債	1,040,000,000	1,005,243,200	
３６６　１０年国債	1,170,000,000	1,137,006,000	
３６７　１０年国債	1,110,000,000	1,075,623,300	
３６８　１０年国債	1,190,000,000	1,149,742,300	
３６９　１０年国債	1,110,000,000	1,097,923,200	

３７０　１０年国債	950,000,000	937,783,000	
３７１　１０年国債	1,010,000,000	985,618,600	
３７２　１０年国債	1,020,000,000	1,030,077,600	
３７３　１０年国債	280,000,000	276,785,600	
２　３０年国債	440,000,000	492,861,600	
４　３０年国債	340,000,000	395,848,400	
５　３０年国債	290,000,000	325,600,400	
７　３０年国債	474,000,000	539,838,600	
９　３０年国債	240,000,000	255,885,600	
１０　３０年国債	95,000,000	98,790,500	
１１　３０年国債	430,000,000	470,123,300	
１２　３０年国債	570,000,000	644,248,200	
１４　３０年国債	392,000,000	454,939,520	
１６　３０年国債	205,000,000	240,639,250	
１８　３０年国債	190,000,000	219,556,400	
１９　３０年国債	170,000,000	196,589,700	
２１　３０年国債	345,000,000	399,416,850	
２２　３０年国債	315,000,000	372,128,400	
２３　３０年国債	349,000,000	412,570,350	
２４　３０年国債	460,000,000	543,789,000	
２５　３０年国債	260,000,000	301,173,600	
２６　３０年国債	253,000,000	296,187,100	
２７　３０年国債	250,000,000	295,900,000	
２８　３０年国債	96,000,000	113,698,560	
２９　３０年国債	157,000,000	183,683,720	
３０　３０年国債	142,000,000	164,035,560	
３１　３０年国債	235,000,000	267,956,400	
３２　３０年国債	360,000,000	414,763,200	
３３　３０年国債	208,000,000	229,898,240	
３４　３０年国債	87,000,000	98,561,430	
３５　３０年国債	260,000,000	285,838,800	
３６　３０年国債	90,000,000	98,786,700	
３７　３０年国債	225,000,000	243,020,250	
３８　３０年国債	220,000,000	233,248,400	
３９　３０年国債	220,000,000	236,552,800	
４０　３０年国債	260,000,000	274,716,000	
４１　３０年国債	240,000,000	248,856,000	
４２　３０年国債	280,000,000	289,982,000	
４３　３０年国債	265,000,000	274,108,050	
４４　３０年国債	310,000,000	320,251,700	
４５　３０年国債	315,000,000	313,752,600	
４６　３０年国債	315,000,000	313,242,300	

４７　３０年国債	290,000,000	293,262,500	
４８　３０年国債	400,000,000	389,352,000	
４９　３０年国債	345,000,000	335,191,650	
５０　３０年国債	325,000,000	278,941,000	
５１　３０年国債	345,000,000	262,783,050	
５２　３０年国債	363,000,000	289,089,570	
５３　３０年国債	277,000,000	225,034,800	
５４　３０年国債	115,000,000	97,521,150	
５５　３０年国債	355,000,000	300,124,100	
５６　３０年国債	320,000,000	269,702,400	
５７　３０年国債	255,000,000	214,258,650	
５８　３０年国債	350,000,000	293,177,500	
５９　３０年国債	390,000,000	317,951,400	
６０　３０年国債	420,000,000	358,024,800	
６１　３０年国債	315,000,000	254,882,250	
６２　３０年国債	275,000,000	210,322,750	
６３　３０年国債	230,000,000	170,423,100	
６４　３０年国債	315,000,000	232,262,100	
６５　３０年国債	275,000,000	201,951,750	
６６　３０年国債	360,000,000	263,084,400	
６７　３０年国債	340,000,000	261,738,800	
６８　３０年国債	340,000,000	260,783,400	
６９　３０年国債	350,000,000	275,114,000	
７０　３０年国債	370,000,000	289,839,500	
７１　３０年国債	350,000,000	273,217,000	
７２　３０年国債	370,000,000	287,823,000	
７３　３０年国債	380,000,000	294,838,200	
７４　３０年国債	340,000,000	285,804,000	
７５　３０年国債	360,000,000	326,228,400	
７６　３０年国債	370,000,000	343,038,100	
７７　３０年国債	350,000,000	339,937,500	
７８　３０年国債	400,000,000	369,812,000	
７９　３０年国債	310,000,000	272,204,800	
８０　３０年国債	360,000,000	364,928,400	
８１　３０年国債	100,000,000	96,586,000	
８２　２０年国債	620,000,000	639,771,800	
８４　２０年国債	500,000,000	517,210,000	
８５　２０年国債	645,000,000	671,380,500	
８８　２０年国債	742,000,000	779,381,960	
８９　２０年国債	20,000,000	20,961,000	
９０　２０年国債	580,000,000	610,879,200	
９２　２０年国債	324,000,000	341,949,600	

９３　２０年国債	632,000,000	667,903,920	
９５　２０年国債	305,000,000	326,502,500	
９７　２０年国債	327,000,000	350,311,830	
９９　２０年国債	153,000,000	163,924,200	
１００　２０年国債	207,000,000	223,377,840	
１０１　２０年国債	355,000,000	385,956,000	
１０２　２０年国債	457,000,000	498,756,090	
１０５　２０年国債	370,000,000	400,003,300	
１０６　２０年国債	370,000,000	401,675,700	
１０７　２０年国債	378,000,000	409,808,700	
１０９　２０年国債	40,000,000	43,135,600	
１１１　２０年国債	386,000,000	423,685,180	
１１３　２０年国債	27,000,000	29,602,530	
１１４　２０年国債	163,000,000	179,348,900	
１１８　２０年国債	200,000,000	220,022,000	
１１９　２０年国債	295,000,000	320,886,250	
１２０　２０年国債	200,000,000	215,012,000	
１２１　２０年国債	55,000,000	60,289,900	
１２２　２０年国債	130,000,000	141,668,800	
１２３　２０年国債	70,000,000	77,833,700	
１２５　２０年国債	205,000,000	229,917,750	
１２６　２０年国債	180,000,000	199,339,200	
１２７　２０年国債	145,000,000	159,582,650	
１２８　２０年国債	65,000,000	71,610,500	
１３０　２０年国債	155,000,000	169,841,250	
１３１　２０年国債	80,000,000	87,075,200	
１３２　２０年国債	450,000,000	490,135,500	
１３３　２０年国債	190,000,000	208,374,900	
１３４　２０年国債	200,000,000	219,586,000	
１３５　２０年国債	155,000,000	168,979,450	
１３６　２０年国債	120,000,000	129,843,600	
１３７　２０年国債	185,000,000	201,781,350	
１３９　２０年国債	60,000,000	64,965,000	
１４０　２０年国債	420,000,000	458,446,800	
１４１　２０年国債	360,000,000	393,040,800	
１４２　２０年国債	240,000,000	264,151,200	
１４３　２０年国債	150,000,000	162,561,000	
１４４　２０年国債	170,000,000	182,775,500	
１４５　２０年国債	110,000,000	120,264,100	
１４６　２０年国債	195,000,000	213,177,900	
１４７　２０年国債	840,000,000	909,946,800	
１４８　２０年国債	459,000,000	492,635,520	

	１４９　２０年国債	565,000,000	606,199,800	
	１５０　２０年国債	511,000,000	542,758,650	
	１５１　２０年国債	700,000,000	728,266,000	
	１５２　２０年国債	480,000,000	498,772,800	
	１５３　２０年国債	587,000,000	615,563,420	
	１５４　２０年国債	670,000,000	694,354,500	
	１５５　２０年国債	510,000,000	516,278,100	
	１５６　２０年国債	200,000,000	188,286,000	
	１５７　２０年国債	385,000,000	352,159,500	
	１５８　２０年国債	380,000,000	359,369,800	
	１５９　２０年国債	388,000,000	370,140,360	
	１６０　２０年国債	375,000,000	361,151,250	
	１６１　２０年国債	610,000,000	577,901,800	
	１６２　２０年国債	470,000,000	443,539,000	
	１６３　２０年国債	520,000,000	488,789,600	
	１６４　２０年国債	475,000,000	438,653,000	
	１６５　２０年国債	600,000,000	551,682,000	
	１６６　２０年国債	475,000,000	447,469,000	
	１６７　２０年国債	530,000,000	482,983,700	
	１６８　２０年国債	490,000,000	437,717,000	
	１６９　２０年国債	480,000,000	419,985,600	
	１７０　２０年国債	515,000,000	448,559,850	
	１７１　２０年国債	475,000,000	411,559,000	
	１７２　２０年国債	480,000,000	420,595,200	
	１７３　２０年国債	485,000,000	422,784,200	
	１７４　２０年国債	700,000,000	607,026,000	
	１７５　２０年国債	655,000,000	575,096,550	
	１７６　２０年国債	670,000,000	585,278,500	
	１７７　２０年国債	670,000,000	572,173,300	
	１７８　２０年国債	620,000,000	536,727,800	
	１７９　２０年国債	690,000,000	594,600,600	
	１８０　２０年国債	550,000,000	498,437,500	
	１８１　２０年国債	530,000,000	487,435,700	
	１８２　２０年国債	550,000,000	522,203,000	
	１８３　２０年国債	540,000,000	537,991,200	
	１８４　２０年国債	590,000,000	557,060,300	
	１８５　２０年国債	590,000,000	555,048,400	
	１８６　２０年国債	480,000,000	482,553,600	
	１８７　２０年国債	60,000,000	58,121,400	
	国債証券　小計		104,594,011,690	
地方債証券	１　東京都３０年	100,000,000	112,595,300	
	８　東京都３０年	400,000,000	451,558,800	

	１３　東京都３０年	500,000,000	534,918,000	
	６　東京都２０年	100,000,000	102,014,100	
	２６－１５　北海道公債	100,000,000	100,330,100	
	３０－１８　北海道公債	200,000,000	196,888,600	
	２１０　神奈川県公債	100,000,000	100,317,300	
	２１１　神奈川県公債	100,000,000	100,297,200	
	３　神奈川県２０年	100,000,000	102,614,000	
	７　神奈川県２０年	100,000,000	106,027,800	
	１３　神奈川県２０年	100,000,000	110,022,000	
	３８８　大阪府公債	100,000,000	100,318,800	
	３９２　大阪府公債	100,000,000	100,253,600	
	１　大阪府２０年	200,000,000	218,920,200	
	１７９　大阪府５年	100,000,000	99,572,000	
	１９３　大阪府５年	300,000,000	297,646,500	
	２７－４　京都府公債	100,000,000	100,547,600	
	２９－４　京都府公債	100,000,000	99,699,700	
	１－６　京都府５年	200,000,000	200,008,400	
	５　兵庫県公債１５年	300,000,000	311,778,600	
	１０兵庫県公債２０年	100,000,000	110,365,000	
	７　静岡県３０年	100,000,000	107,441,100	
	１　静岡県２０年	100,000,000	103,156,000	
	２２－８　愛知県２０年	200,000,000	217,594,600	
	２７－１６　愛知県公債	400,000,000	401,688,800	
	２　埼玉県公債	300,000,000	298,231,800	
	５　埼玉県２０年	100,000,000	108,032,400	
	２６－３　福岡県公債	100,000,000	100,326,500	
	２６－１０　福岡県公債	100,000,000	100,349,600	
	１－１　福岡県公債	200,000,000	195,411,200	
	１－３　福岡県３０年	100,000,000	72,905,000	
	２６－４　千葉県公債	100,000,000	100,328,600	
	２７－３　千葉県公債	100,000,000	100,507,200	
	２８－１　千葉県公債	100,000,000	99,663,800	
	９　千葉県２０年	200,000,000	217,072,600	
	１３７　共同発行地方	200,000,000	200,661,000	
	１３８　共同発行地方	200,000,000	200,657,200	
	１５５　共同発行地方	100,000,000	99,994,900	
	１７２　共同発行地方	500,000,000	498,929,000	
	１８３　共同発行地方	600,000,000	595,395,000	
	１９９　共同発行地方	100,000,000	97,671,200	
	３　名古屋市２０年	100,000,000	102,505,000	
	５　名古屋市２０年	100,000,000	105,310,500	
	１　京都市３０年	100,000,000	117,599,400	

	７　京都市２０年	100,000,000	108,927,000	
	２６－１７　神戸市公債	100,000,000	100,175,300	
	２６－３　横浜市公債	200,000,000	200,648,800	
	４　横浜市２０年	100,000,000	102,063,900	
	７　横浜市２０年	100,000,000	103,357,900	
	９　横浜市２０年	100,000,000	104,910,900	
	１４　横浜市２０年	100,000,000	107,911,900	
	２－７　札幌市公債	100,000,000	97,116,100	
	９４　川崎市公債	100,000,000	96,180,600	
	１－２　北九州市５年	100,000,000	99,993,100	
	１－２　岡山県公債	100,000,000	98,032,200	
	地方債証券　小計		9,117,443,700	
特殊債券	４７日本政策投資ＣＯ	100,000,000	102,678,500	
	１２４　日本政策投資	100,000,000	97,538,600	
	３６　日本政策投資Ｂ	100,000,000	106,144,800	
	１８　道路機構	100,000,000	120,393,000	
	２２　道路機構	300,000,000	349,976,100	
	２７　道路機構	100,000,000	107,091,500	
	３７　道路機構	300,000,000	325,178,700	
	４７　道路機構	200,000,000	219,103,400	
	１３５　道路機構	200,000,000	204,209,400	
	７４　政保道路機構	100,000,000	107,350,900	
	７９　政保道路機構	200,000,000	217,266,000	
	８１　政保道路機構	200,000,000	217,514,800	
	８８　政保道路機構	100,000,000	114,070,000	
	９０　政保道路機構	500,000,000	546,377,000	
	９９　政保道路機構	100,000,000	110,346,500	
	１２７　政保道路機構	200,000,000	220,247,400	
	１７６　政保道路機構	100,000,000	108,111,700	
	１９６　政保道路機構	100,000,000	109,330,200	
	２１０　政保道路機構	200,000,000	214,141,400	
	２２７　政保道路機構	200,000,000	200,715,000	
	２３１　政保道路機構	300,000,000	301,101,600	
	２８８　政保道路機構	189,000,000	188,108,676	
	９　道路債券	100,000,000	117,000,900	
	２　地方公営２０年	100,000,000	108,599,700	
	４　地方公共団２０年	100,000,000	108,680,800	
	１８　地方公共団２０	300,000,000	322,505,100	
	Ｆ９６　地方公共団体	100,000,000	103,357,700	
	Ｆ１４３地方公共団体	100,000,000	103,153,100	
	６３　地方公共団体	100,000,000	100,257,200	
	６４　地方公共団体	100,000,000	100,249,500	

	６７政保地方公共団	100,000,000	100,347,100	
	７６政保地方公共団	300,000,000	301,292,100	
	８５　地方公共団体	100,000,000	99,292,600	
	１０１　地方公共団体	100,000,000	99,169,700	
	１０６　地方公共団体	200,000,000	197,594,000	
	２９　地方公共団５年	300,000,000	297,277,800	
	１５　公営企業２０年	100,000,000	102,888,100	
	１７　公営企業２０年	100,000,000	104,194,100	
	２０　公営企業２０年	100,000,000	105,669,300	
	２２　公営企業２０年	100,000,000	106,233,000	
	２４　公営企業２０年	200,000,000	214,625,000	
	１０　日本政策金融	100,000,000	109,612,000	
	８９　都市再生	100,000,000	102,830,700	
	９３　都市再生	100,000,000	102,933,700	
	１１７　都市再生	100,000,000	101,251,200	
	３３　政保中部空港	200,000,000	199,525,600	
	５２　住宅支援機構	100,000,000	108,959,200	
	９３　住宅支援機構	100,000,000	103,542,100	
	１２４　住宅支援機構	100,000,000	103,916,000	
	１３０　住宅支援機構	200,000,000	216,049,600	
	２２６　住宅支援機構	100,000,000	99,395,900	
	Ｓ７　住宅機構ＲＭＢＳ	9,679,000	9,698,358	
	Ｓ９　住宅機構ＲＭＢＳ	9,966,000	9,988,921	
	Ｓ１０　住宅機構ＲＭＢＳ	9,862,000	9,882,710	
	Ｓ１１　住宅機構ＲＭＢＳ	10,715,000	10,820,007	
	２　住宅機構ＲＭＢＳ	19,114,000	19,159,873	
	１９　住宅機構ＲＭＢＳ	12,959,000	13,358,137	
	２４　住宅機構ＲＭＢＳ	26,156,000	27,071,460	
	２６　住宅機構ＲＭＢＳ	40,413,000	41,698,133	
	２７　住宅機構ＲＭＢＳ	14,543,000	15,063,639	
	２８　住宅機構ＲＭＢＳ	16,907,000	17,655,980	
	２９　住宅機構ＲＭＢＳ	18,297,000	19,147,810	
	３０　住宅機構ＲＭＢＳ	17,919,000	18,750,441	
	３２　住宅機構ＲＭＢＳ	35,534,000	36,969,573	
	３５　住宅機構ＲＭＢＳ	17,981,000	18,727,211	
	３６　住宅機構ＲＭＢＳ	17,194,000	17,843,933	
	４３　住宅機構ＲＭＢＳ	22,384,000	23,230,115	
	４６　住宅機構ＲＭＢＳ	17,224,000	17,909,515	
	４８　住宅機構ＲＭＢＳ	32,762,000	34,036,441	
	４９　住宅機構ＲＭＢＳ	16,717,000	17,320,483	
	５１　住宅機構ＲＭＢＳ	36,492,000	37,772,869	
	５５　住宅機構ＲＭＢＳ	48,808,000	50,272,240	

	５７　住宅機構ＲＭＢＳ	23,298,000	24,022,567	
	５８　住宅機構ＲＭＢＳ	26,104,000	26,894,951	
	５９　住宅機構ＲＭＢＳ	49,474,000	51,057,168	
	６０　住宅機構ＲＭＢＳ	75,279,000	77,356,700	
	６１　住宅機構ＲＭＢＳ	25,287,000	25,896,416	
	６７　住宅機構ＲＭＢＳ	32,458,000	32,873,462	
	６９　住宅機構ＲＭＢＳ	67,954,000	69,469,374	
	７０　住宅機構ＲＭＢＳ	58,750,000	60,118,875	
	７３　住宅機構ＲＭＢＳ	33,491,000	34,291,434	
	９９　住宅機構ＲＭＢＳ	52,733,000	52,332,229	
	１２３　住宅機構ＲＭＢＳ	70,114,000	66,888,756	
	１２４　住宅機構ＲＭＢＳ	69,725,000	66,301,502	
	１２５　住宅機構ＲＭＢＳ	69,725,000	66,308,475	
	１２７　住宅機構ＲＭＢＳ	71,870,000	68,104,012	
	１２８　住宅機構ＲＭＢＳ	70,525,000	66,998,750	
	１２９　住宅機構ＲＭＢＳ	72,122,000	68,609,658	
	１３７　住宅機構ＲＭＢＳ	74,688,000	70,856,505	
	１６７　住宅機構ＲＭＢＳ	87,049,000	81,147,077	
	１８３　住宅機構ＲＭＢＳ	186,386,000	176,507,542	
	１８６　住宅機構ＲＭＢＳ	94,601,000	91,365,645	
	１９８　住宅機構ＲＭＢＳ	198,074,000	199,975,510	
	８５　中日本高速道	300,000,000	298,895,400	
	特殊債券　小計		10,570,047,833	
社債券	８６　東日本高速道	200,000,000	198,154,200	
	２３　西日本高速道	100,000,000	100,258,000	
	８４　西日本高速道	200,000,000	199,243,600	
	１３　大和ハウス	100,000,000	99,454,200	
	１７　アサヒグループＨＤ	200,000,000	198,889,200	
	３０　東レ	100,000,000	99,593,400	
	１２　旭化成	200,000,000	195,209,400	
	２４三菱ケミカルホールデイ	100,000,000	99,035,800	
	３２　住友電工	100,000,000	98,918,700	
	１６　小松製作所	100,000,000	98,998,000	
	２２　日立製作所	100,000,000	100,543,400	
	９　ＴＤＫ	100,000,000	97,657,300	
	６３　三井物産	100,000,000	106,022,900	
	８　みずほコーポレート	100,000,000	107,065,900	
	１　三井住友ＦＧ劣後	100,000,000	100,240,000	
	８　住友信託　劣後	100,000,000	105,301,500	
	１　みずほＦＧ劣後	100,000,000	100,279,300	
	９　みずほ銀行劣後	100,000,000	105,513,300	
	１７　ＮＴＴフアイナンス	200,000,000	198,032,400	

	７３　ホンダフアイナンス	200,000,000	198,390,200	
	１０１　トヨタフアイナンス	200,000,000	200,280,600	
	２０７　オリツクス	200,000,000	198,782,800	
	２　三菱ＨＣキヤピタル	200,000,000	198,192,200	
	５８　三菱地所	100,000,000	115,605,600	
	１３５　三菱地所	200,000,000	191,829,800	
	１０　東急	100,000,000	94,978,200	
	３８　京王電鉄	100,000,000	99,329,400	
	１１０東日本旅客鉄	100,000,000	97,837,700	
	１６９　東日本旅客鉄	200,000,000	190,674,200	
	６０　西日本旅客鉄	200,000,000	194,612,800	
	４１　東海旅客鉄道	100,000,000	107,376,700	
	４２　東海旅客鉄道	100,000,000	108,360,000	
	４５　東京地下鉄	100,000,000	96,779,000	
	６４　阪急阪神ＨＬＤＧ	100,000,000	99,179,400	
	１５　九州旅客鉄道	200,000,000	198,847,800	
	３１　ＫＤＤＩ	200,000,000	199,414,000	
	５４６　中部電力	200,000,000	191,574,600	
	５５３　中部電力	200,000,000	199,169,800	
	５５０　関西電力	300,000,000	299,291,700	
	５６０　関西電力	200,000,000	204,925,600	
	５０８　東北電力	200,000,000	197,563,400	
	５４７　東北電力	100,000,000	98,874,200	
	４９６　九州電力	300,000,000	287,477,400	
	５６　東京電力ＰＧ	200,000,000	201,715,400	
	６６　東京電力ＰＧ	100,000,000	99,481,000	
	４１　大阪瓦斯	200,000,000	191,513,800	
	７　フアーストリテイリング	100,000,000	99,160,200	
	社債券　小計		7,069,628,000	
合　計			131,351,131,223	

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。

外国株式インデックス・マザーファンド

（１）貸借対照表

（単位：円）

	（2023年2月20日現在）	（2024年2月19日現在）
資産の部		
流動資産		
預金	6,810,869,309	12,351,920,465
金銭信託	25,870,400	131,822,113
コール・ローン	511,598,077	5,333,439,611

株式	447,345,580,983	662,139,159,724
投資証券	10,991,824,558	13,443,091,182
派生商品評価勘定	73,653,121	684,090,089
未収入金	146,885,647	3,995,018
未収配当金	526,630,908	737,901,232
差入委託証拠金	2,800,185,211	5,593,483,449
流動資産合計	469,233,098,214	700,418,902,883
資産合計	469,233,098,214	700,418,902,883
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	29,809,652	15,564,893
未払解約金	327,539,394	451,645,978
その他未払費用	2,482	2,693
流動負債合計	357,351,528	467,213,564
負債合計	357,351,528	467,213,564
純資産の部		
元本等		
元本	75,342,567,898	83,796,577,402
剰余金		
剰余金又は欠損金（△）	393,533,178,788	616,155,111,917
元本等合計	468,875,746,686	699,951,689,319
純資産合計	468,875,746,686	699,951,689,319
負債純資産合計	469,233,098,214	700,418,902,883

（２）注記表

(重要な会計方針の注記)

項　目	自 2023年2月21日 至 2024年2月19日
１．　有価証券の評価基準及び評価方法	株式、投資証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。 (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	(2023年2月20日現在)	(2024年2月19日現在)
1.　当計算期間の末日における受益権の総数	75,342,567,898口	83,796,577,402口
2.　1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額　6.2233円 (1万口当たりの純資産額62,233円)	1口当たり純資産額　8.3530円 (1万口当たりの純資産額83,530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2月21日 至 2024年2月19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 2 月 19 日現在）
1．　貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2．　時価の算定方法	(1) 有価証券（株式、投資証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。
3．　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。

（デリバティブ取引に関する注記）

（2023 年 2 月 20 日現在）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

（単位：円）

区　分	種　類	契　約　額　等		時　価	評価損益
			うち		

			1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建				
	S&P 500 EMINI FUT MAR23	7,905,483,534	－	7,913,727,000	8,243,466
	SPI 200 FUTURES MAR23	393,279,635	－	386,174,842	△7,104,793
	FTSE 100 IDX FUT MAR23	466,505,042	－	476,212,955	9,707,913
	EURO STOXX 50 MAR23	1,597,424,312	－	1,627,917,260	30,492,948
	小計	10,362,692,523	－	10,404,032,057	41,339,534
合　計		10,362,692,523	－	10,404,032,057	41,339,534

（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	224,229,369	－	227,189,742	2,960,373
	イギリス・ポンド	43,320,618	－	43,306,414	△14,204
	小計	267,549,987	－	270,496,156	2,946,169
	売建				
	イギリス・ポンド	16,066,830	－	16,157,210	△90,380
	ユーロ	109,717,874	－	110,069,727	△351,853
	小計	125,784,704	－	126,226,937	△442,233
合　計		393,334,691	－	396,723,093	2,503,936

(2024年2月19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 MAR24	18,752,037,783	－	19,279,695,168	527,657,385
	SPI 200 FUTURES MAR24	738,865,496	－	746,525,760	7,660,264
	FTSE 100 IDX FUT MAR24	996,118,279	－	1,004,383,406	8,265,127
	EURO STOXX 50 MAR24	3,347,433,048	－	3,479,804,955	132,371,907
	小計	23,834,454,606	－	24,510,409,289	675,954,683

合　計	23,834,454,606	－	24,510,409,289	675,954,683

（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	3,954,129,816	－	3,943,295,865	△10,833,951
	カナダ・ドル	151,970,815	－	152,471,142	500,327
	オーストラリア・ドル	138,394,917	－	139,570,184	1,175,267
	香港・ドル	42,726,845	－	42,555,094	△171,751
	イギリス・ポンド	223,567,889	－	223,389,612	△178,277
	スイス・フラン	122,979,487	－	123,428,025	448,538
	デンマーク・クローネ	50,351,619	－	50,469,315	117,696
	スウェーデン・クローナ	37,308,276	－	37,697,346	389,070
	ユーロ	448,158,949	－	449,282,543	1,123,594
	小計	5,169,588,613	－	5,162,159,126	△7,429,487
合　計		5,169,588,613	－	5,162,159,126	△7,429,487

（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 2 月 21 日 至 2024 年 2 月 19 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）

（2023 年 2 月 20 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	61,407,657,975 円
同期中における追加設定元本額	24,447,125,618 円
同期中における一部解約元本額	10,512,215,695 円
2023 年 2 月 20 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	37,413,562,738 円
三井住友・ＤＣ年金バランス３０（債券重点型）	295,274,961 円
三井住友・ＤＣ年金バランス５０（標準型）	1,115,344,973 円
三井住友・ＤＣ年金バランス７０（株式重点型）	815,354,615 円
ＳＭＡＭ・グローバルバランスファンド（機動的資産配分型）	34,670,931 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）	992,117 円
三井住友・ＤＣターゲットイヤーファンド２０２５（４資産タイプ）	5,457,854 円
三井住友・ＤＣターゲットイヤーファンド２０３０（４資産タイプ）	17,365,378 円
三井住友・ＤＣターゲットイヤーファンド２０３５（４資産タイプ）	51,071,386 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）	57,531,698 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）	108,600,216 円
外国株式指数ファンド	980,282,730 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	18,845,760,167 円
アセットアロケーション・ファンド（安定型）	139,776,013 円
アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）	174,586,158 円
アセットアロケーション・ファンド（成長型）	110,233,388 円
イオン・バランス戦略ファンド	24,288,448 円
三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０５０	23,707,090 円
三井住友・資産最適化ファンド（１安定重視型）	140,014,851 円
三井住友・資産最適化ファンド（２やや安定型）	125,293,120 円
三井住友・資産最適化ファンド（３バランス型）	467,911,037 円
三井住友・資産最適化ファンド（４やや成長型）	254,195,375 円
三井住友・資産最適化ファンド（５成長重視型）	292,755,170 円
三井住友・ＤＣつみたてＮＩＳＡ・世界分散ファンド	59,105,049 円
三井住友ＤＳ・外国株式インデックス年金ファンド	1,855,764,128 円
三井住友ＤＳ・年金バランス３０（債券重点型）	11,428,893 円
三井住友ＤＳ・年金バランス５０（標準型）	52,455,481 円
三井住友ＤＳ・年金バランス７０（株式重点型）	47,972,323 円

三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０６０	3,087,533 円
ＳＭＢＣ・ＤＣインデックスファンド（ＭＳＣＩコクサイ）	534,084,201 円
日興ＦＷＳ・先進国株インデックス（為替ヘッジあり）	317,177,107 円
日興ＦＷＳ・先進国株インデックス（為替ヘッジなし）	1,706,143,742 円
三井住友ＤＳ・先進国株式インデックス・ファンド	52,963,147 円
三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０３５	22,505 円
三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０４０	27,108 円
三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０４５	33,586 円
三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０５５	39,724 円
三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０６５	39,724 円
ＳＭＡＭ・外国株式パッシブ・ファンド（適格機関投資家専用）	424,161,823 円
バランスファンドＶＡ（安定運用型）＜適格機関投資家限定＞	2,738,893 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＞	18,997,417 円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ２５＜適格機関投資家専用＞	494,761,087 円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ３７．５＜適格機関投資家専用＞	683,818,913 円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ５０＜適格機関投資家専用＞	2,995,512,553 円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＬ３０＜適格機関投資家限定＞	9,822,476 円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＬ５０＜適格機関投資家限定＞	48,949,181 円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ７５＜適格機関投資家専用＞	415,329,798 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＞	36,093,954 円
ＳＭＡＭ・インデックス・バランスＶＡ２５＜適格機関投資家専用＞	87,142,750 円
ＳＭＡＭ・インデックス・バランスＶＡ５０＜適格機関投資家専用＞	418,011,926 円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ４０＜適格機関投資家専用＞	287,214,833 円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ３５＜適格機関投資家専用＞	660,368,254 円
ＳＭＡＭ・バランスＶＡ株４０Ｔ＜適格機関投資家限定＞	195,290 円
三井住友・外国株式インデックスファンド・ＶＡＳ（適格機関投資家専用）	190,859,012 円
ＳＭＡＭ・グローバルバランス４０ＶＡ＜適格機関投資家限定＞	58,376,901 円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２０Ａ＜適格機関投資家専用＞	7,134,203 円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ３５Ａ＜適格機関投資家専用＞	6,599,547 円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ５０Ａ＜適格機関投資家専用＞	3,833,026 円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２０Ｌ＜適格機関投資家専用＞	16,687,253 円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２５Ｌ＜適格機関投資家専用＞	51,140,413 円
ＳＭＡＭ・グローバルバランスファンド（標準型）ＶＡ＜適格機関投資家限定＞	105,383,191 円
ＳＭＡＭ・グローバルバランスファンド（債券重視型）ＶＡ＜適格機関投資家限定＞	44,957,268 円
ＳＭＡＭ・世界バランスファンドＶＡ＜適格機関投資家限定＞	259,817,292 円
ＳＭＡＭ・世界バランスファンドＶＡ２＜適格機関投資家限定＞	72,627,493 円
ＳＭＡＭ・外国株式インデックスファンドＳＡ＜適格機関投資家限定＞	1,506,053,315 円
ＳＭＡＭ・年金Ｗリスクコントロールファンド＜適格機関投資家限定＞	15,290,739 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＞	9,454,653 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＞	12,173,583 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＞	264,686,196 円
合　計	75,342,567,898 円

（2024年2月19日現在）	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	75,342,567,898円
同期中における追加設定元本額	16,727,098,331円
同期中における一部解約元本額	8,273,088,827円
2024年2月19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	41,950,087,554円
三井住友・ＤＣ年金バランス３０（債券重点型）	262,630,320円
三井住友・ＤＣ年金バランス５０（標準型）	1,017,359,735円
三井住友・ＤＣ年金バランス７０（株式重点型）	793,921,765円
ＳＭＡＭ・グローバルバランスファンド（機動的資産配分型）	41,980,477円
三井住友・ＤＣターゲットイヤーファンド２０２０（４資産タイプ）	765,630円
三井住友・ＤＣターゲットイヤーファンド２０２５（４資産タイプ）	3,909,208円
三井住友・ＤＣターゲットイヤーファンド２０３０（４資産タイプ）	13,730,815円
三井住友・ＤＣターゲットイヤーファンド２０３５（４資産タイプ）	43,433,433円
三井住友・ＤＣターゲットイヤーファンド２０４０（４資産タイプ）	51,991,661円
三井住友・ＤＣターゲットイヤーファンド２０４５（４資産タイプ）	109,626,387円
外国株式指数ファンド	1,063,149,405円
三井住友・ＤＣつみたてＮＩＳＡ・全海外株インデックスファンド	22,482,800,807円
アセットアロケーション・ファンド（安定型）	105,225,014円
アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）	141,241,547円
アセットアロケーション・ファンド（成長型）	83,174,042円
イオン・バランス戦略ファンド	15,329,934円
三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０５０	27,632,950円
三井住友・資産最適化ファンド（１安定重視型）	141,442,290円
三井住友・資産最適化ファンド（２やや安定型）	132,982,852円
三井住友・資産最適化ファンド（３バランス型）	518,632,989円
三井住友・資産最適化ファンド（４やや成長型）	316,103,384円
三井住友・資産最適化ファンド（５成長重視型）	434,198,025円
三井住友・ＤＣつみたてＮＩＳＡ・世界分散ファンド	63,447,082円
三井住友ＤＳ・外国株式インデックス年金ファンド	2,564,847,357円
三井住友ＤＳ・年金バランス３０（債券重点型）	11,112,507円
三井住友ＤＳ・年金バランス５０（標準型）	57,377,889円
三井住友ＤＳ・年金バランス７０（株式重点型）	57,867,009円
三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０６０	2,612,550円
ＳＭＢＣ・ＤＣインデックスファンド（ＭＳＣＩコクサイ）	1,311,446,447円
日興ＦＷＳ・先進国株インデックス（為替ヘッジあり）	194,246,366円
日興ＦＷＳ・先進国株インデックス（為替ヘッジなし）	2,780,840,810円
三井住友ＤＳ・先進国株式インデックス・ファンド	136,551,619円
三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０３５	2,851,196円
三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０４０	1,779,098円
三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０４５	2,540,163円

三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０５５	736,750 円
三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０６５	484,201 円
三井住友ＤＳ・ＦＷ専用ポートフォリオ・レベル１（保守型）	141,347 円
三井住友ＤＳ・ＦＷ専用ポートフォリオ・レベル２（安定型）	2,481,010 円
三井住友ＤＳ・ＦＷ専用ポートフォリオ・レベル３（安定成長型）	11,849,023 円
三井住友ＤＳ・ＦＷ専用ポートフォリオ・レベル４（成長型）	7,739,434 円
三井住友ＤＳ・ＦＷ専用ポートフォリオ・レベル５（積極成長型）	3,630,417 円
ＳＭＡＭ・外国株式パッシブ・ファンド（適格機関投資家専用）	293,252,354 円
バランスファンドＶＡ（安定運用型）＜適格機関投資家限定＞	2,629,155 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＞	11,708,833 円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ２５＜適格機関投資家専用＞	312,589,377 円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ３７．５＜適格機関投資家専用＞	536,671,089 円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ５０＜適格機関投資家専用＞	2,350,373,208 円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＬ３０＜適格機関投資家限定＞	8,008,470 円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＬ５０＜適格機関投資家限定＞	38,792,047 円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ７５＜適格機関投資家専用＞	367,312,416 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＞	27,381,353 円
ＳＭＡＭ・インデックス・バランスＶＡ２５＜適格機関投資家専用＞	67,281,388 円
ＳＭＡＭ・インデックス・バランスＶＡ５０＜適格機関投資家専用＞	344,123,372 円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ４０＜適格機関投資家専用＞	218,967,456 円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ３５＜適格機関投資家専用＞	486,198,208 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）	177,759,864 円
ＳＭＡＭ・グローバルバランス４０ＶＡ＜適格機関投資家限定＞	42,092,664 円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２０Ａ＜適格機関投資家専用＞	5,291,801 円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ３５Ａ＜適格機関投資家専用＞	5,585,430 円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ５０Ａ＜適格機関投資家専用＞	3,341,135 円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２０Ｌ＜適格機関投資家専用＞	11,984,085 円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２５Ｌ＜適格機関投資家専用＞	39,570,413 円
ＳＭＡＭ・グローバルバランスファンド（標準型）ＶＡ＜適格機関投資家限定＞	80,441,373 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＞	32,878,200 円
ＳＭＡＭ・世界バランスファンドＶＡ＜適格機関投資家限定＞	132,919,956 円
ＳＭＡＭ・世界バランスファンドＶＡ２＜適格機関投資家限定＞	48,871,271 円
ＳＭＡＭ・外国株式インデックスファンドＳＡ＜適格機関投資家限定＞	982,704,790 円
ＳＭＡＭ・年金Wリスクコントロールファンド＜適格機関投資家限定＞	20,499,655 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＞	9,331,767 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＞	15,020,973 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＞	113,869,349 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＞	43,193,451 円
合　計	83,796,577,402 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	31.570	871,584.56	
	BAKER HUGHES CO	78,082	29.150	2,276,090.30	
	CHENIERE ENERGY INC	17,754	160.370	2,847,208.98	
	CHESAPEAKE ENERGY CORP	7,695	78.730	605,827.35	
	CHEVRON CORP	140,288	154.630	21,692,733.44	
	CONOCOPHILLIPS	91,705	110.570	10,139,821.85	
	COTERRA ENERGY INC	59,741	24.680	1,474,407.88	
	DEVON ENERGY CORP	49,897	43.460	2,168,523.62	
	DIAMONDBACK ENERGY INC	13,065	179.420	2,344,122.30	
	EOG RESOURCES INC	43,830	113.560	4,977,334.80	
	EQT CORP	33,522	34.700	1,163,213.40	
	EXXON MOBIL CORP	309,108	103.730	32,063,772.84	
	HALLIBURTON CO	67,581	35.310	2,386,285.11	
	HESS CORP	21,198	148.430	3,146,419.14	
	HF SINCLAIR CORP	10,663	60.110	640,952.93	
	KINDER MORGAN INC	156,197	17.110	2,672,530.67	
	MARATHON OIL CORP	42,380	23.380	990,844.40	
	MARATHON PETROLEUM CORP	31,150	170.010	5,295,811.50	
	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	51,961	60.520	3,144,679.72	
	ONEOK INC	43,615	71.990	3,139,843.85	
	OVINTIV INC	23,075	44.830	1,034,452.25	
	PHILLIPS 66	33,814	143.810	4,862,791.34	
	PIONEER NATURAL RESOURCES CO	17,516	231.570	4,056,180.12	
	SCHLUMBERGER LTD	110,157	48.570	5,350,325.49	
	TARGA RESOURCES CORP	15,416	96.940	1,494,427.04	
	TEXAS PACIFIC LAND CORP	417	1,511.810	630,424.77	
	VALERO ENERGY CORP	26,805	139.540	3,740,369.70	
	WILLIAMS COS INC	92,048	34.310	3,158,166.88	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	17,056	226.850	3,869,153.60	
	ALBEMARLE CORP	8,338	122.590	1,022,155.42	
	AMCOR PLC	122,899	9.040	1,111,006.96	
	AVERY DENNISON CORP	6,759	208.830	1,411,481.97	
	BALL CORP	23,469	62.090	1,457,190.21	
	CELANESE CORP	8,742	151.060	1,320,566.52	
	CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	14,020	77.700	1,089,354.00	
	CLEVELAND-CLIFFS INC	33,403	19.870	663,717.61	

CORTEVA INC	53,900	54.800	2,953,720.00	
CROWN HOLDINGS INC	9,413	72.260	680,183.38	
DOW INC	53,862	55.480	2,988,263.76	
DUPONT DE NEMOURS INC	34,201	68.450	2,341,058.45	
EASTMAN CHEMICAL CO	9,517	85.190	810,753.23	
ECOLAB INC	19,574	215.380	4,215,848.12	
FMC CORP	8,548	52.340	447,402.32	
FREEPORT-MCMORAN INC	113,312	38.830	4,399,904.96	
INTERNATIONAL PAPER CO	23,472	35.800	840,297.60	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	20,983	81.190	1,703,609.77	
LINDE PLC	37,809	431.630	16,319,498.67	
LYONDELLBASELL INDU-CL A	19,214	97.700	1,877,207.80	
MARTIN MARIETTA MATERIALS	4,759	539.870	2,569,241.33	
MOSAIC CO/THE	25,489	30.550	778,688.95	
NEWMONT CORP	86,338	33.430	2,886,279.34	
NUCOR CORP	18,997	185.580	3,525,463.26	
PACKAGING CORP OF AMERICA	7,111	167.980	1,194,505.78	
PPG INDUSTRIES INC	18,754	141.910	2,661,380.14	
RELIANCE STEEL & ALUMINUM	4,056	326.430	1,324,000.08	
RPM INTERNATIONAL INC	10,397	108.440	1,127,450.68	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	19,206	309.080	5,936,190.48	
STEEL DYNAMICS INC	12,713	123.340	1,568,021.42	
VULCAN MATERIALS CO	9,892	255.150	2,523,943.80	
WESTLAKE CORP	2,189	144.150	315,544.35	
WESTROCK CO	16,766	43.710	732,841.86	
3M CO	42,482	91.250	3,876,482.50	
AECOM	10,261	89.190	915,178.59	
AERCAP HOLDINGS NV	15,382	77.640	1,194,258.48	
ALLEGION PLC	6,843	132.420	906,150.06	
AMETEK INC	18,518	173.890	3,220,095.02	
AXON ENTERPRISE INC	5,927	269.800	1,599,104.60	
BOEING CO/THE	43,359	203.890	8,840,466.51	
BUILDERS FIRSTSOURCE INC	9,801	183.790	1,801,325.79	
CARLISLE COS INC	3,499	341.920	1,196,378.08	
CARRIER GLOBAL CORP	66,639	54.000	3,598,506.00	
CATERPILLAR INC	39,051	321.910	12,570,907.41	
CNH INDUSTRIAL NV	87,561	12.150	1,063,866.15	
CUMMINS INC	11,429	266.480	3,045,599.92	
DEERE & CO	20,718	360.680	7,472,568.24	
DOVER CORP	10,436	161.460	1,684,996.56	
EATON CORP PLC	30,454	277.520	8,451,594.08	
EMERSON ELECTRIC CO	45,278	106.150	4,806,259.70	

FASTENAL CO	41,551	70.240	2,918,542.24	
FERGUSON PLC	16,077	198.990	3,199,162.23	
FORTIVE CORP	25,083	84.320	2,114,998.56	
FORTUNE BRANDS INNOVATIONS I	10,648	79.310	844,492.88	
GENERAL DYNAMICS CORP	17,778	269.440	4,790,104.32	
GENERAL ELECTRIC CO	82,651	149.160	12,328,223.16	
GRACO INC	11,645	88.150	1,026,506.75	
HEICO CORP	3,085	194.010	598,520.85	
HEICO CORP-CLASS A	6,593	157.190	1,036,353.67	
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	50,521	197.170	9,961,225.57	
HOWMET AEROSPACE INC	27,783	62.820	1,745,328.06	
HUBBELL INC	3,897	358.880	1,398,555.36	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	2,888	285.090	823,339.92	
IDEX CORP	6,048	227.470	1,375,738.56	
ILLINOIS TOOL WORKS	23,264	253.920	5,907,194.88	
INGERSOLL-RAND INC	29,314	89.470	2,622,723.58	
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	11,600	41.320	479,312.00	
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	52,470	56.860	2,983,444.20	
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	14,388	211.980	3,049,968.24	
LENNOX INTERNATIONAL INC	2,750	448.410	1,233,127.50	
LOCKHEED MARTIN CORP	17,095	424.070	7,249,476.65	
MASCO CORP	19,187	73.160	1,403,720.92	
NORDSON CORP	3,927	264.070	1,037,002.89	
NORTHROP GRUMMAN CORP	10,937	450.960	4,932,149.52	
OTIS WORLDWIDE CORP	31,838	91.240	2,904,899.12	
OWENS CORNING	7,597	139.950	1,063,200.15	
PACCAR INC	39,980	107.770	4,308,644.60	
PARKER HANNIFIN CORP	9,607	520.060	4,996,216.42	
PENTAIR PLC	11,509	74.920	862,254.28	
QUANTA SERVICES INC	11,797	211.440	2,494,357.68	
ROCKWELL AUTOMATION INC	8,678	279.720	2,427,410.16	
RTX CORP	110,909	91.010	10,093,828.09	
SMITH (A.O.) CORP	10,652	80.090	853,118.68	
SNAP-ON INC	4,041	267.240	1,079,916.84	
STANLEY BLACK & DECKER INC	10,869	88.350	960,276.15	
TEXTRON INC	14,870	85.690	1,274,210.30	
TORO CO	8,097	93.760	759,174.72	
TRANE TECHNOLOGIES PLC	17,225	272.170	4,688,128.25	
TRANSDIGM GROUP INC	4,165	1,146.390	4,774,714.35	
UNITED RENTALS INC	5,383	650.310	3,500,618.73	
VERTIV HOLDINGS CO-A	28,880	62.970	1,818,573.60	
WABTEC CORP	12,782	134.280	1,716,366.96	

WATSCO INC	2,364	381.460	901,771.44	
WW GRAINGER INC	3,504	935.800	3,279,043.20	
XYLEM INC	19,463	123.790	2,409,324.77	
AUTOMATIC DATA PROCESSING	31,788	252.970	8,041,410.36	
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	10,637	145.590	1,548,640.83	
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO	8,963	197.920	1,773,956.96	
CINTAS CORP	6,998	614.660	4,301,390.68	
COPART INC	67,779	48.960	3,318,459.84	
DAYFORCE INC	10,485	73.260	768,131.10	
EQUIFAX INC	9,133	258.080	2,357,044.64	
JACOBS SOLUTIONS INC	10,393	147.540	1,533,383.22	
LEIDOS HOLDINGS INC	8,863	123.830	1,097,505.29	
PAYCHEX INC	24,917	123.380	3,074,259.46	
PAYCOM SOFTWARE INC	3,778	190.820	720,917.96	
PAYLOCITY HOLDING CORP	2,718	177.390	482,146.02	
REPUBLIC SERVICES INC	17,805	180.430	3,212,556.15	
ROBERT HALF INC	8,149	80.840	658,765.16	
ROLLINS INC	25,137	41.050	1,031,873.85	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	19,314	63.460	1,225,666.44	
TRANSUNION	14,503	75.070	1,088,740.21	
VERALTO CORP	17,640	86.090	1,518,627.60	
VERISK ANALYTICS INC	11,354	244.700	2,778,323.80	
WASTE CONNECTIONS INC	20,167	167.870	3,385,434.29	
WASTE MANAGEMENT INC	31,845	201.540	6,418,041.30	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	8,726	72.250	630,453.50	
CSX CORP	154,835	36.720	5,685,541.20	
DELTA AIR LINES INC	14,192	40.120	569,383.04	
EXPEDITORS INTL WASH INC	10,436	124.160	1,295,733.76	
FEDEX CORP	18,074	237.590	4,294,201.66	
GRAB HOLDINGS LTD - CL A	159,485	3.530	562,982.05	
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	6,308	211.700	1,335,403.60	
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	12,089	56.820	686,896.98	
NORFOLK SOUTHERN CORP	17,033	252.040	4,292,997.32	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	7,677	423.450	3,250,825.65	
SOUTHWEST AIRLINES CO	14,057	33.930	476,954.01	
UBER TECHNOLOGIES INC	143,350	78.410	11,240,073.50	
U-HAUL HOLDING CO-NON VOTING	5,850	65.350	382,297.50	
UNION PACIFIC CORP	46,789	246.590	11,537,699.51	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	55,802	148.410	8,281,574.82	
APTIV PLC	21,117	78.960	1,667,398.32	
BORGWARNER INC	17,433	30.610	533,624.13	
FORD MOTOR CO	299,200	12.300	3,680,160.00	

GENERAL MOTORS CO	104,301	38.700	4,036,448.70	
LEAR CORP	3,736	136.300	509,216.80	
LUCID GROUP INC	82,293	3.710	305,307.03	
RIVIAN AUTOMOTIVE INC-A	45,698	16.300	744,877.40	
TESLA INC	220,044	199.950	43,997,797.80	
DECKERS OUTDOOR CORP	1,872	862.980	1,615,498.56	
DR HORTON INC	24,030	141.270	3,394,718.10	
GARMIN LTD	10,774	122.200	1,316,582.80	
HASBRO INC	11,407	50.780	579,247.46	
LENNAR CORP-A	19,331	150.220	2,903,902.82	
LULULEMON ATHLETICA INC	9,037	449.600	4,063,035.20	
NIKE INC -CL B	93,516	103.510	9,679,841.16	
NVR INC	250	7,390.650	1,847,662.50	
PULTEGROUP INC	17,535	101.450	1,778,925.75	
VF CORP	20,583	16.650	342,706.95	
AIRBNB INC-CLASS A	33,688	152.510	5,137,756.88	
BOOKING HOLDINGS INC	2,747	3,716.840	10,210,159.48	
CAESARS ENTERTAINMENT INC	15,881	42.510	675,101.31	
CARNIVAL CORP	84,815	14.800	1,255,262.00	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	2,100	2,598.430	5,456,703.00	
DARDEN RESTAURANTS INC	9,323	162.460	1,514,614.58	
DOMINO'S PIZZA INC	2,875	421.850	1,212,818.75	
DOORDASH INC - A	20,142	116.010	2,336,673.42	
DRAFTKINGS INC-CL A	32,265	44.570	1,438,051.05	
EXPEDIA GROUP INC	10,081	135.250	1,363,455.25	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	20,092	197.570	3,969,576.44	
HYATT HOTELS CORP - CL A	3,371	132.830	447,769.93	
LAS VEGAS SANDS CORP	27,977	55.250	1,545,729.25	
MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A	19,665	241.630	4,751,653.95	
MCDONALD'S CORP	56,399	292.020	16,469,635.98	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	22,198	42.540	944,302.92	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	19,234	116.090	2,232,875.06	
STARBUCKS CORP	87,125	93.220	8,121,792.50	
VAIL RESORTS INC	2,860	225.480	644,872.80	
WYNN RESORTS LTD	7,730	105.130	812,654.90	
YUM! BRANDS INC	22,535	134.550	3,032,084.25	
AMAZON.COM INC	714,284	169.510	121,078,280.84	
AUTOZONE INC	1,423	2,727.830	3,881,702.09	
BATH & BODY WORKS INC	15,400	45.400	699,160.00	
BEST BUY CO INC	14,954	73.750	1,102,857.50	
BURLINGTON STORES INC	4,802	195.170	937,206.34	
CARMAX INC	10,366	71.880	745,108.08	

DICK'S SPORTING GOODS INC	4,406	169.150	745,274.90	
EBAY INC	40,534	43.450	1,761,202.30	
ETSY INC	9,090	76.570	696,021.30	
GENUINE PARTS CO	10,245	142.930	1,464,317.85	
GLOBAL-E ONLINE LTD	8,896	40.980	364,558.08	
HOME DEPOT INC	77,200	362.350	27,973,420.00	
LKQ CORP	18,982	50.040	949,859.28	
LOWE'S COS INC	43,814	226.850	9,939,205.90	
MERCADOLIBRE INC	3,384	1,768.780	5,985,551.52	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	4,512	1,051.050	4,742,337.60	
POOL CORP	3,252	387.300	1,259,499.60	
ROSS STORES INC	26,967	144.080	3,885,405.36	
TJX COMPANIES INC	88,167	98.040	8,643,892.68	
TRACTOR SUPPLY COMPANY	8,071	236.490	1,908,710.79	
ULTA BEAUTY INC	3,734	532.090	1,986,824.06	
ALBERTSONS COS INC - CLASS A	31,907	21.580	688,553.06	
COSTCO WHOLESALE CORP	34,016	723.990	24,627,243.84	
DOLLAR GENERAL CORP	15,800	141.500	2,235,700.00	
DOLLAR TREE INC	15,923	143.370	2,282,880.51	
KROGER CO	49,890	47.640	2,376,759.60	
SYSCO CORP	39,957	79.500	3,176,581.50	
TARGET CORP	36,380	149.610	5,442,811.80	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	52,808	21.980	1,160,719.84	
WALMART INC	114,542	170.360	19,513,375.12	
ALTRIA GROUP INC	134,504	40.180	5,404,370.72	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	42,289	53.650	2,268,804.85	
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	22,643	57.870	1,310,350.41	
BUNGE GLOBAL SA	12,343	91.680	1,131,606.24	
CAMPBELL SOUP CO	12,945	41.450	536,570.25	
CELSIUS HOLDINGS INC	11,375	64.410	732,663.75	
COCA-COLA CO/THE	317,240	59.390	18,840,883.60	
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	15,803	67.600	1,068,282.80	
CONAGRA BRANDS INC	39,722	27.210	1,080,835.62	
CONSTELLATION BRANDS INC-A	12,701	243.840	3,097,011.84	
DARLING INGREDIENTS INC	10,514	42.610	448,001.54	
GENERAL MILLS INC	46,029	64.100	2,950,458.90	
HERSHEY CO/THE	11,180	191.160	2,137,168.80	
HORMEL FOODS CORP	25,536	28.990	740,288.64	
JM SMUCKER CO/THE	8,172	124.090	1,014,063.48	
KELLANOVA	19,503	55.470	1,081,831.41	
KEURIG DR PEPPER INC	80,434	30.970	2,491,040.98	
KRAFT HEINZ CO/THE	62,228	34.810	2,166,156.68	

LAMB WESTON HOLDINGS INC	10,534	101.230	1,066,356.82	
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	18,425	66.150	1,218,813.75	
MOLSON COORS BEVERAGE CO - B	16,433	62.150	1,021,310.95	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	104,920	71.980	7,552,141.60	
MONSTER BEVERAGE CORP	60,052	55.020	3,304,061.04	
PEPSICO INC	106,412	166.320	17,698,443.84	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	120,632	89.650	10,814,658.80	
TYSON FOODS INC-CL A	19,731	53.120	1,048,110.72	
CHURCH & DWIGHT CO INC	19,954	97.780	1,951,102.12	
CLOROX COMPANY	9,104	151.050	1,375,159.20	
COLGATE-PALMOLIVE CO	58,956	83.480	4,921,646.88	
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	17,009	146.370	2,489,607.33	
KENVUE INC	136,817	19.050	2,606,363.85	
KIMBERLY-CLARK CORP	25,378	118.290	3,001,963.62	
PROCTER & GAMBLE CO/THE	181,943	157.510	28,657,841.93	
ABBOTT LABORATORIES	134,472	114.010	15,331,152.72	
ALIGN TECHNOLOGY INC	5,703	308.770	1,760,915.31	
BAXTER INTERNATIONAL INC	39,241	41.220	1,617,514.02	
BECTON DICKINSON AND CO	22,525	240.760	5,423,119.00	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	113,309	65.820	7,457,998.38	
CARDINAL HEALTH INC	18,000	104.450	1,880,100.00	
CENCORA INC	13,560	231.720	3,142,123.20	
CENTENE CORP	40,300	78.740	3,173,222.00	
COOPER COS INC/THE	3,384	372.010	1,258,881.84	
CVS HEALTH CORP	100,326	77.100	7,735,134.60	
DAVITA INC	4,138	122.220	505,746.36	
DEXCOM INC	30,245	117.050	3,540,177.25	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	47,943	86.100	4,127,892.30	
ELEVANCE HEALTH INC	18,135	512.630	9,296,545.05	
GE HEALTHCARE TECHNOLOGY	31,160	86.020	2,680,383.20	
HCA HEALTHCARE INC	16,132	308.550	4,977,528.60	
HENRY SCHEIN INC	10,457	75.650	791,072.05	
HOLOGIC INC	19,730	73.790	1,455,876.70	
HUMANA INC	9,498	366.920	3,485,006.16	
IDEXX LABORATORIES INC	6,610	555.540	3,672,119.40	
INSULET CORP	5,082	191.010	970,712.82	
INTUITIVE SURGICAL INC	26,647	378.630	10,089,353.61	
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	6,245	216.640	1,352,916.80	
MCKESSON CORP	10,067	511.060	5,144,841.02	
MEDTRONIC PLC	101,168	84.420	8,540,602.56	
MOLINA HEALTHCARE INC	4,673	401.720	1,877,237.56	
QUEST DIAGNOSTICS INC	7,645	124.000	947,980.00	

RESMED INC	10,758	180.460	1,941,388.68	
STERIS PLC	7,525	231.230	1,740,005.75	
STRYKER CORP	26,349	349.300	9,203,705.70	
TELEFLEX INC	3,067	251.070	770,031.69	
THE CIGNA GROUP	22,335	341.090	7,618,245.15	
UNITEDHEALTH GROUP INC	71,409	521.550	37,243,363.95	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	4,203	162.160	681,558.48	
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	12,279	219.350	2,693,398.65	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	15,537	124.710	1,937,619.27	
ABBVIE INC	136,402	177.490	24,209,990.98	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	23,121	134.840	3,117,635.64	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	9,171	147.000	1,348,137.00	
AMGEN INC	41,525	283.700	11,780,642.50	
AVANTOR INC	56,039	23.760	1,331,486.64	
BIOGEN INC	11,114	219.080	2,434,855.12	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	13,832	88.770	1,227,866.64	
BIO-RAD LABORATORIES-A	1,728	340.520	588,418.56	
BIO-TECHNE CORP	13,296	71.610	952,126.56	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	159,354	49.860	7,945,390.44	
CATALENT INC	16,025	58.140	931,693.50	
CHARLES RIVER LABORATORIES	3,467	244.960	849,276.32	
DANAHER CORP	54,461	250.000	13,615,250.00	
ELI LILLY & CO	62,199	782.060	48,643,349.94	
EXACT SCIENCES CORP	13,570	60.970	827,362.90	
GILEAD SCIENCES INC	96,170	71.580	6,883,848.60	
ILLUMINA INC	11,573	143.410	1,659,683.93	
INCYTE CORP	15,899	57.960	921,506.04	
IQVIA HOLDINGS INC	14,439	238.600	3,445,145.40	
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	4,089	126.780	518,403.42	
JOHNSON & JOHNSON	185,814	156.550	29,089,181.70	
MERCK & CO. INC.	195,998	127.790	25,046,584.42	
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	1,691	1,187.440	2,007,961.04	
MODERNA INC	23,790	88.370	2,102,322.30	
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	6,359	132.310	841,359.29	
PFIZER INC	431,583	27.620	11,920,322.46	
REGENERON PHARMACEUTICALS	8,098	948.050	7,677,308.90	
REPLIGEN CORP	3,456	208.420	720,299.52	
REVVITY INC	10,411	102.460	1,066,711.06	
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	27,162	29.920	812,687.04	
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	82,214	13.020	1,070,426.28	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	29,531	547.840	16,178,263.04	
UNITED THERAPEUTICS CORP	3,537	214.730	759,500.01	

VERTEX PHARMACEUTICALS INC	20,131	422.200	8,499,308.20	
VIATRIS INC	83,466	13.060	1,090,065.96	
WATERS CORP	4,095	325.210	1,331,734.95	
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	5,276	362.050	1,910,175.80	
ZOETIS INC	36,026	188.390	6,786,938.14	
BANK OF AMERICA CORP	553,387	34.090	18,864,962.83	
CITIGROUP INC	150,445	54.850	8,251,908.25	
CITIZENS FINANCIAL GROUP	36,122	31.560	1,140,010.32	
FIFTH THIRD BANCORP	49,541	33.930	1,680,926.13	
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	845	1,514.990	1,280,166.55	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	105,007	12.870	1,351,440.09	
JPMORGAN CHASE & CO	223,370	179.030	39,989,931.10	
KEYCORP	62,741	14.070	882,765.87	
M & T BANK CORP	12,629	138.310	1,746,716.99	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	30,337	148.850	4,515,662.45	
REGIONS FINANCIAL CORP	79,089	18.480	1,461,564.72	
TRUIST FINANCIAL CORP	101,687	36.100	3,670,900.70	
US BANCORP	116,120	41.490	4,817,818.80	
WELLS FARGO & CO	283,753	51.910	14,729,618.23	
ALLY FINANCIAL INC	20,139	35.980	724,601.22	
AMERICAN EXPRESS CO	47,398	212.560	10,074,918.88	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	7,978	397.800	3,173,648.40	
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	31,181	112.710	3,514,410.51	
ARES MANAGEMENT CORP - A	11,370	134.970	1,534,608.90	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	61,100	55.150	3,369,665.00	
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	100,857	405.990	40,946,933.43	
BLACKROCK INC	11,327	794.000	8,993,638.00	
BLACKSTONE INC	53,294	127.890	6,815,769.66	
BLOCK INC	43,616	65.640	2,862,954.24	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	29,775	137.230	4,086,023.25	
CARLYLE GROUP INC/THE	16,730	44.580	745,823.40	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	7,323	186.690	1,367,130.87	
CME GROUP INC	28,301	212.260	6,007,170.26	
COINBASE GLOBAL INC -CLASS A	13,634	180.310	2,458,346.54	
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	18,645	110.490	2,060,086.05	
EQUITABLE HOLDINGS INC	22,820	34.210	780,672.20	
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	2,946	458.420	1,350,505.32	
FIDELITY NATIONAL INFO SERV	47,604	63.650	3,029,994.60	
FISERV INC	46,955	148.040	6,951,218.20	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	5,089	271.620	1,382,274.18	
FRANKLIN RESOURCES INC	21,778	27.270	593,886.06	
FUTU HOLDINGS LTD-ADR	6,533	52.285	341,577.90	

GLOBAL PAYMENTS INC	20,594	134.190	2,763,508.86	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	24,977	384.440	9,602,157.88	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	44,499	137.120	6,101,702.88	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	4,971	172.480	857,398.08	
KKR & CO INC	45,385	95.660	4,341,529.10	
LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	6,164	257.660	1,588,216.24	
MARKETAXESS HOLDINGS INC	2,653	219.040	581,113.12	
MASTERCARD INC - A	64,946	468.130	30,403,170.98	
MOODY'S CORP	12,518	370.760	4,641,173.68	
MORGAN STANLEY	96,914	86.500	8,383,061.00	
MSCI INC	6,223	568.750	3,539,331.25	
NASDAQ INC	27,999	55.420	1,551,704.58	
NORTHERN TRUST CORP	16,793	79.950	1,342,600.35	
PAYPAL HOLDINGS INC	80,330	59.140	4,750,716.20	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	14,529	118.490	1,721,541.21	
ROBINHOOD MARKETS INC - A	31,965	14.000	447,510.00	
S&P GLOBAL INC	24,887	423.570	10,541,386.59	
SCHWAB (CHARLES) CORP	116,344	64.400	7,492,553.60	
SEI INVESTMENTS COMPANY	7,550	65.870	497,318.50	
STATE STREET CORP	25,474	72.490	1,846,610.26	
SYNCHRONY FINANCIAL	32,112	39.560	1,270,350.72	
T ROWE PRICE GROUP INC	17,303	108.860	1,883,604.58	
TOAST INC-CLASS A	21,393	22.420	479,631.06	
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	8,688	101.510	881,918.88	
VISA INC-CLASS A SHARES	123,942	278.560	34,525,283.52	
AFLAC INC	44,628	79.380	3,542,570.64	
ALLSTATE CORP	20,503	161.780	3,316,975.34	
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	4,866	123.440	600,659.04	
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	55,264	70.040	3,870,690.56	
AON PLC-CLASS A	15,769	311.240	4,907,943.56	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	29,061	86.110	2,502,442.71	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	16,577	239.220	3,965,549.94	
ASSURANT INC	3,114	173.720	540,964.08	
BROWN & BROWN INC	18,424	82.690	1,523,480.56	
CHUBB LTD	31,161	250.900	7,818,294.90	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	13,251	111.860	1,482,256.86	
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	2,244	359.810	807,413.64	
EVEREST GROUP LTD	3,547	367.870	1,304,834.89	
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	19,058	52.390	998,448.62	
GLOBE LIFE INC	6,373	125.530	800,002.69	
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	21,767	93.060	2,025,637.02	
LOEWS CORP	12,727	74.340	946,125.18	

MARKEL GROUP INC	957	1,461.500	1,398,655.50	
MARSH & MCLENNAN COS	38,094	200.300	7,630,228.20	
METLIFE INC	47,592	68.770	3,272,901.84	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	19,458	80.040	1,557,418.32	
PROGRESSIVE CORP	44,405	189.090	8,396,541.45	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	27,229	107.280	2,921,127.12	
TRAVELERS COS INC/THE	18,256	217.530	3,971,227.68	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	7,897	277.310	2,189,917.07	
WR BERKLEY CORP	14,486	82.610	1,196,688.46	
ACCENTURE PLC-CL A	48,593	369.480	17,954,141.64	
ADOBE INC	34,737	546.660	18,989,328.42	
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	10,300	109.190	1,124,657.00	
ANSYS INC	6,763	329.850	2,230,775.55	
ASPEN TECHNOLOGY INC	1,901	182.750	347,407.75	
ATLASSIAN CORP-CL A	12,421	207.840	2,581,580.64	
AUTODESK INC	16,146	258.300	4,170,511.80	
BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	18,166	53.160	965,704.56	
BILL HOLDINGS INC	6,004	63.490	381,193.96	
CADENCE DESIGN SYS INC	20,318	290.300	5,898,315.40	
CHECK POINT SOFTWARE TECH	7,561	162.770	1,230,703.97	
CLOUDFLARE INC - CLASS A	22,962	98.520	2,262,216.24	
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	36,763	77.000	2,830,751.00	
CONFLUENT INC-CLASS A	15,954	33.960	541,797.84	
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	16,959	329.240	5,583,581.16	
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	3,173	260.430	826,344.39	
DATADOG INC - CLASS A	18,911	129.740	2,453,513.14	
DOCUSIGN INC	17,164	50.220	861,976.08	
DROPBOX INC-CLASS A	16,584	25.080	415,926.72	
DYNATRACE INC	21,256	51.090	1,085,969.04	
EPAM SYSTEMS INC	4,815	311.980	1,502,183.70	
FAIR ISAAC CORP	1,871	1,282.060	2,398,734.26	
FORTINET INC	52,961	68.480	3,626,769.28	
GARTNER INC	6,179	448.610	2,771,961.19	
GEN DIGITAL INC	41,779	21.360	892,399.44	
GODADDY INC - CLASS A	11,895	109.980	1,308,212.10	
HUBSPOT INC	3,878	613.500	2,379,153.00	
INTL BUSINESS MACHINES CORP	70,794	187.640	13,283,786.16	
INTUIT INC	21,746	655.740	14,259,722.04	
MANHATTAN ASSOCIATES INC	4,648	243.810	1,133,228.88	
MICROSOFT CORP	542,626	404.060	219,253,461.56	
MONDAY.COM LTD	1,879	225.300	423,338.70	
MONGODB INC	5,236	465.060	2,435,054.16	

OKTA INC	10,337	88.860	918,545.82	
ORACLE CORP	125,744	111.310	13,996,564.64	
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	146,227	24.440	3,573,787.88	
PALO ALTO NETWORKS INC	23,852	366.410	8,739,611.32	
PTC INC	9,246	178.190	1,647,544.74	
ROPER TECHNOLOGIES INC	8,088	545.570	4,412,570.16	
SALESFORCE INC	75,234	289.720	21,796,794.48	
SERVICENOW INC	15,875	765.000	12,144,375.00	
SNOWFLAKE INC-CLASS A	21,974	230.310	5,060,831.94	
SPLUNK INC	12,234	155.370	1,900,796.58	
SYNOPSYS INC	11,669	552.910	6,451,906.79	
TWILIO INC - A	15,028	58.590	880,490.52	
TYLER TECHNOLOGIES INC	3,139	440.980	1,384,236.22	
UIPATH INC - CLASS A	25,298	24.960	631,438.08	
UNITY SOFTWARE INC	19,066	33.900	646,337.40	
VERISIGN INC	6,425	194.240	1,247,992.00	
WIX.COM LTD	4,119	127.260	524,183.94	
WORKDAY INC-CLASS A	15,569	302.670	4,712,269.23	
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	18,307	62.120	1,137,230.84	
ZSCALER INC	6,271	252.750	1,584,995.25	
AMPHENOL CORP-CL A	45,311	105.520	4,781,216.72	
APPLE INC	1,201,879	182.310	219,114,560.49	
ARISTA NETWORKS INC	20,286	261.750	5,309,860.50	
CDW CORP/DE	9,855	241.370	2,378,701.35	
CISCO SYSTEMS INC	313,778	48.440	15,199,406.32	
CORNING INC	58,470	31.910	1,865,777.70	
DELL TECHNOLOGIES -C	18,797	84.210	1,582,895.37	
F5 INC	3,921	182.350	714,994.35	
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	102,647	14.930	1,532,519.71	
HP INC	66,419	28.580	1,898,255.02	
JABIL INC	9,808	138.500	1,358,408.00	
JUNIPER NETWORKS INC	21,151	36.920	780,894.92	
KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	13,320	155.220	2,067,530.40	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	12,784	320.490	4,097,144.16	
NETAPP INC	17,045	85.710	1,460,926.95	
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	13,715	87.520	1,200,336.80	
SUPER MICRO COMPUTER INC	3,540	803.320	2,843,752.80	
TE CONNECTIVITY LTD	23,194	142.400	3,302,825.60	
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	3,432	432.260	1,483,516.32	
TRIMBLE INC	20,783	60.290	1,253,007.07	
WESTERN DIGITAL CORP	24,533	54.000	1,324,782.00	
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	4,189	275.460	1,153,901.94	

ADVANCED MICRO DEVICES	124,536	173.870	21,653,074.32	
ANALOG DEVICES INC	38,973	188.240	7,336,277.52	
APPLIED MATERIALS INC	64,289	199.570	12,830,155.73	
BROADCOM INC	34,214	1,245.480	42,612,852.72	
ENPHASE ENERGY INC	10,381	131.870	1,368,942.47	
ENTEGRIS INC	12,569	136.810	1,719,564.89	
FIRST SOLAR INC	6,859	156.975	1,076,691.52	
INTEL CORP	324,491	43.510	14,118,603.41	
KLA CORP	10,566	661.350	6,987,824.10	
LAM RESEARCH CORP	10,243	926.030	9,485,325.29	
LATTICE SEMICONDUCTOR CORP	11,073	73.240	810,986.52	
MARVELL TECHNOLOGY INC	65,112	66.290	4,316,274.48	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	40,124	81.610	3,274,519.64	
MICRON TECHNOLOGY INC	84,909	79.500	6,750,265.50	
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	3,399	730.500	2,482,969.50	
NVIDIA CORP	190,007	726.130	137,969,782.91	
NXP SEMICONDUCTORS NV	19,715	232.160	4,577,034.40	
ON SEMICONDUCTOR	31,206	78.640	2,454,039.84	
QORVO INC	7,835	112.170	878,851.95	
QUALCOMM INC	85,631	152.690	13,074,997.39	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	13,506	103.750	1,401,247.50	
TERADYNE INC	10,642	102.240	1,088,038.08	
TEXAS INSTRUMENTS INC	70,543	160.380	11,313,686.34	
AT&T INC	549,913	16.970	9,332,023.61	
LIBERTY GLOBAL LTD-C	21,079	18.950	399,447.05	
T-MOBILE US INC	40,664	160.410	6,522,912.24	
VERIZON COMMUNICATIONS INC	326,424	40.490	13,216,907.76	
AES CORP	54,086	16.770	907,022.22	
ALLIANT ENERGY CORP	21,204	48.350	1,025,213.40	
AMEREN CORPORATION	19,979	69.510	1,388,740.29	
AMERICAN ELECTRIC POWER	39,756	81.350	3,234,150.60	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	15,191	122.820	1,865,758.62	
ATMOS ENERGY CORP	10,802	113.950	1,230,887.90	
CENTERPOINT ENERGY INC	44,329	27.880	1,235,892.52	
CMS ENERGY CORP	20,578	57.270	1,178,502.06	
CONSOLIDATED EDISON INC	25,230	87.320	2,203,083.60	
CONSTELLATION ENERGY	25,008	131.160	3,280,049.28	
DOMINION ENERGY INC	66,086	45.860	3,030,703.96	
DTE ENERGY COMPANY	16,277	107.800	1,754,660.60	
DUKE ENERGY CORP	59,214	91.880	5,440,582.32	
EDISON INTERNATIONAL	27,815	66.310	1,844,412.65	
ENTERGY CORP	17,246	100.150	1,727,186.90	

ESSENTIAL UTILITIES INC	16,329	36.190	590,946.51	
EVERGY INC	17,275	50.030	864,268.25	
EVERSOURCE ENERGY	25,375	58.870	1,493,826.25	
EXELON CORP	76,292	34.910	2,663,353.72	
FIRSTENERGY CORP	45,110	37.390	1,686,662.90	
NEXTERA ENERGY INC	159,722	57.030	9,108,945.66	
NISOURCE INC	34,855	25.900	902,744.50	
NRG ENERGY INC	20,349	51.900	1,056,113.10	
P G & E CORP	149,297	16.430	2,452,949.71	
PPL CORP	55,523	26.640	1,479,132.72	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	37,236	59.790	2,226,340.44	
SEMPRA	48,838	70.490	3,442,590.62	
SOUTHERN CO/THE	84,470	66.480	5,615,565.60	
VISTRA CORP	25,777	45.580	1,174,915.66	
WEC ENERGY GROUP INC	25,816	78.070	2,015,455.12	
XCEL ENERGY INC	40,756	59.070	2,407,456.92	
ALPHABET INC-CL A	456,748	140.520	64,182,228.96	
ALPHABET INC-CL C	402,027	141.760	56,991,347.52	
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	7,601	293.000	2,227,093.00	
COMCAST CORP-CLASS A	313,150	41.240	12,914,306.00	
ELECTRONIC ARTS INC	19,428	142.280	2,764,215.84	
FOX CORP - CLASS A	23,886	30.440	727,089.84	
FOX CORP - CLASS B	8,773	27.950	245,205.35	
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	26,027	32.450	844,576.15	
LIBERTY BROADBAND-C	8,196	60.370	494,792.52	
LIBERTY MEDIA CORP-LIBER-NEW	12,383	30.010	371,613.83	
LIBERTY MEDIA CORP-LIB-NEW-C	13,438	69.180	929,640.84	
LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	11,080	93.250	1,033,210.00	
MATCH GROUP INC	17,799	37.590	669,064.41	
META PLATFORMS INC-CLASS A	171,113	473.320	80,991,205.16	
NETFLIX INC	34,282	583.950	20,018,973.90	
NEWS CORP - CLASS A	34,405	26.240	902,787.20	
OMNICOM GROUP	15,106	87.510	1,321,926.06	
PARAMOUNT GLOBAL-CLASS B	40,964	12.000	491,568.00	
PINTEREST INC- CLASS A	48,115	35.280	1,697,497.20	
ROBLOX CORP -CLASS A	29,846	42.910	1,280,691.86	
ROKU INC	9,945	72.000	716,040.00	
SEA LTD-ADR	28,149	44.990	1,266,423.51	
SIRIUS XM HOLDINGS INC	56,550	4.800	271,440.00	
SNAP INC - A	86,463	11.170	965,791.71	
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWRE	12,652	153.380	1,940,563.76	
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	32,608	88.930	2,899,829.44	

	WALT DISNEY CO/THE	140,582	111.600	15,688,951.20	
	WARNER BROS DISCOVERY INC	165,916	9.830	1,630,954.28	
	CBRE GROUP INC - A	23,502	93.130	2,188,741.26	
	COSTAR GROUP INC	30,836	81.400	2,510,050.40	
	HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	79,100	3.240	256,284.00	
	ZILLOW GROUP INC - C	10,672	54.800	584,825.60	
アメリカ・ドル小計		26,086,834		3,327,801,340.81 (499,270,035,162)	
カナダ・ドル	ARC RESOURCES LTD	44,923	22.400	1,006,275.20	
	CAMECO CORP	33,586	56.860	1,909,699.96	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	82,506	85.160	7,026,210.96	
	CENOVUS ENERGY INC	99,824	23.500	2,345,864.00	
	ENBRIDGE INC	163,171	46.460	7,580,924.66	
	IMPERIAL OIL LTD	16,267	80.750	1,313,560.25	
	KEYERA CORP	19,802	32.740	648,317.48	
	MEG ENERGY CORP	21,651	25.870	560,111.37	
	PARKLAND CORP	7,666	45.710	350,412.86	
	PEMBINA PIPELINE CORP	45,973	45.910	2,110,620.43	
	SUNCOR ENERGY INC	100,785	44.580	4,492,995.30	
	TC ENERGY CORP	81,340	53.320	4,337,048.80	
	TOURMALINE OIL CORP	26,107	57.230	1,494,103.61	
	AGNICO EAGLE MINES LTD	36,483	64.460	2,351,694.18	
	BARRICK GOLD CORP	139,992	19.740	2,763,442.08	
	CCL INDUSTRIES INC - CL B	13,268	58.380	774,585.84	
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	41,452	12.120	502,398.24	
	FRANCO-NEVADA CORP	14,724	147.120	2,166,194.88	
	IVANHOE MINES LTD-CL A	56,432	14.470	816,571.04	
	KINROSS GOLD CORP	110,156	6.830	752,365.48	
	LUNDIN MINING CORP	46,446	11.690	542,953.74	
	NUTRIEN LTD	36,792	68.920	2,535,704.64	
	PAN AMERICAN SILVER CORP	25,157	17.670	444,524.19	
	TECK RESOURCES LTD-CLS B	34,947	52.220	1,824,932.34	
	WEST FRASER TIMBER CO LTD	4,438	107.530	477,218.14	
	WHEATON PRECIOUS METALS CORP	34,221	59.910	2,050,180.11	
	CAE INC	27,474	25.660	704,982.84	
	STANTEC INC	9,939	112.570	1,118,833.23	
	TOROMONT INDUSTRIES LTD	6,027	124.580	750,843.66	
	WSP GLOBAL INC	9,260	207.950	1,925,617.00	
	ELEMENT FLEET MANAGEMENT COR	32,674	22.590	738,105.66	
	GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	15,630	49.850	779,155.50	
	RB GLOBAL INC	12,520	92.980	1,164,109.60	
	THOMSON REUTERS CORP	12,639	216.260	2,733,310.14	

AIR CANADA	12,083	18.000	217,494.00	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	42,942	175.060	7,517,426.52	
CANADIAN PACIFIC KANSAS CITY	71,487	115.190	8,234,587.53	
TFI INTERNATIONAL INC	6,995	197.060	1,378,434.70	
MAGNA INTERNATIONAL INC	22,436	74.110	1,662,731.96	
BRP INC/CA- SUB VOTING	3,082	89.790	276,732.78	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	11,302	46.560	526,221.12	
RESTAURANT BRANDS INTERN	21,066	104.110	2,193,181.26	
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	4,737	140.010	663,227.37	
DOLLARAMA INC	20,468	103.340	2,115,163.12	
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	57,969	82.000	4,753,458.00	
EMPIRE CO LTD 'A'	9,148	34.660	317,069.68	
LOBLAW COMPANIES LTD	11,573	137.760	1,594,296.48	
METRO INC/CN	18,929	71.020	1,344,337.58	
WESTON (GEORGE) LTD	4,984	173.650	865,471.60	
SAPUTO INC	18,270	28.220	515,579.40	
BANK OF MONTREAL	56,754	127.030	7,209,460.62	
BANK OF NOVA SCOTIA	95,377	63.860	6,090,775.22	
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	73,290	61.930	4,538,849.70	
NATIONAL BANK OF CANADA	25,956	103.710	2,691,896.76	
ROYAL BANK OF CANADA	107,792	131.940	14,222,076.48	
TORONTO-DOMINION BANK	139,736	80.870	11,300,450.32	
BROOKFIELD ASSET MGMT-A	23,555	55.080	1,297,409.40	
BROOKFIELD CORP	103,140	54.430	5,613,910.20	
IGM FINANCIAL INC	4,949	35.100	173,709.90	
ONEX CORPORATION	4,217	102.740	433,254.58	
TMX GROUP LTD	26,034	34.180	889,842.12	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	1,745	1,374.970	2,399,322.65	
GREAT-WEST LIFECO INC	22,964	41.780	959,435.92	
IA FINANCIAL CORP INC	8,268	92.640	765,947.52	
INTACT FINANCIAL CORP	14,283	228.670	3,266,093.61	
MANULIFE FINANCIAL CORP	134,995	33.300	4,495,333.50	
POWER CORP OF CANADA	41,436	38.320	1,587,827.52	
SUN LIFE FINANCIAL INC	41,957	72.770	3,053,210.89	
CGI INC	15,720	154.800	2,433,456.00	
CONSTELLATION SOFTWARE INC	1,547	3,710.830	5,740,654.01	
DESCARTES SYSTEMS GRP/THE	6,424	117.050	751,929.20	
OPEN TEXT CORP	21,507	53.930	1,159,872.51	
SHOPIFY INC - CLASS A	92,186	109.620	10,105,429.32	
BCE INC	8,653	50.830	439,831.99	
QUEBECOR INC -CL B	14,578	31.770	463,143.06	
ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	28,451	61.550	1,751,159.05	

	TELUS CORP	15,222	23.940	364,414.68	
	ALGONQUIN POWER & UTILITIES	44,154	8.120	358,530.48	
	ALTAGAS LTD	27,309	28.250	771,479.25	
	BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	11,200	34.200	383,040.00	
	CANADIAN UTILITIES LTD-A	7,344	30.180	221,641.92	
	EMERA INC	22,591	48.380	1,092,952.58	
	FORTIS INC	35,086	52.950	1,857,803.70	
	HYDRO ONE LTD	24,747	40.580	1,004,233.26	
	NORTHLAND POWER INC	15,741	24.000	377,784.00	
	FIRSTSERVICE CORP	3,669	222.990	818,150.31	
カナダ・ドル小計		3,124,320		198,353,592.74 (22,094,606,694)	
オーストラリア・ドル	AMPOL LTD	19,016	37.590	714,811.44	
	SANTOS LTD	239,685	7.370	1,766,478.45	
	WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	146,210	30.700	4,488,647.00	
	BHP GROUP LTD	384,833	45.610	17,552,233.13	
	BLUESCOPE STEEL LTD	37,214	22.850	850,339.90	
	FORTESCUE LTD	135,233	28.400	3,840,617.20	
	IGO LTD	54,323	7.490	406,879.27	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	33,723	57.300	1,932,327.90	
	MINERAL RESOURCES LTD	11,662	59.750	696,804.50	
	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	92,960	13.160	1,223,353.60	
	ORICA LTD	36,212	16.730	605,826.76	
	PILBARA MINERALS LTD	197,160	3.710	731,463.60	
	RIO TINTO LTD	29,368	128.960	3,787,297.28	
	SOUTH32 LTD	336,639	2.880	969,520.32	
	REECE LTD	13,059	23.120	301,924.08	
	BRAMBLES LTD	105,161	15.280	1,606,860.08	
	COMPUTERSHARE LTD	38,485	26.210	1,008,691.85	
	AURIZON HOLDINGS LTD	130,251	3.910	509,281.41	
	QANTAS AIRWAYS LTD	78,226	5.820	455,275.32	
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	45,243	44.320	2,005,169.76	
	IDP EDUCATION LTD	23,591	20.520	484,087.32	
	LOTTERY CORP LTD/THE	173,268	5.050	875,003.40	
	WESFARMERS LTD	86,240	62.950	5,428,808.00	
	COLES GROUP LTD	99,972	16.130	1,612,548.36	
	ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALI	138,738	5.460	757,509.48	
	WOOLWORTHS GROUP LTD	92,646	35.980	3,333,403.08	
	TREASURY WINE ESTATES LTD	45,684	11.400	520,797.60	
	COCHLEAR LTD	5,404	334.540	1,807,854.16	
	RAMSAY HEALTH CARE LTD	14,565	52.230	760,729.95	
	SONIC HEALTHCARE LTD	31,126	31.940	994,164.44	

	CSL LTD	37,282	284.000	10,588,088.00	
	ANZ GROUP HOLDINGS LTD	237,876	28.420	6,760,435.92	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	128,942	116.280	14,993,375.76	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	237,426	33.070	7,851,677.82	
	WESTPAC BANKING CORP	269,603	24.570	6,624,145.71	
	ASX LTD	15,385	65.120	1,001,871.20	
	MACQUARIE GROUP LTD	28,015	192.700	5,398,490.50	
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	22,786	34.020	775,179.72	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP	173,755	6.080	1,056,430.40	
	MEDIBANK PRIVATE LTD	193,702	3.750	726,382.50	
	QBE INSURANCE GROUP LTD	124,450	16.110	2,004,889.50	
	SUNCORP GROUP LTD	88,234	14.370	1,267,922.58	
	WISETECH GLOBAL LTD	12,907	80.010	1,032,689.07	
	XERO LTD	11,173	117.500	1,312,827.50	
	TELSTRA GROUP LTD	273,343	3.860	1,055,103.98	
	ORIGIN ENERGY LTD	134,865	8.730	1,177,371.45	
	CAR GROUP LTD	33,837	34.540	1,168,729.98	
	REA GROUP LTD	3,813	185.080	705,710.04	
	SEEK LTD	29,833	25.350	756,266.55	
オーストラリア・ドル小計		4,933,124		128,286,296.82 (12,602,845,800)	
香港・ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	196,924	42.400	8,349,577.60	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	101,000	84.700	8,554,700.00	
	XINYI GLASS HOLDINGS LTD	94,000	7.160	673,040.00	
	MTR CORP	118,500	25.400	3,009,900.00	
	SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	160,000	13.500	2,160,000.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	176,000	45.650	8,034,400.00	
	SANDS CHINA LTD	172,800	24.500	4,233,600.00	
	BUDWEISER BREWING CO APAC LT	147,000	13.380	1,966,860.00	
	WH GROUP LTD	722,000	4.740	3,422,280.00	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	247,000	19.640	4,851,080.00	
	HANG SENG BANK LTD	63,400	82.900	5,255,860.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	92,300	251.800	23,241,140.00	
	AIA GROUP LTD	868,200	64.300	55,825,260.00	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	41,000	45.100	1,849,100.00	
	CLP HOLDINGS LTD	119,600	64.200	7,678,320.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	861,389	5.920	5,099,422.88	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	111,000	45.300	5,028,300.00	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	160,924	36.000	5,793,264.00	
	ESR GROUP LTD	157,000	9.980	1,566,860.00	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	190,000	8.420	1,599,800.00	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	145,384	21.500	3,125,756.00	

	NEW WORLD DEVELOPMENT	84,833	9.620	816,093.46	
	SINO LAND CO	248,200	8.100	2,010,420.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	108,000	73.000	7,884,000.00	
	SWIRE PACIFIC LTD - CL A	27,000	63.100	1,703,700.00	
	SWIRE PROPERTIES LTD	116,800	15.340	1,791,712.00	
	WHARF HOLDINGS LTD	113,000	26.300	2,971,900.00	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	125,000	25.600	3,200,000.00	
香港・ドル小計		5,768,254		181,696,345.94 (3,484,935,915)	
シンガポール・ドル	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	10,800	26.520	286,416.00	
	KEPPEL LTD	115,000	7.340	844,100.00	
	SEATRIUM LTD	3,231,727	0.093	300,550.61	
	SINGAPORE TECH ENGINEERING	108,600	3.910	424,626.00	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	113,566	7.320	831,303.12	
	GENTING SINGAPORE LTD	452,500	1.040	470,600.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	159,600	3.240	517,104.00	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	139,800	33.870	4,735,026.00	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	258,400	13.260	3,426,384.00	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	93,500	29.190	2,729,265.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	65,200	9.370	610,924.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	645,315	2.380	1,535,849.70	
	SEMBCORP INDUSTRIES LTD	89,200	5.760	513,792.00	
	CAPITALAND INVESTMENT LTD/SI	220,100	2.940	647,094.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	49,000	6.080	297,920.00	
	UOL GROUP LTD	30,900	6.080	187,872.00	
シンガポール・ドル小計		5,783,208		18,358,826.43 (2,047,743,500)	
ニュージーランド・ドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	123,055	8.150	1,002,898.25	
	EBOS GROUP LTD	12,972	37.360	484,633.92	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	38,841	24.130	937,233.33	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	132,027	5.190	685,220.13	
	MERCURY NZ LTD	48,206	6.780	326,836.68	
	MERIDIAN ENERGY LTD	91,327	5.720	522,390.44	
ニュージーランド・ドル小計		446,428		3,959,212.75 (364,643,494)	
イギリス・ポンド	BP PLC	1,284,625	4.720	6,063,430.00	
	SHELL PLC	512,561	24.970	12,798,648.17	
	ANGLO AMERICAN PLC	95,436	18.022	1,719,947.59	
	ANTOFAGASTA PLC	30,983	17.850	553,046.55	
	CRH PLC	54,581	61.280	3,344,723.68	
	CRODA INTERNATIONAL PLC	10,296	50.400	518,918.40	
	ENDEAVOUR MINING PLC	17,507	13.000	227,591.00	

	GLENCORE PLC	811,618	3.995	3,242,413.91	
	MONDI PLC	30,822	13.750	423,802.50	
	RIO TINTO PLC	87,195	55.150	4,808,804.25	
	ASHTEAD GROUP PLC	35,259	54.000	1,903,986.00	
	BAE SYSTEMS PLC	231,522	12.420	2,875,503.24	
	BUNZL PLC	26,105	32.150	839,275.75	
	DCC PLC	5,954	57.480	342,235.92	
	MELROSE INDUSTRIES PLC	119,456	6.108	729,637.24	
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	649,146	3.233	2,098,689.01	
	SMITHS GROUP PLC	24,369	16.445	400,748.20	
	SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	5,904	104.550	617,263.20	
	EXPERIAN PLC	69,750	33.960	2,368,710.00	
	INTERTEK GROUP PLC	11,884	44.300	526,461.20	
	RELX PLC	144,062	34.020	4,900,989.24	
	RENTOKIL INITIAL PLC	190,467	4.278	814,817.82	
	BARRATT DEVELOPMENTS PLC	64,766	4.780	309,581.48	
	BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE	6,637	47.200	313,266.40	
	BURBERRY GROUP PLC	26,233	13.385	351,128.70	
	PERSIMMON PLC	27,665	14.220	393,396.30	
	TAYLOR WIMPEY PLC	225,588	1.457	328,681.71	
	COMPASS GROUP PLC	136,342	21.910	2,987,253.22	
	ENTAIN PLC	42,158	9.334	393,502.77	
	FLUTTER ENTERTAINMENT PLC-DI	13,239	170.850	2,261,883.15	
	INTERCONTINENTAL HOTELS GROU	11,820	77.600	917,232.00	
	PEARSON PLC	46,942	9.698	455,243.51	
	WHITBREAD PLC	16,522	34.820	575,296.04	
	JD SPORTS FASHION PLC	251,482	1.121	281,911.32	
	KINGFISHER PLC	179,593	2.276	408,753.66	
	NEXT PLC	9,030	84.700	764,841.00	
	OCADO GROUP PLC	42,697	5.360	228,855.92	
	SAINSBURY (J) PLC	113,480	2.534	287,558.32	
	TESCO PLC	551,571	2.796	1,542,192.51	
	ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	30,992	22.860	708,477.12	
	BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	167,558	24.135	4,044,012.33	
	COCA-COLA HBC AG-DI	17,866	24.620	439,860.92	
	DIAGEO PLC	169,199	29.275	4,953,300.72	
	IMPERIAL BRANDS PLC	69,831	18.450	1,288,381.95	
	HALEON PLC	415,231	3.230	1,341,196.13	
	RECKITT BENCKISER GROUP PLC	53,559	57.660	3,088,211.94	
	UNILEVER PLC	190,822	40.295	7,689,172.49	
	NMC HEALTH PLC	3,940	0.010	39.40	
	SMITH & NEPHEW PLC	57,278	11.170	639,795.26	

	ASTRAZENECA PLC	120,019	100.940	12,114,717.86	
	GSK PLC	311,133	16.764	5,215,833.61	
	HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	14,590	19.875	289,976.25	
	BARCLAYS PLC	1,208,742	1.467	1,773,224.51	
	HSBC HOLDINGS PLC	1,513,711	6.388	9,669,585.86	
	LLOYDS BANKING GROUP PLC	4,801,858	0.432	2,074,402.65	
	NATWEST GROUP PLC	407,238	2.295	934,611.21	
	STANDARD CHARTERED PLC	182,397	5.946	1,084,532.56	
	3I GROUP PLC	70,572	24.760	1,747,362.72	
	ABRDN PLC	138,015	1.643	226,758.64	
	HARGREAVES LANSDOWN PLC	31,008	8.296	257,242.36	
	LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	32,399	88.880	2,879,623.12	
	M&G PLC	217,201	2.243	487,181.84	
	SCHRODERS PLC	61,711	4.083	251,966.01	
	ST JAMES'S PLACE PLC	33,823	6.552	221,608.29	
	WISE PLC - A	43,661	8.500	371,118.50	
	ADMIRAL GROUP PLC	19,808	25.890	512,829.12	
	AVIVA PLC	217,835	4.325	942,136.37	
	LEGAL & GENERAL GROUP PLC	457,083	2.402	1,097,913.36	
	PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	59,286	5.050	299,394.30	
	PRUDENTIAL PLC	211,966	8.344	1,768,644.30	
	SAGE GROUP PLC/THE	75,045	11.780	884,030.10	
	HALMA PLC	32,277	22.530	727,200.81	
	BT GROUP PLC	540,623	1.062	574,141.62	
	VODAFONE GROUP PLC	1,629,376	0.656	1,068,870.65	
	CENTRICA PLC	403,810	1.391	561,699.71	
	NATIONAL GRID PLC	280,606	10.160	2,850,956.96	
	SEVERN TRENT PLC	20,117	25.540	513,788.18	
	SSE PLC	87,793	15.955	1,400,737.31	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	51,208	10.430	534,099.44	
	AUTO TRADER GROUP PLC	77,901	7.216	562,133.61	
	INFORMA PLC	102,755	8.170	839,508.35	
	WPP PLC	78,503	7.820	613,893.46	
イギリス・ポンド小計		20,925,613		144,464,392.78 (27,354,332,773)	
イスラエル・シュケル	ICL GROUP LTD	67,143	18.210	1,222,674.03	
	ELBIT SYSTEMS LTD	2,213	738.000	1,633,194.00	
	BANK HAPOALIM BM	98,327	31.820	3,128,765.14	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	115,937	27.560	3,195,223.72	
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	85,339	17.620	1,503,673.18	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	11,916	133.800	1,594,360.80	
	NICE LTD	4,458	808.100	3,602,509.80	

	AZRIELI GROUP LTD	3,527	234.900	828,492.30	
イスラエル・シュケル小計		388,860		16,708,892.97 (694,341,389)	
スイス・フラン	CLARIANT AG-REG	10,101	11.070	111,818.07	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	538	624.500	335,981.00	
	GIVAUDAN-REG	709	3,667.000	2,599,903.00	
	HOLCIM LTD	39,459	67.740	2,672,952.66	
	SIG GROUP AG	22,269	18.020	401,287.38	
	SIKA AG-REG	12,022	254.300	3,057,194.60	
	ABB LTD-REG	122,905	40.040	4,921,116.20	
	GEBERIT AG-REG	2,322	512.400	1,189,792.80	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	1,766	222.600	393,111.60	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	3,030	231.200	700,536.00	
	VAT GROUP AG	2,164	429.500	929,438.00	
	ADECCO GROUP AG-REG	14,810	36.650	542,786.50	
	SGS SA-REG	11,450	84.620	968,899.00	
	KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG	4,194	282.100	1,183,127.40	
	CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG	39,172	137.050	5,368,522.60	
	SWATCH GROUP AG/THE-BR	2,619	217.700	570,156.30	
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	5,225	41.950	219,188.75	
	AVOLTA AG	8,656	35.540	307,634.24	
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	216	1,299.000	280,584.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	72	11,200.000	806,400.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	8	111,000.000	888,000.00	
	NESTLE SA-REG	206,281	97.150	20,040,199.15	
	ALCON INC	38,392	68.460	2,628,316.32	
	SONOVA HOLDING AG-REG	4,173	284.300	1,186,383.90	
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	8,823	144.650	1,276,246.95	
	BACHEM HOLDING AG	1,756	65.650	115,281.40	
	LONZA GROUP AG-REG	5,801	457.100	2,651,637.10	
	NOVARTIS AG-REG	158,203	88.440	13,991,473.32	
	ROCHE HOLDING AG-BR	2,584	241.600	624,294.40	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	53,731	228.200	12,261,414.20	
	SANDOZ GROUP AG	30,936	28.710	888,172.56	
	BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	3,006	106.500	320,139.00	
	JULIUS BAER GROUP LTD	15,168	49.420	749,602.56	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,773	1,230.000	2,180,790.00	
	UBS GROUP AG-REG	252,693	24.480	6,185,924.64	
	BALOISE HOLDING AG - REG	3,909	143.200	559,768.80	
	HELVETIA HOLDING AG-REG	2,221	123.200	273,627.20	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	2,272	638.000	1,449,536.00	
	SWISS RE AG	22,781	100.950	2,299,741.95	

	ZURICH INSURANCE GROUP AG	11,172	441.400	4,931,320.80	
	TEMENOS AG - REG	3,743	60.620	226,900.66	
	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	13,555	76.560	1,037,770.80	
	SWISSCOM AG-REG	1,994	509.400	1,015,743.60	
	BKW AG	1,385	133.200	184,482.00	
	SWISS PRIME SITE-REG	5,572	85.750	477,799.00	
スイス・フラン小計		1,155,631		106,004,996.41 (18,072,791,838)	
デンマーク・クローネ	NOVOZYMES A/S-B SHARES	26,836	373.500	10,023,246.00	
	ROCKWOOL A/S-B SHS	1,102	2,204.000	2,428,808.00	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	78,424	188.540	14,786,060.96	
	AP MOLLER-MAERSK A/S-A	206	10,400.000	2,142,400.00	
	AP MOLLER-MAERSK A/S-B	412	10,535.000	4,340,420.00	
	DSV A/S	13,716	1,143.000	15,677,388.00	
	PANDORA A/S	6,892	1,134.000	7,815,528.00	
	CARLSBERG AS-B	8,080	944.800	7,633,984.00	
	COLOPLAST-B	10,365	894.000	9,266,310.00	
	DEMANT A/S	8,178	366.000	2,993,148.00	
	GENMAB A/S	4,634	1,989.000	9,217,026.00	
	NOVO NORDISK A/S-B	251,901	850.900	214,342,560.90	
	DANSKE BANK A/S	50,000	193.550	9,677,500.00	
	TRYG A/S	24,975	145.550	3,635,111.25	
	ORSTED A/S	14,988	397.200	5,953,233.60	
デンマーク・クローネ小計		500,709		319,932,724.71 (6,942,540,126)	
ノルウェー・クローネ	AKER BP ASA	21,204	261.300	5,540,605.20	
	EQUINOR ASA	72,237	266.050	19,218,653.85	
	NORSK HYDRO ASA	108,109	58.300	6,302,754.70	
	YARA INTERNATIONAL ASA	12,718	355.000	4,514,890.00	
	KONGSBERG GRUPPEN ASA	6,526	655.000	4,274,530.00	
	MOWI ASA	36,354	201.900	7,339,872.60	
	ORKLA ASA	63,195	75.000	4,739,625.00	
	SALMAR ASA	6,204	632.400	3,923,409.60	
	DNB BANK ASA	66,810	206.100	13,769,541.00	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	18,691	172.600	3,226,066.60	
	TELENOR ASA	48,435	114.150	5,528,855.25	
	ADEVINTA ASA	15,540	114.600	1,780,884.00	
ノルウェー・クローネ小計		476,023		80,159,687.80 (1,144,680,342)	
スウェーデン・クローナ	BOLIDEN AB	20,658	277.500	5,732,595.00	
	HOLMEN AB-B SHARES	7,024	403.300	2,832,779.20	
	SVENSKA CELLULOSA AB SCA-B	45,662	139.850	6,385,830.70	

	ALFA LAVAL AB	23,093	378.600	8,743,009.80	
	ASSA ABLOY AB-B	80,816	287.000	23,194,192.00	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	200,121	176.800	35,381,392.80	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	125,066	154.100	19,272,670.60	
	BEIJER REF AB	23,918	144.700	3,460,934.60	
	EPIROC AB-A	56,566	195.850	11,078,451.10	
	EPIROC AB-B	33,182	173.500	5,757,077.00	
	HUSQVARNA AB-B SHS	34,897	78.620	2,743,602.14	
	INDUTRADE AB	17,913	279.000	4,997,727.00	
	INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	8,223	265.000	2,179,095.00	
	LIFCO AB-B SHS	15,149	273.500	4,143,251.50	
	NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	109,274	58.420	6,383,787.08	
	SAAB AB-B	6,953	792.200	5,508,166.60	
	SANDVIK AB	76,866	224.100	17,225,670.60	
	SKANSKA AB-B SHS	26,915	186.750	5,026,376.25	
	SKF AB-B SHARES	31,715	218.400	6,926,556.00	
	VOLVO AB-A SHS	13,283	277.200	3,682,047.60	
	VOLVO AB-B SHS	111,479	270.000	30,099,330.00	
	SECURITAS AB-B SHS	41,010	106.950	4,386,019.50	
	VOLVO CAR AB-B	38,628	38.600	1,491,040.80	
	EVOLUTION AB	13,101	1,311.600	17,183,271.60	
	HENNES & MAURITZ AB-B SHS	52,210	142.380	7,433,659.80	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	45,427	239.200	10,866,138.40	
	GETINGE AB-B SHS	21,124	205.300	4,336,757.20	
	SWEDISH ORPHAN BIOVITRUM AB	13,513	254.400	3,437,707.20	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	129,315	153.800	19,888,647.00	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	113,533	122.750	13,936,175.75	
	SWEDBANK AB - A SHARES	63,538	217.900	13,844,930.20	
	EQT AB	29,893	279.100	8,343,136.30	
	INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	10,598	341.600	3,620,276.80	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	10,642	341.400	3,633,178.80	
	INVESTOR AB-B SHS	131,535	255.400	33,594,039.00	
	LUNDBERGS AB-B SHS	6,081	559.800	3,404,143.80	
	ERICSSON LM-B SHS	221,040	55.630	12,296,455.20	
	HEXAGON AB-B SHS	157,105	118.250	18,577,666.25	
	TELE2 AB-B SHS	38,424	83.440	3,206,098.56	
	TELIA CO AB	187,675	24.450	4,588,653.75	
	FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	60,454	66.900	4,044,372.60	
	SAGAX AB-B	14,721	252.600	3,718,524.60	
スウェーデン・クローナ小計		2,468,340		406,585,435.68 (5,850,764,418)	
ユーロ	ENI SPA	179,276	14.154	2,537,472.50	

	GALP ENERGIA SGPS SA	31,670	14.350	454,464.50	
	NESTE OYJ	31,509	27.320	860,825.88	
	OMV AG	10,043	40.660	408,348.38	
	REPSOL SA	96,457	13.585	1,310,368.34	
	TENARIS SA	41,201	15.085	621,517.08	
	TOTALENERGIES SE	178,056	59.890	10,663,773.84	
	AIR LIQUIDE SA	39,911	171.100	6,828,772.10	
	AKZO NOBEL N.V.	12,475	69.160	862,771.00	
	ARCELORMITTAL	44,177	25.630	1,132,256.51	
	ARKEMA	5,145	98.300	505,753.50	
	BASF SE	70,317	46.590	3,276,069.03	
	COVESTRO AG	16,049	48.170	773,080.33	
	DSM-FIRMENICH AG	13,915	103.020	1,433,523.30	
	EVONIK INDUSTRIES AG	17,669	17.345	306,468.80	
	HEIDELBERG MATERIALS AG	10,008	85.320	853,882.56	
	OCI NV	11,025	26.480	291,942.00	
	SMURFIT KAPPA GROUP PLC	20,828	37.980	791,047.44	
	STORA ENSO OYJ-R SHS	47,758	11.200	534,889.60	
	SYENSQO SA	4,802	85.130	408,794.26	
	SYMRISE AG	9,721	97.960	952,269.16	
	UMICORE	16,912	20.670	349,571.04	
	UPM-KYMMENE OYJ	38,447	28.910	1,111,502.77	
	VOESTALPINE AG	6,890	25.740	177,348.60	
	WACKER CHEMIE AG	1,414	101.500	143,521.00	
	ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	14,249	36.390	518,521.11	
	AIRBUS SE	44,971	146.340	6,581,056.14	
	ALSTOM	25,574	11.695	299,087.93	
	BOUYGUES SA	17,123	34.300	587,318.90	
	BRENNTAG SE	12,153	80.320	976,128.96	
	COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN	34,454	69.130	2,381,805.02	
	DAIMLER TRUCK HOLDING AG	44,374	35.550	1,577,495.70	
	DASSAULT AVIATION SA	1,720	184.300	316,996.00	
	EIFFAGE	6,641	96.660	641,919.06	
	FERROVIAL SE	42,157	34.810	1,467,485.17	
	GEA GROUP AG	10,467	37.770	395,338.59	
	IMCD NV	4,340	142.650	619,101.00	
	KINGSPAN GROUP PLC	11,262	82.000	923,484.00	
	KNORR-BREMSE AG	7,217	58.740	423,926.58	
	KONE OYJ-B	27,371	47.000	1,286,437.00	
	LEGRAND SA	19,539	92.020	1,797,978.78	
	LEONARDO SPA	35,486	18.770	666,072.22	
	METSO CORP	50,483	10.395	524,770.78	

MTU AERO ENGINES AG	3,854	227.000	874,858.00	
PRYSMIAN SPA	19,681	43.700	860,059.70	
RATIONAL AG	350	764.500	267,575.00	
RHEINMETALL AG	2,899	388.200	1,125,391.80	
SAFRAN SA	25,961	187.880	4,877,552.68	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	41,472	201.900	8,373,196.80	
SIEMENS AG-REG	58,391	169.220	9,880,925.02	
SIEMENS ENERGY AG	40,928	13.895	568,694.56	
THALES SA	8,928	140.650	1,255,723.20	
VINCI SA	38,750	113.240	4,388,050.00	
WARTSILA OYJ ABP	38,260	14.645	560,317.70	
BUREAU VERITAS SA	17,817	25.270	450,235.59	
RANDSTAD NV	8,946	51.620	461,792.52	
TELEPERFORMANCE	4,299	135.300	581,654.70	
WOLTERS KLUWER	18,802	143.950	2,706,547.90	
ADP	3,679	121.300	446,262.70	
AENA SME SA	5,640	167.200	943,008.00	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	50,885	7.411	377,108.73	
DHL GROUP	73,067	42.720	3,121,422.24	
GETLINK SE	30,428	15.305	465,700.54	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	24,500	104.100	2,550,450.00	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF	3,679	98.050	360,725.95	
CONTINENTAL AG	8,078	77.060	622,490.68	
DR ING HC F PORSCHE AG	8,498	80.620	685,108.76	
FERRARI NV	9,563	363.000	3,471,369.00	
MERCEDES-BENZ GROUP AG	61,762	67.380	4,161,523.56	
MICHELIN (CGDE)	51,844	33.280	1,725,368.32	
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF	14,142	47.470	671,320.74	
RENAULT SA	14,764	38.285	565,239.74	
STELLANTIS NV	171,748	23.775	4,083,308.70	
VOLKSWAGEN AG	1,960	135.750	266,070.00	
VOLKSWAGEN AG-PREF	15,275	119.660	1,827,806.50	
ADIDAS AG	12,090	176.240	2,130,741.60	
HERMES INTERNATIONAL	2,402	2,199.000	5,281,998.00	
KERING	5,801	428.100	2,483,408.10	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	21,313	815.800	17,387,145.40	
MONCLER SPA	15,710	62.520	982,189.20	
PUMA SE	9,601	42.210	405,258.21	
SEB SA	1,127	113.200	127,576.40	
ACCOR SA	16,469	36.980	609,023.62	
AMADEUS IT GROUP SA	34,652	60.500	2,096,446.00	
DELIVERY HERO SE	13,293	22.595	300,355.33	

LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	5,785	39.380	227,813.30	
SODEXO SA	6,960	76.460	532,161.60	
D'IETEREN GROUP	1,885	172.800	325,728.00	
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL	81,748	39.600	3,237,220.80	
PROSUS NV	114,557	28.945	3,315,852.36	
ZALANDO SE	17,418	19.820	345,224.76	
CARREFOUR SA	49,914	15.210	759,191.94	
HELLOFRESH SE	9,790	12.395	121,347.05	
JERONIMO MARTINS	22,106	21.800	481,910.80	
KESKO OYJ-B SHS	20,250	17.930	363,082.50	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	71,069	27.315	1,941,249.73	
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	66,143	57.810	3,823,726.83	
DANONE	50,315	61.300	3,084,309.50	
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	35,407	9.972	353,078.60	
HEINEKEN HOLDING NV	7,962	73.700	586,799.40	
HEINEKEN NV	22,805	88.940	2,028,276.70	
JDE PEET'S NV	13,317	22.560	300,431.52	
KERRY GROUP PLC-A	12,402	76.620	950,241.24	
LOTUS BAKERIES	31	9,110.000	282,410.00	
PERNOD RICARD SA	14,736	157.150	2,315,762.40	
REMY COINTREAU	2,008	98.940	198,671.52	
BEIERSDORF AG	7,876	137.250	1,080,981.00	
HENKEL AG & CO KGAA	8,714	63.180	550,550.52	
HENKEL AG & CO KGAA VOR-PREF	13,009	70.340	915,053.06	
L'OREAL	18,258	442.400	8,077,339.20	
AMPLIFON SPA	10,123	31.860	322,518.78	
BIOMERIEUX	2,791	103.800	289,705.80	
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	3,583	111.400	399,146.20	
DIASORIN SPA	1,313	90.260	118,511.38	
ESSILORLUXOTTICA	23,299	187.420	4,366,698.58	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG	17,125	38.990	667,703.75	
FRESENIUS SE & CO KGAA	31,227	26.440	825,641.88	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	60,155	18.920	1,138,132.60	
SIEMENS HEALTHINEERS AG	19,203	55.080	1,057,701.24	
ARGENX SE	4,581	365.600	1,674,813.60	
BAYER AG-REG	75,808	28.610	2,168,866.88	
EUROFINS SCIENTIFIC	9,270	57.840	536,176.80	
GRIFOLS SA	15,169	10.605	160,867.24	
IPSEN	3,380	104.900	354,562.00	
MERCK KGAA	9,982	155.700	1,554,197.40	
ORION OYJ-CLASS B	10,542	39.980	421,469.16	
QIAGEN N.V.	15,195	39.960	607,192.20	

RECORDATI INDUSTRIA CHIMICA	8,068	51.020	411,629.36	
SANOFI	86,255	86.460	7,457,607.30	
SARTORIUS AG-VORZUG	2,164	337.700	730,782.80	
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	2,207	253.800	560,136.60	
UCB SA	10,230	94.900	970,827.00	
ABN AMRO BANK NV-CVA	28,787	14.985	431,373.19	
AIB GROUP PLC	103,685	4.060	420,961.10	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	452,595	9.016	4,080,596.52	
BANCO BPM SPA	91,957	4.916	452,060.61	
BANCO SANTANDER SA	1,274,611	3.673	4,681,646.20	
BANK OF IRELAND GROUP PLC	75,242	8.460	636,547.32	
BNP PARIBAS	80,474	54.380	4,376,176.12	
CAIXABANK SA	308,048	3.963	1,220,794.22	
COMMERZBANK AG	82,105	10.820	888,376.10	
CREDIT AGRICOLE SA	90,899	12.230	1,111,694.77	
ERSTE GROUP BANK AG	28,304	39.210	1,109,799.84	
FINECOBANK SPA	43,093	13.085	563,871.90	
ING GROEP NV	270,646	12.384	3,351,680.06	
INTESA SANPAOLO	1,163,000	2.825	3,285,475.00	
KBC GROUP NV	20,304	63.100	1,281,182.40	
MEDIOBANCA SPA	47,708	11.695	557,945.06	
NORDEA BANK ABP	243,753	10.982	2,676,895.44	
SOCIETE GENERALE SA	55,196	22.005	1,214,587.98	
UNICREDIT SPA	121,851	29.790	3,629,941.29	
ADYEN NV	1,553	1,507.800	2,341,613.40	
AMUNDI SA	3,955	60.350	238,684.25	
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	146,020	11.982	1,749,611.64	
DEUTSCHE BOERSE AG	14,432	187.650	2,708,164.80	
EDENRED	20,297	55.480	1,126,077.56	
EURAZEO SE	3,897	78.300	305,135.10	
EURONEXT NV	5,502	82.150	451,989.30	
EXOR NV	8,669	98.360	852,682.84	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT NV	7,933	70.680	560,704.44	
NEXI SPA	57,060	7.218	411,859.08	
SOFINA	804	218.200	175,432.80	
WORLDLINE SA	16,677	12.025	200,540.92	
AEGON LTD	127,748	5.374	686,517.75	
AGEAS	11,247	39.110	439,870.17	
ALLIANZ SE-REG	31,080	247.100	7,679,868.00	
ASR NEDERLAND NV	14,593	43.220	630,709.46	
ASSICURAZIONI GENERALI	82,510	20.870	1,721,983.70	
AXA SA	139,104	30.980	4,309,441.92	

HANNOVER RUECK SE	4,298	228.800	983,382.40	
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	10,609	408.700	4,335,898.30	
NN GROUP NV	20,802	37.420	778,410.84	
POSTE ITALIANE SPA	34,720	10.035	348,415.20	
SAMPO OYJ-A SHS	36,423	41.530	1,512,647.19	
TALANX AG	5,345	65.700	351,166.50	
BECHTLE AG	4,305	49.230	211,935.15	
CAPGEMINI SE	12,750	219.700	2,801,175.00	
DASSAULT SYSTEMES SE	50,781	43.455	2,206,688.35	
NEMETSCHEK SE	5,941	86.360	513,064.76	
SAP SE	80,955	165.080	13,364,051.40	
NOKIA OYJ	404,925	3.289	1,331,798.32	
ASM INTERNATIONAL NV	3,686	581.300	2,142,671.80	
ASML HOLDING NV	31,029	874.600	27,137,963.40	
BE SEMICONDUCTOR INDUSTRIES	6,286	161.900	1,017,703.40	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	97,120	33.460	3,249,635.20	
STMICROELECTRONICS NV	48,663	42.565	2,071,340.59	
CELLNEX TELECOM SA	41,167	33.170	1,365,509.39	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	251,340	22.185	5,575,977.90	
ELISA OYJ	10,160	42.340	430,174.40	
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	28,190	10.650	300,223.50	
KONINKLIJKE KPN NV	222,179	3.318	737,189.92	
ORANGE	132,722	10.766	1,428,885.05	
TELECOM ITALIA SPA	696,355	0.278	193,586.69	
TELEFONICA SA	412,202	3.561	1,467,851.32	
ACCIONA SA	1,810	109.150	197,561.50	
CORP ACCIONA ENERGIAS RENOVA	6,849	21.140	144,787.86	
E.ON SE	178,555	11.755	2,098,914.02	
EDP RENOVAVEIS SA	27,294	14.150	386,210.10	
EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	227,046	3.768	855,509.32	
ELIA GROUP SA/NV	2,111	105.000	221,655.00	
ENAGAS SA	14,471	14.475	209,467.72	
ENDESA SA	25,535	16.480	420,816.80	
ENEL SPA	617,940	5.874	3,629,779.56	
ENGIE	142,233	14.322	2,037,061.02	
FORTUM OYJ	30,500	11.140	339,770.00	
IBERDROLA SA	473,759	10.775	5,104,753.22	
NATURGY ENERGY GROUP SA	10,603	22.940	243,232.82	
REDEIA CORP SA	34,539	14.720	508,414.08	
RWE AG	48,289	31.800	1,535,590.20	
SNAM SPA	168,809	4.383	739,889.84	
TERNA-RETE ELETTRICA NAZIONA	101,686	7.354	747,798.84	

	VEOLIA ENVIRONNEMENT	48,732	29.240	1,424,923.68	
	VERBUND AG	5,338	64.200	342,699.60	
	BOLLORE SE	69,288	6.165	427,160.52	
	PUBLICIS GROUPE	18,281	97.380	1,780,203.78	
	SCOUT24 SE	6,149	66.000	405,834.00	
	UNIVERSAL MUSIC GROUP NV	66,170	26.870	1,777,987.90	
	VIVENDI SE	57,161	10.305	589,044.10	
	LEG IMMOBILIEN SE	6,505	71.300	463,806.50	
	VONOVIA SE	55,940	26.660	1,491,360.40	
ユーロ小計		13,846,584		384,493,531.13 (62,214,898,272)	
合　計		85,903,928		662,139,159,724 (662,139,159,724)	

(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	588 銘柄	71.3%	75.4%
カナダ・ドル	株式	86 銘柄	3.2%	3.3%
オーストラリア・ドル	株式	49 銘柄	1.8%	1.9%
香港・ドル	株式	28 銘柄	0.5%	0.5%
シンガポール・ドル	株式	16 銘柄	0.3%	0.3%
ニュージーランド・ドル	株式	6 銘柄	0.1%	0.1%
イギリス・ポンド	株式	82 銘柄	3.9%	4.1%
イスラエル・シュケル	株式	8 銘柄	0.1%	0.1%
スイス・フラン	株式	45 銘柄	2.6%	2.7%
デンマーク・クローネ	株式	15 銘柄	1.0%	1.0%
ノルウェー・クローネ	株式	12 銘柄	0.2%	0.2%
スウェーデン・クローナ	株式	42 銘柄	0.8%	0.9%
ユーロ	株式	220 銘柄	8.9%	9.4%

(b)株式以外の有価証券

種　類	通　貨	銘　柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	アメリカ・ドル	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	13,343.00	1,591,553.04	
		AMERICAN HOMES 4 RENT- A	26,290.00	905,164.70	
		AMERICAN TOWER CORP	36,440.00	6,819,017.20	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	35,166.00	656,197.56	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	10,245.00	1,814,594.40	
		BOSTON PROPERTIES INC	9,604.00	646,925.44	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	7,861.00	755,913.76	
		CROWN CASTLE INC	33,131.00	3,585,436.82	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	22,476.00	3,061,680.72	

		EQUINIX INC	7,252.00	6,209,379.96	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	14,256.00	943,462.08	
		EQUITY RESIDENTIAL	26,128.00	1,568,463.84	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	5,455.00	1,283,943.35	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	15,328.00	2,169,984.96	
		GAMING AND LEISURE PROPERTIE	22,625.00	1,022,423.75	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	36,377.00	624,229.32	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	59,277.00	1,168,942.44	
		INVITATION HOMES INC	44,730.00	1,462,671.00	
		IRON MOUNTAIN INC	23,774.00	1,616,156.52	
		KIMCO REALTY CORP	57,934.00	1,137,244.42	
		MID-AMERICA APARTMENT COMM	9,567.00	1,235,769.39	
		PROLOGIS INC	71,892.00	9,589,673.88	
		PUBLIC STORAGE	11,880.00	3,344,457.60	
		REALTY INCOME CORP	63,896.00	3,343,677.68	
		REGENCY CENTERS CORP	13,101.00	796,671.81	
		SBA COMMUNICATIONS CORP	8,176.00	1,690,796.80	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	24,260.00	3,638,029.60	
		SUN COMMUNITIES INC	10,118.00	1,315,340.00	
		UDR INC	27,406.00	988,808.48	
		VENTAS INC	28,342.00	1,240,245.92	
		VICI PROPERTIES INC	76,652.00	2,263,533.56	
		WELLTOWER INC	39,901.00	3,715,980.13	
		WEYERHAEUSER CO	54,126.00	1,785,616.74	
		WP CAREY INC	16,778.00	963,057.20	
	アメリカ・ドル小計		963,787.00	74,955,044.07 (11,245,505,262)	
	カナダ・ドル	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	8,170.00	411,359.50	
		RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	7,441.00	137,881.73	
	カナダ・ドル小計		15,611.00	549,241.23 (61,179,981)	
	オーストラリア・ドル	APA GROUP	108,912.00	880,008.96	
		DEXUS/AU	79,604.00	625,687.44	
		GOODMAN GROUP	133,948.00	3,832,252.28	
		GPT GROUP	159,776.00	726,980.80	
		MIRVAC GROUP	326,863.00	751,784.90	
		SCENTRE GROUP	350,311.00	1,068,448.55	
		STOCKLAND	193,824.00	909,034.56	
		TRANSURBAN GROUP	235,928.00	3,088,297.52	
		VICINITY CENTRES	241,241.00	494,544.05	
	オーストラリア・ドル小計		1,830,407.00	12,377,039.06 (1,215,920,317)	

	香港・ドル	HKT TRUST AND HKT LTD-SS	276,000.00	2,519,880.00	
		LINK REIT	189,400.00	7,310,840.00	
	香港・ドル小計		465,400.00	9,830,720.00 (188,553,211)	
	シンガポール・ドル	CAPITALAND ASCENDAS REIT	267,000.00	742,260.00	
		CAPITALAND INTEGRATED COMMER	408,716.00	801,083.36	
		MAPLETREE LOGISTICS TRUST	208,100.00	322,555.00	
		MAPLETREE PAN ASIA COM TRUST	112,400.00	158,484.00	
	シンガポール・ドル小計		996,216.00	2,024,382.36 (225,799,608)	
	イギリス・ポンド	LAND SECURITIES GROUP PLC	59,857.00	386,317.07	
		SEGRO PLC	89,254.00	758,123.47	
	イギリス・ポンド小計		149,111.00	1,144,440.54 (216,699,816)	
	ユーロ	COVIVIO	2,388.00	99,245.28	
		GECINA SA	3,082.00	287,396.50	
		KLEPIERRE	18,172.00	430,312.96	
		UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	8,942.00	626,118.84	
		WAREHOUSES DE PAUW SCA	13,418.00	345,647.68	
	ユーロ小計		46,002.00	1,788,721.26 (289,432,987)	
投資証券合計				13,443,091,182 (13,443,091,182)	
合　計				13,443,091,182 (13,443,091,182)	

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

通　貨	銘柄数		組入 投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカ・ドル	投資証券	34銘柄	1.6%	83.7%
カナダ・ドル	投資証券	2銘柄	0.0%	0.5%
オーストラリア・ドル	投資証券	9銘柄	0.2%	9.0%
香港・ドル	投資証券	2銘柄	0.0%	1.4%
シンガポール・ドル	投資証券	4銘柄	0.0%	1.7%
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。

外国債券パッシブ・マザーファンド

（１）貸借対照表

（単位：円）

	(2023年2月20日現在)	(2024年2月19日現在)
資産の部		
流動資産		
預金	420,137,655	506,317,357
金銭信託	27,452,528	22,985,235
コール・ローン	542,885,324	929,968,111
国債証券	149,970,158,950	175,822,424,619
未収利息	936,129,638	1,239,675,278
前払費用	76,300,180	93,938,074
流動資産合計	151,973,064,275	178,615,308,674
資産合計	151,973,064,275	178,615,308,674
負債の部		
流動負債		
未払金	38,956,261	－
未払解約金	360,727,345	58,192,859
その他未払費用	2,185	1,726
流動負債合計	399,685,791	58,194,585
負債合計	399,685,791	58,194,585
純資産の部		
元本等		
元本	78,149,894,072	80,415,247,995
剰余金		
剰余金又は欠損金（△）	73,423,484,412	98,141,866,094
元本等合計	151,573,378,484	178,557,114,089
純資産合計	151,573,378,484	178,557,114,089
負債純資産合計	151,973,064,275	178,615,308,674

（２）注記表

(重要な会計方針の注記)

項　目	自 2023年2月21日 至 2024年2月19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	（2023年2月20日現在）	（2024年2月19日現在）
1．　当計算期間の末日における受益権の総数	78,149,894,072口	80,415,247,995口
2．　1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額　1.9395円 （1万口当たりの純資産額19,395円）	1口当たり純資産額　2.2204円 （1万口当たりの純資産額22,204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2月21日 至 2024年2月19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	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

体制	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 2 月 19 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 2 月 21 日 至 2024 年 2 月 19 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）

（2023 年 2 月 20 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	82,333,458,509 円
同期中における追加設定元本額	11,125,531,084 円
同期中における一部解約元本額	15,309,095,521 円
2023 年 2 月 20 日現在の元本の内訳	
三井住友・ＤＣ外国債券インデックスファンドＳ	26,114,593,808 円
三井住友・ＤＣ年金バランス３０（債券重点型）	897,622,791 円
三井住友・ＤＣ年金バランス５０（標準型）	2,277,304,683 円
三井住友・ＤＣ年金バランス７０（株式重点型）	1,269,134,694 円
ＳＭＡＭ・グローバルバランスファンド（機動的資産配分型）	163,762,412 円
三井住友・ＤＣターゲットイヤーファンド２０２０（４資産タイプ）	6,297,588 円
三井住友・ＤＣターゲットイヤーファンド２０２５（４資産タイプ）	29,502,621 円
三井住友・ＤＣターゲットイヤーファンド２０３０（４資産タイプ）	102,718,935 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）	268,930,247 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）	195,766,919 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）	310,561,552 円
三井住友・ＤＣ年金バランスゼロ（債券型）	24,106,305 円
アセットアロケーション・ファンド（安定型）	116,200,545 円
アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）	152,961,156 円
アセットアロケーション・ファンド（成長型）	97,271,094 円
三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０５０	29,148,525 円
三井住友・資産最適化ファンド（１安定重視型）	87,757,719 円
三井住友・資産最適化ファンド（２やや安定型）	65,514,212 円
三井住友・資産最適化ファンド（３バランス型）	177,153,519 円
三井住友・資産最適化ファンド（４やや成長型）	52,809,123 円
三井住友・資産最適化ファンド（５成長重視型）	26,615,507 円
三井住友・ＤＣつみたてＮＩＳＡ・世界分散ファンド	186,388,452 円
三井住友ＤＳ・外国債券インデックス年金ファンド	740,469,062 円
三井住友ＤＳ・年金バランス３０（債券重点型）	36,230,420 円
三井住友ＤＳ・年金バランス５０（標準型）	110,716,800 円
三井住友ＤＳ・年金バランス７０（株式重点型）	75,508,558 円
三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０６０	3,803,824 円
日興ＦＷＳ・先進国債インデックス（為替ヘッジなし）	890,014,503 円
三井住友ＤＳ・先進国債インデックス・ファンド	90,944,838 円
三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０３５	27,622 円

三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０４０	32,834 円
三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０４５	40,651 円
三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０５５	47,947 円
三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０６５	47,947 円
ＳＭＡＭ・年金外国債券パッシブ・ファンド＜適格機関投資家限定＞	4,127,762,178 円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ安定成長型＜適格機関投資家限定＞	30,152,077 円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ２５＜適格機関投資家専用＞	5,611,457,006 円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ３７．５＜適格機関投資家専用＞	3,950,525,621 円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ５０＜適格機関投資家専用＞	9,244,600,710 円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＬ３０＜適格機関投資家限定＞	29,825,111 円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＬ５０＜適格機関投資家限定＞	74,453,005 円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ７５＜適格機関投資家専用＞	637,751,835 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＞	108,360,283 円
ＳＭＡＭ・インデックス・バランスＶＡ２５＜適格機関投資家専用＞	942,176,072 円
ＳＭＡＭ・インデックス・バランスＶＡ５０＜適格機関投資家専用＞	1,268,921,919 円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ４０＜適格機関投資家専用＞	1,323,429,747 円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ３５＜適格機関投資家専用＞	4,101,843,816 円
ＳＭＡＭ・バランスＶＡ株４０Ｔ＜適格機関投資家限定＞	604,716 円
ＳＭＡＭ・外国債券パッシブファンドＶＡ＜適格機関投資家限定＞	7,085,943,621 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）	347,826,035 円
ＳＭＡＭ・グローバルバランス４０ＶＡ＜適格機関投資家限定＞	118,096,909 円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２０Ａ＜適格機関投資家専用＞	67,375,516 円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ３５Ａ＜適格機関投資家専用＞	30,968,221 円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ５０Ａ＜適格機関投資家専用＞	11,644,067 円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２０Ｌ＜適格機関投資家専用＞	79,129,938 円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２５Ｌ＜適格機関投資家専用＞	363,615,745 円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２０Ａ２＜適格機関投資家専用＞	87,782,097 円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ３５Ａ２＜適格機関投資家専用＞	37,478,954 円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ５０Ａ２＜適格機関投資家専用＞	5,563,850 円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２５Ｌ２＜適格機関投資家専用＞	894,241,280 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＞	536,701,272 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＞	733,398,496 円
ＳＭＡＭ・世界バランスファンドＶＡ＜適格機関投資家限定＞	403,957,887 円
ＳＭＡＭ・世界バランスファンドＶＡ２＜適格機関投資家限定＞	271,348,478 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＞	80,252,402 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＞	51,570,634 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＞	66,141,197 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＞	824,985,964 円
合　計	78,149,894,072 円

（2024 年 2 月 19 日現在）

開示対象ファンドの

期首における当該親投資信託の元本額	78,149,894,072 円
同期中における追加設定元本額	13,335,323,911 円
同期中における一部解約元本額	11,069,969,988 円
2024 年 2 月 19 日現在の元本の内訳	
三井住友・ＤＣ外国債券インデックスファンドＳ	27,036,917,024 円
三井住友・ＤＣ年金バランス３０（債券重点型）	969,291,403 円
三井住友・ＤＣ年金バランス５０（標準型）	2,437,524,335 円
三井住友・ＤＣ年金バランス７０（株式重点型）	1,460,646,470 円
ＳＭＡＭ・グローバルバランスファンド（機動的資産配分型）	121,105,587 円
三井住友・ＤＣターゲットイヤーファンド２０２０（４資産タイプ）	5,712,728 円
三井住友・ＤＣターゲットイヤーファンド２０２５（４資産タイプ）	25,193,200 円
三井住友・ＤＣターゲットイヤーファンド２０３０（４資産タイプ）	95,498,475 円
三井住友・ＤＣターゲットイヤーファンド２０３５（４資産タイプ）	292,748,845 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）	220,951,196 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）	358,827,889 円
三井住友・ＤＣ年金バランスゼロ（債券型）	19,824,266 円
アセットアロケーション・ファンド（安定型）	57,265,000 円
アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）	101,159,985 円
アセットアロケーション・ファンド（成長型）	64,458,044 円
イオン・バランス戦略ファンド	82,860,131 円
三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０５０	40,653,897 円
三井住友・資産最適化ファンド（１安定重視型）	359,406,170 円
三井住友・資産最適化ファンド（２やや安定型）	242,197,240 円
三井住友・資産最適化ファンド（３バランス型）	684,187,770 円
三井住友・資産最適化ファンド（４やや成長型）	218,225,142 円
三井住友・資産最適化ファンド（５成長重視型）	113,475,292 円
三井住友・ＤＣつみたてＮＩＳＡ・世界分散ファンド	231,601,277 円
三井住友ＤＳ・外国債券インデックス年金ファンド	1,067,046,769 円
三井住友ＤＳ・年金バランス３０（債券重点型）	40,599,325 円
三井住友ＤＳ・年金バランス５０（標準型）	140,958,749 円
三井住友ＤＳ・年金バランス７０（株式重点型）	109,081,800 円
三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０６０	3,854,235 円
日興ＦＷＳ・先進国債インデックス（為替ヘッジなし）	3,271,941,028 円
三井住友ＤＳ・先進国債インデックス・ファンド	313,784,002 円
三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０３５	4,250,284 円
三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０４０	2,643,628 円
三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０４５	3,761,241 円
三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０５５	1,072,377 円
三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０６５	702,610 円
三井住友ＤＳ・ＦＷ専用ポートフォリオ・レベル１（保守型）	617,466 円
三井住友ＤＳ・ＦＷ専用ポートフォリオ・レベル２（安定型）	8,666,727 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）	32,673,788 円
三井住友ＤＳ・ＦＷ専用ポートフォリオ・レベル４（成長型）	17,130,944 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）	6,299,676 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＞	5,050,280,230 円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ安定成長型＜適格機関投資家限定＞	21,269,064 円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ２５＜適格機関投資家専用＞	4,123,873,956 円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ３７．５＜適格機関投資家専用＞	3,597,206,169 円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ５０＜適格機関投資家専用＞	8,585,342,356 円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＬ３０＜適格機関投資家限定＞	28,565,773 円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＬ５０＜適格機関投資家限定＞	68,538,172 円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ７５＜適格機関投資家専用＞	646,535,008 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＞	97,653,517 円
ＳＭＡＭ・インデックス・バランスＶＡ２５＜適格機関投資家専用＞	851,328,029 円
ＳＭＡＭ・インデックス・バランスＶＡ５０＜適格機関投資家専用＞	1,219,045,963 円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ４０＜適格機関投資家専用＞	1,182,676,466 円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ３５＜適格機関投資家専用＞	3,585,194,533 円
ＳＭＡＭ・外国債券パッシブファンドＶＡ＜適格機関投資家限定＞	6,191,016,644 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）	293,323,555 円
ＳＭＡＭ・グローバルバランス４０ＶＡ＜適格機関投資家限定＞	101,932,994 円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２０Ａ＜適格機関投資家専用＞	56,153,532 円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ３５Ａ＜適格機関投資家専用＞	29,310,007 円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ５０Ａ＜適格機関投資家専用＞	11,741,981 円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２０Ｌ＜適格機関投資家専用＞	63,446,869 円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２５Ｌ＜適格機関投資家専用＞	328,215,221 円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２０Ａ２＜適格機関投資家専用＞	71,432,351 円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ３５Ａ２＜適格機関投資家専用＞	37,190,973 円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ５０Ａ２＜適格機関投資家専用＞	5,511,845 円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２５Ｌ２＜適格機関投資家専用＞	776,532,407 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＞	475,694,440 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＞	631,728,833 円
ＳＭＡＭ・世界バランスファンドＶＡ＜適格機関投資家限定＞	247,141,919 円
ＳＭＡＭ・世界バランスファンドＶＡ２＜適格機関投資家限定＞	211,356,046 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＞	132,924,650 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＞	57,415,916 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＞	91,674,234 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＞	990,643,082 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＞	288,535,245 円
合　計	80,415,247,995 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 05/31/25	4,400,000.00	4,150,828.00	
		T 0.25 06/30/25	2,900,000.00	2,726,667.00	
		T 0.25 07/31/25	300,000.00	281,124.00	
		T 0.25 09/30/25	2,000,000.00	1,861,440.00	
		T 0.25 10/31/25	1,000,000.00	927,730.00	
		T 0.375 04/30/25	3,000,000.00	2,844,240.00	
		T 0.375 07/31/27	2,500,000.00	2,181,675.00	
		T 0.375 09/30/27	4,800,000.00	4,165,296.00	
		T 0.375 11/30/25	2,000,000.00	1,853,820.00	
		T 0.375 12/31/25	3,000,000.00	2,773,050.00	
		T 0.5 03/31/25	1,600,000.00	1,524,272.00	
		T 0.5 04/30/27	1,200,000.00	1,061,808.00	
		T 0.5 05/31/27	2,500,000.00	2,204,675.00	
		T 0.5 06/30/27	4,000,000.00	3,517,960.00	
		T 0.5 10/31/27	1,000,000.00	869,270.00	
		T 0.625 03/31/27	2,400,000.00	2,138,856.00	
		T 0.625 05/15/30	5,000,000.00	4,001,950.00	
		T 0.625 07/31/26	800,000.00	728,656.00	
		T 0.625 08/15/30	4,800,000.00	3,808,656.00	
		T 0.625 11/30/27	3,400,000.00	2,961,910.00	
		T 0.625 12/31/27	7,200,000.00	6,252,696.00	
		T 0.75 01/31/28	5,900,000.00	5,135,596.00	
		T 0.75 04/30/26	1,500,000.00	1,381,575.00	
		T 0.75 05/31/26	2,000,000.00	1,836,900.00	
		T 0.75 08/31/26	1,500,000.00	1,367,040.00	
		T 0.875 06/30/26	2,000,000.00	1,839,240.00	
		T 0.875 09/30/26	2,500,000.00	2,281,775.00	
		T 0.875 11/15/30	4,900,000.00	3,932,593.00	
		T 1 07/31/28	2,900,000.00	2,513,401.00	
		T 1.125 02/15/31	5,700,000.00	4,636,551.00	
		T 1.125 02/28/25	1,500,000.00	1,442,460.00	
		T 1.125 02/28/27	2,000,000.00	1,815,500.00	
		T 1.125 05/15/40	3,800,000.00	2,316,556.00	
		T 1.125 08/15/40	3,100,000.00	1,871,780.00	
		T 1.125 08/31/28	3,500,000.00	3,043,600.00	
		T 1.125 10/31/26	3,700,000.00	3,388,645.00	
		T 1.25 05/15/50	5,100,000.00	2,546,991.00	
		T 1.25 05/31/28	3,000,000.00	2,641,260.00	
		T 1.25 06/30/28	3,000,000.00	2,635,410.00	

T 1.25 08/15/31	5,200,000.00	4,195,204.00	
T 1.25 09/30/28	3,000,000.00	2,618,370.00	
T 1.25 11/30/26	4,200,000.00	3,851,904.00	
T 1.25 12/31/26	2,600,000.00	2,380,456.00	
T 1.375 01/31/25	1,900,000.00	1,836,388.00	
T 1.375 08/15/50	4,500,000.00	2,322,495.00	
T 1.375 08/31/26	600,000.00	555,702.00	
T 1.375 10/31/28	3,000,000.00	2,628,330.00	
T 1.375 11/15/31	4,900,000.00	3,962,287.00	
T 1.375 11/15/40	3,500,000.00	2,198,420.00	
T 1.375 12/31/28	1,000,000.00	872,590.00	
T 1.5 01/31/27	3,400,000.00	3,127,796.00	
T 1.5 02/15/25	3,000,000.00	2,898,870.00	
T 1.5 02/15/30	2,100,000.00	1,791,888.00	
T 1.5 11/30/28	4,500,000.00	3,958,200.00	
T 1.625 02/15/26	2,900,000.00	2,735,715.00	
T 1.625 05/15/26	11,450,000.00	10,741,016.00	
T 1.625 05/15/31	5,500,000.00	4,594,920.00	
T 1.625 08/15/29	3,750,000.00	3,273,750.00	
T 1.625 09/30/26	900,000.00	837,702.00	
T 1.625 11/15/50	3,200,000.00	1,767,552.00	
T 1.625 11/30/26	200,000.00	185,420.00	
T 1.75 01/31/29	3,300,000.00	2,927,562.00	
T 1.75 03/15/25	1,500,000.00	1,449,900.00	
T 1.75 08/15/41	4,400,000.00	2,904,000.00	
T 1.75 11/15/29	1,300,000.00	1,137,747.00	
T 1.75 12/31/26	2,500,000.00	2,321,375.00	
T 1.875 02/15/32	5,300,000.00	4,434,987.00	
T 1.875 02/15/41	3,300,000.00	2,251,260.00	
T 1.875 02/15/51	5,800,000.00	3,415,968.00	
T 1.875 02/28/27	3,400,000.00	3,156,458.00	
T 1.875 02/28/29	2,800,000.00	2,495,500.00	
T 1.875 07/31/26	2,500,000.00	2,349,100.00	
T 1.875 11/15/51	3,300,000.00	1,932,216.00	
T 2 02/15/25	2,500,000.00	2,427,450.00	
T 2 02/15/50	2,800,000.00	1,717,604.00	
T 2 08/15/25	3,300,000.00	3,169,023.00	
T 2 08/15/51	2,900,000.00	1,756,965.00	
T 2 11/15/26	1,000,000.00	937,030.00	
T 2 11/15/41	3,800,000.00	2,609,574.00	
T 2.125 05/15/25	600,000.00	580,368.00	
T 2.25 02/15/27	4,400,000.00	4,134,416.00	

T 2.25 02/15/52	1,700,000.00	1,093,933.00	
T 2.25 03/31/26	8,200,000.00	7,820,094.00	
T 2.25 05/15/41	5,000,000.00	3,615,500.00	
T 2.25 08/15/27	4,200,000.00	3,911,964.00	
T 2.25 08/15/46	1,950,000.00	1,309,308.00	
T 2.25 08/15/49	3,500,000.00	2,286,550.00	
T 2.25 11/15/25	4,000,000.00	3,837,160.00	
T 2.25 11/15/27	4,400,000.00	4,081,572.00	
T 2.375 02/15/42	2,800,000.00	2,041,368.00	
T 2.375 03/31/29	5,000,000.00	4,560,900.00	
T 2.375 05/15/27	3,000,000.00	2,817,360.00	
T 2.375 05/15/29	2,400,000.00	2,185,488.00	
T 2.375 05/15/51	3,900,000.00	2,591,433.00	
T 2.375 11/15/49	1,900,000.00	1,275,470.00	
T 2.5 01/31/25	3,400,000.00	3,320,848.00	
T 2.5 02/15/45	1,400,000.00	1,004,934.00	
T 2.5 02/15/46	1,000,000.00	709,840.00	
T 2.5 02/28/26	2,100,000.00	2,014,593.00	
T 2.5 03/31/27	3,000,000.00	2,835,030.00	
T 2.5 05/15/46	1,000,000.00	707,940.00	
T 2.625 01/31/26	2,200,000.00	2,118,270.00	
T 2.625 02/15/29	1,800,000.00	1,665,828.00	
T 2.625 03/31/25	1,000,000.00	975,270.00	
T 2.625 04/15/25	4,500,000.00	4,385,385.00	
T 2.625 05/31/27	4,800,000.00	4,540,080.00	
T 2.625 07/31/29	1,100,000.00	1,011,175.00	
T 2.625 12/31/25	1,400,000.00	1,349,656.00	
T 2.75 02/15/28	5,300,000.00	4,992,653.00	
T 2.75 02/28/25	2,000,000.00	1,955,560.00	
T 2.75 04/30/27	1,600,000.00	1,521,360.00	
T 2.75 05/15/25	3,000,000.00	2,923,650.00	
T 2.75 05/31/29	1,400,000.00	1,297,996.00	
T 2.75 06/30/25	900,000.00	875,682.00	
T 2.75 08/15/32	4,200,000.00	3,735,606.00	
T 2.75 08/15/42	2,000,000.00	1,542,180.00	
T 2.75 08/15/47	1,800,000.00	1,322,568.00	
T 2.75 08/31/25	3,400,000.00	3,298,714.00	
T 2.75 11/15/42	300,000.00	230,517.00	
T 2.75 11/15/47	1,500,000.00	1,100,505.00	
T 2.875 04/30/25	400,000.00	390,684.00	
T 2.875 04/30/29	3,500,000.00	3,268,860.00	
T 2.875 05/15/28	3,500,000.00	3,303,125.00	

T 2.875 05/15/32	5,700,000.00	5,135,643.00	
T 2.875 05/15/43	1,200,000.00	936,444.00	
T 2.875 05/15/49	1,400,000.00	1,045,072.00	
T 2.875 05/15/52	3,200,000.00	2,372,480.00	
T 2.875 05/31/25	3,100,000.00	3,024,112.00	
T 2.875 06/15/25	2,000,000.00	1,950,000.00	
T 2.875 08/15/28	4,500,000.00	4,236,030.00	
T 2.875 08/15/45	800,000.00	611,480.00	
T 2.875 11/15/46	3,000,000.00	2,270,490.00	
T 2.875 11/30/25	2,500,000.00	2,422,400.00	
T 3 02/15/47	2,500,000.00	1,932,175.00	
T 3 02/15/48	2,400,000.00	1,844,184.00	
T 3 02/15/49	3,300,000.00	2,525,457.00	
T 3 05/15/42	800,000.00	643,184.00	
T 3 05/15/45	900,000.00	704,664.00	
T 3 05/15/47	2,700,000.00	2,082,942.00	
T 3 07/15/25	2,000,000.00	1,951,160.00	
T 3 08/15/48	2,000,000.00	1,533,120.00	
T 3 08/15/52	3,000,000.00	2,283,750.00	
T 3 09/30/25	1,000,000.00	972,870.00	
T 3 10/31/25	2,600,000.00	2,527,174.00	
T 3 11/15/44	1,000,000.00	786,320.00	
T 3 11/15/45	800,000.00	624,024.00	
T 3.125 02/15/42	1,000,000.00	822,360.00	
T 3.125 02/15/43	2,300,000.00	1,871,349.00	
T 3.125 05/15/48	2,400,000.00	1,885,440.00	
T 3.125 08/15/25	3,000,000.00	2,929,020.00	
T 3.125 08/15/44	700,000.00	563,346.00	
T 3.125 08/31/29	2,700,000.00	2,544,210.00	
T 3.125 11/15/28	2,900,000.00	2,753,840.00	
T 3.125 11/15/41	1,000,000.00	825,230.00	
T 3.25 05/15/42	2,200,000.00	1,835,966.00	
T 3.25 06/30/29	3,000,000.00	2,849,160.00	
T 3.375 05/15/33	5,500,000.00	5,110,435.00	
T 3.375 05/15/44	500,000.00	419,450.00	
T 3.375 08/15/42	3,000,000.00	2,546,010.00	
T 3.375 11/15/48	3,100,000.00	2,544,883.00	
T 3.5 01/31/28	1,000,000.00	968,980.00	
T 3.5 01/31/30	2,500,000.00	2,394,525.00	
T 3.5 02/15/33	6,100,000.00	5,732,658.00	
T 3.5 02/15/39	200,000.00	180,378.00	
T 3.5 04/30/30	2,500,000.00	2,389,725.00	

		T 3.625 02/15/44	300,000.00	261,777.00	
		T 3.625 02/15/53	1,700,000.00	1,465,417.00	
		T 3.625 03/31/28	3,000,000.00	2,918,940.00	
		T 3.625 03/31/30	1,200,000.00	1,155,696.00	
		T 3.625 05/15/26	2,500,000.00	2,450,375.00	
		T 3.625 05/15/53	2,100,000.00	1,811,565.00	
		T 3.625 05/31/28	2,000,000.00	1,944,880.00	
		T 3.625 08/15/43	500,000.00	437,265.00	
		T 3.75 04/15/26	3,300,000.00	3,243,702.00	
		T 3.75 05/31/30	3,000,000.00	2,906,760.00	
		T 3.75 06/30/30	4,400,000.00	4,261,796.00	
		T 3.75 08/15/41	1,100,000.00	994,895.00	
		T 3.75 11/15/43	700,000.00	622,643.00	
		T 3.75 12/31/28	1,000,000.00	976,090.00	
		T 3.75 12/31/30	2,400,000.00	2,320,488.00	
		T 3.875 01/15/26	5,300,000.00	5,224,899.00	
		T 3.875 02/15/43	2,600,000.00	2,363,452.00	
		T 3.875 04/30/25	1,000,000.00	988,100.00	
		T 3.875 05/15/43	1,500,000.00	1,362,765.00	
		T 3.875 08/15/33	6,000,000.00	5,798,400.00	
		T 3.875 08/15/40	500,000.00	463,485.00	
		T 3.875 09/30/29	2,300,000.00	2,250,297.00	
		T 3.875 12/31/27	4,400,000.00	4,323,000.00	
		T 3.875 12/31/29	1,500,000.00	1,466,130.00	
		T 4 01/15/27	4,900,000.00	4,841,396.00	
		T 4 01/31/29	1,600,000.00	1,579,616.00	
		T 4 02/15/26	2,000,000.00	1,976,040.00	
		T 4 02/28/30	1,500,000.00	1,474,800.00	
		T 4 02/29/28	5,000,000.00	4,934,050.00	
		T 4 06/30/28	3,000,000.00	2,960,910.00	
		T 4 07/31/30	2,200,000.00	2,160,928.00	
		T 4 10/31/29	1,600,000.00	1,574,864.00	
		T 4 11/15/42	2,000,000.00	1,853,040.00	
		T 4 11/15/52	2,600,000.00	2,401,880.00	
		T 4.125 01/31/25	3,500,000.00	3,470,460.00	
		T 4.125 06/15/26	2,000,000.00	1,981,560.00	
		T 4.125 07/31/28	1,000,000.00	992,080.00	
		T 4.125 08/15/53	1,000,000.00	944,920.00	
		T 4.125 08/31/30	500,000.00	494,420.00	
		T 4.125 10/31/27	3,500,000.00	3,469,025.00	
		T 4.125 11/15/32	5,600,000.00	5,523,000.00	
		T 4.25 01/31/26	3,300,000.00	3,275,415.00	

		T 4.25 05/15/39	100,000.00	98,101.00	
		T 4.25 10/15/25	2,000,000.00	1,984,280.00	
		T 4.25 11/15/40	600,000.00	581,388.00	
		T 4.25 12/31/25	3,500,000.00	3,472,910.00	
		T 4.375 05/15/40	900,000.00	888,813.00	
		T 4.375 05/15/41	300,000.00	294,321.00	
		T 4.375 08/15/26	4,000,000.00	3,987,080.00	
		T 4.375 08/15/43	500,000.00	486,445.00	
		T 4.375 08/31/28	1,000,000.00	1,002,320.00	
		T 4.375 11/15/39	300,000.00	297,378.00	
		T 4.375 11/30/28	1,900,000.00	1,906,308.00	
		T 4.375 11/30/30	1,900,000.00	1,905,928.00	
		T 4.375 12/15/26	4,000,000.00	3,991,840.00	
		T 4.5 05/15/38	2,000,000.00	2,029,320.00	
		T 4.5 07/15/26	3,900,000.00	3,897,465.00	
		T 4.5 08/15/39	300,000.00	302,136.00	
		T 4.5 11/15/25	3,800,000.00	3,785,940.00	
		T 4.5 11/15/33	4,500,000.00	4,568,175.00	
		T 4.625 02/15/40	1,000,000.00	1,018,160.00	
		T 4.625 02/28/25	3,800,000.00	3,786,206.00	
		T 4.625 03/15/26	2,500,000.00	2,500,275.00	
		T 4.625 09/15/26	4,000,000.00	4,012,080.00	
		T 4.625 09/30/30	1,500,000.00	1,526,010.00	
		T 4.625 10/15/26	1,000,000.00	1,003,370.00	
		T 4.625 11/15/26	2,800,000.00	2,810,808.00	
		T 4.75 02/15/41	900,000.00	925,515.00	
		T 4.75 11/15/43	700,000.00	715,967.00	
		T 4.75 11/15/53	300,000.00	315,117.00	
		T 4.875 10/31/28	1,400,000.00	1,432,998.00	
		T 5.25 11/15/28	500,000.00	519,840.00	
		T 5.375 02/15/31	320,000.00	342,224.00	
		T 6 02/15/26	1,000,000.00	1,026,520.00	
		T 6.125 11/15/27	1,000,000.00	1,059,600.00	
	アメリカ・ドル小計		626,170,000.00	554,711,738.00 (83,223,402,052)	
	カナダ・ドル	CAN 0.5 09/01/25	2,700,000.00	2,543,211.00	
		CAN 1 06/01/27	800,000.00	731,560.00	
		CAN 1.25 03/01/27	400,000.00	369,748.00	
		CAN 1.25 06/01/30	800,000.00	694,792.00	
		CAN 1.5 04/01/25	300,000.00	289,638.00	
		CAN 1.5 06/01/26	2,600,000.00	2,452,918.00	
		CAN 1.5 12/01/31	2,100,000.00	1,801,527.00	

	CAN 1.75 12/01/53	1,100,000.00	757,581.00	
	CAN 2 06/01/28	700,000.00	653,653.00	
	CAN 2 06/01/32	2,000,000.00	1,771,380.00	
	CAN 2.25 06/01/25	500,000.00	485,440.00	
	CAN 2.25 06/01/29	1,100,000.00	1,029,391.00	
	CAN 2.25 12/01/29	1,600,000.00	1,490,416.00	
	CAN 2.5 12/01/32	2,930,000.00	2,688,392.20	
	CAN 2.75 06/01/33	1,800,000.00	1,681,956.00	
	CAN 2.75 09/01/27	2,300,000.00	2,217,522.00	
	CAN 2.75 12/01/48	1,300,000.00	1,147,731.00	
	CAN 2.75 12/01/55	300,000.00	261,345.00	
	CAN 3 04/01/26	200,000.00	195,200.00	
	CAN 3 10/01/25	900,000.00	879,372.00	
	CAN 3.25 12/01/33	300,000.00	291,864.00	
	CAN 3.5 08/01/25	1,300,000.00	1,280,799.00	
	CAN 3.5 12/01/45	1,200,000.00	1,201,380.00	
	CAN 4 06/01/41	1,300,000.00	1,379,092.00	
	CAN 4.5 11/01/25	1,800,000.00	1,801,512.00	
	CAN 5 06/01/37	400,000.00	459,324.00	
	CAN 5.75 06/01/29	250,000.00	275,342.50	
	CAN 5.75 06/01/33	300,000.00	350,466.00	
	CANADA 2.75 12/01/64	700,000.00	605,934.00	
カナダ・ドル小計		33,980,000.00	31,788,486.70 (3,540,919,534)	
オーストラリア・ドル	ACGB 0.25 11/21/25	1,300,000.00	1,221,194.00	
	ACGB 0.5 09/21/26	100,000.00	92,018.00	
	ACGB 1.25 05/21/32	800,000.00	640,008.00	
	ACGB 1.5 06/21/31	4,100,000.00	3,440,023.00	
	ACGB 1.75 06/21/51	500,000.00	281,040.00	
	ACGB 1.75 11/21/32	1,400,000.00	1,154,006.00	
	ACGB 2.25 05/21/28	1,300,000.00	1,221,090.00	
	ACGB 2.5 05/21/30	2,400,000.00	2,208,264.00	
	ACGB 2.75 05/21/41	600,000.00	475,512.00	
	ACGB 2.75 06/21/35	800,000.00	692,552.00	
	ACGB 2.75 11/21/27	2,400,000.00	2,313,432.00	
	ACGB 2.75 11/21/28	200,000.00	190,712.00	
	ACGB 2.75 11/21/29	1,800,000.00	1,693,638.00	
	ACGB 3 03/21/47	1,200,000.00	932,760.00	
	ACGB 3 11/21/33	900,000.00	814,437.00	
	ACGB 3.25 04/21/29	800,000.00	777,248.00	
	ACGB 3.25 06/21/39	2,000,000.00	1,742,000.00	
	ACGB 3.75 04/21/37	900,000.00	848,538.00	

	ACGB 4.25 04/21/26	2,150,000.00	2,169,092.00	
	ACGB 4.5 04/21/33	1,500,000.00	1,536,780.00	
オーストラリア・ドル小計		27,150,000.00	24,444,344.00 (2,401,412,355)	
シンガポール・ドル	SIGB 0.5 11/01/25	200,000.00	190,746.00	
	SIGB 1.25 11/01/26	600,000.00	571,200.00	
	SIGB 1.625 07/01/31	1,000,000.00	905,500.00	
	SIGB 2.25 08/01/36	1,000,000.00	917,000.00	
	SIGB 2.625 05/01/28	800,000.00	786,880.00	
	SIGB 2.75 03/01/46	1,000,000.00	960,500.00	
	SIGB 2.75 04/01/42	700,000.00	676,389.00	
	SIGB 2.875 09/01/30	200,000.00	197,760.00	
	SIGB 3.375 09/01/33	400,000.00	410,344.00	
	SIGB 3.5 03/01/27	880,000.00	890,736.00	
シンガポール・ドル小計		6,780,000.00	6,507,055.00 (725,796,915)	
ニュージーランド・ドル	NZGB 0.5 05/15/26	100,000.00	90,755.00	
	NZGB 1.75 05/15/41	700,000.00	433,286.00	
	NZGB 2 05/15/32	1,120,000.00	909,764.80	
	NZGB 2.75 04/15/25	550,000.00	533,742.00	
	NZGB 2.75 05/15/51	500,000.00	328,785.00	
	NZGB 3 04/20/29	1,000,000.00	923,910.00	
	NZGB 4.5 04/15/27	1,100,000.00	1,091,530.00	
	NZGB 4.5 05/15/30	170,000.00	168,111.30	
ニュージーランド・ドル小計		5,240,000.00	4,479,884.10 (412,597,326)	
イギリス・ポンド	UK TSY GILT 1.125 01/31/39	600,000.00	382,758.00	
	UKT 0.125 01/30/26	1,500,000.00	1,384,110.00	
	UKT 0.125 01/31/28	1,700,000.00	1,458,413.00	
	UKT 0.25 01/31/25	700,000.00	670,915.00	
	UKT 0.25 07/31/31	1,300,000.00	987,103.00	
	UKT 0.375 10/22/26	2,000,000.00	1,807,700.00	
	UKT 0.375 10/22/30	600,000.00	474,552.00	
	UKT 0.5 01/31/29	2,050,000.00	1,729,175.00	
	UKT 0.5 10/22/61	900,000.00	260,991.00	
	UKT 0.625 06/07/25	900,000.00	855,315.00	
	UKT 0.625 07/31/35	1,700,000.00	1,146,140.00	
	UKT 0.875 01/31/46	400,000.00	195,280.00	
	UKT 0.875 07/31/33	1,300,000.00	971,620.00	
	UKT 0.875 10/22/29	500,000.00	422,070.00	
	UKT 1 01/31/32	2,100,000.00	1,668,492.00	
	UKT 1.125 10/22/73	300,000.00	107,070.00	

	UKT 1.25 07/22/27	900,000.00	818,397.00	
	UKT 1.25 07/31/51	1,200,000.00	576,480.00	
	UKT 1.25 10/22/41	2,700,000.00	1,628,802.00	
	UKT 1.5 07/22/26	1,100,000.00	1,031,965.00	
	UKT 1.5 07/22/47	2,000,000.00	1,111,280.00	
	UKT 1.625 10/22/28	900,000.00	809,991.00	
	UKT 1.625 10/22/54	500,000.00	257,090.00	
	UKT 1.75 01/22/49	1,950,000.00	1,127,100.00	
	UKT 1.75 09/07/37	100,000.00	73,351.00	
	UKT 2 09/07/25	1,100,000.00	1,058,475.00	
	UKT 2.5 07/22/65	1,600,000.00	1,001,808.00	
	UKT 3.25 01/22/44	1,600,000.00	1,316,736.00	
	UKT 3.25 01/31/33	2,400,000.00	2,248,128.00	
	UKT 3.5 01/22/45	1,250,000.00	1,062,237.50	
	UKT 3.5 07/22/68	1,300,000.00	1,052,220.00	
	UKT 3.5 10/22/25	700,000.00	687,624.00	
	UKT 3.75 01/29/38	1,100,000.00	1,023,627.00	
	UKT 3.75 07/22/52	1,200,000.00	1,034,160.00	
	UKT 4 01/22/60	1,300,000.00	1,170,130.00	
	UKT 4.125 01/29/27	1,700,000.00	1,693,625.00	
	UKT 4.25 03/07/36	700,000.00	698,194.00	
	UKT 4.25 06/07/32	500,000.00	507,725.00	
	UKT 4.25 09/07/39	600,000.00	584,394.00	
	UKT 4.25 12/07/27	900,000.00	904,050.00	
	UKT 4.25 12/07/40	600,000.00	580,500.00	
	UKT 4.25 12/07/46	1,500,000.00	1,418,475.00	
	UKT 4.25 12/07/49	900,000.00	847,206.00	
	UKT 4.25 12/07/55	1,700,000.00	1,595,280.00	
	UKT 4.5 09/07/34	400,000.00	410,044.00	
	UKT 4.5 12/07/42	1,050,000.00	1,040,025.00	
	UKT 4.625 01/31/34	400,000.00	414,564.00	
	UKT 4.75 12/07/30	1,150,000.00	1,201,474.00	
	UKT 4.75 12/07/38	1,000,000.00	1,033,450.00	
	UKT 5 03/07/25	1,300,000.00	1,302,028.00	
	UKT 6 12/07/28	650,000.00	705,783.00	
イギリス・ポンド小計		58,500,000.00	48,548,122.50 (9,192,586,995)	
イスラエル・シュケル	ILGOV 0.5 04/30/25	3,100,000.00	2,980,588.00	
	ILGOV 1 03/31/30	1,400,000.00	1,171,184.00	
	ILGOV 1.5 05/31/37	1,200,000.00	837,600.00	
	ILGOV 2.25 09/28/28	1,900,000.00	1,763,979.00	
	ILGOV 3.75 02/28/29	500,000.00	494,600.00	

	ILGOV 3.75 03/31/47	3,600,000.00	3,092,976.00	
	ILGOV 6.25 10/30/26	3,300,000.00	3,498,033.00	
イスラエル・シュケル小計		15,000,000.00	13,838,960.00 (575,080,751)	
デンマーク・クローネ	DGB 0 11/15/31	500,000.00	416,490.00	
	DGB 0.25 11/15/52	1,800,000.00	963,198.00	
	DGB 0.5 11/15/27	6,100,000.00	5,673,061.00	
	DGB 0.5 11/15/29	5,400,000.00	4,853,250.00	
	DGB 1.75 11/15/25	100,000.00	98,195.00	
	DGB 2.25 11/15/33	1,200,000.00	1,174,068.00	
	DGB 4.5 11/15/39	7,000,000.00	8,688,400.00	
デンマーク・クローネ小計		22,100,000.00	21,866,662.00 (474,506,564)	
ノルウェー・クローネ	NGB 1.375 08/19/30	6,800,000.00	5,875,948.00	
	NGB 1.5 02/19/26	2,300,000.00	2,189,968.00	
	NGB 1.75 02/17/27	200,000.00	188,126.00	
	NGB 1.75 03/13/25	1,200,000.00	1,168,344.00	
	NGB 1.75 09/06/29	5,000,000.00	4,504,700.00	
	NGB 2 04/26/28	5,900,000.00	5,494,198.00	
	NGB 3 08/15/33	1,100,000.00	1,033,659.00	
	NGB 3.5 10/06/42	700,000.00	689,983.00	
ノルウェー・クローネ小計		23,200,000.00	21,144,926.00 (301,949,543)	
スウェーデン・クローナ	SGB 0.125 05/12/31	500,000.00	425,600.00	
	SGB 0.75 05/12/28	3,700,000.00	3,446,513.00	
	SGB 0.75 11/12/29	4,200,000.00	3,836,364.00	
	SGB 1 11/12/26	6,200,000.00	5,925,960.00	
	SGB 2.5 05/12/25	5,000,000.00	4,955,900.00	
	SGB 3.5 03/30/39	5,300,000.00	5,896,462.00	
スウェーデン・クローナ小計		24,900,000.00	24,486,799.00 (352,365,038)	
メキシコ・ペソ	MBONO 5 03/06/25	16,000,000.00	15,186,240.00	
	MBONO 5.5 03/04/27	3,000,000.00	2,683,260.00	
	MBONO 5.75 03/05/26	19,000,000.00	17,491,020.00	
	MBONO 7.5 05/26/33	6,000,000.00	5,356,200.00	
	MBONO 7.5 06/03/27	22,000,000.00	20,788,680.00	
	MBONO 7.75 05/29/31	29,000,000.00	26,739,160.00	
	MBONO 7.75 11/23/34	18,000,000.00	16,208,640.00	
	MBONO 8 11/07/47	9,000,000.00	7,822,530.00	
	MBONO 8.5 05/31/29	25,000,000.00	24,270,000.00	
	MBONO 8.5 11/18/38	40,000,000.00	37,557,600.00	
メキシコ・ペソ小計		187,000,000.00	174,103,330.00	

			(1,534,024,441)	
オフショア・人民元	CGB 2.18 08/15/26	22,800,000.00	22,793,160.00	
	CGB 2.18 08/25/25	39,000,000.00	39,012,480.00	
	CGB 2.24 05/25/25	31,000,000.00	31,021,080.00	
	CGB 2.26 02/24/25	18,000,000.00	18,046,620.00	
	CGB 2.3 05/15/26	17,000,000.00	17,038,250.00	
	CGB 2.37 01/15/29	6,000,000.00	6,023,280.00	
	CGB 2.39 11/15/26	35,000,000.00	35,184,450.00	
	CGB 2.4 07/15/28	41,000,000.00	41,123,410.00	
	CGB 2.46 02/15/26	29,000,000.00	29,173,710.00	
	CGB 2.48 04/15/27	9,000,000.00	9,071,640.00	
	CGB 2.5 07/25/27	13,000,000.00	13,089,050.00	
	CGB 2.52 08/25/33	11,000,000.00	10,997,030.00	
	CGB 2.54 12/25/30	5,000,000.00	5,022,300.00	
	CGB 2.55 10/15/28	11,000,000.00	11,087,340.00	
	CGB 2.6 09/15/30	32,000,000.00	32,153,280.00	
	CGB 2.62 04/15/28	27,000,000.00	27,358,830.00	
	CGB 2.62 06/25/30	22,000,000.00	22,196,900.00	
	CGB 2.62 09/25/29	19,000,000.00	19,240,730.00	
	CGB 2.64 01/15/28	31,500,000.00	31,929,660.00	
	CGB 2.67 05/25/33	5,000,000.00	5,067,400.00	
	CGB 2.67 11/25/33	15,000,000.00	15,300,600.00	
	CGB 2.69 08/12/26	50,000,000.00	50,632,500.00	
	CGB 2.8 03/24/29	26,000,000.00	26,564,200.00	
	CGB 2.8 03/25/30	15,000,000.00	15,289,050.00	
	CGB 2.8 11/15/32	21,000,000.00	21,473,760.00	
	CGB 2.88 02/25/33	10,900,000.00	11,233,649.00	
	CGB 2.91 10/14/28	21,000,000.00	21,578,340.00	
	CGB 3 10/15/53	6,000,000.00	6,442,020.00	
	CGB 3.02 05/27/31	43,000,000.00	44,544,990.00	
	CGB 3.12 10/25/52	16,000,000.00	17,295,680.00	
	CGB 3.19 04/15/53	8,000,000.00	8,905,440.00	
	CGB 3.72 04/12/51	38,700,000.00	46,138,140.00	
オフショア・人民元小計		694,900,000.00	712,028,969.00 (14,817,892,468)	
マレーシア・リンギット	MGS 3.502 05/31/27	5,100,000.00	5,101,683.00	
	MGS 3.582 07/15/32	2,500,000.00	2,448,250.00	
	MGS 3.757 05/22/40	1,400,000.00	1,353,030.00	
	MGS 3.882 03/14/25	500,000.00	503,115.00	
	MGS 3.9 11/30/26	1,300,000.00	1,315,457.00	
	MGS 3.955 09/15/25	3,200,000.00	3,225,952.00	
	MGS 4.498 04/15/30	4,000,000.00	4,170,640.00	

	MGS 4.504 04/30/29	700,000.00	728,532.00	
	MGS 4.696 10/15/42	1,700,000.00	1,834,589.00	
	MGS 4.736 03/15/46	6,700,000.00	7,242,834.00	
マレーシア・リンギット小計		27,100,000.00	27,924,082.00 (876,528,557)	
ポーランド・ズロチ	POLGB 0 10/25/25	5,000,000.00	4,603,050.00	
	POLGB 0.25 10/25/26	7,900,000.00	6,976,569.00	
	POLGB 0.75 04/25/25	1,800,000.00	1,714,698.00	
	POLGB 1.25 10/25/30	7,800,000.00	6,089,304.00	
	POLGB 2.75 04/25/28	3,000,000.00	2,740,080.00	
	POLGB 2.75 10/25/29	700,000.00	618,457.00	
	POLGB 6 10/25/33	2,000,000.00	2,083,120.00	
ポーランド・ズロチ小計		28,200,000.00	24,825,278.00 (925,374,650)	
ユーロ	BGB 0 10/22/27	800,000.00	725,288.00	
	BGB 0 10/22/31	1,500,000.00	1,216,155.00	
	BGB 0.1 06/22/30	700,000.00	594,937.00	
	BGB 0.35 06/22/32	700,000.00	572,775.00	
	BGB 0.4 06/22/40	800,000.00	515,128.00	
	BGB 0.65 06/22/71	400,000.00	168,140.00	
	BGB 0.8 06/22/25	700,000.00	678,300.00	
	BGB 0.8 06/22/27	800,000.00	751,320.00	
	BGB 0.8 06/22/28	1,000,000.00	925,100.00	
	BGB 0.9 06/22/29	900,000.00	821,754.00	
	BGB 1 06/22/26	700,000.00	671,020.00	
	BGB 1 06/22/31	1,300,000.00	1,149,863.00	
	BGB 1.25 04/22/33	900,000.00	787,257.00	
	BGB 1.45 06/22/37	1,200,000.00	982,920.00	
	BGB 1.6 06/22/47	650,000.00	468,812.50	
	BGB 1.7 06/22/50	1,100,000.00	785,268.00	
	BGB 1.9 06/22/38	1,000,000.00	855,000.00	
	BGB 2.15 06/22/66	500,000.00	376,075.00	
	BGB 2.25 06/22/57	500,000.00	389,720.00	
	BGB 3 06/22/34	200,000.00	201,098.00	
	BGB 3.75 06/22/45	600,000.00	640,116.00	
	BGB 4 03/28/32	300,000.00	325,968.00	
	BGB 4.25 03/28/41	680,000.00	768,801.20	
	BGB 4.5 03/28/26	1,100,000.00	1,135,365.00	
	BGB 5 03/28/35	1,000,000.00	1,187,080.00	
	BGB 5.5 03/28/28	1,000,000.00	1,108,320.00	
	BKO 3.1 09/18/25	300,000.00	300,231.00	
	BTPS 0 08/01/26	1,300,000.00	1,203,735.00	

		BTPS 0.35 02/01/25	2,400,000.00	2,330,736.00	
		BTPS 0.45 02/15/29	2,400,000.00	2,086,392.00	
		BTPS 0.5 02/01/26	1,500,000.00	1,423,110.00	
		BTPS 0.85 01/15/27	900,000.00	842,760.00	
		BTPS 0.9 04/01/31	2,000,000.00	1,672,220.00	
		BTPS 0.95 03/01/37	1,000,000.00	691,770.00	
		BTPS 0.95 06/01/32	3,300,000.00	2,673,198.00	
		BTPS 0.95 08/01/30	1,200,000.00	1,026,492.00	
		BTPS 0.95 09/15/27	800,000.00	740,048.00	
		BTPS 0.95 12/01/31	2,600,000.00	2,138,110.00	
		BTPS 1.1 04/01/27	2,300,000.00	2,159,815.00	
		BTPS 1.25 12/01/26	800,000.00	759,824.00	
		BTPS 1.45 03/01/36	400,000.00	303,864.00	
		BTPS 1.45 05/15/25	700,000.00	683,963.00	
		BTPS 1.5 06/01/25	1,900,000.00	1,855,179.00	
		BTPS 1.6 06/01/26	1,200,000.00	1,158,660.00	
		BTPS 1.65 12/01/30	1,100,000.00	977,416.00	
		BTPS 1.7 09/01/51	1,500,000.00	905,460.00	
		BTPS 1.85 07/01/25	1,000,000.00	979,830.00	
		BTPS 2 02/01/28	2,500,000.00	2,389,100.00	
		BTPS 2 12/01/25	1,300,000.00	1,272,622.00	
		BTPS 2.05 08/01/27	1,500,000.00	1,445,010.00	
		BTPS 2.1 07/15/26	1,000,000.00	975,650.00	
		BTPS 2.2 06/01/27	900,000.00	873,000.00	
		BTPS 2.25 09/01/36	500,000.00	414,240.00	
		BTPS 2.45 09/01/33	600,000.00	538,152.00	
		BTPS 2.45 09/01/50	1,700,000.00	1,222,300.00	
		BTPS 2.5 11/15/25	1,200,000.00	1,185,228.00	
		BTPS 2.65 12/01/27	400,000.00	392,196.00	
		BTPS 2.7 03/01/47	1,250,000.00	973,225.00	
		BTPS 2.8 03/01/67	700,000.00	504,714.00	
		BTPS 2.8 06/15/29	1,000,000.00	972,420.00	
		BTPS 2.8 12/01/28	1,300,000.00	1,273,064.00	
		BTPS 2.95 09/01/38	1,000,000.00	873,330.00	
		BTPS 3 08/01/29	2,600,000.00	2,553,642.00	
		BTPS 3.1 03/01/40	700,000.00	611,233.00	
		BTPS 3.25 09/01/46	1,600,000.00	1,370,800.00	
		BTPS 3.35 03/01/35	700,000.00	663,621.00	
		BTPS 3.45 03/01/48	1,000,000.00	881,000.00	
		BTPS 3.5 03/01/30	1,000,000.00	1,004,990.00	
		BTPS 3.7 06/15/30	1,900,000.00	1,922,933.00	
		BTPS 3.85 09/01/49	1,100,000.00	1,027,158.00	

BTPS 3.85 09/15/26	2,900,000.00	2,946,255.00	
BTPS 3.85 12/15/29	1,300,000.00	1,328,691.00	
BTPS 4 02/01/37	2,000,000.00	2,001,820.00	
BTPS 4 04/30/35	1,100,000.00	1,108,723.00	
BTPS 4.1 02/01/29	700,000.00	724,045.00	
BTPS 4.4 05/01/33	1,700,000.00	1,787,244.00	
BTPS 4.5 03/01/26	1,300,000.00	1,332,032.00	
BTPS 4.75 09/01/28	1,800,000.00	1,910,178.00	
BTPS 4.75 09/01/44	1,200,000.00	1,273,128.00	
BTPS 5 03/01/25	1,000,000.00	1,014,950.00	
BTPS 5 08/01/34	1,570,000.00	1,720,704.30	
BTPS 5 08/01/39	1,800,000.00	1,962,720.00	
BTPS 5 09/01/40	1,700,000.00	1,853,646.00	
BTPS 5.75 02/01/33	1,700,000.00	1,959,420.00	
BTPS 6 05/01/31	2,200,000.00	2,547,996.00	
BTPS 6.5 11/01/27	1,700,000.00	1,894,633.00	
BTPS 7.25 11/01/26	400,000.00	441,876.00	
DBR 0 02/15/30	1,500,000.00	1,306,665.00	
DBR 0 02/15/32	3,200,000.00	2,663,808.00	
DBR 0 05/15/35	2,000,000.00	1,523,520.00	
DBR 0 05/15/36	800,000.00	591,808.00	
DBR 0 08/15/29	2,500,000.00	2,202,250.00	
DBR 0 08/15/30	2,500,000.00	2,154,875.00	
DBR 0 08/15/31	200,000.00	168,598.00	
DBR 0 08/15/31	2,300,000.00	1,939,291.00	
DBR 0 08/15/50	3,000,000.00	1,557,240.00	
DBR 0 08/15/50	900,000.00	469,377.00	
DBR 0 11/15/27	1,300,000.00	1,187,212.00	
DBR 0 11/15/28	400,000.00	357,984.00	
DBR 0.25 02/15/27	300,000.00	280,365.00	
DBR 0.25 02/15/29	1,200,000.00	1,082,568.00	
DBR 0.25 08/15/28	1,500,000.00	1,365,435.00	
DBR 0.5 02/15/25	1,400,000.00	1,362,102.00	
DBR 0.5 02/15/26	3,200,000.00	3,058,560.00	
DBR 0.5 02/15/28	1,600,000.00	1,484,736.00	
DBR 0.5 08/15/27	2,100,000.00	1,963,248.00	
DBR 1 05/15/38	1,600,000.00	1,304,800.00	
DBR 1 08/15/25	1,900,000.00	1,844,520.00	
DBR 1.25 08/15/48	1,650,000.00	1,265,286.00	
DBR 1.7 08/15/32	2,400,000.00	2,283,552.00	
DBR 1.8 08/15/53	200,000.00	169,708.00	
DBR 1.8 08/15/53	900,000.00	764,901.00	

DBR 2.1 11/15/29	1,400,000.00	1,379,490.00	
DBR 2.3 02/15/33	1,600,000.00	1,593,360.00	
DBR 2.3 02/15/33	800,000.00	797,216.00	
DBR 2.5 07/04/44	1,600,000.00	1,575,680.00	
DBR 2.5 08/15/46	2,700,000.00	2,668,707.00	
DBR 3.25 07/04/42	1,000,000.00	1,093,010.00	
DBR 4 01/04/37	1,300,000.00	1,511,016.00	
DBR 4.25 07/04/39	700,000.00	847,000.00	
DBR 4.75 07/04/28	1,600,000.00	1,751,856.00	
DBR 4.75 07/04/34	600,000.00	727,044.00	
DBR 4.75 07/04/40	1,450,000.00	1,864,352.00	
DBR 5.5 01/04/31	900,000.00	1,077,930.00	
DBR 5.625 01/04/28	1,000,000.00	1,115,260.00	
DBR 6.25 01/04/30	800,000.00	968,320.00	
DBR 6.5 07/04/27	1,000,000.00	1,126,010.00	
FRTR 0 02/25/25	3,000,000.00	2,900,940.00	
FRTR 0 02/25/26	2,000,000.00	1,887,860.00	
FRTR 0 02/25/27	1,100,000.00	1,012,968.00	
FRTR 0 03/25/25	1,900,000.00	1,833,006.00	
FRTR 0 05/25/32	2,900,000.00	2,314,374.00	
FRTR 0 11/25/29	3,500,000.00	3,005,345.00	
FRTR 0 11/25/30	3,600,000.00	3,004,200.00	
FRTR 0 11/25/31	3,000,000.00	2,432,070.00	
FRTR 0.25 11/25/26	2,900,000.00	2,706,802.00	
FRTR 0.5 05/25/25	1,300,000.00	1,256,918.00	
FRTR 0.5 05/25/26	3,100,000.00	2,942,210.00	
FRTR 0.5 05/25/29	3,000,000.00	2,682,090.00	
FRTR 0.5 05/25/40	1,300,000.00	862,940.00	
FRTR 0.5 05/25/72	100,000.00	38,690.00	
FRTR 0.5 06/25/44	1,200,000.00	717,756.00	
FRTR 0.75 02/25/28	4,200,000.00	3,892,056.00	
FRTR 0.75 05/25/28	3,100,000.00	2,860,773.00	
FRTR 0.75 05/25/52	3,000,000.00	1,623,120.00	
FRTR 0.75 11/25/28	3,400,000.00	3,109,130.00	
FRTR 1 05/25/27	2,000,000.00	1,892,720.00	
FRTR 1 11/25/25	800,000.00	772,944.00	
FRTR 1.25 05/25/34	1,200,000.00	1,026,000.00	
FRTR 1.25 05/25/36	2,750,000.00	2,255,825.00	
FRTR 1.25 05/25/38	900,000.00	707,058.00	
FRTR 1.5 05/25/31	3,050,000.00	2,809,263.50	
FRTR 1.5 05/25/50	2,400,000.00	1,655,520.00	
FRTR 1.75 05/25/66	800,000.00	540,040.00	

FRTR 1.75 06/25/39	2,700,000.00	2,259,279.00	
FRTR 2 05/25/48	2,000,000.00	1,576,800.00	
FRTR 2 11/25/32	2,700,000.00	2,534,436.00	
FRTR 2.5 05/25/30	2,600,000.00	2,571,400.00	
FRTR 2.5 05/25/43	1,600,000.00	1,428,656.00	
FRTR 2.5 09/24/26	2,200,000.00	2,181,542.00	
FRTR 2.75 02/25/29	1,100,000.00	1,102,211.00	
FRTR 2.75 10/25/27	2,650,000.00	2,651,696.00	
FRTR 3 05/25/33	1,500,000.00	1,519,845.00	
FRTR 3.25 05/25/45	900,000.00	899,451.00	
FRTR 3.5 04/25/26	1,800,000.00	1,823,346.00	
FRTR 3.5 11/25/33	1,900,000.00	2,000,016.00	
FRTR 4 04/25/55	1,370,000.00	1,546,812.20	
FRTR 4 04/25/60	1,400,000.00	1,603,294.00	
FRTR 4 10/25/38	2,000,000.00	2,209,220.00	
FRTR 4.5 04/25/41	1,900,000.00	2,230,220.00	
FRTR 4.75 04/25/35	800,000.00	935,000.00	
FRTR 5.5 04/25/29	1,650,000.00	1,869,384.00	
FRTR 5.75 10/25/32	400,000.00	488,972.00	
FRTR 6 10/25/25	2,100,000.00	2,199,771.00	
IRISH 0 10/18/31	500,000.00	409,840.00	
IRISH 0.9 05/15/28	500,000.00	466,815.00	
IRISH 1 05/15/26	800,000.00	769,856.00	
IRISH 1.1 05/15/29	500,000.00	464,125.00	
IRISH 1.3 05/15/33	500,000.00	443,360.00	
IRISH 1.35 03/18/31	500,000.00	459,890.00	
IRISH 1.5 05/15/50	500,000.00	362,440.00	
IRISH 1.7 05/15/37	300,000.00	260,328.00	
IRISH 2 02/18/45	1,100,000.00	926,200.00	
IRISH 2.4 05/15/30	600,000.00	593,100.00	
IRISH 2.6 10/18/34	300,000.00	294,591.00	
IRISH 5.4 03/13/25	800,000.00	817,128.00	
NETHER 0 01/15/27	1,300,000.00	1,204,268.00	
NETHER 0 07/15/30	2,200,000.00	1,869,824.00	
NETHER 0.25 07/15/25	930,000.00	894,129.90	
NETHER 0.25 07/15/29	500,000.00	442,430.00	
NETHER 0.5 01/15/40	1,500,000.00	1,062,150.00	
NETHER 0.5 07/15/26	1,300,000.00	1,232,699.00	
NETHER 0.5 07/15/32	1,700,000.00	1,431,502.00	
NETHER 0.75 07/15/27	400,000.00	375,916.00	
NETHER 0.75 07/15/28	1,500,000.00	1,386,585.00	
NETHER 2.5 01/15/33	600,000.00	594,276.00	

NETHER 2.5 07/15/33	500,000.00	493,045.00	
NETHER 2.75 01/15/47	2,300,000.00	2,297,102.00	
NETHER 3.75 01/15/42	1,300,000.00	1,470,664.00	
NETHER 4 01/15/37	300,000.00	338,886.00	
NETHER 5.5 01/15/28	700,000.00	773,402.00	
OBL 0 04/10/26	2,100,000.00	1,981,539.00	
OBL 0 04/11/25	2,800,000.00	2,701,356.00	
OBL 0 04/16/27	3,200,000.00	2,957,216.00	
OBL 0 10/09/26	1,400,000.00	1,307,334.00	
OBL 0 10/10/25	2,600,000.00	2,479,672.00	
OBL 1.3 10/15/27	300,000.00	287,904.00	
OBL 2.2 04/13/28	600,000.00	594,204.00	
OBL 2.4 10/19/28	1,600,000.00	1,598,976.00	
RAGB 0 02/20/30	1,300,000.00	1,105,312.00	
RAGB 0 02/20/31	1,400,000.00	1,154,580.00	
RAGB 0 04/20/25	230,000.00	221,602.70	
RAGB 0 10/20/40	300,000.00	180,399.00	
RAGB 0.5 02/20/29	550,000.00	493,328.00	
RAGB 0.5 04/20/27	700,000.00	652,715.00	
RAGB 0.75 02/20/28	600,000.00	555,918.00	
RAGB 0.75 03/20/51	900,000.00	522,792.00	
RAGB 0.75 10/20/26	600,000.00	568,914.00	
RAGB 0.85 06/30/20	250,000.00	112,025.00	
RAGB 0.9 02/20/32	1,000,000.00	863,380.00	
RAGB 1.2 10/20/25	1,000,000.00	970,870.00	
RAGB 1.5 02/20/47	700,000.00	517,286.00	
RAGB 1.5 11/02/86	400,000.00	238,312.00	
RAGB 2.4 05/23/34	1,000,000.00	954,550.00	
RAGB 3.15 06/20/44	500,000.00	499,780.00	
RAGB 3.8 01/26/62	700,000.00	803,936.00	
RAGB 4.15 03/15/37	300,000.00	334,698.00	
RAGB 4.85 03/15/26	800,000.00	830,448.00	
RAGB 6.25 07/15/27	1,000,000.00	1,110,760.00	
RFGB 0 09/15/26	300,000.00	279,162.00	
RFGB 0 09/15/30	400,000.00	334,936.00	
RFGB 0.25 09/15/40	700,000.00	444,738.00	
RFGB 0.5 04/15/26	700,000.00	665,973.00	
RFGB 0.5 09/15/27	500,000.00	462,480.00	
RFGB 0.5 09/15/28	300,000.00	272,013.00	
RFGB 0.5 09/15/29	800,000.00	708,872.00	
RFGB 0.75 04/15/31	800,000.00	696,976.00	
RFGB 1.375 04/15/47	500,000.00	363,335.00	

RFGB 2.625 07/04/42	800,000.00	748,216.00	
RFGB 2.75 04/15/38	200,000.00	192,334.00	
RFGB 2.75 07/04/28	200,000.00	200,432.00	
RFGB 4 07/04/25	300,000.00	303,324.00	
SPGB 0 01/31/25	500,000.00	484,210.00	
SPGB 0 01/31/27	500,000.00	459,020.00	
SPGB 0 05/31/25	2,600,000.00	2,494,804.00	
SPGB 0.5 04/30/30	1,600,000.00	1,377,664.00	
SPGB 0.5 10/31/31	1,400,000.00	1,155,434.00	
SPGB 0.7 04/30/32	2,000,000.00	1,654,620.00	
SPGB 0.8 07/30/27	1,700,000.00	1,584,009.00	
SPGB 0.8 07/30/29	700,000.00	624,792.00	
SPGB 0.85 07/30/37	800,000.00	574,096.00	
SPGB 1 10/31/50	800,000.00	429,664.00	
SPGB 1.2 10/31/40	1,400,000.00	974,610.00	
SPGB 1.25 10/31/30	2,100,000.00	1,876,707.00	
SPGB 1.3 10/31/26	1,400,000.00	1,341,312.00	
SPGB 1.4 04/30/28	2,000,000.00	1,882,320.00	
SPGB 1.4 07/30/28	1,200,000.00	1,125,708.00	
SPGB 1.45 04/30/29	2,100,000.00	1,952,538.00	
SPGB 1.45 10/31/27	1,800,000.00	1,708,650.00	
SPGB 1.45 10/31/71	400,000.00	193,808.00	
SPGB 1.5 04/30/27	1,500,000.00	1,435,635.00	
SPGB 1.6 04/30/25	1,400,000.00	1,372,532.00	
SPGB 1.85 07/30/35	600,000.00	515,208.00	
SPGB 1.95 04/30/26	2,400,000.00	2,346,888.00	
SPGB 1.95 07/30/30	700,000.00	657,433.00	
SPGB 2.15 10/31/25	1,600,000.00	1,576,400.00	
SPGB 2.35 07/30/33	700,000.00	651,511.00	
SPGB 2.55 10/31/32	1,600,000.00	1,526,912.00	
SPGB 2.7 10/31/48	750,000.00	620,130.00	
SPGB 2.8 05/31/26	1,100,000.00	1,094,830.00	
SPGB 2.9 10/31/46	1,700,000.00	1,480,360.00	
SPGB 3.15 04/30/33	1,800,000.00	1,791,540.00	
SPGB 3.45 07/30/66	1,300,000.00	1,172,756.00	
SPGB 3.55 10/31/33	1,500,000.00	1,537,215.00	
SPGB 3.9 07/30/39	700,000.00	721,903.00	
SPGB 4.2 01/31/37	1,050,000.00	1,131,889.50	
SPGB 4.65 07/30/25	800,000.00	816,128.00	
SPGB 4.7 07/30/41	1,500,000.00	1,702,290.00	
SPGB 4.9 07/30/40	1,400,000.00	1,614,508.00	
SPGB 5.15 10/31/28	1,500,000.00	1,645,620.00	

		SPGB 5.15 10/31/44	1,400,000.00	1,684,284.00	
		SPGB 5.75 07/30/32	1,000,000.00	1,194,310.00	
		SPGB 5.9 07/30/26	500,000.00	533,525.00	
		SPGB 6 01/31/29	1,900,000.00	2,167,482.00	
	ユーロ小計		375,580,000.00	348,977,117.80 (56,467,987,431)	
国債証券合計				175,822,424,619 (175,822,424,619)	
合　計				175,822,424,619 (175,822,424,619)	

(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	240 銘柄	46.6%	47.3%
カナダ・ドル	国債証券	29 銘柄	2.0%	2.0%
オーストラリア・ドル	国債証券	20 銘柄	1.3%	1.4%
シンガポール・ドル	国債証券	10 銘柄	0.4%	0.4%
ニュージーランド・ドル	国債証券	8 銘柄	0.2%	0.2%
イギリス・ポンド	国債証券	51 銘柄	5.1%	5.2%
イスラエル・シュケル	国債証券	7 銘柄	0.3%	0.3%
デンマーク・クローネ	国債証券	7 銘柄	0.3%	0.3%
ノルウェー・クローネ	国債証券	8 銘柄	0.2%	0.2%
スウェーデン・クローナ	国債証券	6 銘柄	0.2%	0.2%
メキシコ・ペソ	国債証券	10 銘柄	0.9%	0.9%
オフショア・人民元	国債証券	32 銘柄	8.3%	8.4%
マレーシア・リンギット	国債証券	10 銘柄	0.5%	0.5%
ポーランド・ズロチ	国債証券	7 銘柄	0.5%	0.5%
ユーロ	国債証券	284 銘柄	31.6%	32.1%

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。

【中間財務諸表】

1．当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号）ならびに同規則第38条の3、第57条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づいて作成しております。
なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

2．当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第20期中間計算期間（2024年2月20日から2024年8月19日まで）の中間財務諸表について、PwC Japan有限責任監査法人により中間監査を受けております。

独　立　監　査　人　の　中　間　監　査　報　告　書

2024年11月6日

三井住友DSアセットマネジメント株式会社
　取　締　役　会　御　中

PwC Japan有限責任監査法人
東京事務所
指定有限責任社員
業務執行社員　　公認会計士　和田 渉

指定有限責任社員
業務執行社員　　公認会計士　榊原 康太

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている三井住友・ＤＣ年金バランス３０（債券重点型）の2024年2月20日から2024年8月19日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、三井住友・ＤＣ年金バランス３０（債券重点型）の2024年8月19日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2024年2月20日から2024年8月19日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

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

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

・　不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、中間監査の

意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。

・　中間財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。

・　経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。

・　経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。

・　中間財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。

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

利害関係

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

以　上

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

【三井住友・ＤＣ年金バランス３０（債券重点型）】

（１）【中間貸借対照表】

（単位：円）

	第19期 (2024年 2月19日現在)	第20期中間計算期間 (2024年 8月19日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	25,043,329	6,838,138
コール・ローン	1,013,237,330	1,096,692,495
親投資信託受益証券	20,436,285,548	21,239,834,002
未収入金	13,770,000	-
流動資産合計	21,488,336,207	22,343,364,635
資産合計	21,488,336,207	22,343,364,635
負債の部		
流動負債		
未払解約金	23,470,532	26,864,575
未払受託者報酬	3,365,367	3,615,488
未払委託者報酬	21,314,211	22,898,397
その他未払費用	562,173	542,242
流動負債合計	48,712,283	53,920,702
負債合計	48,712,283	53,920,702
純資産の部		
元本等		
元本	11,866,094,525	12,252,512,872
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（△）	9,573,529,399	10,036,931,061
(分配準備積立金)	3,295,449,785	3,064,790,098
元本等合計	21,439,623,924	22,289,443,933
純資産合計	21,439,623,924	22,289,443,933
負債純資産合計	21,488,336,207	22,343,364,635

（２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第19期中間計算期間 自　2023年 2月21日 至　2023年 8月20日	第20期中間計算期間 自　2024年 2月20日 至　2024年 8月19日
営業収益		
受取利息	4,885	385,860
有価証券売買等損益	927,931,501	168,968,454
営業収益合計	927,936,386	169,354,314
営業費用		
支払利息	227,277	9,500
受託者報酬	3,067,707	3,615,488
委託者報酬	19,429,052	22,898,397
その他費用	528,513	544,167
営業費用合計	23,252,549	27,067,552
営業利益又は営業損失（△）	904,683,837	142,286,762
経常利益又は経常損失（△）	904,683,837	142,286,762
中間純利益又は中間純損失（△）	904,683,837	142,286,762
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（△）	32,082,521	18,439,697
期首剰余金又は期首欠損金（△）	6,805,022,013	9,573,529,399
剰余金増加額又は欠損金減少額	776,427,239	1,044,938,944
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	－	－
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	776,427,239	1,044,938,944
剰余金減少額又は欠損金増加額	350,758,329	705,384,347
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	350,758,329	705,384,347
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	－	－
分配金	－	－
中間剰余金又は中間欠損金（△）	8,103,292,239	10,036,931,061

（３）【中間注記表】

（重要な会計方針の注記）

項　目	第20期中間計算期間 自 2024年2月20日 至 2024年8月19日
１．　有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。 (1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。 (2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。 (3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。
２．　その他中間財務諸表作成のための重要な事項	中間計算期間の取扱い 当中間計算期間は前期末が休日のため、2024年2月20日から2024年8月19日までとなっております。

（中間貸借対照表に関する注記）

項　目	第19期 (2024年2月19日現在)	第20期中間計算期間 (2024年8月19日現在)
１．　当中間計算期間の末日における受益権の総数	11,866,094,525口	12,252,512,872口
２．　１単位当たり純資産の額	１口当たり純資産額　1.8068円 （１万口当たりの純資産額18,068円）	１口当たり純資産額　1.8192円 （１万口当たりの純資産額18,192円）

（中間損益及び剰余金計算書に関する注記）

該当事項はありません。

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

項　目	第20期中間計算期間 (2024年8月19日現在)
１．　中間貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
２．　時価の算定方法	(1) 有価証券（親投資信託受益証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。

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

(デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

項　目	第19期 (2024年2月19日現在)	第20期中間計算期間 (2024年8月19日現在)
期首元本額	10,835,317,736円	11,866,094,525円
期中追加設定元本額	2,308,715,920円	1,259,553,448円
期中一部解約元本額	1,277,939,131円	873,135,101円

独　立　監　査　人　の　中　間　監　査　報　告　書

2024年11月6日

三井住友DSアセットマネジメント株式会社
　取　締　役　会　御　中

PwC Japan有限責任監査法人
東京事務所
指定有限責任社員
業務執行社員　　公認会計士　和田 渉

指定有限責任社員
業務執行社員　　公認会計士　榊原 康太

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている三井住友・ＤＣ年金バランス５０（標準型）の2024年2月20日から2024年8月19日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、三井住友・ＤＣ年金バランス５０（標準型）の2024年8月19日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2024年2月20日から2024年8月19日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

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

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

・　不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、中間監査の

意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。

・　中間財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。

・　経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。

・　経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。

・　中間財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。

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

利害関係

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

以　上

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

【三井住友・ＤＣ年金バランス５０（標準型）】

（１）【中間貸借対照表】

（単位：円）

	第19期 (2024年 2月19日現在)	第20期中間計算期間 (2024年 8月19日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	65,748,233	17,391,185
コール・ローン	2,660,132,086	2,789,177,779
親投資信託受益証券	52,598,478,792	54,251,811,049
未収入金	29,420,000	－
流動資産合計	55,353,779,111	57,058,380,013
資産合計	55,353,779,111	57,058,380,013
負債の部		
流動負債		
未払解約金	50,659,070	27,711,404
未払受託者報酬	8,586,685	9,356,029
未払委託者報酬	57,244,869	62,373,838
その他未払費用	1,434,550	1,386,047
流動負債合計	117,925,174	100,827,318
負債合計	117,925,174	100,827,318
純資産の部		
元本等		
元本	24,837,835,222	25,206,892,804
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（△）	30,398,018,715	31,750,659,891
（分配準備積立金）	15,891,947,981	15,080,270,813
元本等合計	55,235,853,937	56,957,552,695
純資産合計	55,235,853,937	56,957,552,695
負債純資産合計	55,353,779,111	57,058,380,013

（２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第19期中間計算期間 自　2023年 2月21日 至　2023年 8月20日	第20期中間計算期間 自　2024年 2月20日 至　2024年 8月19日
営業収益		
受取利息	12,063	1,009,106
有価証券売買等損益	3,573,425,273	940,862,257
営業収益合計	3,573,437,336	941,871,363
営業費用		
支払利息	560,946	24,842
受託者報酬	7,807,368	9,356,029
委託者報酬	52,049,342	62,373,838
その他費用	1,343,934	1,391,100
営業費用合計	61,761,590	73,145,809
営業利益又は営業損失（△）	3,511,675,746	868,725,554
経常利益又は経常損失（△）	3,511,675,746	868,725,554
中間純利益又は中間純損失（△）	3,511,675,746	868,725,554
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（△）	92,829,001	72,909,625
期首剰余金又は期首欠損金（△）	21,053,593,499	30,398,018,715
剰余金増加額又は欠損金減少額	1,595,272,485	2,160,719,515
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	－	－
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	1,595,272,485	2,160,719,515
剰余金減少額又は欠損金増加額	850,546,529	1,603,894,268
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	850,546,529	1,603,894,268
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	－	－
分配金	－	－
中間剰余金又は中間欠損金（△）	25,217,166,200	31,750,659,891

（３）【中間注記表】

（重要な会計方針の注記）

項　目	第20期中間計算期間 自 2024年2月20日 至 2024年8月19日
１．　有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。 (1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。 (2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。 (3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。
２．　その他中間財務諸表作成のための重要な事項	中間計算期間の取扱い 当中間計算期間は前期末が休日のため、2024年2月20日から2024年8月19日までとなっております。

（中間貸借対照表に関する注記）

項　目	第19期 (2024年2月19日現在)	第20期中間計算期間 (2024年8月19日現在)
１．　当中間計算期間の末日における受益権の総数	24,837,835,222口	25,206,892,804口
２．　１単位当たり純資産の額	１口当たり純資産額　2.2239円 （１万口当たりの純資産額22,239円）	１口当たり純資産額　2.2596円 （１万口当たりの純資産額22,596円）

（中間損益及び剰余金計算書に関する注記）

該当事項はありません。

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

項　目	第20期中間計算期間 (2024年8月19日現在)
１．　中間貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
２．　時価の算定方法	(1) 有価証券（親投資信託受益証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。

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

(デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

項　目	第19期 (2024年2月19日現在)	第20期中間計算期間 (2024年8月19日現在)
期首元本額	23,793,955,246円	24,837,835,222円
期中追加設定元本額	3,113,993,768円	1,677,835,635円
期中一部解約元本額	2,070,113,792円	1,308,778,053円

独　立　監　査　人　の　中　間　監　査　報　告　書

2024年11月6日

三井住友DSアセットマネジメント株式会社
　取　締　役　会　御　中

PwC Japan有限責任監査法人
東京事務所
指定有限責任社員
業務執行社員　　公認会計士　和田 渉

指定有限責任社員
業務執行社員　　公認会計士　榊原 康太

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている三井住友・ＤＣ年金バランス７０（株式重点型）の2024年2月20日から2024年8月19日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、三井住友・ＤＣ年金バランス７０（株式重点型）の2024年8月19日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2024年2月20日から2024年8月19日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

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

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

・　不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、中間監査の

意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。

・　中間財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。

・　経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。

・　経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。

・　中間財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。

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

利害関係

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

以　上

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

【三井住友・ＤＣ年金バランス７０（株式重点型）】

（１）【中間貸借対照表】

（単位：円）

	第19期 (2024年 2月19日現在)	第20期中間計算期間 (2024年 8月19日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	39,206,921	10,411,450
コール・ローン	1,586,287,305	1,669,776,100
親投資信託受益証券	31,448,373,289	32,766,918,527
未収入金	73,100,000	5,380,000
流動資産合計	33,146,967,515	34,452,486,077
資産合計	33,146,967,515	34,452,486,077
負債の部		
流動負債		
未払解約金	93,663,640	20,675,305
未払受託者報酬	5,005,939	5,678,895
未払委託者報酬	35,041,829	39,752,555
その他未払費用	836,344	851,752
流動負債合計	134,547,752	66,958,507
負債合計	134,547,752	66,958,507
純資産の部		
元本等		
元本	12,420,585,863	12,626,925,443
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（△）	20,591,833,900	21,758,602,127
(分配準備積立金)	11,137,227,128	10,411,426,474
元本等合計	33,012,419,763	34,385,527,570
純資産合計	33,012,419,763	34,385,527,570
負債純資産合計	33,146,967,515	34,452,486,077

（２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第19期中間計算期間 自　2023年 2月21日 至　2023年 8月20日	第20期中間計算期間 自　2024年 2月20日 至　2024年 8月19日
営業収益		
受取利息	6,757	602,261
有価証券売買等損益	2,654,216,057	838,805,238
営業収益合計	2,654,222,814	839,407,499
営業費用		
支払利息	313,663	14,769
受託者報酬	4,391,522	5,678,895
委託者報酬	30,740,938	39,752,555
その他費用	755,713	854,748
営業費用合計	36,201,836	46,300,967
営業利益又は営業損失（△）	2,618,020,978	793,106,532
経常利益又は経常損失（△）	2,618,020,978	793,106,532
中間純利益又は中間純損失（△）	2,618,020,978	793,106,532
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（△）	85,228,272	81,239,845
期首剰余金又は期首欠損金（△）	13,106,055,031	20,591,833,900
剰余金増加額又は欠損金減少額	1,367,013,469	1,857,870,978
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	－	－
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	1,367,013,469	1,857,870,978
剰余金減少額又は欠損金増加額	697,248,939	1,402,969,438
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	697,248,939	1,402,969,438
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	－	－
分配金	－	－
中間剰余金又は中間欠損金（△）	16,308,612,267	21,758,602,127

（３）【中間注記表】

（重要な会計方針の注記）

項　目	第20期中間計算期間 自 2024年2月20日 至 2024年8月19日
１．　有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。 (1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。 (2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。 (3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。
２．　その他中間財務諸表作成のための重要な事項	中間計算期間の取扱い 当中間計算期間は前期末が休日のため、2024年2月20日から2024年8月19日までとなっております。

（中間貸借対照表に関する注記）

項　目	第19期 (2024年2月19日現在)	第20期中間計算期間 (2024年8月19日現在)
１．　当中間計算期間の末日における受益権の総数	12,420,585,863口	12,626,925,443口
２．　１単位当たり純資産の額	１口当たり純資産額　2.6579円 （１万口当たりの純資産額26,579円）	１口当たり純資産額　2.7232円 （１万口当たりの純資産額27,232円）

（中間損益及び剰余金計算書に関する注記）

該当事項はありません。

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

項　目	第20期中間計算期間 (2024年8月19日現在)
１．　中間貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
２．　時価の算定方法	(1) 有価証券（親投資信託受益証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。

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

(デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

項　目	第19期 (2024年2月19日現在)	第20期中間計算期間 (2024年8月19日現在)
期首元本額	11,655,750,413円	12,420,585,863円
期中追加設定元本額	2,086,350,077円	1,050,643,220円
期中一部解約元本額	1,321,514,627円	844,303,640円

（参考）

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

なお、以下に記載した状況は、監査の対象外です。

国内株式インデックス・マザーファンド（Ｂ号）

（１）貸借対照表

（単位：円）

	（2024 年 8 月 19 日現在）
資産の部	
流動資産	
金銭信託	35,934,385
コール・ローン	5,763,114,261
株式	321,698,148,330
派生商品評価勘定	139,296,700
未収配当金	405,800,185
差入委託証拠金	768,602,684
流動資産合計	328,810,896,545
資産合計	328,810,896,545
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	232,731,000
前受金	47,755,000
未払解約金	57,805,366
流動負債合計	338,291,366
負債合計	338,291,366
純資産の部	
元本等	
元本	69,719,004,911
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	258,753,600,268
元本等合計	328,472,605,179
純資産合計	328,472,605,179
負債純資産合計	328,810,896,545

（２）注記表

（重要な会計方針の注記）

項　目	自 2024 年 2 月 20 日 至 2024 年 8 月 19 日

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

（貸借対照表に関する注記）

項　目	(2024 年 8 月 19 日現在)
1．　当計算期間の末日における受益権の総数	69,719,004,911 口
2．　１単位当たり純資産の額	１口当たり純資産額　4.7114 円 （１万口当たりの純資産額 47,114 円）

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

項　目	(2024 年 8 月 19 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 8 月 19 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 0609 月	7,005,074,300	－	6,911,640,000	△93,434,300
	小計	7,005,074,300	－	6,911,640,000	△93,434,300
合　計		7,005,074,300	－	6,911,640,000	△93,434,300

（注）１．時価の算定方法

株価指数先物取引の時価の算定方法については以下のように評価しております。

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

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

2)株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

２．ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

（その他の注記）

（2024 年 8 月 19 日現在）	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	68,652,536,502 円
同期中における追加設定元本額	5,501,567,586 円
同期中における一部解約元本額	4,435,099,177 円
2024 年 8 月 19 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	9,725,816,443 円
三井住友・ＤＣ年金バランス３０（債券重点型）	934,691,368 円
三井住友・ＤＣ年金バランス５０（標準型）	4,171,376,045 円
三井住友・ＤＣ年金バランス７０（株式重点型）	3,612,996,848 円
ＳＭＡＭ・グローバルバランスファンド（機動的資産配分型）	141,904,457 円
三井住友・ＤＣターゲットイヤーファンド２０２０（４資産タイプ）	2,893,514 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）	42,630,809 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）	130,670,522 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）	129,798,785 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）	258,942,967 円
国内株式指数ファンド（ＴＯＰＩＸ）	1,565,305,317 円
三井住友・ＤＣつみたてＮＩＳＡ・日本株インデックスファンド	29,154,851,497 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）	152,032,133 円

アセットアロケーション・ファンド（成長型）	92,585,784 円
三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０５０	67,728,858 円
三井住友・資産最適化ファンド（１安定重視型）	216,395,313 円
三井住友・資産最適化ファンド（２やや安定型）	215,308,084 円
三井住友・資産最適化ファンド（３バランス型）	886,576,150 円
三井住友・資産最適化ファンド（４やや成長型）	535,468,014 円
三井住友・資産最適化ファンド（５成長重視型）	667,518,786 円
三井住友・ＤＣつみたてＮＩＳＡ・世界分散ファンド	65,310,389 円
三井住友ＤＳ・国内株式インデックス年金ファンド	1,431,788,700 円
三井住友ＤＳ・年金バランス３０（債券重点型）	41,926,400 円
三井住友ＤＳ・年金バランス５０（標準型）	252,682,070 円
三井住友ＤＳ・年金バランス７０（株式重点型）	287,520,900 円
三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０６０	8,919,277 円
日興ＦＷＳ・日本株インデックス	2,755,487,820 円
三井住友ＤＳ・ＴＯＰＩＸインデックス・ファンド	187,352,710 円
三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０３５	19,799,182 円
三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０４０	12,117,173 円
三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０４５	13,283,165 円
三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０５５	6,785,353 円
三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０６５	4,001,901 円
三井住友ＤＳ・ＦＷ専用ポートフォリオ・レベル１（保守型）	667,303 円
三井住友ＤＳ・ＦＷ専用ポートフォリオ・レベル２（安定型）	21,672,021 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）	108,688,480 円
三井住友ＤＳ・ＦＷ専用ポートフォリオ・レベル４（成長型）	114,180,012 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）	41,351,307 円
ＳＭＡＭ・国内株式パッシブ・ファンド（適格機関投資家専用）	1,919,612,024 円
バランスファンドＶＡ（安定運用型）＜適格機関投資家限定＞	7,746,416 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＞	707,293,741 円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ３７．５＜適格機関投資家専用＞	982,514,264 円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ５０＜適格機関投資家専用＞	3,879,778,739 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＞	90,371,685 円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ７５＜適格機関投資家専用＞	567,812,241 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＞	350,659,945 円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ３５＜適格機関投資家専用＞	1,025,665,047 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＞	24,047,788 円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ３５Ａ＜適格機関投資家専用＞	19,576,935 円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ５０Ａ＜適格機関投資家専用＞	13,106,868 円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２０Ｌ＜適格機関投資家専用＞	53,449,784 円

ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２５Ｌ＜適格機関投資家専用＞	140,237,012 円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２０Ａ２＜適格機関投資家専用＞	28,569,453 円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ３５Ａ２＜適格機関投資家専用＞	28,385,337 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＞	324,318,538 円
ＳＭＡＭ・国内株式インデックスファンド・ＶＡ（適格機関投資家専用）	149,894,824 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＞	136,028,096 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＞	38,414,398 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・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
ＳＭＤＡＭ・日米３資産バランスオープン＜適格機関投資家限定＞	8,929,794 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＞	70,477,561 円
合　計	69,719,004,911 円

国内債券パッシブ・マザーファンド

（１）貸借対照表

（単位：円）

	（2024 年 8 月 19 日現在）
資産の部	
流動資産	
金銭信託	2,728,088
コール・ローン	437,527,498
国債証券	109,264,781,800
地方債証券	11,077,840,600
特殊債券	10,545,066,161
社債券	7,633,906,700
未収入金	277,021,200
未収利息	340,455,340
前払費用	24,140,852
流動資産合計	139,603,468,239
資産合計	139,603,468,239
負債の部	
流動負債	
未払金	99,152,000
未払解約金	180,120,000
流動負債合計	279,272,000
負債合計	279,272,000
純資産の部	
元本等	

元本	116,506,674,843
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	22,817,521,396
元本等合計	139,324,196,239
純資産合計	139,324,196,239
負債純資産合計	139,603,468,239

（２）注記表

（重要な会計方針の注記）

項　目	自 2024年2月20日 至 2024年8月19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。

（貸借対照表に関する注記）

項　目	(2024年8月19日現在)
１．　当計算期間の末日における受益権の総数	116,506,674,843口
２．　１単位当たり純資産の額	１口当たり純資産額　1.1958円 （１万口当たりの純資産額11,958円）

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

項　目	(2024年8月19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。

（その他の注記）

（2024年8月19日現在）	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	108,788,622,566円
同期中における追加設定元本額	16,565,258,674円
同期中における一部解約元本額	8,847,206,397円
2024年8月19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）	10,371,816,034円
三井住友・ＤＣ年金バランス５０（標準型）	16,947,447,522円
三井住友・ＤＣ年金バランス７０（株式重点型）	4,476,863,852円
ＳＭＡＭ・グローバルバランスファンド（機動的資産配分型）	846,912,979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）	1,372,199,423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）	774,149,611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）	917,724,614円
三井住友・ＤＣ年金バランスゼロ（債券型）	135,813,767円
アセットアロケーション・ファンド（安定型）	2,562,372,844円
アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）	1,119,722,423円
アセットアロケーション・ファンド（成長型）	422,880,309円
三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０５０	179,071,005円
三井住友・資産最適化ファンド（１安定重視型）	3,781,317,444円
三井住友・資産最適化ファンド（２やや安定型）	1,159,429,572円
三井住友・資産最適化ファンド（３バランス型）	2,401,887,409円
三井住友・資産最適化ファンド（４やや成長型）	569,419,654円
三井住友・資産最適化ファンド（５成長重視型）	82,023,352円
三井住友・ＤＣつみたてＮＩＳＡ・世界分散ファンド	395,699,890円
三井住友ＤＳ・年金バランス３０（債券重点型）	453,936,704円
三井住友ＤＳ・年金バランス５０（標準型）	1,036,130,367円
三井住友ＤＳ・年金バランス７０（株式重点型）	356,702,306円
三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０６０	18,037,241円
三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０３５	229,420,607円

三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０４０	106,105,096 円
三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０４５	71,172,485 円
三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０５５	13,605,035 円
三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０６５	7,708,848 円
三井住友ＤＳ・ＦＷ専用ポートフォリオ・レベル１（保守型）	9,567,445 円
三井住友ＤＳ・ＦＷ専用ポートフォリオ・レベル２（安定型）	107,395,800 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）	271,294,662 円
三井住友ＤＳ・ＦＷ専用ポートフォリオ・レベル４（成長型）	136,753,010 円
三井住友ＤＳ・ＦＷ専用ポートフォリオ・レベル５（積極成長型）	11,710,237 円
ＳＭＡＭ・年金グローバル債券ファンド＜適格機関投資家限定＞	1,004,318,429 円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ２５＜適格機関投資家専用＞	7,866,006,907 円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ３７．５＜適格機関投資家専用＞	5,979,931,894 円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ５０＜適格機関投資家専用＞	15,748,536,156 円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＬ３０＜適格機関投資家限定＞	303,813,465 円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＬ５０＜適格機関投資家限定＞	493,192,607 円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ７５＜適格機関投資家専用＞	280,784,936 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＞	1,819,907,465 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＞	2,117,927,100 円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ３５＜適格機関投資家専用＞	7,433,132,110 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）	878,319,473 円
ＳＭＡＭ・グローバルバランス４０ＶＡ＜適格機関投資家限定＞	368,081,993 円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２０Ａ＜適格機関投資家専用＞	441,061,228 円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ３５Ａ＜適格機関投資家専用＞	164,458,081 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＞	1,084,797,212 円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２５Ｌ＜適格機関投資家専用＞	1,948,462,390 円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２０Ａ２＜適格機関投資家専用＞	537,649,572 円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ３５Ａ２＜適格機関投資家専用＞	232,266,486 円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ５０Ａ２＜適格機関投資家専用＞	26,762,746 円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ３０Ｌ２＜適格機関投資家専用＞	238,312,950 円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２５Ｌ２＜適格機関投資家専用＞	4,553,636,869 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＞	717,974,170 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＞	1,145,237,936 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＞	4,701,805,872 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＞	442,896,397 円
合　計	116,506,674,843 円

外国株式インデックス・マザーファンド

（１）貸借対照表

（単位：円）

	（2024年8月19日現在）
資産の部	
流動資産	
預金	5,959,506,354
金銭信託	5,785,955
コール・ローン	927,944,600
株式	775,913,180,637
投資証券	15,875,789,097
派生商品評価勘定	357,829,300
未収入金	287,493
未収配当金	973,549,784
差入委託証拠金	2,892,096,058
流動資産合計	802,905,969,278
資産合計	802,905,969,278
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	4,789,463
未払解約金	7,060,567
流動負債合計	11,850,030
負債合計	11,850,030
純資産の部	
元本等	
元本	88,139,875,188
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	714,754,244,060
元本等合計	802,894,119,248
純資産合計	802,894,119,248
負債純資産合計	802,905,969,278

（２）注記表

（重要な会計方針の注記）

項　目	自 2024年2月20日 至 2024年8月19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。

(貸借対照表に関する注記)

項　目	(2024年8月19日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	88,139,875,188口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額　9.1093円 (1万口当たりの純資産額91,093円)

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項　目	(2024年8月19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8月19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	8,914,219,270	－	9,200,874,326	286,655,056
	SPI 200 FUTURES SEP24	305,310,581	－	312,840,480	7,529,899
	FTSE 100 IDX FUT SEP24	470,224,472	－	478,914,338	8,689,866
	EURO STOXX 50 SEP24	1,555,862,029	－	1,609,274,076	53,412,047
	小計	11,245,616,352	－	11,601,903,220	356,286,868
合　計		11,245,616,352	－	11,601,903,220	356,286,868

（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	1,323,849,649	－	1,320,853,093	△2,996,556
	カナダ・ドル	64,360,971	－	64,367,873	6,902
	イギリス・ポンド	42,745,933	－	42,686,147	△59,786
	スイス・フラン	54,762,921	－	54,764,044	1,123
	ユーロ	127,098,938	－	126,900,225	△198,713
	小計	1,612,818,412	－	1,609,571,382	△3,247,030
合　計		1,612,818,412	－	1,609,571,382	△3,247,030

（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。

（その他の注記）

（2024年8月19日現在）	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	83,796,577,402円
同期中における追加設定元本額	8,902,096,068円
同期中における一部解約元本額	4,558,798,282円
2024年8月19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	44,530,846,472円
三井住友・ＤＣ年金バランス３０（債券重点型）	243,413,687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）	756,713,501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）	633,438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）	2,646,635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）	10,892,543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）	34,368,867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）	42,312,740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）	95,460,175円
外国株式指数ファンド	1,202,169,071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	24,043,909,623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）	68,010,186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	31,827,385円
三井住友・資産最適化ファンド（１安定重視型）	155,185,772円
三井住友・資産最適化ファンド（２やや安定型）	143,894,016円
三井住友・資産最適化ファンド（３バランス型）	572,488,255円
三井住友・資産最適化ファンド（４やや成長型）	352,845,730円
三井住友・資産最適化ファンド（５成長重視型）	510,922,743円
三井住友・ＤＣつみたてＮＩＳＡ・世界分散ファンド	68,268,556円
三井住友ＤＳ・外国株式インデックス年金ファンド	3,019,906,252円
三井住友ＤＳ・年金バランス３０（債券重点型）	10,626,484円

三井住友ＤＳ・年金バランス５０（標準型）	55,451,872 円
三井住友ＤＳ・年金バランス７０（株式重点型）	59,438,964 円
三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０６０	4,232,678 円
ＳＭＢＣ・ＤＣインデックスファンド（ＭＳＣＩコクサイ）	2,147,338,922 円
日興ＦＷＳ・先進国株インデックス（為替ヘッジあり）	152,567,562 円
日興ＦＷＳ・先進国株インデックス（為替ヘッジなし）	3,585,531,403 円
三井住友ＤＳ・先進国株式インデックス・ファンド	163,822,041 円
三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０３５	8,164,618 円
三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０４０	5,237,685 円
三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０４５	6,058,879 円
三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０５５	3,246,500 円
三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０６５	1,839,468 円
三井住友ＤＳ・ＦＷ専用ポートフォリオ・レベル１（保守型）	132,742 円
三井住友ＤＳ・ＦＷ専用ポートフォリオ・レベル２（安定型）	4,523,760 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）	23,261,648 円
三井住友ＤＳ・ＦＷ専用ポートフォリオ・レベル４（成長型）	24,960,348 円
三井住友ＤＳ・ＦＷ専用ポートフォリオ・レベル５（積極成長型）	9,195,805 円
ＳＭＡＭ・外国株式パッシブ・ファンド（適格機関投資家専用）	240,547,212 円
バランスファンドＶＡ（安定運用型）＜適格機関投資家限定＞	1,942,360 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＞	9,177,883 円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ２５＜適格機関投資家専用＞	245,794,741 円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ３７．５＜適格機関投資家専用＞	452,629,384 円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ５０＜適格機関投資家専用＞	2,047,321,017 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＞	31,449,420 円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ７５＜適格機関投資家専用＞	343,570,870 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＞	186,557,963 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）	163,908,636 円
ＳＭＡＭ・グローバルバランス４０ＶＡ＜適格機関投資家限定＞	35,732,170 円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２０Ａ＜適格機関投資家専用＞	4,136,470 円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ３５Ａ＜適格機関投資家専用＞	4,129,448 円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ５０Ａ＜適格機関投資家専用＞	3,245,145 円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２０Ｌ＜適格機関投資家専用＞	9,285,460 円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２５Ｌ＜適格機関投資家専用＞	31,431,756 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＞	70,180,971 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＞	29,644,946 円
ＳＭＡＭ・世界バランスファンドＶＡ＜適格機関投資家限定＞	111,150,173 円
ＳＭＡＭ・世界バランスファンドＶＡ２＜適格機関投資家限定＞	40,376,158 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・マルチアセットストラテジーファンド２０１６－０４＜適格機関投資家限定	14,536,347 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＞	23,235,506 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＞	32,167,904 円
合　計	88,139,875,188 円

外国債券パッシブ・マザーファンド

（１）貸借対照表

（単位：円）

	（2024 年 8 月 19 日現在）
資産の部	
流動資産	
預金	719,501,626
金銭信託	3,739,795
コール・ローン	599,783,873
国債証券	182,084,031,607
未収利息	1,232,724,596
前払費用	96,747,667
流動資産合計	184,736,529,164
資産合計	184,736,529,164
負債の部	
流動負債	
未払解約金	371,743,382
流動負債合計	371,743,382
負債合計	371,743,382
純資産の部	
元本等	
元本	80,475,712,153
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	103,889,073,629
元本等合計	184,364,785,782
純資産合計	184,364,785,782
負債純資産合計	184,736,529,164

（２）注記表

（重要な会計方針の注記）

項　目	自 2024 年 2 月 20 日 至 2024 年 8 月 19 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。

（貸借対照表に関する注記）

項　目	(2024年8月19日現在)
1．　当計算期間の末日における受益権の総数	80,475,712,153口
2．　1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額　2.2909円 （1万口当たりの純資産額22,909円）

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

項　目	(2024年8月19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。

（その他の注記）

（2024年8月19日現在）	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	80,415,247,995円
同期中における追加設定元本額	6,235,464,012円
同期中における一部解約元本額	6,174,999,854円
2024年8月19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	28,349,311,305円
三井住友・ＤＣ年金バランス３０（債券重点型）	967,385,386円
三井住友・ＤＣ年金バランス５０（標準型）	2,454,949,516円
三井住友・ＤＣ年金バランス７０（株式重点型）	1,526,946,218円
ＳＭＡＭ・グローバルバランスファンド（機動的資産配分型）	118,518,040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）	5,272,221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）	21,311,621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）	78,792,485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）	257,528,022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）	213,843,075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）	358,364,894円
三井住友・ＤＣ年金バランスゼロ（債券型）	19,479,666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	49,196,770円
三井住友・資産最適化ファンド（１安定重視型）	382,979,785円
三井住友・資産最適化ファンド（２やや安定型）	264,933,529円
三井住友・資産最適化ファンド（３バランス型）	772,840,364円
三井住友・資産最適化ファンド（４やや成長型）	253,619,536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	264,690,089円
三井住友ＤＳ・外国債券インデックス年金ファンド	1,310,715,338円
三井住友ＤＳ・年金バランス３０（債券重点型）	42,249,179円
三井住友ＤＳ・年金バランス５０（標準型）	146,771,567円
三井住友ＤＳ・年金バランス７０（株式重点型）	118,333,962円
三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０６０	6,480,133円
日興ＦＷＳ・先進国債インデックス（為替ヘッジなし）	4,386,257,627円
三井住友ＤＳ・先進国債インデックス・ファンド	328,547,821円
三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０３５	12,817,492円
三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０４０	7,697,068円
三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０４５	8,898,273円
三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０５５	4,914,491円
三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０６５	2,770,077円
三井住友ＤＳ・ＦＷ専用ポートフォリオ・レベル１（保守型）	828,066円
三井住友ＤＳ・ＦＷ専用ポートフォリオ・レベル２（安定型）	3,300,545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）	16,019,495 円
三井住友ＤＳ・ＦＷ専用ポートフォリオ・レベル４（成長型）	15,965,482 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）	6,009,006 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＞	5,814,998,799 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＞	3,545,497,490 円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ３７．５＜適格機関投資家専用＞	3,399,191,514 円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ５０＜適格機関投資家専用＞	8,216,472,501 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＞	651,933,074 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＞	1,117,627,193 円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ３５＜適格機関投資家専用＞	3,287,566,547 円
ＳＭＡＭ・外国債券パッシブファンドＶＡ＜適格機関投資家限定＞	5,731,290,674 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）	264,240,653 円
ＳＭＡＭ・グローバルバランス４０ＶＡ＜適格機関投資家限定＞	95,592,430 円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２０Ａ＜適格機関投資家専用＞	51,708,478 円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ３５Ａ＜適格機関投資家専用＞	25,169,536 円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ５０Ａ＜適格機関投資家専用＞	11,741,981 円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２０Ｌ＜適格機関投資家専用＞	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＞	302,108,214 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＞	692,289,548 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＞	449,889,584 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＞	588,515,844 円
ＳＭＡＭ・世界バランスファンドＶＡ＜適格機関投資家限定＞	214,119,065 円
ＳＭＡＭ・世界バランスファンドＶＡ２＜適格機関投資家限定＞	190,709,890 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＞	79,736,653 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＞	127,763,459 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＞	233,856,611 円
合　計	80,475,712,153 円

２【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

三井住友・ＤＣ年金バランス３０（債券重点型）

2024年8月30日現在

Ⅰ　資産総額	22,466,302,053円
Ⅱ　負債総額	32,568,357円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	22,433,733,696円
Ⅳ　発行済口数	12,294,552,774口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ） （１万口当たり純資産額）	1.8247円 (18,247円)

三井住友・ＤＣ年金バランス５０（標準型）

2024年8月30日現在

Ⅰ　資産総額	57,601,480,042円
Ⅱ　負債総額	46,999,376円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	57,554,480,666円
Ⅳ　発行済口数	25,305,503,566口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ） （１万口当たり純資産額）	2.2744円 (22,744円)

三井住友・ＤＣ年金バランス７０（株式重点型）

2024年8月30日現在

Ⅰ　資産総額	34,917,205,355円
Ⅱ　負債総額	26,368,543円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	34,890,836,812円
Ⅳ　発行済口数	12,684,495,011口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ） （１万口当たり純資産額）	2.7507円 (27,507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8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。

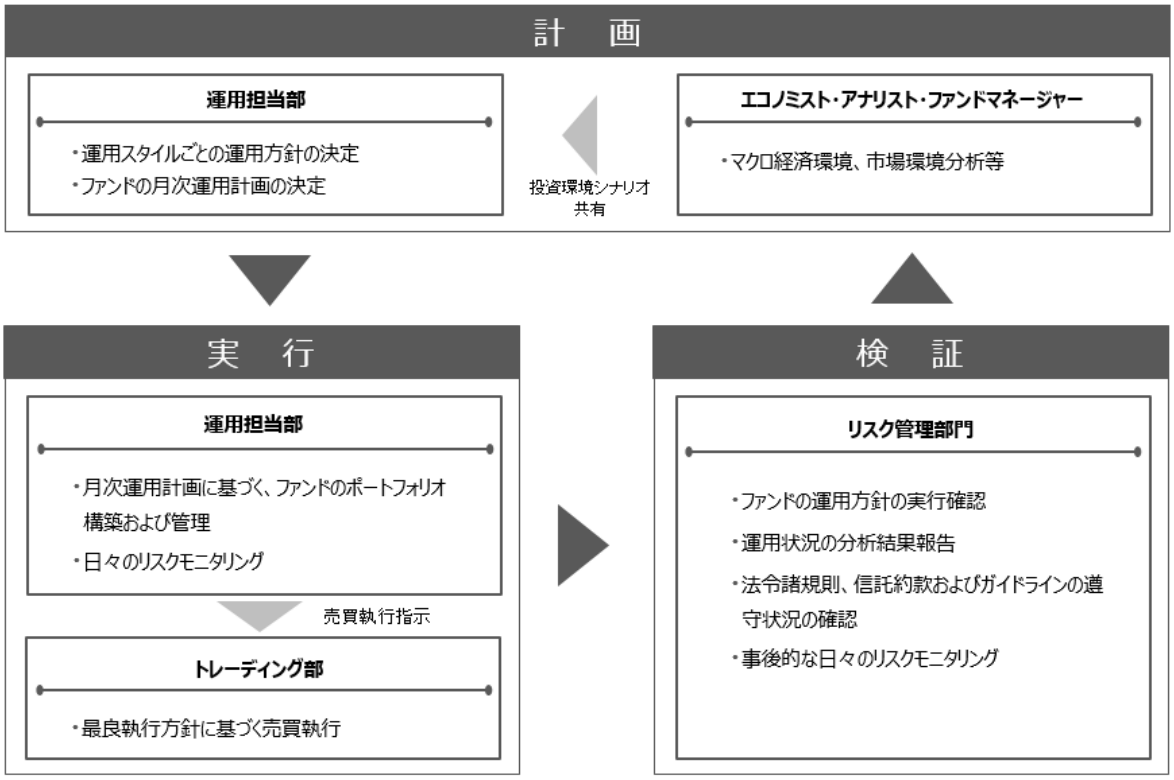
取締役の任期は、選任後１年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会の終結の時までとし、補欠または増員によって選任された取締役の任期は、他の現任取締役の任期の満了する時までとします。

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 8 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	660	12,430,152
単位型株式投資信託	85	654,171
追加型公社債投資信託	1	23,124
単位型公社債投資信託	146	233,547
合　計	892	13,340,996

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	㈱三井住友銀行	東京都千代田区	1,770,996,505	銀行業	% —	投信の販売委託役員の兼任	委託販売手数料	5,279,199	未払手数料	1,265,651
親会社の子会社	SMBC日興証券㈱	東京都千代田区	10,000,000	証券業	% —	投信の販売委託役員の兼任	委託販売手数料	7,030,381	未払手数料	1,288,749

(注) 取引条件及び取引条件の決定方針等

投信の販売委託については、一般取引条件を基に、協議の上決定しております。

2. 親会社に関する注記

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

当事業年度(自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)

1．関連当事者との取引

(1)兄弟会社等

(単位：千円)

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金、出資金又は基金	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額	科目	期末残高
親会社の子会社	㈱三井住友銀行	東京都千代田区	1,770,996,505	銀行業	% —	投信の販売委託 役員の兼任	委託販売手数料	6,642,605	未払手数料	1,630,250
親会社の子会社	SMBC日興証券㈱	東京都千代田区	135,000,000	証券業	% —	投信の販売委託 役員の兼任	委託販売手数料	6,960,278	未払手数料	1,200,878

(注) 取引条件及び取引条件の決定方針等

投信の販売委託については、一般取引条件を基に、協議の上決定しております。

2．親会社に関する注記

(単位：千円)

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

(注) 子会社株式の売却及び子会社株式売却益

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

(1株当たり情報)

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

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

2. 1株当たり当期純利益の算定上の基礎は、次のとおりであります。

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

4【利害関係人との取引制限】

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

イ　自己またはその取締役もしくは執行役との間における取引を行うことを内容とした運用を行うこと（投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。）。

ロ　運用財産相互間において取引を行うことを内容とした運用を行うこと（投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。）。

ハ　通常の取引の条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託会社の親法人等（委託会社の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。）または子法人等（委託会社が総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。）と有価証券の売買その他の取引または店頭デリバティブ取引を行うこと。

ニ　委託会社の親法人等または子法人等の利益を図るため、その行う投資運用業に関して運用の方針、運用財産の額もしくは市場の状況に照らして不必要な取引を行うことを内容とした運用を行うこと。

ホ　上記ハ、ニに掲げるもののほか、委託会社の親法人等または子法人等が関与する行為であって、投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのあるものとして内閣府令で定める行為。

5【その他】

イ　定款の変更、その他の重要事項

（イ）定款の変更

該当ありません。

（ロ）その他の重要事項

該当ありません。

ロ　訴訟事件その他会社に重要な影響を与えることが予想される事実

該当ありません。

追加型証券投資信託
三井住友・ＤＣ年金バランス30（債券重点型）
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〕

約款第20条に基づき委託者が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、主として内外の株式および公社債に投資することにより、信託財産の着実な成長を目指した運用を行います。

２．運用方法

(1) 投資対象

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う「国内株式インデックス・マザーファンド（Ｂ号)」、ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ（総合）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行う「国内債券パッシブ・マザーファンド」、ＭＳＣＩコクサイインデックス（配当込み、円ベース）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行う「外国株式インデックス・マザーファンド」、ＦＴＳＥ世界国債インデックス（除く日本、円ベース）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行う「外国債券パッシブ・マザーファンド」（以下「マザーファンド」といいます。）の受益証券を主要投資対象とします。このほか、内外の株式・公社債へ直接投資を行うことがあります。

(2) 投資態度

① 国内株式、国内債券、外国株式、外国債券を主要投資対象とする４つのマザーファンドに分散投資することにより、信託財産の着実な成長を目指した運用を行います。

② マザーファンド受益証券への投資を通じて行う各資産への実質的な基本資産配分は下記の通りとします。ただし、それぞれの資産の時価変動等に伴う各資産比率の変化については、一定の範囲（±３％）を設けて調整を行います。

国内株式20％、国内債券55％、外国株式10％、外国債券10％、短期金融資産５％

③ 運用にあたっては、以下の比率により独自に作成した合成指数をベンチマークとし、ベンチマークに連動する投資成果を目指します。

ＴＯＰＩＸ（東証株価指数、配当込み）20％、ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ（総合）55％、ＭＳＣＩコクサイインデックス（配当込み、円ベース）10％、ＦＴＳＥ世界国債インデックス（除く日本、円ベース）10％、有担保コール翌日物５％

④ 実質外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行わないことを基本とします。

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 株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の50％未満とします。

② 新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10％以内とします。

③ 投資信託証券（マザーファンド受益証券を除きます。）への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の５％以内とします。

④ 外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の50％以下とします。

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

⑥ 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。

⑦ 有価証券先物取引等は、約款第24条の範囲内で行います。

⑧ スワップ取引は、約款第25条の範囲内で行います。

⑨ 金利先渡取引および為替先渡取引は、約款第26条の範囲内で行います。

⑩　デリバティブ取引（法人税法第61条の５に定めるものをいいます。）は、価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。

⑪　外国為替予約取引は、為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。

３．収益分配方針

毎決算時（原則として毎年２月18日、ただし決算応当日が休業日の場合は翌営業日）に、原則として以下の方針に基づき収益分配を行います。

①　分配対象額の範囲は、繰越分を含めた利子、配当収益と売買益（評価損益を含みます。）等の全額とします。

②　収益分配金額は、委託者が基準価額水準等を勘案して決定します。ただし、分配対象収益が少額の場合には、収益分配を行わない場合があります。

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、運用の基本方針と同一の運用を行います。

追加型証券投資信託
『三井住友・ＤＣ年金バランス30（債券重点型）』
〔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、信託財産に属する財産についての対抗要件に関する事項を除き、信託法（大正11年法律第62号）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26条第１項に基づく信託事務の委任として、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100万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、受託者と合意のうえ、金5,000億円を限度として信託金を追加することができます。

②　追加信託が行われたときは、受託者はその引受を証する書面を委託者に交付します。

③　委託者は、受託者と合意のうえ、第１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52条第１項、第53条第１項、第54条第１項または第56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　この信託に係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100万口に、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、受益権の再分割を行いません。ただし、社債、株式等の振替に関する法律が施行された場合には、受託者と協議のうえ、同法に定めるところにしたがい、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　この約款において基準価額とは、信託財産に属する資産（受入担保金代用有価証券および第29条に規定する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（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32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　この信託の受益権は、平成19年１月４日より、社債等の振替に関する法律（政令で定める日以降「社債、株式等の振替に関する法律」となった場合は読み替えるものとし、「社債、株式等の振替に関する法律」を含め「社振法」といいます。以下同じ。）の規定の適用を受けることとし、同日以降に追加信託される受益権の帰属は、委託者があらかじめこの投資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。）及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、社振法の規定にしたがい、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。

④　委託者は、受益者を代理してこの信託の受益権を振替受入簿に記載または記録を申請することができるものとし、原則としてこの信託の平成18年12月29日現在のすべての受益権（受益権につき、既に信託契約の一部解約が行われたもので、当該一部解約に係る一部解約金の支払開始日が平成19年１月４日以降となるものを含みます。）を受益者を代理して平成19年１月４日に振替受入簿に記載または記録するよう申請します。ただし、保護預かりではない受益証券に係る受益権については、信託期間中において委託者が受益証券を確認した後当該申請を行うものとします。振替受入簿に記載または記録された受益権に係る受益証券（当該記載または記録以降に到来する計算期間の末日に係る収益分配金交付票を含みます。）は無効となり、当該記載または記録により振替受益権となります。また、委託者は、受益者を代理してこの信託の受益権を振替受入簿に記載または記録を申請する場合において、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。）に当該申請の手続きを委任することができます。

【受益権の設定に係る受託者の通知】

第12条　受託者は、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係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　委託者は、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、委託者が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　指定販売会社は、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定める申込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。

③　前２項の取得申込者は、委託者、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係る口数の増加の記載または記録が行われます。なお、委託者、指定販売会社は、当該取得申込みの代金（第４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係る口数の増加の記載または記録を行うことができます。

④　第１項および第２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、委託者、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係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、取得日がこの信託契約締結日である場合の受益権を表示する受益証券の価額は、１口につき１円に、委託者、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係る消費税等に相当する金額を加算した価額とします。

⑤　前項の規定にかかわらず、第48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42条に規定する各計算期間終了日の基準価額とします。

【受益権の譲渡に係る記載または記録】

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係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、当該譲渡に係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。）に社振法の規定にしたがい、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係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え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。

【受益証券の再交付の費用】

第16条　〔削　除〕

【投資の対象とする資産の種類】

第17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．デリバティブ取引に係る権利（金融商品取引法第２条第20項に規定するものをいい、本約款第24条、第25条および第26条に定めるものに限ります。）

ハ．金銭債権

ニ．約束手形

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18条　委託者は、信託金を、主として、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て締結された親投資信託である「国内株式インデックス・マザーファンド（Ｂ号）受益証券」、「国内債券パッシブ・マザーファンド受益証券」、「外国株式インデックス・マザーファンド受益証券」、「外国債券パッシブ・マザーファンド受益証券」（以下「マザーファンド」といいます。）の受益証券（以下「マザーファンド受益証券」といいます。）または次の有価証券（金融商品取引法第２条第２項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図します。

１．株券または新株引受権証書

２．国債証券

３．地方債証券

４．特別の法律により法人の発行する債券

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

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

ます。）

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

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

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

10. コマーシャル・ペーパー

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

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

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

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

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

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

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

18. 外国法人が発行する譲渡性預金証書

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

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

21. 外国の者に対する権利で前号の有価証券の性質を有するもの

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

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

５．貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第２条第２項第１号で定めるもの

６．外国の者に対する権利で前号の権利の性質を有するもの

③ 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。

④ 委託者は、信託財産に属する新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額とマザーファンドに属する新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、信託財産の純資産総額の100分の10を超えることとなる投資の指図をしません。

⑤ 委託者は、信託財産に属する投資信託証券（マザーファンド受益証券を除きます。）の時価総額とマザーファンドに属する当該投資信託証券の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、信託財産の純資産総額の100分の５を超えることとなる投資の指図をしません。

⑥ 前２項において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの時価総

額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める当該資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

【デリバティブ取引等にかかる投資制限】

第18条の２　委託者は、デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。

【受託者の自己または利害関係人等との取引】

第19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、受託者および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。以下この条および第33条において同じ。）、第33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17条ならびに第18条第１項および第２項に定める資産への投資等を、信託財産を害するおそれがないと認められる取引として行うことができます。

②　前項に定める信託財産を害するおそれがないと認められる取引とは、次の各号のいずれかに該当する場合をいいます。

１．取引所価格（気配値等を含む。）等の適正な価格による取引であること。

２．受託者の店頭に表示する利率等の公正な条件によること。

３．前２号に該当しない場合で、委託者が適正な条件であると判断する場合であること。

③　前２項の取扱いは、第23条から第29条まで、第32条および第37条から第39条までにおける委託者の指図による取引についても同様とします。

④　この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。

【運用の基本方針】

第20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したがって、その指図を行います。

【投資する株式等の範囲】

第21条　委託者が投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、取引所に上場されている株式の発行会社の発行するもの、取引所に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。

②　前項の規定にかかわらず、上場予定または登録予定の株式、新株引受権証券および新株予約権証券で目論見書等において上場または登録されることが確認できるものについては委託者が投資することを指図することができるものとします。

【同一銘柄の新株引受権証券等への投資制限】

第22条　委託者は、信託財産に属する同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額とマザーファンドに属する当該同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、信託財産の純資産総額の100分の５を超えることとなる投資の指図をしません。

②　前項において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める当該資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

【信用取引の指図】

第23条　委託者は、信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、株券の引渡しまたは買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。

②　前項の信用取引の指図は、当該売付けにかかる建玉の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。

③　信託財産の一部解約等の事由により、前項の売付けにかかる建玉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売付けの一部を決済するための指図をするものとします。

【先物取引等の指図】

第24条　委託者は、わが国の取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第８項第３号イに掲げるものをいいます。以下同じ。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第８項第３号ロに掲げるものをいいます。以下同じ。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第８項第３号ハに掲げるものをいいます。以下同じ。）ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めて取り扱うものとします（以下同じ。）。

②　委託者は、わが国の取引所における通貨にかかる先物取引および通貨にかかるオプション取引ならびに外国の取引所における通貨にかかる先物取引およびオプション取引を行うことの指図をすることができます。

③　委託者は、わが国の取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。

【スワップ取引の指図】

第25条　委託者は、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行うことの指図をすることができます。

②　スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として第５条に定める信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこのかぎりではありません。

③　スワップ取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の合計額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記純資産総額が減少して、スワップ取引の想定元本の合計額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託者は、速やかに、その超える額に相当するスワップ取引の一部の解約を指図するものとします。

④　スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額により行うものとします。

⑤　委託者は、スワップ取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めたときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

【金利先渡取引および為替先渡取引の指図】

第26条　委託者は、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことの指図をすることができます。

②　金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として第５条に定める信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。

③　金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかる金利先渡取引および為替先渡取引の想定元本の合計額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記純資産総額が減少して、金利先渡取引および為替先渡取引の想定元本の合計額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託者は、速やかに、その超える額に相当する金利先渡取引および為替先渡取引の一部の解約を指図するものとします。

④　金利先渡取引および為替先渡取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額により行うものとします。

⑤　委託者は、金利先渡取引および為替先渡取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めたときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

⑥　本条において「金利先渡取引」とは、当事者間において、あらかじめ将来の特定の日（以下「決済日」といいます。）における決済日から一定の期間を経過した日（以下「満期日」といいます。）までの期間に係る国内または海外において代表的利率として公表される預金契約または金銭の貸借契約に基づく債権の利率（以下「指標利率」といいます。）の数値を取り決め、その取り決めに係る数値と決済日における当該指標利率の現実の数値との差にあらかじめ元本として定めた金額および当事者間で約定した日数を基準とした数値を乗じた額を決済日における当該指標利率の現実の数値で決済日における現在価値に割り引いた額の金銭の授受を約する取引をいいます。

⑦　本条において「為替先渡取引」とは、当事者間において、あらかじめ決済日から満期日までの期

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

【有価証券の貸付の指図】

第27条　委託者は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式および公社債を次の各号の範囲内で貸付けることの指図をすることができます。

１．株式の貸付は、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額を超えないものとします。

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

②　前項各号に定める限度額を超えることとなった場合には、委託者は、速やかに、その超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとします。

③　委託者は、有価証券の貸付にあたって必要と認めたときは、担保の受入れの指図を行うものとします。

【有価証券の空売りの指図】

第28条　委託者は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産において有しない有価証券または第29条の規定により借り入れた有価証券を売り付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、売り付けた有価証券の引渡しまたは買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。

②　前項の売付けの指図は、当該売付けにかかる有価証券の時価総額が信託財産の純資産総額を超えない範囲で行うものとします。

③　信託財産の一部解約等の事由により、前項の売付けにかかる有価証券の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託者は速やかに、その超える額に相当する売付けの一部を決済するための指図をするものとします。

【有価証券の借入れの指図】

第29条　委託者は、信託財産の効率的な運用に資するため、有価証券の借入れの指図をすることができます。なお、当該有価証券の借入れを行うにあたり担保の提供が必要と認めたときは、担保の提供の指図をするものとします。

②　前項の指図は、当該借入れにかかる有価証券の時価総額が信託財産の純資産総額を超えない範囲で行うものとします。

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有価証券の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託者は速やかに、その超える額に相当する借り入れた有価証券の一部を返還するための指図をするものとします。

④　第１項の借入れにかかる品借料は、信託財産中から支弁します。

【外貨建資産への投資制限】

第30条　委託者は、信託財産に属する外貨建資産の時価総額とマザーファンドに属する当該外貨建資産の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、信託財産の純資産総額の100分の50を超えることとなる投資の指図はしません。ただし、有価証券の値上がり等により100分の50を超えることとなった場合には、委託者は速やかにこれを調整します。

②　前項において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める当該外貨建資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

【特別の場合の外貨建有価証券への投資制限】

第31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32条　委託者は、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。

②　前項の予約取引の指図は、信託財産にかかる為替の買予約の合計額と売予約の合計額との差額につき円換算した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、信託財産に属する外貨建資産の為替変動リスクを回避するためにする当該予約取引の指図については、この限りではありません。

③　前項の限度額を超えることとなった場合には、委託者は所定の期間内に、その超える額に相当する為替予約の一部を解消するための外国為替の売買の予約取引の指図をするものとします。

【信託業務の委託等】

第33条　受託者は、委託者と協議のうえ、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もの（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係る実績等に照らし、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（裁量性のないものに限ります。）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．信託財産の保存に係る業務

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係る業務

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

【有価証券の保管】

第34条　〔削　除〕

【混蔵寄託】

第35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36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売却等の指図】

第37条　委託者は、信託財産に属するマザーファンド受益証券にかかる信託契約の一部解約の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38条　委託者は、前条の規定による一部解約金および売却代金、有価証券にかかる償還金等、株式の清算分配金、有価証券等にかかる利子等、株式の配当金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39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に資するため、信託財産において一部解約金の支払資金の不足額が生じるときは、資金借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。

②　前項の資金借入れ額は、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　前項の借入期間は、有価証券等の売却代金または償還金の入金日までに限るものとします。

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40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41条　信託財産に属する有価証券について、借替、転換、新株発行または株式割当がある場合で、委託者の申出があるときは、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、株式の清算分配金、有価証券等にかかる利子等、株式の配当金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、受託者がこれを立替えて信託財産に繰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42条　この信託の計算期間は、毎年２月19日から翌年２月18日までとすることを原則とします。ただし、第１計算期間は平成17年９月30日から平成18年２月20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条に定める信託期間の終了日とします。

【信託財産に関する報告】

第43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。

【信託事務等の諸費用】

第44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42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。

【信託報酬等の額および支弁の方法】

第45条　委託者および受託者の信託報酬の総額は、第42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22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項の信託報酬に係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46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、貸付有価証券にかかる品貸料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47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48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48条第４項に規定する支払日までに、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ならびに収益分配金の再投資】

第48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、指定販売会社との別に定める「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。また、委託者の自らの募集にかかる受益権に帰属する収益分配金は、この信託の受益権の取得申込金として、委託者が受益者に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係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、当該償還に係る受益権の口数と同口数の抹消の申請を行うものとし、社振法の規定にしたが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。また、受益証券を保有している受益者に対しては、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受益証券と引換えに当該受益者に支払います。

④　一部解約金は、第51条第１項の受益者の請求を受付けた日から起算して、原則として５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。ただし、委託者の自らの募集に係る受益権に帰属する償還金および一部解約金の支払いは、委託者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、追加信託の都度当該口数により加重平均され、収益分配の都度、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、追加信託の都度、当該口数により加重平均され、収益分配の都度、調整されるものとします。

【受益証券の保管および返還請求の取扱い】

第49条　〔削　除〕

【収益分配金および償還金の時効】

第50条　受益者が、収益分配金については第48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第48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。

【一部解約】

第51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　委託者は、前項の一部解約の実行の請求を受付けた場合には、信託契約の一部を解約します。なお、前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係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、当該一部解約に係る受益権の口数と同口数の抹消の申請を行うものとし、社振法の規定にしたが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。

③　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。

④　平成19年１月４日以降の信託契約の一部解約に係る一部解約の実行の請求を受益者がするときは、委託者、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。ただし、平成19年１月４日以降に一部解約金が受益者に支払われることとなる一部解約の実行の請求で、平成19年１月４日前に行われる当該請求については、振替受益権となることが確実な受益証券をもって行うものとします。

⑤　委託者は、取引所における取引の停止、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ができます。

⑥　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。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付けたものとして、第３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51条の２　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係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、この約款によるほか、民法その他の法令等にしたがって取り扱われます。

【信託契約の解約】

第52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、その他やむを得ない事情が発生したときは、受託者と合意のうえ、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、あらかじめ、解約しようとする旨を公告し、かつ、その旨を記載した書面をこの信託契約に係る知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託契約

に係るすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。

③　前項の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託者に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は１ヵ月を下らないものとします。

④　前項の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の二分の一を超えるときは、第１項の信託契約の解約をしません。

⑤　委託者は、この信託契約の解約をしないこととしたときは、解約しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を知られたる受益者に対して交付します。ただし、すべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。

⑥　第３項から前項までの規定は、信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、第３項の一定の期間が１ヵ月を下らずにその公告および書面の交付を行うことが困難な場合には適用しません。

【信託契約に関する監督官庁の命令】

第53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、その命令にしたがい、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、その手続について第57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54条　委託者が監督官庁より登録の取消を受けたとき、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57条第４項に該当する場合を除き、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55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56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背いた場合、その他重要な事由が生じたときは、委託者または受益者は、裁判所に受託者の解任を請求することができます。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57条の規定にしたがい、新受託者を選任します。

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】

第57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、受託者と合意のうえ、この信託約款を変更することができるものとし、あらかじめ、変更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。

②　委託者は、前項の変更事項のうち、その内容が重大なものについて、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面をこの信託約款に係る知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託約款に係るすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。

③　前項の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託者に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は１ヵ月を下らないものとします。

④　前項の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の２分の１を超えるときは、第１項の信託約款の変更をしません。

⑤　委託者は、当該信託約款の変更をしないこととしたときは、変更しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を知られたる受益者に対して交付します。ただし、すべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。

【反対者の買取請求権】

第58条　第52条に規定する信託契約の解約または前条に規定する信託約款の変更を行う場合において、第52条第３項または前条第３項の期間内に委託者に異議を述べた受益者は、受託者に自己に帰属す

る受益権を信託財産をもって買取るべき旨の請求をすることができます。

【運用報告書に記載すべき事項の提供】

第58条の２　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59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60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。

【付則】

第１条　平成18年12月29日現在の信託約款第11条、第12条、第14条から第16条の規定および受益権と読み替えられた受益証券に関する規定は、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には、なおその効力を有するものとします。

上記条項により信託契約を締結します。

平成17年９月30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　井上　恵介

受託者　大阪市中央区北浜四丁目５番33号
住友信託銀行株式会社
取締役社長　森田　豊

追加型証券投資信託
三井住友・ＤＣ年金バランス50（標準型）
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〕

約款第20条に基づき委託者が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、主として内外の株式および公社債に投資することにより、信託財産の着実な成長を目指した運用を行います。

２．運用方法

(1) 投資対象

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う「国内株式インデックス・マザーファンド（Ｂ号)」、ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ（総合）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行う「国内債券パッシブ・マザーファンド」、ＭＳＣＩコクサイインデックス（配当込み、円ベース）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行う「外国株式インデックス・マザーファンド」、ＦＴＳＥ世界国債インデックス（除く日本、円ベース）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行う「外国債券パッシブ・マザーファンド」（以下「マザーファンド」といいます。）の受益証券を主要投資対象とします。このほか、内外の株式・公社債へ直接投資を行うことがあります。

(2) 投資態度

① 国内株式、国内債券、外国株式、外国債券を主要投資対象とする４つのマザーファンドに分散投資することにより、信託財産の着実な成長を目指した運用を行います。

② マザーファンド受益証券への投資を通じて行う各資産への実質的な基本資産配分は下記の通りとします。ただし、それぞれの資産の時価変動等に伴う各資産比率の変化については、一定の範囲（±３％）を設けて調整を行います。
国内株式35％、国内債券35％、外国株式15％、外国債券10％、短期金融資産５％

③ 運用にあたっては、以下の比率により独自に作成した合成指数をベンチマークとし、ベンチマークに連動する投資成果を目指します。
ＴＯＰＩＸ（東証株価指数、配当込み）35％、ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ（総合）35％、ＭＳＣＩコクサイインデックス（配当込み、円ベース）15％、ＦＴＳＥ世界国債インデックス（除く日本、円ベース）10％、有担保コール翌日物５％

④ 実質外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行わないことを基本とします。

⑤ 株式以外の資産（他の投資信託受益証券を通じて投資する場合は、当該他の投資信託の信託財産に属する株式以外の資産のうち、この投資信託の信託財産に属するとみなした部分を含みます。）への投資割合は、原則として信託財産総額の75％以下とします。

⑥ 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 株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の25％以上とします。

② 新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10％以内とします。

③ 投資信託証券（マザーファンド受益証券を除きます。）への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の５％以内とします。

④ 外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の50％以下とします。

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

⑥ 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。

⑦　有価証券先物取引等は、約款第24条の範囲内で行います。
⑧　スワップ取引は、約款第25条の範囲内で行います。
⑨　金利先渡取引および為替先渡取引は、約款第26条の範囲内で行います。
⑩　デリバティブ取引（法人税法第61条の５に定めるものをいいます。）は、価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。
⑪　外国為替予約取引は、為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。

３．収益分配方針

毎決算時（原則として毎年２月18日、ただし決算応当日が休業日の場合は翌営業日）に、原則として以下の方針に基づき収益分配を行います。

①　分配対象額の範囲は、繰越分を含めた利子、配当収益と売買益（評価損益を含みます。）等の全額とします。
②　収益分配金額は、委託者が基準価額水準等を勘案して決定します。ただし、分配対象収益が少額の場合には、収益分配を行わない場合があります。
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、運用の基本方針と同一の運用を行います。

追加型証券投資信託
『三井住友・ＤＣ年金バランス50（標準型）』
〔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、信託財産に属する財産についての対抗要件に関する事項を除き、信託法（大正11年法律第62号）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26条第１項に基づく信託事務の委任として、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100万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、受託者と合意のうえ、金5,000億円を限度として信託金を追加することができます。

②　追加信託が行われたときは、受託者はその引受を証する書面を委託者に交付します。

③　委託者は、受託者と合意のうえ、第１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52条第１項、第53条第１項、第54条第１項または第56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　この信託に係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100万口に、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、受益権の再分割を行いません。ただし、社債、株式等の振替に関する法律が施行された場合には、受託者と協議のうえ、同法に定めるところにしたがい、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　この約款において基準価額とは、信託財産に属する資産（受入担保金代用有価証券および第29条に規定する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（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32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　この信託の受益権は、平成19年１月４日より、社債等の振替に関する法律（政令で定める日以降「社債、株式等の振替に関する法律」となった場合は読み替えるものとし、「社債、株式等の振替に関する法律」を含め「社振法」といいます。以下同じ。）の規定の適用を受けることとし、同日以降に追加信託される受益権の帰属は、委託者があらかじめこの投資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。）及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、社振法の規定にしたがい、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。

④　委託者は、受益者を代理してこの信託の受益権を振替受入簿に記載または記録を申請することができるものとし、原則としてこの信託の平成18年12月29日現在のすべての受益権（受益権につき、既に信託契約の一部解約が行われたもので、当該一部解約に係る一部解約金の支払開始日が平成19年１月４日以降となるものを含みます。）を受益者を代理して平成19年１月４日に振替受入簿に記載または記録するよう申請します。ただし、保護預かりではない受益証券に係る受益権については、信託期間中において委託者が受益証券を確認した後当該申請を行うものとします。振替受入簿に記載または記録された受益権に係る受益証券（当該記載または記録以降に到来する計算期間の末日に係る収益分配金交付票を含みます。）は無効となり、当該記載または記録により振替受益権となります。また、委託者は、受益者を代理してこの信託の受益権を振替受入簿に記載または記録を申請する場合において、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。）に当該申請の手続きを委任することができます。

【受益権の設定に係る受託者の通知】

第12条　受託者は、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係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　委託者は、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、委託者が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　指定販売会社は、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定める申込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。

③　前２項の取得申込者は、委託者、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係る口数の増加の記載または記録が行われます。なお、委託者、指定販売会社は、当該取得申込みの代金（第４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係る口数の増加の記載または記録を行うことができます。

④　第１項および第２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、委託者、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係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、取得日がこの信託契約締結日である場合の受益権を表示する受益証券の価額は、１口につき１円に、委託者、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係る消費税等に相当する金額を加算した価額とします。

⑤　前項の規定にかかわらず、第48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42条に規定する各計算期間終了日の基準価額とします。

【受益権の譲渡に係る記載または記録】

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係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、当該譲渡に係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。）に社振法の規定にしたがい、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係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え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。

【受益証券の再交付の費用】

第16条　〔削　除〕

【投資の対象とする資産の種類】

第17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．デリバティブ取引に係る権利（金融商品取引法第２条第20項に規定するものをいい、本約款第24条、第25条および第26条に定めるものに限ります。）

ハ．金銭債権

ニ．約束手形

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18条　委託者は、信託金を、主として、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て締結された親投資信託である「国内株式インデックス・マザーファンド（Ｂ号）受益証券」、「国内債券パッシブ・マザーファンド受益証券」、「外国株式インデックス・マザーファンド受益証券」、「外国債券パッシブ・マザーファンド受益証券」（以下「マザーファンド」といいます。）の受益証券（以下「マザーファンド受益証券」といいます。）または次の有価証券（金融商品取引法第２条第２項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図します。

１．株券または新株引受権証書

２．国債証券

３．地方債証券

４．特別の法律により法人の発行する債券

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

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

ます。）

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

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

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

10. コマーシャル・ペーパー

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

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

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

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

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

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

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

18. 外国法人が発行する譲渡性預金証書

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

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

21. 外国の者に対する権利で前号の有価証券の性質を有するもの

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

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

５．貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第２条第２項第１号で定めるもの

６．外国の者に対する権利で前号の権利の性質を有するもの

③ 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。

④ 委託者は、信託財産に属する新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額とマザーファンドに属する新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、信託財産の純資産総額の100分の10を超えることとなる投資の指図をしません。

⑤ 委託者は、信託財産に属する投資信託証券（マザーファンド受益証券を除きます。）の時価総額とマザーファンドに属する当該投資信託証券の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、信託財産の純資産総額の100分の５を超えることとなる投資の指図をしません。

⑥ 前２項において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの時価総

額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める当該資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

【デリバティブ取引等にかかる投資制限】

第18条の２　委託者は、デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。

【受託者の自己または利害関係人等との取引】

第19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、受託者および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。以下この条および第33条において同じ。）、第33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17条ならびに第18条第１項および第２項に定める資産への投資等を、信託財産を害するおそれがないと認められる取引として行うことができます。

②　前項に定める信託財産を害するおそれがないと認められる取引とは、次の各号のいずれかに該当する場合をいいます。

１．取引所価格（気配値等を含む。）等の適正な価格による取引であること。

２．受託者の店頭に表示する利率等の公正な条件によること。

３．前２号に該当しない場合で、委託者が適正な条件であると判断する場合であること。

③　前２項の取扱いは、第23条から第29条まで、第32条および第37条から第39条までにおける委託者の指図による取引についても同様とします。

④　この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。

【運用の基本方針】

第20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したがって、その指図を行います。

【投資する株式等の範囲】

第21条　委託者が投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、取引所に上場されている株式の発行会社の発行するもの、取引所に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。

②　前項の規定にかかわらず、上場予定または登録予定の株式、新株引受権証券および新株予約権証券で目論見書等において上場または登録されることが確認できるものについては委託者が投資することを指図することができるものとします。

【同一銘柄の新株引受権証券等への投資制限】

第22条　委託者は、信託財産に属する同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額とマザーファンドに属する当該同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、信託財産の純資産総額の100分の５を超えることとなる投資の指図をしません。

②　前項において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める当該資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

【信用取引の指図】

第23条　委託者は、信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、株券の引渡しまたは買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。

②　前項の信用取引の指図は、当該売付けにかかる建玉の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。

③　信託財産の一部解約等の事由により、前項の売付けにかかる建玉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売付けの一部を決済するための指図をするものとします。

【先物取引等の指図】

第24条　委託者は、わが国の取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第８項第３号イに掲げるものをいいます。以下同じ。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第８項第３号ロに掲げるものをいいます。以下同じ。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第８項第３号ハに掲げるものをいいます。以下同じ。）ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めて取り扱うものとします（以下同じ。）。

②　委託者は、わが国の取引所における通貨にかかる先物取引および通貨にかかるオプション取引ならびに外国の取引所における通貨にかかる先物取引およびオプション取引を行うことの指図をすることができます。

③　委託者は、わが国の取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。

【スワップ取引の指図】

第25条　委託者は、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行うことの指図をすることができます。

②　スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として第５条に定める信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこのかぎりではありません。

③　スワップ取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の合計額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記純資産総額が減少して、スワップ取引の想定元本の合計額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託者は、速やかに、その超える額に相当するスワップ取引の一部の解約を指図するものとします。

④　スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額により行うものとします。

⑤　委託者は、スワップ取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めたときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

【金利先渡取引および為替先渡取引の指図】

第26条　委託者は、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことの指図をすることができます。

②　金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として第５条に定める信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。

③　金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかる金利先渡取引および為替先渡取引の想定元本の合計額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記純資産総額が減少して、金利先渡取引および為替先渡取引の想定元本の合計額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託者は、速やかに、その超える額に相当する金利先渡取引および為替先渡取引の一部の解約を指図するものとします。

④　金利先渡取引および為替先渡取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額により行うものとします。

⑤　委託者は、金利先渡取引および為替先渡取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めたときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

⑥　本条において「金利先渡取引」とは、当事者間において、あらかじめ将来の特定の日（以下「決済日」といいます。）における決済日から一定の期間を経過した日（以下「満期日」といいます。）までの期間に係る国内または海外において代表的利率として公表される預金契約または金銭の貸借契約に基づく債権の利率（以下「指標利率」といいます。）の数値を取り決め、その取り決めに係る数値と決済日における当該指標利率の現実の数値との差にあらかじめ元本として定めた金額および当事者間で約定した日数を基準とした数値を乗じた額を決済日における当該指標利率の現実の数値で決済日における現在価値に割り引いた額の金銭の授受を約する取引をいいます。

⑦　本条において「為替先渡取引」とは、当事者間において、あらかじめ決済日から満期日までの期

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

【有価証券の貸付の指図】

第27条　委託者は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式および公社債を次の各号の範囲内で貸付けることの指図をすることができます。

１．株式の貸付は、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額を超えないものとします。

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

②　前項各号に定める限度額を超えることとなった場合には、委託者は、速やかに、その超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとします。

③　委託者は、有価証券の貸付にあたって必要と認めたときは、担保の受入れの指図を行うものとします。

【有価証券の空売りの指図】

第28条　委託者は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産において有しない有価証券または第29条の規定により借り入れた有価証券を売り付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、売り付けた有価証券の引渡しまたは買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。

②　前項の売付けの指図は、当該売付けにかかる有価証券の時価総額が信託財産の純資産総額を超えない範囲で行うものとします。

③　信託財産の一部解約等の事由により、前項の売付けにかかる有価証券の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託者は速やかに、その超える額に相当する売付けの一部を決済するための指図をするものとします。

【有価証券の借入れの指図】

第29条　委託者は、信託財産の効率的な運用に資するため、有価証券の借入れの指図をすることができます。なお、当該有価証券の借入れを行うにあたり担保の提供が必要と認めたときは、担保の提供の指図をするものとします。

②　前項の指図は、当該借入れにかかる有価証券の時価総額が信託財産の純資産総額を超えない範囲で行うものとします。

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有価証券の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託者は速やかに、その超える額に相当する借り入れた有価証券の一部を返還するための指図をするものとします。

④　第１項の借入れにかかる品借料は、信託財産中から支弁します。

【外貨建資産への投資制限】

第30条　委託者は、信託財産に属する外貨建資産の時価総額とマザーファンドに属する当該外貨建資産の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、信託財産の純資産総額の100分の50を超えることとなる投資の指図はしません。ただし、有価証券の値上がり等により100分の50を超えることとなった場合には、委託者は速やかにこれを調整します。

②　前項において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める当該外貨建資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

【特別の場合の外貨建有価証券への投資制限】

第31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32条　委託者は、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。

②　前項の予約取引の指図は、信託財産にかかる為替の買予約の合計額と売予約の合計額との差額につき円換算した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、信託財産に属する外貨建資産の為替変動リスクを回避するためにする当該予約取引の指図については、この限りではありません。

③　前項の限度額を超えることとなった場合には、委託者は所定の期間内に、その超える額に相当する為替予約の一部を解消するための外国為替の売買の予約取引の指図をするものとします。

【信託業務の委託等】

第33条　受託者は、委託者と協議のうえ、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もの（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係る実績等に照らし、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（裁量性のないものに限ります。）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．信託財産の保存に係る業務

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係る業務

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

【有価証券の保管】

第34条　〔削　除〕

【混蔵寄託】

第35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36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売却等の指図】

第37条　委託者は、信託財産に属するマザーファンド受益証券にかかる信託契約の一部解約の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38条　委託者は、前条の規定による一部解約金および売却代金、有価証券にかかる償還金等、株式の清算分配金、有価証券等にかかる利子等、株式の配当金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39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に資するため、信託財産において一部解約金の支払資金の不足額が生じるときは、資金借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。

②　前項の資金借入れ額は、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　前項の借入期間は、有価証券等の売却代金または償還金の入金日までに限るものとします。

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40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41条　信託財産に属する有価証券について、借替、転換、新株発行または株式割当がある場合で、委託者の申出があるときは、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、株式の清算分配金、有価証券等にかかる利子等、株式の配当金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、受託者がこれを立替えて信託財産に繰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42条　この信託の計算期間は、毎年２月19日から翌年２月18日までとすることを原則とします。ただし、第１計算期間は平成17年９月30日から平成18年２月20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条に定める信託期間の終了日とします。

【信託財産に関する報告】

第43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。

【信託事務等の諸費用】

第44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42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。

【信託報酬等の額および支弁の方法】

第45条　委託者および受託者の信託報酬の総額は、第42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23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項の信託報酬に係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46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、貸付有価証券にかかる品貸料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47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48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48条第４項に規定する支払日までに、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ならびに収益分配金の再投資】

第48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、指定販売会社との別に定める「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。また、委託者の自らの募集にかかる受益権に帰属する収益分配金は、この信託の受益権の取得申込金として、委託者が受益者に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係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、当該償還に係る受益権の口数と同口数の抹消の申請を行うものとし、社振法の規定にしたが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。また、受益証券を保有している受益者に対しては、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受益証券と引換えに当該受益者に支払います。

④　一部解約金は、第51条第１項の受益者の請求を受付けた日から起算して、原則として５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。ただし、委託者の自らの募集に係る受益権に帰属する償還金および一部解約金の支払いは、委託者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、追加信託の都度当該口数により加重平均され、収益分配の都度、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、追加信託の都度、当該口数により加重平均され、収益分配の都度、調整されるものとします。

【受益証券の保管および返還請求の取扱い】

第49条　〔削　除〕

【収益分配金および償還金の時効】

第50条　受益者が、収益分配金については第48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第48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。

【一部解約】

第51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　委託者は、前項の一部解約の実行の請求を受付けた場合には、信託契約の一部を解約します。なお、前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係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、当該一部解約に係る受益権の口数と同口数の抹消の申請を行うものとし、社振法の規定にしたが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。

③　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。

④　平成19年１月４日以降の信託契約の一部解約に係る一部解約の実行の請求を受益者がするときは、委託者、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。ただし、平成19年１月４日以降に一部解約金が受益者に支払われることとなる一部解約の実行の請求で、平成19年１月４日前に行われる当該請求については、振替受益権となることが確実な受益証券をもって行うものとします。

⑤　委託者は、取引所における取引の停止、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ができます。

⑥　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。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付けたものとして、第３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51条の２　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係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、この約款によるほか、民法その他の法令等にしたがって取り扱われます。

【信託契約の解約】

第52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、その他やむを得ない事情が発生したときは、受託者と合意のうえ、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、あらかじめ、解約しようとする旨を公告し、かつ、その旨を記載した書面をこの信託契約に係る知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託契約

に係るすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。

③　前項の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託者に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は１ヵ月を下らないものとします。

④　前項の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の二分の一を超えるときは、第１項の信託契約の解約をしません。

⑤　委託者は、この信託契約の解約をしないこととしたときは、解約しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を知られたる受益者に対して交付します。ただし、すべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。

⑥　第３項から前項までの規定は、信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、第３項の一定の期間が１ヵ月を下らずにその公告および書面の交付を行うことが困難な場合には適用しません。

【信託契約に関する監督官庁の命令】

第53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、その命令にしたがい、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、その手続について第57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54条　委託者が監督官庁より登録の取消を受けたとき、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57条第４項に該当する場合を除き、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55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56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背いた場合、その他重要な事由が生じたときは、委託者または受益者は、裁判所に受託者の解任を請求することができます。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57条の規定にしたがい、新受託者を選任します。

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】

第57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、受託者と合意のうえ、この信託約款を変更することができるものとし、あらかじめ、変更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。

②　委託者は、前項の変更事項のうち、その内容が重大なものについて、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面をこの信託約款に係る知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託約款に係るすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。

③　前項の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託者に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は１ヵ月を下らないものとします。

④　前項の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の２分の１を超えるときは、第１項の信託約款の変更をしません。

⑤　委託者は、当該信託約款の変更をしないこととしたときは、変更しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を知られたる受益者に対して交付します。ただし、すべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。

【反対者の買取請求権】

第58条　第52条に規定する信託契約の解約または前条に規定する信託約款の変更を行う場合において、第52条第３項または前条第３項の期間内に委託者に異議を述べた受益者は、受託者に自己に帰属す

る受益権を信託財産をもって買取るべき旨の請求をすることができます。

【運用報告書に記載すべき事項の提供】

第58条の２　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59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60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。

【付則】

第１条　平成18年12月29日現在の信託約款第11条、第12条、第14条から第16条の規定および受益権と読み替えられた受益証券に関する規定は、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には、なおその効力を有するものとします。

上記条項により信託契約を締結します。

平成17年９月30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　井上　恵介

受託者　大阪市中央区北浜四丁目５番33号
住友信託銀行株式会社
取締役社長　森田　豊

追加型証券投資信託
三井住友・ＤＣ年金バランス70（株式重点型）
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〕

約款第20条に基づき委託者が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、主として内外の株式および公社債に投資することにより、信託財産の着実な成長を目指した運用を行います。

２．運用方法

(1) 投資対象

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う「国内株式インデックス・マザーファンド（Ｂ号)」、ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ（総合）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行う「国内債券パッシブ・マザーファンド」、ＭＳＣＩコクサイインデックス（配当込み、円ベース）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行う「外国株式インデックス・マザーファンド」、ＦＴＳＥ世界国債インデックス（除く日本、円ベース）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行う「外国債券パッシブ・マザーファンド」（以下「マザーファンド」といいます。）の受益証券を主要投資対象とします。このほか、内外の株式・公社債へ直接投資を行うことがあります。

(2) 投資態度

① 国内株式、国内債券、外国株式、外国債券を主要投資対象とする４つのマザーファンドに分散投資することにより、信託財産の着実な成長を目指した運用を行います。

② マザーファンド受益証券への投資を通じて行う各資産への実質的な基本資産配分は下記の通りとします。ただし、それぞれの資産の時価変動等に伴う各資産比率の変化については、一定の範囲（±３％）を設けて調整を行います。
国内株式50％、国内債券15％、外国株式20％、外国債券10％、短期金融資産５％

③ 運用にあたっては、以下の比率により独自に作成した合成指数をベンチマークとし、ベンチマークに連動する投資成果を目指します。
ＴＯＰＩＸ（東証株価指数、配当込み）50％、ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ（総合）15％、ＭＳＣＩコクサイインデックス（配当込み、円ベース）20％、ＦＴＳＥ世界国債インデックス（除く日本、円ベース）10％、有担保コール翌日物５％

④ 実質外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行わないことを基本とします。

⑤ 株式以外の資産（他の投資信託受益証券を通じて投資する場合は、当該他の投資信託の信託財産に属する株式以外の資産のうち、この投資信託の信託財産に属するとみなした部分を含みます。）への投資割合は、原則として信託財産総額の50％以下とします。

⑥ 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 株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の50％以上とします。

② 新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10％以内とします。

③ 投資信託証券（マザーファンド受益証券を除きます。）への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の５％以内とします。

④ 外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の50％以下とします。

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

⑥ 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。

⑦　有価証券先物取引等は、約款第24条の範囲内で行います。
⑧　スワップ取引は、約款第25条の範囲内で行います。
⑨　金利先渡取引および為替先渡取引は、約款第26条の範囲内で行います。
⑩　デリバティブ取引（法人税法第61条の５に定めるものをいいます。）は、価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。
⑪　外国為替予約取引は、為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。

３．収益分配方針

毎決算時（原則として毎年２月18日、ただし決算応当日が休業日の場合は翌営業日）に、原則として以下の方針に基づき収益分配を行います。

①　分配対象額の範囲は、繰越分を含めた利子、配当収益と売買益（評価損益を含みます。）等の全額とします。
②　収益分配金額は、委託者が基準価額水準等を勘案して決定します。ただし、分配対象収益が少額の場合には、収益分配を行わない場合があります。
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、運用の基本方針と同一の運用を行います。

追加型証券投資信託
『三井住友・ＤＣ年金バランス70（株式重点型）』
〔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、信託財産に属する財産についての対抗要件に関する事項を除き、信託法（大正11年法律第62号）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26条第１項に基づく信託事務の委任として、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100万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、受託者と合意のうえ、金5,000億円を限度として信託金を追加することができます。

②　追加信託が行われたときは、受託者はその引受を証する書面を委託者に交付します。

③　委託者は、受託者と合意のうえ、第１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52条第１項、第53条第１項、第54条第１項または第56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　この信託に係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100万口に、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、受益権の再分割を行いません。ただし、社債、株式等の振替に関する法律が施行された場合には、受託者と協議のうえ、同法に定めるところにしたがい、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　この約款において基準価額とは、信託財産に属する資産（受入担保金代用有価証券および第29条に規定する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（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32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　この信託の受益権は、平成19年１月４日より、社債等の振替に関する法律（政令で定める日以降「社債、株式等の振替に関する法律」となった場合は読み替えるものとし、「社債、株式等の振替に関する法律」を含め「社振法」といいます。以下同じ。）の規定の適用を受けることとし、同日以降に追加信託される受益権の帰属は、委託者があらかじめこの投資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。）及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、社振法の規定にしたがい、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。

④　委託者は、受益者を代理してこの信託の受益権を振替受入簿に記載または記録を申請することができるものとし、原則としてこの信託の平成18年12月29日現在のすべての受益権（受益権につき、既に信託契約の一部解約が行われたもので、当該一部解約に係る一部解約金の支払開始日が平成19年１月４日以降となるものを含みます。）を受益者を代理して平成19年１月４日に振替受入簿に記載または記録するよう申請します。ただし、保護預かりではない受益証券に係る受益権については、信託期間中において委託者が受益証券を確認した後当該申請を行うものとします。振替受入簿に記載または記録された受益権に係る受益証券（当該記載または記録以降に到来する計算期間の末日に係る収益分配金交付票を含みます。）は無効となり、当該記載または記録により振替受益権となります。また、委託者は、受益者を代理してこの信託の受益権を振替受入簿に記載または記録を申請する場合において、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。）に当該申請の手続きを委任することができます。

【受益権の設定に係る受託者の通知】

第12条　受託者は、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係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　委託者は、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、委託者が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　指定販売会社は、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定める申込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。

③　前２項の取得申込者は、委託者、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係る口数の増加の記載または記録が行われます。なお、委託者、指定販売会社は、当該取得申込みの代金（第４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係る口数の増加の記載または記録を行うことができます。

④　第１項および第２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、委託者、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係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、取得日がこの信託契約締結日である場合の受益権を表示する受益証券の価額は、１口につき１円に、委託者、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係る消費税等に相当する金額を加算した価額とします。

⑤　前項の規定にかかわらず、第48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42条に規定する各計算期間終了日の基準価額とします。

【受益権の譲渡に係る記載または記録】

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係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、当該譲渡に係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。）に社振法の規定にしたがい、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係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え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。

【受益証券の再交付の費用】

第16条　〔削　除〕

【投資の対象とする資産の種類】

第17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．デリバティブ取引に係る権利（金融商品取引法第２条第20項に規定するものをいい、本約款第24条、第25条および第26条に定めるものに限ります。）

ハ．金銭債権

ニ．約束手形

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18条　委託者は、信託金を、主として、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て締結された親投資信託である「国内株式インデックス・マザーファンド（Ｂ号）受益証券」、「国内債券パッシブ・マザーファンド受益証券」、「外国株式インデックス・マザーファンド受益証券」、「外国債券パッシブ・マザーファンド受益証券」（以下「マザーファンド」といいます。）の受益証券（以下「マザーファンド受益証券」といいます。）または次の有価証券（金融商品取引法第２条第２項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図します。

１．株券または新株引受権証書

２．国債証券

３．地方債証券

４．特別の法律により法人の発行する債券

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

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

ます。）

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

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

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

10. コマーシャル・ペーパー

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

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

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

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

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

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

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

18. 外国法人が発行する譲渡性預金証書

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

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

21. 外国の者に対する権利で前号の有価証券の性質を有するもの

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

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

５．貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第２条第２項第１号で定めるもの

６．外国の者に対する権利で前号の権利の性質を有するもの

③ 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。

④ 委託者は、信託財産に属する新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額とマザーファンドに属する新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、信託財産の純資産総額の100分の10を超えることとなる投資の指図をしません。

⑤ 委託者は、信託財産に属する投資信託証券（マザーファンド受益証券を除きます。）の時価総額とマザーファンドに属する当該投資信託証券の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、信託財産の純資産総額の100分の５を超えることとなる投資の指図をしません。

⑥ 前２項において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの時価総

額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める当該資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

【デリバティブ取引等にかかる投資制限】

第18条の２　委託者は、デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。

【受託者の自己または利害関係人等との取引】

第19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、受託者および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。以下この条および第33条において同じ。）、第33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17条ならびに第18条第１項および第２項に定める資産への投資等を、信託財産を害するおそれがないと認められる取引として行うことができます。

②　前項に定める信託財産を害するおそれがないと認められる取引とは、次の各号のいずれかに該当する場合をいいます。

１．取引所価格（気配値等を含む。）等の適正な価格による取引であること。

２．受託者の店頭に表示する利率等の公正な条件によること。

３．前２号に該当しない場合で、委託者が適正な条件であると判断する場合であること。

③　前２項の取扱いは、第23条から第29条まで、第32条および第37条から第39条までにおける委託者の指図による取引についても同様とします。

④　この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。

【運用の基本方針】

第20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したがって、その指図を行います。

【投資する株式等の範囲】

第21条　委託者が投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、取引所に上場されている株式の発行会社の発行するもの、取引所に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。

②　前項の規定にかかわらず、上場予定または登録予定の株式、新株引受権証券および新株予約権証券で目論見書等において上場または登録されることが確認できるものについては委託者が投資することを指図することができるものとします。

【同一銘柄の新株引受権証券等への投資制限】

第22条　委託者は、信託財産に属する同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額とマザーファンドに属する当該同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、信託財産の純資産総額の100分の５を超えることとなる投資の指図をしません。

②　前項において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める当該資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

【信用取引の指図】

第23条　委託者は、信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、株券の引渡しまたは買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。

②　前項の信用取引の指図は、当該売付けにかかる建玉の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。

③　信託財産の一部解約等の事由により、前項の売付けにかかる建玉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売付けの一部を決済するための指図をするものとします。

【先物取引等の指図】

第24条　委託者は、わが国の取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第８項第３号イに掲げるものをいいます。以下同じ。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第８項第３号ロに掲げるものをいいます。以下同じ。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第８項第３号ハに掲げるものをいいます。以下同じ。）ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めて取り扱うものとします（以下同じ。）。

②　委託者は、わが国の取引所における通貨にかかる先物取引および通貨にかかるオプション取引ならびに外国の取引所における通貨にかかる先物取引およびオプション取引を行うことの指図をすることができます。

③　委託者は、わが国の取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。

【スワップ取引の指図】

第25条　委託者は、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行うことの指図をすることができます。

②　スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として第５条に定める信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこのかぎりではありません。

③　スワップ取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の合計額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記純資産総額が減少して、スワップ取引の想定元本の合計額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託者は、速やかに、その超える額に相当するスワップ取引の一部の解約を指図するものとします。

④　スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額により行うものとします。

⑤　委託者は、スワップ取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めたときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

【金利先渡取引および為替先渡取引の指図】

第26条　委託者は、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことの指図をすることができます。

②　金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として第５条に定める信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。

③　金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかる金利先渡取引および為替先渡取引の想定元本の合計額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記純資産総額が減少して、金利先渡取引および為替先渡取引の想定元本の合計額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託者は、速やかに、その超える額に相当する金利先渡取引および為替先渡取引の一部の解約を指図するものとします。

④　金利先渡取引および為替先渡取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額により行うものとします。

⑤　委託者は、金利先渡取引および為替先渡取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めたときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

⑥　本条において「金利先渡取引」とは、当事者間において、あらかじめ将来の特定の日（以下「決済日」といいます。）における決済日から一定の期間を経過した日（以下「満期日」といいます。）までの期間に係る国内または海外において代表的利率として公表される預金契約または金銭の貸借契約に基づく債権の利率（以下「指標利率」といいます。）の数値を取り決め、その取り決めに係る数値と決済日における当該指標利率の現実の数値との差にあらかじめ元本として定めた金額および当事者間で約定した日数を基準とした数値を乗じた額を決済日における当該指標利率の現実の数値で決済日における現在価値に割り引いた額の金銭の授受を約する取引をいいます。

⑦　本条において「為替先渡取引」とは、当事者間において、あらかじめ決済日から満期日までの期

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

【有価証券の貸付の指図】

第27条　委託者は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式および公社債を次の各号の範囲内で貸付けることの指図をすることができます。

１．株式の貸付は、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額を超えないものとします。

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

②　前項各号に定める限度額を超えることとなった場合には、委託者は、速やかに、その超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとします。

③　委託者は、有価証券の貸付にあたって必要と認めたときは、担保の受入れの指図を行うものとします。

【有価証券の空売りの指図】

第28条　委託者は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産において有しない有価証券または第29条の規定により借り入れた有価証券を売り付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、売り付けた有価証券の引渡しまたは買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。

②　前項の売付けの指図は、当該売付けにかかる有価証券の時価総額が信託財産の純資産総額を超えない範囲で行うものとします。

③　信託財産の一部解約等の事由により、前項の売付けにかかる有価証券の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託者は速やかに、その超える額に相当する売付けの一部を決済するための指図をするものとします。

【有価証券の借入れの指図】

第29条　委託者は、信託財産の効率的な運用に資するため、有価証券の借入れの指図をすることができます。なお、当該有価証券の借入れを行うにあたり担保の提供が必要と認めたときは、担保の提供の指図をするものとします。

②　前項の指図は、当該借入れにかかる有価証券の時価総額が信託財産の純資産総額を超えない範囲で行うものとします。

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有価証券の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託者は速やかに、その超える額に相当する借り入れた有価証券の一部を返還するための指図をするものとします。

④　第１項の借入れにかかる品借料は、信託財産中から支弁します。

【外貨建資産への投資制限】

第30条　委託者は、信託財産に属する外貨建資産の時価総額とマザーファンドに属する当該外貨建資産の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、信託財産の純資産総額の100分の50を超えることとなる投資の指図はしません。ただし、有価証券の値上がり等により100分の50を超えることとなった場合には、委託者は速やかにこれを調整します。

②　前項において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める当該外貨建資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

【特別の場合の外貨建有価証券への投資制限】

第31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32条　委託者は、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。

②　前項の予約取引の指図は、信託財産にかかる為替の買予約の合計額と売予約の合計額との差額につき円換算した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、信託財産に属する外貨建資産の為替変動リスクを回避するためにする当該予約取引の指図については、この限りではありません。

③　前項の限度額を超えることとなった場合には、委託者は所定の期間内に、その超える額に相当する為替予約の一部を解消するための外国為替の売買の予約取引の指図をするものとします。

【信託業務の委託等】

第33条　受託者は、委託者と協議のうえ、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もの（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係る実績等に照らし、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（裁量性のないものに限ります。）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．信託財産の保存に係る業務

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係る業務

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

【有価証券の保管】

第34条　〔削　除〕

【混蔵寄託】

第35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36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売却等の指図】

第37条　委託者は、信託財産に属するマザーファンド受益証券にかかる信託契約の一部解約の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38条　委託者は、前条の規定による一部解約金および売却代金、有価証券にかかる償還金等、株式の清算分配金、有価証券等にかかる利子等、株式の配当金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39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に資するため、信託財産において一部解約金の支払資金の不足額が生じるときは、資金借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。

②　前項の資金借入れ額は、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　前項の借入期間は、有価証券等の売却代金または償還金の入金日までに限るものとします。

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40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41条　信託財産に属する有価証券について、借替、転換、新株発行または株式割当がある場合で、委託者の申出があるときは、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、株式の清算分配金、有価証券等にかかる利子等、株式の配当金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、受託者がこれを立替えて信託財産に繰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42条　この信託の計算期間は、毎年２月19日から翌年２月18日までとすることを原則とします。ただし、第１計算期間は平成17年９月30日から平成18年２月20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条に定める信託期間の終了日とします。

【信託財産に関する報告】

第43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。

【信託事務等の諸費用】

第44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42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。

【信託報酬等の額および支弁の方法】

第45条　委託者および受託者の信託報酬の総額は、第42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24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項の信託報酬に係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46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、貸付有価証券にかかる品貸料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47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48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48条第４項に規定する支払日までに、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ならびに収益分配金の再投資】

第48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、指定販売会社との別に定める「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。また、委託者の自らの募集にかかる受益権に帰属する収益分配金は、この信託の受益権の取得申込金として、委託者が受益者に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係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、当該償還に係る受益権の口数と同口数の抹消の申請を行うものとし、社振法の規定にしたが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。また、受益証券を保有している受益者に対しては、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受益証券と引換えに当該受益者に支払います。

④　一部解約金は、第51条第１項の受益者の請求を受付けた日から起算して、原則として５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。ただし、委託者の自らの募集に係る受益権に帰属する償還金および一部解約金の支払いは、委託者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、追加信託の都度当該口数により加重平均され、収益分配の都度、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、追加信託の都度、当該口数により加重平均され、収益分配の都度、調整されるものとします。

【受益証券の保管および返還請求の取扱い】

第49条　〔削　除〕

【収益分配金および償還金の時効】

第50条　受益者が、収益分配金については第48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第48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。

【一部解約】

第51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　委託者は、前項の一部解約の実行の請求を受付けた場合には、信託契約の一部を解約します。なお、前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係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、当該一部解約に係る受益権の口数と同口数の抹消の申請を行うものとし、社振法の規定にしたが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。

③　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。

④　平成19年１月４日以降の信託契約の一部解約に係る一部解約の実行の請求を受益者がするときは、委託者、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。ただし、平成19年１月４日以降に一部解約金が受益者に支払われることとなる一部解約の実行の請求で、平成19年１月４日前に行われる当該請求については、振替受益権となることが確実な受益証券をもって行うものとします。

⑤　委託者は、取引所における取引の停止、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ができます。

⑥　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。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付けたものとして、第３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51条の２　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係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、この約款によるほか、民法その他の法令等にしたがって取り扱われます。

【信託契約の解約】

第52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、その他やむを得ない事情が発生したときは、受託者と合意のうえ、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、あらかじめ、解約しようとする旨を公告し、かつ、その旨を記載した書面をこの信託契約に係る知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託契約

に係るすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。

③　前項の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託者に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は１ヵ月を下らないものとします。

④　前項の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の二分の一を超えるときは、第１項の信託契約の解約をしません。

⑤　委託者は、この信託契約の解約をしないこととしたときは、解約しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を知られたる受益者に対して交付します。ただし、すべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。

⑥　第３項から前項までの規定は、信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、第３項の一定の期間が１ヵ月を下らずにその公告および書面の交付を行うことが困難な場合には適用しません。

【信託契約に関する監督官庁の命令】

第53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、その命令にしたがい、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、その手続について第57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54条　委託者が監督官庁より登録の取消を受けたとき、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57条第４項に該当する場合を除き、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55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56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背いた場合、その他重要な事由が生じたときは、委託者または受益者は、裁判所に受託者の解任を請求することができます。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57条の規定にしたがい、新受託者を選任します。

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】

第57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、受託者と合意のうえ、この信託約款を変更することができるものとし、あらかじめ、変更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。

②　委託者は、前項の変更事項のうち、その内容が重大なものについて、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面をこの信託約款に係る知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託約款に係るすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。

③　前項の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託者に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は１ヵ月を下らないものとします。

④　前項の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の２分の１を超えるときは、第１項の信託約款の変更をしません。

⑤　委託者は、当該信託約款の変更をしないこととしたときは、変更しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を知られたる受益者に対して交付します。ただし、すべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。

【反対者の買取請求権】

第58条　第52条に規定する信託契約の解約または前条に規定する信託約款の変更を行う場合において、第52条第３項または前条第３項の期間内に委託者に異議を述べた受益者は、受託者に自己に帰属す

る受益権を信託財産をもって買取るべき旨の請求をすることができます。

【運用報告書に記載すべき事項の提供】

第58条の２　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59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60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。

【付則】

第１条　平成18年12月29日現在の信託約款第11条、第12条、第14条から第16条の規定および受益権と読み替えられた受益証券に関する規定は、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には、なおその効力を有するものとします。

上記条項により信託契約を締結します。

平成17年９月30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　井上　恵介

受託者　大阪市中央区北浜四丁目５番33号
住友信託銀行株式会社
取締役社長　森田　豊

親投資信託
国内株式インデックス・マザーファンド（Ｂ号）
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〕

約款第12条に基づき委託者の定める方針は、次の通りとします。

１．基本方針

この投資信託は、主としてわが国の株式に投資し、ＴＯＰＩＸ（東証株価指数、配当込み）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。

２．運用方法

(1) 投資対象

わが国の取引所に上場されている株式を主要投資対象とします。

(2) 運用方針

① 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。

② 株価指数先物取引等を含む株式の実質組入比率は、原則として高位を保ちます。ただし、資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

③ 株式以外の資産への投資割合は、原則として信託財産総額の50％以下とします。

(3) 投資制限

① 外貨建資産への投資は行いません。

② 株式への投資割合には制限を設けません。

③ 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。

④ 有価証券先物取引等は、約款第16条の範囲内で行います。

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

親投資信託
『国内株式インデックス・マザーファンド（Ｂ号）』
〔約款〕

【信託の種類、委託者および受託者】

第１条　この信託は、その受益権を他の投資信託の受託者に取得させることを目的とする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、信託財産に属する財産についての対抗要件に関する事項を除き、信託法（大正11年法律第62号）の適用を受けます。

【信託事務の委託】

第１条の２　受託者は、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と信託契約を締結し、これを委託することができます。

【信託の目的および金額】

第２条　委託者は、金300億円を上限として、もしくは自らが委託者として設定する他の証券投資信託（信託の元本および収益の管理および運用に関する事項（投資対象とする資産の種類を含みます。）がこの信託と同一性を有するものに限ります。以下同じ。）の信託財産に属する有価証券（投資信託及び投資法人に関する法律施行規則に規定するものに限ります。以下「信託適格有価証券」といいます。）を金300億円相当を上限として、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。

②　前項に規定する信託適格有価証券とは、次の各号の有価証券および金融商品取引法第２条第１項第20号に掲げる有価証券（次の各号の有価証券に該当するものを除きます。）であって次の各号の有価証券に係る権利を表示するものをいいます。

１．取引所に上場されている有価証券

２．店頭売買有価証券（金融商品取引法第２条第８項第10号ハに規定する店頭売買有価証券をいいます。以下同じ。）

３．第１号および第２号に掲げる有価証券以外の有価証券で次に掲げるもの。

イ．金融商品取引法第２条第１項第１号から第５号までに掲げる有価証券（同項第17号に掲げる有価証券であって、これらの有価証券の性質を有するものを含みます。ロ．において同じ。）

ロ．金融商品取引法第２条第１項第９号に掲げる有価証券のうち、その価格が認可金融商品取引業協会（同条第13項に規定する認可金融商品取引業協会をいいます。以下同じ。）又は外国において設立されているこれと類似の性質を有する団体の定める規則に基づいて公表されているもの。

ハ．金融商品取引法第２条第１項第10号、第11号および第19号に掲げる有価証券

③　この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。

【信託金の限度額】

第３条　委託者は、受託者と合意のうえ、金5,000億円もしくは5,000億円相当の信託適格有価証券を限度として信託金もしくは信託適格有価証券を追加することができます。

②　追加信託が行われたときは、受託者はその引き受けを証する書面を委託者に交付します。

③　委託者は、受託者と合意のうえ、第１項の限度額を変更することができます。

【信託適格有価証券での信託の方法】

第４条　他の証券投資信託が、この信託の受益権を信託適格有価証券により取得する場合は、当該信託適格有価証券について前日の公表されている最終価格に基づき算出された価格又はこれに準ずるものとして合理的な方法により算出した価格をもって、それに相当する口数のこの信託にかかる受益証券の取得をするものとします。

【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37条第１項および第２項、第38条第１項、第39条第１項および第41条第２項の規定による信託終了の日までとします。

【受益証券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証券の取得申込みの勧誘は、投資信託及び投資法人に関する法律第２条第９項で定める適格機関投資家私募により行われます。

【受益者】

第７条　この信託の元本および収益の受益者は、この信託の受益証券を投資対象とする三井住友ＤＳアセットマネジメント株式会社の証券投資信託の受託者である信託業務を営む銀行とします。

【受益権の分割および再分割】

第８条　委託者は、第２条の信託により生じた受益権については300億口を上限とした口数に、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10条の追加口数に、それぞれ均等に分割します。

②　委託者は、受託者と協議のうえ、一定日現在の受益権を均等に再分割できます。

【信託日時の異なる受益権の内容】

第９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。

【追加信託金の計算方法】

第10条　追加信託金もしくは、追加信託に係る信託適格有価証券の価額の総額は、追加信託を行う日の前営業日の信託財産に属する資産（受入担保金代用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の定めるところにしたがい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。）を受益権総口数で除した金額に、当該金額に0.08％の率を乗じて得た額を追加信託時の信託財産留保額として加算した金額に、当該追加信託に係る受益権の口数を乗じた額とします。

【受益証券の発行、種類および受託者による認証】

第11条　委託者は、第８条の規定により分割された受益権を表示する記名式の受益証券を発行します。

②　委託者は、１口の整数倍の口数を表示した受益証券を発行します。

③　委託者は、受益証券を発行するときは、その発行する受益証券がこの信託約款に適合する旨の受託者の認証を受けなければなりません。

④　前項の認証は、受託者の代表取締役がその旨を受益証券に記載し記名捺印することによって行います。

⑤　受益者は、当該受益証券を他に譲渡することはできません。

【運用の基本方針】

第12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したがって、その指図を行います。

【投資の対象とする資産の種類】

第13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（「特定資産」とは、投資信託及び投資法人に関する法律第２条第１項で定めるものをいいます。以下同じ。）

イ．有価証券

ロ．デリバティブ取引に係る権利（金融商品取引法第２条第20項に規定するものをいい、本約款第16条に定めるものに限ります。）

ハ．金銭債権

ニ．約束手形

２．次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

【運用の指図範囲等】

第14条　委託者は、信託金を、主として次の有価証券（金融商品取引法第２条第２項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除き、かつ本邦通貨表示のものに限ります。）に投資することを指図します。

１．株券または新株引受権証書

２．国債証券

３．特別の法律により法人の発行する債券

４．コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等

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

６．外国法人が発行する譲渡性預金証書

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

なお、第１号の証券または証書を以下「株式」といい、第２号および第３号の証券を以下「公社債」といいます。

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には、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をすることができます。

【デリバティブ取引等にかかる投資制限】

第14条の２　委託者は、デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。

【投資する株式の範囲】

第15条　委託者が投資することを指図する株式は、わが国の取引所に上場されている株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当により取得する株式については、この限りではありません。

②　前項の規定にかかわらず、上場予定の株式で目論見書等において上場されることが確認できるものについては、委託者が投資することを指図できるものとします。

【先物取引等の運用指図、目的、範囲】

第16条　委託者は、わが国の取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第８項第３号イに掲げるものをいいます。以下同じ。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第８項第３号ロに掲げるものをいいます。以下同じ。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第８項第３号ハに掲げるものをいいます。以下同じ。）ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めるものとします。

【有価証券の貸付の指図および範囲】

第17条　委託者は、信託財産に属する株式および公社債を、次の各号の範囲内で貸付けることの指図をすることができます。

１．株式の貸付は、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額を超えないものとします。

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

②　前項各号に定める限度額を超えることとなった場合には、委託者は速やかに、その超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとします。

③　委託者は、有価証券の貸付にあたって必要と認めたときは、担保の受入れの指図を行うものとします。

【保管業務の委任】

第18条　受託者は、委託者と協議のうえ、信託財産に属する資産を外国で保管する場合には、その業務を行うに充分な能力を有すると認められる金融機関と保管契約を締結し、これを委任することができます。

【有価証券の保管】

第19条　受託者は、信託財産に属する有価証券を、法令等に基づき、保管振替機関等に預託し保管させることができます。

【混蔵寄託】

第20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できるものとします。

【一括登録】

第21条　（削　　除）

【信託財産の登記等および記載等の留保等】

第22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。

【有価証券の売却等の指図】

第23条　委託者は、信託財産に属する有価証券の売却等の指図ができます。

【再投資の指図】

第24条　委託者は、前条の規定による売却代金、有価証券に係る償還金等、株式の清算分配金、有価証券等に係る利子等、株式の配当金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。

【損益の帰属】

第25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、全て受益者に帰属します。

【資金の借入れ】

第26条　委託者は、信託財産の効率的な運用および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入れた資金の返済を含みます。）を目的として、資金借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。

②　一部解約に伴う支払資金の手当てに係る借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が５営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は当該有価証券等の売却代金、解約代金および償還金の合計額を限度とします。

③　借入金の利息は、信託財産中より支弁します。

【受託者による資金の立替え】

第27条　信託財産に属する有価証券等について、借替、転換、新株発行または株式割当がある場合で、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等に係る償還金等、株式の清算分配金、有価証券等に係る利子等、株式の配当金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もりうるものがあるときは、受託者がこれを立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28条　この信託の計算期間は、毎年12月１日から翌年11月30日までとすることを原則とします。ただし、第１期の計算期間は平成15年２月17日から平成15年11月30日までとします。

②　前項にかかわらず、前項の原則により各計算期間終了日に該当する日（以下本項において「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条に定める信託期間の終了日とします。

【信託財産に関する報告】

第29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。

【信託事務の諸費用】

第30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および受託者の立替えた立替金の利息は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。

【信託報酬】

第31条　委託者および受託者は、この信託契約に関し信託報酬を収受しません。

【利益の留保】

第32条　信託財産から生ずる利益は、信託終了日まで信託財産中に留保し、収益の分配は行いません。

【追加信託金および一部解約金の計理処理】

第33条　追加信託金（追加信託に係る信託適格有価証券の価額を含みます。）または信託の一部解約金は当該金額と元本に相当する金額との差額を、追加信託にあっては追加信託差金、信託の一部解約にあっては解約差金として処理します。

【償還金の委託者への交付と支払いに関する受託者の免責】

第34条　受託者は、信託が終了したときは、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口数で除した額に償還口数を乗じて得た額をいいます。以下同じ。）の全額を委託者に交付します。

②　受託者は、前項の規定により委託者に償還金を交付した後は、受益者に対する支払いにつき、その責に任じません。

【償還金の支払い】

第35条　委託者は、受託者より償還金の交付を受けた後、受益証券と引換えに受益者に当該償還金を支払います。

【一部解約】

第36条　委託者は、受益者の請求があった場合には、信託の一部を解約します。

②　解約金は、一部解約を行う日の前営業日の信託財産の純資産総額を受益権総口数で除した金額から、当該金額に0.08％の率を乗じて得た額を一部解約時の信託財産留保額として控除した金額に、当該一部解約に係る受益権の口数を乗じた額とします。

【信託契約の解約】

第37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、またはやむを得ない事情が発生したときは、受託者と合意のうえ、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、この信託の受益証券を投資対象とする全ての証券投資信託がその信託を終了させることとなる場合には、この信託契約を解約し、信託を終了させます。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。

③　委託者は、前２項の事項について、あらかじめ解約しようとする旨を公告し、かつ、その旨を記載した書面をこの信託契約に係る知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託契約に係る全ての受益者に対して書面を交付したときは、原則として公告を行いません。

④　前項の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託者に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は１ヵ月を下らないものとします。

⑤　前項の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の２分の１を超えるときは、第１項の信託契約の解約をしません。

⑥　委託者は、この信託契約の解約をしないこととしたときは、解約しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を知られたる受益者に対して交付します。ただし、全ての受益者に対して書面を交付したときは、原則として公告を行いません。

⑦　第４項から前項までの規定は、第２項の規定に基づいてこの信託契約を解約する場合には適用しません。

【信託契約に関する監督官庁の命令】

第38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、その命令にしたがい、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42条の規定にしたがいます。

【委託者の登録取消等に伴う取扱い】

第39条　委託者が監督官庁より登録の取消を受けたとき、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42条第４項に該当する場合を除き、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40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41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背いた場合、その他重要な事由が生じたときは、委託者または受益者は、裁判所に受託者の解任を請求することができます。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42条の規定にしたがい、新受託者を選任します。

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】

第42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、受託者と合意のうえ、この信託約款を変更することができるものとし、あらかじめ変更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。

② 委託者は、前項の変更事項のうち、その内容が重大なものについて、あらかじめ変更しようとする旨およびその内容を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面をこの信託約款に係る知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託約款に係る全ての受益者に対して書面を交付したときは、原則として公告を行いません。

③ 前項の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託者に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は１ヵ月を下らないものとします。

④ 前項の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の２分の１を超えるときは、第１項の信託約款の変更をしません。

⑤ 委託者は、当該信託約款の変更をしないこととしたときは、変更しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を知られたる受益者に対して交付します。ただし、全ての受益者に対して書面を交付したときは、原則として公告を行いません。

【反対者の買取請求権】

第43条 第37条に規定する信託契約の解約または前条に規定する信託約款の変更を行う場合において、第37条第４項または前条第３項の一定の期間内に委託者に対して異議を述べた受益者は、受託者に対し、自己の有する受益証券を、信託財産をもって買取るべき旨を請求することができます。

【利益相反のおそれがある場合の受益者への書面交付】

第44条 委託者は、投資信託及び投資法人に関する法律第13条第１項に定める書面を交付しません。

【運用報告書】

第45条 委託者は、投資信託及び投資法人に関する法律第14条に定める運用報告書を交付しません。

【公告】

第46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47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。

信託契約締結日平成15年２月17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　井上　恵介

受託者　大阪市中央区北浜四丁目５番33号
住友信託銀行株式会社
取締役社長　高橋　温

親投資信託
国内債券パッシブ・マザーファンド
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〕

約款第15条に基づき委託者が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、ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ（総合）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。

２．運用方法

(1) 投資対象

わが国の公社債および短期金融資産を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

① ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ（総合）をベンチマークとし、ベンチマークと連動する投資成果を目指します。

② 公社債の組入比率は原則として高位を保ちます。

③ 資金動向、市況動向等の急変により上記の運用が困難となった場合、暫定的に上記と異なる運用を行う場合があります。

(3) 投資制限

① 株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への投資割合は、信託財産の純資産総額の10％以内とします。

② 新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の５％以内とします。

③ 投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の５％以内とします。

④ 外貨建資産への投資は行いません。

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。

⑥ 有価証券先物取引等は、約款第19条の範囲内で行います。

⑦ スワップ取引は、約款第20条の範囲内で行います。

⑧ 金利先渡取引は、約款第21条の範囲内で行います。

⑨ デリバティブ取引（法人税法第61条の５に定めるものをいいます。）は、価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。

親投資信託『国内債券パッシブ・マザーファンド』
〔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、その受益権を他の投資信託の受託者に取得させることを目的とする証券投資信託（親投資信託）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、信託財産に属する財産についての対抗要件に関する事項を除き、信託法（大正11年法律第62号）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26条第１項に基づく信託事務の委任として、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と信託契約を締結し、これを委託することができます。

【信託の目的および金額】

第３条　委託者は、金30億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、受託者と合意のうえ、１兆円を限度として信託金を追加することができます。

②　追加信託が行われたときは、受託者はその引受を証する書面を委託者に交付します。

③　委託者は、受託者と合意のうえ、第１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43条第１項、第２項、第44条第１項、第45条第１項または第47条第２項による信託終了の日までとします。

【受益証券の取得申込の勧誘の種類】

第６条　この信託にかかる受益証券の取得申込の勧誘は、金融商品取引法第２条第３項第１号に規定する適格機関投資家のみを対象として、投資信託及び投資法人に関する法律第２条第９項で定める適格機関投資家私募により行われます。

【受益者】

第７条　この信託の元本および収益の受益者は、この信託の受益証券を投資対象とする三井住友ＤＳアセットマネジメント株式会社の証券投資信託の受託者である信託業務を営む銀行とします。

【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30億口に、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、受託者と協議のうえ、一定日現在の受益権を均等に再分割できます。

【追加信託金の計算方法】

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、当該基準価額に0.03％の率を乗じて得た額を追加信託時の信託財産留保額として加算した金額に、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　この約款において基準価額とは、信託財産に属する資産（受入担保金代用有価証券および第24条に規定する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（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。

【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。

【受益証券の発行】

第11条　委託者は、第８条の規定により分割された受益権を表示する記名式の受益証券を発行します。

②　委託者が発行する受益証券は、１口の整数倍の口数を表示した受益証券とします。

③　受益者は、当該受益証券を他に譲渡することはできません。

【受益証券の発行についての受託者の認証】

第12条　委託者は、前条の規定により受益証券を発行するときは、その発行する受益証券がこの信託約款に適合する旨の受託者の認証を受けなければなりません。

②　前項の認証は、受託者の代表取締役がその旨を受益証券に記載し、記名捺印することによって行

います。

【投資の対象とする資産の種類】

第13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．デリバティブ取引に係る権利（金融商品取引法第２条第20項に規定するものをいい、本約款第19条、第20条および第21条に定めるものに限ります。）

ハ．金銭債権

ニ．約束手形

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14条　委託者は、信託金を、主として次の有価証券（金融商品取引法第２条第２項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図します。

１．株券または新株引受権証書

２．国債証券

３．地方債証券

４．特別の法律により法人の発行する債券

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

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

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

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

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

10．コマーシャル・ペーパー

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

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

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

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

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

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

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

18．外国法人が発行する譲渡性預金証書

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

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

21．外国の者に対する権利で前号の有価証券の性質を有するもの

なお、第１号の証券または証書、第12号ならびに第17号の証券または証書のうち第１号の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、第２号から第６号までの証券および第12号ならびに第17号の証券または証書のうち第２号から第６号までの証券の性質を有するものを

以下「公社債」といい、第13号の証券および第14号の証券（ただし、投資法人債券を除きます。）を以下「投資信託証券」といいます。

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

５．貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第２条第２項第１号で定めるもの

６．外国の者に対する権利で前号の権利の性質を有するもの

③ 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。

④ 委託者は、信託財産に属する株式、新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額が、信託財産の純資産総額の100分の10を超えることとなる投資の指図をしません。

⑤ 委託者は、信託財産に属する新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額が、信託財産の純資産総額の100分の５を超えることとなる投資の指図をしません。

⑥ 委託者は、信託財産に属する投資信託証券の時価総額が、信託財産の純資産総額の100分の５を超えることとなる投資の指図をしません。

【デリバティブ取引等にかかる投資制限】

第14条の２　委託者は、デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。

【運用の基本方針】

第15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。

【投資する株式等の範囲】

第16条　委託者が投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、取引所に上場されている株式の発行会社の発行するもの、取引所に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。

② 前項の規定にかかわらず、上場予定または登録予定の株式、新株引受権証券および新株予約権証券で目論見書等において上場または登録されることが確認できるものについては委託者が投資することを指図することができるものとします。

③ この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。

【同一銘柄の転換社債等への投資制限】

第17条　〔削　　除〕

【信用取引の指図】

第18条　委託者は、信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売り付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、株券の引渡しまたは買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。

② 前項の信用取引の指図は、当該売付けにかかる建玉の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。

③ 信託財産の一部解約等の事由により、前項の売付けにかかる建玉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売付けの一部を決済するための指図をするものとします。

【先物取引等の指図】

第19条　委託者は、わが国の取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第８項第３号イに掲げるものをいいます。以下同じ。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第８項第

３号ロに掲げるものをいいます。以下同じ。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第８項第３号ハに掲げるものをいいます。以下同じ。）ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めて取り扱うものとします（以下同じ。）。

② 委託者は、わが国の取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。

【スワップ取引の指図】

第20条 委託者は、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行うことの指図をすることができます。

② スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として第５条に定める信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこのかぎりではありません。

③ スワップ取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の合計額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記純資産総額が減少して、スワップ取引の想定元本の合計額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託者は、速やかに、その超える額に相当するスワップ取引の一部の解約を指図するものとします。

④ スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額により行うものとします。

⑤ 委託者は、スワップ取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めたときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

【金利先渡取引の指図】

第21条 委託者は、金利先渡取引を行うことの指図をすることができます。

② 金利先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として第５条に定める信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。

③ 金利先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の合計額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記純資産総額が減少して、金利先渡取引の想定元本の合計額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託者は、速やかに、その超える額に相当する金利先渡取引の一部の解約を指図するものとします。

④ 金利先渡取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額により行うものとします。

⑤ 委託者は、金利先渡取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めたときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

⑥ 本条において「金利先渡取引」とは、当事者間において、あらかじめ将来の特定の日（以下「決済日」といいます。）における決済日から一定の期間を経過した日（以下「満期日」といいます。）までの期間に係る国内または海外において代表的利率として公表される預金契約または金銭の貸借契約に基づく債権の利率（以下「指標利率」といいます。）の数値を取り決め、その取り決めに係る数値と決済日における当該指標利率の現実の数値との差にあらかじめ元本として定めた金額および当事者間で約定した日数を基準とした数値を乗じた額を決済日における当該指標利率の現実の数値で決済日における現在価値に割り引いた額の金銭の授受を約する取引をいいます。

【有価証券の貸付の指図】

第22条 委託者は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式および公社債を次の各号の範囲内で貸付けることの指図をすることができます。

１．株式の貸付は、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額を超えないものとします。

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

② 前項各号に定める限度額を超えることとなった場合には、委託者は、速やかに、その超える額に

相当する契約の一部の解約を指図するものとします。

③　委託者は、有価証券の貸付にあたって必要と認めたときは、担保の受入れの指図を行うものとします。

【有価証券の空売りの指図】

第23条　委託者は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産において有しない有価証券または第24条の規定により借り入れた有価証券を売り付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、売り付けた有価証券の引渡しまたは買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。

②　前項の売付けの指図は、当該売付けにかかる有価証券の時価総額が信託財産の純資産総額を超えない範囲で行うものとします。

③　信託財産の一部解約等の事由により、前項の売付けにかかる有価証券の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託者は速やかに、その超える額に相当する売付けの一部を決済するための指図をするものとします。

【有価証券の借入れの指図】

第24条　委託者は、信託財産の効率的な運用に資するため、有価証券の借入れの指図をすることができます。なお、当該有価証券の借入れを行うにあたり担保の提供が必要と認めたときは、担保の提供の指図をするものとします。

②　前項の指図は、当該借入れにかかる有価証券の時価総額が信託財産の純資産総額を超えない範囲で行うものとします。

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有価証券の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託者は速やかに、その超える額に相当する借り入れた有価証券の一部を返還するための指図をするものとします。

④　第１項の借入れにかかる品借料は、信託財産中から支弁します。

【外貨建資産への投資制限】

第25条　委託者は、外貨建資産への投資の指図をしません。

【保管業務の委任】

第26条　受託者は、委託者と協議のうえ、信託財産に属する資産を外国で保管する場合には、その業務を行うに充分な能力を有すると認められる金融機関と保管契約を締結し、これを委任することができます。

②　この保管にかかる費用は受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。

【有価証券の保管】

第27条　受託者は、信託財産に属する有価証券を、法令等に基づき、保管振替機関等に預託し保管させることができます。

【混蔵寄託】

第28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29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。

【有価証券の売却等の指図】
第30条　委託者は、信託財産に属する有価証券の売却等の指図ができます。
【再投資の指図】
第31条　委託者は、前条の規定による売却代金、有価証券にかかる償還金等、株式の清算分配金、有価証券等にかかる利子等、株式の配当金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。
【損益の帰属】
第32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33条　信託財産に属する有価証券について、借替、転換、新株発行または株式割当がある場合で、委託者の申出があるときは、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、株式の清算分配金、有価証券等にかかる利子等、株式の配当金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、受託者がこれを立替えて信託財産に繰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34条　この信託の計算期間は、毎年５月26日から翌年５月25日までとすることを原則とします。ただし、第１期の計算期間は平成17年６月10日から平成18年５月25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条に定める信託期間の終了日とします。
【信託財産に関する報告】
第35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。
【信託事務等の諸費用】
第36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および受託者の立替えた立替金の利息は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。
【信託報酬】
第37条　委託者および受託者は、この信託契約に関しては信託報酬を収受しません。
【利益の留保】
第38条　信託財産から生ずる利益は、信託終了時まで信託財産中に留保し、収益の分配は行いません。
【償還金の委託者への交付と支払いに関する受託者の免責】
第39条　受託者は、信託が終了したときは、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口数で除した額をいいます。以下同じ。）の全額を委託者に交付します。
②　受託者は、前項の規定により委託者に償還金を交付した後は、受益者に対する支払いにつき、その責に任じません。
【償還金の支払いの時期】
第40条　委託者は、受託者より償還金の交付を受けた後、受益証券と引換えに当該償還金を受益者に対して支払います。
【追加信託金および一部解約金の計理処理】
第41条　追加信託金または信託の一部解約金は、当該金額と元本に相当する金額との差額を、追加信託にあっては追加信託差金、信託の一部解約にあっては解約差金として処理します。
【一部解約】
第42条　委託者は、受益者の請求があった場合には、この信託契約の一部を解約します。
②　一部解約の価額は、一部解約を行う日の前営業日の基準価額から当該基準価額に0.03％の率を乗じて得た額を一部解約時の信託財産留保額として控除した価額とします。
【信託契約の解約】

第43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、またはやむを得ない事情が発生したときは、受託者と合意のうえ、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、この信託の受益証券を投資対象とするすべての証券投資信託がその信託を終了させることとなる場合には、この信託契約を解約し、信託を終了させます。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。

③　委託者は、前２項の事項について、あらかじめ、解約しようとする旨を公告し、かつ、その旨を記載した書面をこの信託契約に係る知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託契約に係るすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。

④　前項の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託者に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は１ヵ月を下らないものとします。

⑤　前項の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の２分の１を超えるときは、第１項の信託契約の解約をしません。

⑥　委託者は、この信託契約の解約をしないこととしたときは、解約しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を知られたる受益者に対して交付します。ただし、すべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。

⑦　第４項から前項までの規定は、第２項の規定に基づいてこの信託契約を解約する場合および信託財産の状況に照らし、真に止むを得ない事情が生じている場合であって、１ヵ月を下らずにその公告および書面の交付を行うことが困難な場合には適用しません。

【信託契約に関する監督官庁の命令】

第44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、その手続について第48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45条　委託者が監督官庁より登録の取消を受けたとき、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48条第４項に該当する場合を除き、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46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47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背いた場合、その他重要な事由が生じたときは、委託者または受益者は、裁判所に受託者の解任を請求することができます。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48条の規定に従い新受託者を選任します。

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】

第48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、受託者と合意のうえ、この信託約款を変更することができるものとし、あらかじめ、変更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。

②　委託者は、前項の変更事項のうち、その内容が重大なものについて、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面をこの信託約款に係る知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託約款に係るすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。

③　前項の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託者に対して異議を述べ

るべき旨を付記します。なお、一定の期間は１ヵ月を下らないものとします。

④　前項の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の２分の１を超えるときは、第１項の信託約款の変更をしません。

⑤　委託者は、当該信託約款の変更をしないこととしたときは、変更しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を知られたる受益者に対して交付します。ただし、すべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。

【反対者の買取請求権】

第49条　第43条に規定する信託契約の解約または前条に規定する信託約款の変更を行う場合において、第43条第４項または前条第３項の一定の期間内に委託者に異議を述べた受益者は、受託者に自己の有する受益証券を、信託財産をもって買い取るべき旨の請求をすることができます。

【利益相反のおそれがある場合の受益者への書面交付】

第50条　委託者は、投資信託及び投資法人に関する法律第13条第１項に定める書面を交付しません。

【運用報告書の交付】

第51条　委託者は、投資信託及び投資法人に関する法律第14条に定める運用報告書を交付しません。

【公告】

第52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53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17年６月10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　井上　恵介

受託者　大阪市中央区北浜四丁目５番33号
住友信託銀行株式会社
取締役社長　高橋　温

親投資信託
外国株式インデックス・マザーファンド
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〕

約款第12条に基づき委託者が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、主として日本を除く世界各国の株式に投資し、ＭＳＣＩコクサイインデックス（配当込み、円ベース）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。

２．運用方針

（１）投資対象

日本を除く世界各国の株式を主要投資対象とします。

（２）投資態度

① 主として世界各国の株式に投資し、ＭＳＣＩコクサイインデックス（配当込み、円ベース）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。

② 外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行わないものとします。

③ 株価指数先物取引等を含む株式の実質組入比率は、原則として高位を保ちます。ただし、資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

（３）投資制限

① 株式への投資割合には制限を設けません。

② 外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

③ 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。

④ 有価証券先物取引等は、約款第16条の範囲で行います。

⑤ スワップ取引は、約款第17条の範囲で行います。

⑥ 金利先渡取引および為替先渡取引は、約款第18条の範囲で行います。

⑦ デリバティブ取引（法人税法第61条の５に定めるものをいいます。）は、価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。

⑧ 外国為替予約取引は、為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。

親投資信託『外国株式インデックス・マザーファンド』
〔約款〕

【信託の種類、委託者および受託者】

第１条　この信託は、その受益権を他の投資信託の受託者に取得させることを目的とする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、信託財産に属する財産についての対抗要件に関する事項を除き、信託法（大正11年法律第62号）の適用を受けます。

【信託事務の委託】

第１条の２　受託者は、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と信託契約を締結し、これを委託することができます。

【信託の目的および金額】

第２条　委託者は、金5,213,511,682円相当額の金銭および自らが委託者として設定する他の証券投資信託（信託の元本および収益の管理および運用に関する事項（投資対象とする資産の種類を含みます。）がこの信託と同一性を有するものに限ります。以下同じ。）の信託財産に属する有価証券（投資信託及び投資法人に関する法律施行規則に規定するものに限ります。以下「信託適格有価証券」といいます。）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。

②　前項に規定する信託適格有価証券とは、次の各号の有価証券および金融商品取引法第２条第１項第20号に掲げる有価証券（次の各号の有価証券に該当するものを除きます。）であって次の各号の有価証券に係る権利を表示するものをいいます。

１．取引所に上場されている有価証券

２．店頭売買有価証券（金融商品取引法第２条第８項第10号ハに規定する店頭売買有価証券をいいます。以下同じ。）

３．第１号および第２号に掲げる有価証券以外の有価証券で次に掲げるもの。

イ．金融商品取引法第２条第１項第１号から第５号までに掲げる有価証券（同項第17号に掲げる有価証券であって、これらの有価証券の性質を有するものを含みます。ロ．において同じ。）

ロ．金融商品取引法第２条第１項第９号に掲げる有価証券のうち、その価格が認可金融商品取引業協会（同条第13項に規定する認可金融商品取引業協会をいいます。以下同じ。）又は外国において設立されているこれと類似の性質を有する団体の定める規則に基づいて公表されているもの。

ハ．金融商品取引法第２条第１項第10号、第11号および第19号に掲げる有価証券

③　この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。

【信託金の限度額】

第３条　委託者は、受託者と合意のうえ、金１兆円もしくは１兆円相当の信託適格有価証券を限度として信託金もしくは信託適格有価証券を追加することができます。

②　追加信託が行われたときは、受託者はその引き受けを証する書面を委託者に交付します。

③　委託者は、受託者と合意のうえ、第１項の限度額を変更することができます。

【信託適格有価証券での信託の方法】

第４条　他の証券投資信託が、この信託の受益権を信託適格有価証券により取得する場合は、当該信託適格有価証券について前日の公表されている最終価格に基づき算出された価格又はこれに準ずるものとして合理的な方法により算出した価格をもって、それに相当する口数のこの信託にかかる受益証券の取得をするものとします。

【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項および第２項、第42条第１項、第43条第１項および第45条第２項の規定による信託終了の日までとします。

【受益証券の取得申込の勧誘の種類】

第６条　この信託に係る受益証券の取得申込みの勧誘は、投資信託及び投資法人に関する法律第２条第９

項で定める適格機関投資家私募により行われます。

【受益者】

第７条　この信託の元本および収益の受益者は、この信託の受益証券を投資対象とする三井住友ＤＳアセットマネジメント株式会社の証券投資信託の受託者である信託業務を営む銀行とします。

【受益権の分割および再分割】

第８条　委託者は、第２条の信託により生じた受益権については5,213,511,682口を、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10条の追加口数に、それぞれ均等に分割します。

②　委託者は、受託者と協議のうえ、一定日現在の受益権を均等に再分割できます。

【信託日時の異なる受益権の内容】

第９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。

【追加信託の計算方法】

第10条　追加信託金もしくは、追加信託に係る信託適格有価証券の価額の総額は、追加信託を行う日の前営業日の信託財産に属する資産（受入担保金代用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の定めるところにしたがい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。）を受益権総口数で除した金額に、当該金額に0.15%の率を乗じて得た額を追加信託時の信託財産留保額として加算した金額に、当該追加信託に係る受益権の口数を乗じた額とします。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。

②　第21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るものとします。

【受益証券の発行、種類および受託者による認証】

第11条　委託者は、第８条の規定により分割された受益権を表示する記名式の受益証券を発行します。

②　委託者は、１口の整数倍の口数を表示した受益証券を発行します。

③　委託者は、受益証券を発行するときは、その発行する受益証券がこの信託約款に適合する旨の受託者の認証を受けなければなりません。

④　前項の認証は、受託者の代表取締役がその旨を受益証券に記載し記名捺印することによって行います。

⑤　受益者は、当該受益証券を他に譲渡することはできません。

【運用の基本方針】

第12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したがって、その指図を行います。

【投資の対象とする資産の種類】

第13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（「特定資産」とは、投資信託及び投資法人に関する法律第２条第１項で定めるものをいいます。以下同じ。）

イ．有価証券

ロ．デリバティブ取引に係る権利（金融商品取引法第２条第20項に規定するものをいい、本約款第16条、第17条および第18条に定めるものに限ります。）

ハ．金銭債権

ニ．約束手形

２．次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

【運用の指図範囲等】

第14条　委託者は、信託金を、主として次の有価証券（金融商品取引法第２条第２項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図します。

１．株券または新株引受権証書

２．国債証券

３．特別の法律により法人の発行する債券

４．社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株

引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
５．コマーシャル・ペーパー
６．新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）および新株予約権証券
７．外国または外国の者の発行する証券または証書で、前各号の証券または証書の性質を有するもの
８．投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第２条第１項第10号で定めるものをいいます。）
９．投資証券または外国投資証券（金融商品取引法第２条第１項第11号で定めるものをいいます。）
10. 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第２条第１項第18号で定めるものをいいます。）
11. オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第２条第１項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限ります。）
12. 預託証書（金融商品取引法第２条第１項第20号で定めるものをいいます。）
13. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
14. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第２条第１項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
15. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第２条第１項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
16. 外国の者に対する権利で前号の有価証券の性質を有するもの

なお、第１号の証券または証書、第７号ならびに第12号の証券または証書のうち第１号の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といいます。第２号から第４号までの証券および第７号ならびに第12号の証券または証書のうち第２号から第４号までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といいます。

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
５．貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第２条第２項第１号で定めるもの
６．外国の者に対する権利で前号の権利の性質を有するもの

【デリバティブ取引等にかかる投資制限】

第14条の２　委託者は、デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。

【投資する株式等の範囲】

第15条　委託者が投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、取引所に上場されている株式の発行会社の発行するもの、および取引所に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。

② 前項の規定にかかわらず、上場予定または登録予定の株式、新株引受権証券および新株予約権証券で目論見書等において上場または登録されることが確認できるものについては委託者が投資することを指図することができるものとします。

【先物取引等の運用指図、目的、範囲】

第16条　委託者は、わが国の取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第８項第３号イに掲げるものをいいます。以下同じ。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第８項第３号ロに掲げるものをいいます。以下同じ。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第８項第３号ハに掲げるものをいいます。以下同じ。）ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。なお、選択権取引はオプショ

ン取引に含めるものとします（以下同じ。）。

② 委託者は、わが国の取引所における通貨に係る先物取引ならびに外国の取引所における通貨に係る先物取引およびオプション取引を行うことの指図をすることができます。

③ 委託者は、わが国の取引所における金利に係る先物取引およびオプション取引ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。

【スワップ取引の運用指図、目的、範囲】

第17条 委託者は、異なった通貨、異なった受取り金利または異なった受取り金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行うことの指図をすることができます。

② スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として第５条に定める信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。

③ スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。

④ 委託者は、スワップ取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めたときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

【金利先渡取引および為替先渡取引の運用指図、目的、範囲】

第18条 委託者は、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことの指図をすることができます。

② 金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として第５条に定める信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。

③ 金利先渡取引および為替先渡取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。

④ 委託者は、金利先渡取引および為替先渡取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めたときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

⑤ 本条において「金利先渡取引」とは、当事者間において、あらかじめ将来の特定の日（以下「決済日」といいます。）における決済日から一定の期間を経過した日（以下「満期日」といいます。）までの期間に係る国内または海外において代表的利率として公表される預金契約または金銭の貸借契約に基づく債権の利率（以下「指標利率」といいます。）の数値を取り決め、その取り決めに係る数値と決済日における当該指標利率の現実の数値との差にあらかじめ元本として定めた金額および当事者間で約定した日数を基準とした数値を乗じた額を決済日における当該指標利率の現実の数値で決済日における現在価値に割り引いた額の金銭の授受を約する取引をいいます。

⑥ 本条において「為替先渡取引」とは、当事者間において、あらかじめ決済日から満期日までの期間に係る為替スワップ取引（同一の相手方との間で直物外国為替取引および当該直物外国為替取引と反対売買の関係に立つ先物外国為替取引を同時に約定する取引をいいます。以下本条において同じ。）のスワップ幅（当該直物外国為替取引に係る外国為替相場と当該先物外国為替取引に係る外国為替相場との差を示す数値をいいます。以下本条において同じ。）を取り決め、その取り決めに係るスワップ幅から決済日における当該為替スワップ取引の現実のスワップ幅を差し引いた値にあらかじめ元本として定めた金額を乗じた額を決済日における指標利率の数値で決済日における現在価値に割り引いた額の金銭またはその取り決めに係るスワップ幅から決済日における当該為替スワップ取引の現実のスワップ幅を差し引いた値にあらかじめ元本として定めた金額を乗じた金額とあらかじめ元本として定めた金額について決済日を受渡日として行なった先物外国為替取引を決済日における直物外国為替取引で反対売買したときの差金に係る決済日から満期日までの利息とを合算した額を決済日における指標利率の数値で決済日における現在価値に割り引いた額の金銭の授受を約する取引をいいます。

【有価証券の貸付の指図】

第19条 委託者は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式および公社債を次の各号の範囲内で貸付けることの指図をすることができます。

１．株式の貸付は、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額を超えないものとします。

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

② 前項各号に定める限度額を超えることとなった場合には、委託者は速やかに、その超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとします。

③ 委託者は、有価証券の貸付にあたって必要と認めたときは、担保の受入れの指図を行うものとします。

【特別の場合の外貨建有価証券への投資制限】

第20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。

【外国為替予約の指図および範囲】

第21条 委託者は、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。

② 前項の予約取引の指図は、信託財産に係る為替の買予約の合計額と売予約の合計額との差額につき円換算した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、信託財産に属する外貨建資産の為替変動リスクを回避するためにする当該予約取引の指図については、この限りではありません。

③ 前項の限度額を超えることとなった場合には、委託者は所定の期間内に、その超える額に相当する為替予約の一部を解消するための外国為替の売買の予約取引の指図をするものとします。

【保管業務の委任】

第22条 受託者は、委託者と協議のうえ、信託財産に属する資産を外国で保管する場合には、その業務を行うに充分な能力を有すると認められる金融機関と保管契約を締結し、これを委任することができます。

【有価証券の保管】

第23条 受託者は、信託財産に属する有価証券を、法令等に基づき、保管振替機関等に預託し保管させることができます。

【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できるものとします。

【一括登録】

第25条 （削　　除）

【信託財産の登記等および記載等の留保等】

第26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。

【有価証券の売却等の指図】

第27条 委託者は、信託財産に属する有価証券の売却等の指図ができます。

【再投資の指図】

第28条 委託者は、前条の規定による売却代金、有価証券に係る償還金等、株式の清算分配金、有価証券に係る利子等、株式の配当金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。

【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。

【資金の借入れ】

第30条　委託者は、信託財産の効率的な運用および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入れた資金の返済を含みます。）を目的として、資金借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。

②　一部解約に伴う支払資金の手当てに係る借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が５営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は当該有価証券等の売却代金、解約代金および償還金の合計額を限度とします。

③　借入金の利息は、信託財産中より支弁します。

【受託者による資金の立替え】

第31条　信託財産に属する有価証券について、借替、転換、新株発行または株式割当がある場合で、委託者の申出があるときは、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係る償還金等、株式の清算分配金、有価証券に係る利子等、株式の配当金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もりうるものがあるときは、受託者がこれを立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32条　この信託の計算期間は、毎年12月１日から翌年11月30日までとすることを原則とします。ただし、第1期の計算期間は平成15年５月19日から平成15年12月１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（以下本項において「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条に定める信託期間の終了日とします。

【信託財産に関する報告】

第33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。

【信託事務等の諸費用】

第34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および受託者の立替えた立替金の利息は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。

【信託報酬】

第35条　委託者および受託者は、この信託契約に関し信託報酬を収受しません。

【利益の留保】

第36条　信託財産から生ずる利益は、信託終了時まで信託財産中に留保し、収益の分配は行いません。

【追加信託金および一部解約金の計算処理】

第37条　追加信託金（追加信託に係る信託適格有価証券の価額を含みます。）または信託の一部解約金は当該金額と元本に相当する金額との差額を、追加信託にあっては追加信託差金、信託の一部解約にあっては解約差金として処理します。

【償還金の委託者への交付と支払いに関する受託者の免責】

第38条　受託者は、信託が終了したときは、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口数で除した額に償還口数を乗じて得た額をいいます。以下同じ。）の全額を委託者に交付します。

②　受託者は、前項の規定により委託者に償還金を交付した後は、受益者に対する支払いにつき、その責に任じません。

【償還金の支払い】

第39条　委託者は、受託者より償還金の交付を受けた後、受益証券と引き換えに受益者に当該償還金を支払います。

【一部解約】

第40条　委託者は、受益者の請求があった場合には、信託の一部を解約します。

②　解約金は、一部解約を行う日の前営業日の信託財産の純資産総額を受益権総口数で除した金額から、当該金額に0.15%の率を乗じて得た額を一部解約時の信託財産留保額として控除した金額に、当該一部解約に係る受益権の口数を乗じた額とします。

【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、受託者と合意のうえ、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、この信託の受益証券を投資対象とする全ての証券投資信託がその信託を終了させることとなる場合には、この信託契約を解約し、信託を終了させます。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。

③　委託者は、前２項の事項について、あらかじめ解約しようとする旨を公告し、かつ、その旨を記載した書面をこの信託契約に係る知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託契約に係る全ての受益者に対して書面を交付したときは、原則として公告を行いません。

④　前項の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託者に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は１ヵ月を下らないものとします。

⑤　前項の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の２分の１を超えるときは、第１項の信託契約の解約をしません。

⑥　委託者は、この信託契約の解約をしないこととしたときは、解約しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を知られたる受益者に対して交付します。ただし、全ての受益者に対して書面を交付したときは、原則として公告を行いません。

⑦　第４項から前項までの規定は、第２項の規定に基づいてこの信託契約を解約する場合には適用しません。

【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、その命令にしたがい、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条の規定にしたがいます。

【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４項に該当する場合を除き、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背いた場合、その他重要な事由が生じたときは、委託者または受益者は、裁判所に受託者の解任を請求することができます。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条の規定にしたがい、新受託者を選任します。

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】

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

託者と合意のうえ、この信託約款を変更することができるものとし、あらかじめ変更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。

② 委託者は、前項の変更事項のうち、その内容が重大なものについて、あらかじめ変更しようとする旨およびその内容を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面をこの信託約款に係る知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託約款に係る全ての受益者に対して書面を交付したときは、原則として公告を行いません。

③ 前項の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託者に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は１ヵ月を下らないものとします。

④ 前項の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の２分の１を超えるときは、第１項の信託約款の変更をしません。

⑤ 委託者は、当該信託約款の変更をしないこととしたときは、変更しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を知られたる受益者に対して交付します。ただし、全ての受益者に対して書面を交付したときは、原則として公告を行いません。

【反対者の買取請求権】

第47条　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信託約款の変更を行う場合において、第41条第４項または前条第３項の一定の期間内に委託者に対して異議を述べた受益者は、受託者に対し、自己の有する受益証券を、信託財産をもって買取るべき旨を請求することができます。

【利益相反のおそれがある場合の受益者への書面交付】

第48条　委託者は、投資信託及び投資法人に関する法律第13条第１項に定める書面を交付しません。

【運用報告書】

第49条　委託者は、投資信託及び投資法人に関する法律第14条に定める運用報告書を交付しません。

【公告】

第50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51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15年５月19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　井上　恵介

受託者　大阪市中央区北浜四丁目5番33号
住友信託銀行株式会社
取締役社長　高橋　温

親投資信託
外国債券パッシブ・マザーファンド
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〕

約款第15条に基づき委託者が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、ＦＴＳＥ世界国債インデックス（除く日本、円ベース）をベンチマークとし、ベンチマークと連動する投資成果を目指した運用を行います。

２．運用方法

(1) 投資対象

ベンチマーク採用国の国債を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

① ＦＴＳＥ世界国債インデックス（除く日本、円ベース）をベンチマークとし、ベンチマークと連動する投資成果を目指します。

② ポートフォリオ構築にあたっては、取引コストを極力抑えながら、推定トラッキングエラーを最小化します。

③ ベンチマークの月次の変化状況とポートフォリオのリスク量の状況を勘案しながらリバランスを行います。

④ 保有する外貨建て資産については、原則として為替ヘッジを行いません。

⑤ 公社債の組入比率は原則として高位を保ちます。

⑥ 資金動向、市況動向等の急変により上記の運用が困難となった場合、暫定的に上記と異なる運用を行う場合があります。

(3) 投資制限

① 株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への投資割合は、信託財産の純資産総額の10％以内とします。

② 投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の５％以内とします。

③ 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

④ 同一発行体の発行する債券への投資割合は、国債を除き、信託財産の純資産総額の５％以内とします。

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

⑥ 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。

⑦ 有価証券先物取引等は、約款第20条の範囲内で行います。

⑧ スワップ取引は、約款第21条の範囲内で行います。

⑨ 金利先渡取引および為替先渡取引は、約款第22条の範囲内で行います。

⑩ デリバティブ取引（法人税法第61条の５に定めるものをいいます。）は、価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。

⑪ 外国為替予約取引は、為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。

親投資信託『外国債券パッシブ・マザーファンド』
〔約款〕

【信託の種類、委託者および受託者】

第１条　この信託は、その受益権を他の投資信託の受託者に取得させることを目的とする証券投資信託（親投資信託）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、信託財産に属する財産についての対抗要件に関する事項を除き、信託法（大正11年法律第62号）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26条第１項に基づく信託事務の委任として、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と信託契約を締結し、これを委託することができます。

【信託の目的および金額】

第３条　委託者は、金37億5,000万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、受託者と合意のうえ、5,000億円を限度として信託金を追加することができます。

②　追加信託が行われたときは、受託者はその引受を証する書面を委託者に交付します。

③　委託者は、受託者と合意のうえ、第１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45条第１項、第２項、第46条第１項、第47条第１項または第49条第２項による信託終了の日までとします。

【受益証券の取得申込の勧誘の種類】

第６条　この信託にかかる受益証券の取得申込の勧誘は、金融商品取引法第２条第３項第１号に規定する適格機関投資家のみを対象として、投資信託及び投資法人に関する法律第２条第９項で定める適格機関投資家私募により行われます。

【受益者】

第７条　この信託の元本および収益の受益者は、この信託の受益証券を投資対象とする三井住友ＤＳアセットマネジメント株式会社の証券投資信託の受託者である信託業務を営む銀行とします。

【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37億5,000万口に、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、受託者と協議のうえ、一定日現在の受益権を均等に再分割できます。

【追加信託金の計算方法】

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、当該基準価額に0.1％の率を乗じて得た額を追加信託時の信託財産留保額として加算した金額に、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　この約款において基準価額とは、信託財産に属する資産（受入担保金代用有価証券および第25条に規定する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（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27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。

【受益証券の発行】

第11条　委託者は、第８条の規定により分割された受益権を表示する記名式の受益証券を発行します。

② 委託者が発行する受益証券は、１口の整数倍の口数を表示した受益証券とします。
③ 受益者は、当該受益証券を他に譲渡することはできません。

【受益証券の発行についての受託者の認証】

第12条 委託者は、前条の規定により受益証券を発行するときは、その発行する受益証券がこの信託約款に適合する旨の受託者の認証を受けなければなりません。

② 前項の認証は、受託者の代表取締役がその旨を受益証券に記載し、記名捺印することによって行います。

【投資の対象とする資産の種類】

第13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．デリバティブ取引に係る権利（金融商品取引法第２条第20項に規定するものをいい、本約款第20条、第21条および第22条に定めるものに限ります。）
　ハ．金銭債権
　ニ．約束手形
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14条 委託者は、信託金を、主として次の有価証券（金融商品取引法第２条第２項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図します。

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

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

21. 外国の者に対する権利で前号の有価証券の性質を有するもの

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

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

５．貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第２条第２項第１号で定めるもの

６．外国の者に対する権利で前号の権利の性質を有するもの

③ 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。

④ 委託者は、信託財産に属する株式、新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額が、信託財産の純資産総額の100分の10を超えることとなる投資の指図をしません。

⑤ 委託者は、信託財産に属する投資信託証券の時価総額が、信託財産の純資産総額の100分の５を超えることとなる投資の指図をしません。

【デリバティブ取引等にかかる投資制限】

第14条の２　委託者は、デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。

【運用の基本方針】

第15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したがって、その指図を行います。

【投資する株式等の範囲】

第16条　委託者が投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、取引所に上場されている株式の発行会社の発行するもの、取引所に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。

② 前項の規定にかかわらず、上場予定または登録予定の株式、新株引受権証券および新株予約権証券で目論見書等において上場または登録されることが確認できるものについては委託者が投資することを指図することができるものとします。

③ この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。

【同一発行体の発行する公社債への投資制限】

第17条　委託者は、信託財産に属する同一の発行体にかかる公社債（わが国および外国の国債証券を除きます。）の時価総額が、信託財産の純資産総額の100分の５を超えることとなる投資の指図をしません。

【同一銘柄の新株引受権証券等への投資制限】

第18条　委託者は、信託財産に属する同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額が、信託財産の純資産総額の100分の５を超えることとなる投資の指図をしません。

【信用取引の指図】

第19条　委託者は、信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、株券の引渡しまたは買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。

② 前項の信用取引の指図は、当該売付けにかかる建玉の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。

③ 信託財産の一部解約等の事由により、前項の売付けにかかる建玉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売付けの一部を決済するための指図をするものとします。

【先物取引等の指図】

第20条 委託者は、わが国の取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第８項第３号イに掲げるものをいいます。以下同じ。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第８項第３号ロに掲げるものをいいます。以下同じ。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第８項第３号ハに掲げるものをいいます。以下同じ。）ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めて取り扱うものとします（以下同じ。）。

② 委託者は、わが国の取引所における通貨にかかる先物取引および通貨にかかるオプション取引ならびに外国の取引所における通貨にかかる先物取引およびオプション取引を行うことの指図をすることができます。

③ 委託者は、わが国の取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。

【スワップ取引の指図】

第21条 委託者は、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行うことの指図をすることができます。

② スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として第５条に定める信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。

③ スワップ取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の合計額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記純資産総額が減少して、スワップ取引の想定元本の合計額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託者は、速やかに、その超える額に相当するスワップ取引の一部の解約を指図するものとします。

④ スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額により行うものとします。

⑤ 委託者は、スワップ取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めたときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

【金利先渡取引および為替先渡取引の指図】

第22条 委託者は、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことの指図をすることができます。

② 金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として第５条に定める信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。

③ 金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかる金利先渡取引および為替先渡取引の想定元本の合計額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記純資産総額が減少して、金利先渡取引および為替先渡取引の想定元本の合計額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託者は、速やかに、その超える額に相当する金利先渡取引および為替先渡取引の一部の解約を指図するものとします。

④ 金利先渡取引および為替先渡取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額により行うものとします。

⑤ 委託者は、金利先渡取引および為替先渡取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めたときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

⑥ 本条において「金利先渡取引」とは、当事者間において、あらかじめ将来の特定の日（以下「決済日」といいます。）における決済日から一定の期間を経過した日（以下「満期日」といいます。）までの期間に係る国内または海外において代表的利率として公表される預金契約または金銭の

貸借契約に基づく債権の利率（以下「指標利率」といいます。）の数値を取り決め、その取り決めに係る数値と決済日における当該指標利率の現実の数値との差にあらかじめ元本として定めた金額および当事者間で約定した日数を基準とした数値を乗じた額を決済日における当該指標利率の現実の数値で決済日における現在価値に割り引いた額の金銭の授受を約する取引をいいます。

⑦　本条において「為替先渡取引」とは、当事者間において、あらかじめ決済日から満期日までの期間に係る為替スワップ取引（同一の相手方との間で直物外国為替取引および当該直物外国為替取引と反対売買の関係に立つ先物外国為替取引を同時に約定する取引をいいます。以下本条において同じ。）のスワップ幅（当該直物外国為替取引に係る外国為替相場と当該先物外国為替取引に係る外国為替相場との差を示す数値をいいます。以下本条において同じ。）を取り決め、その取り決めに係るスワップ幅から決済日における当該為替スワップ取引の現実のスワップ幅を差し引いた値にあらかじめ元本として定めた金額を乗じた額を決済日における指標利率の数値で決済日における現在価値に割り引いた額の金銭またはその取り決めに係るスワップ幅から決済日における当該為替スワップ取引の現実のスワップ幅を差し引いた値にあらかじめ元本として定めた金額を乗じた金額とあらかじめ元本として定めた金額について決済日を受渡日として行なった先物外国為替取引を決済日における直物外国為替取引で反対売買したときの差金に係る決済日から満期日までの利息とを合算した額を決済日における指標利率の数値で決済日における現在価値に割り引いた額の金銭の授受を約する取引をいいます。

【有価証券の貸付の指図】

第23条　委託者は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式および公社債を次の各号の範囲内で貸付けることの指図をすることができます。

１．株式の貸付は、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額を超えないものとします。

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

②　前項各号に定める限度額を超えることとなった場合には、委託者は、速やかに、その超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとします。

③　委託者は、有価証券の貸付にあたって必要と認めたときは、担保の受入れの指図を行うものとします。

【有価証券の空売りの指図】

第24条　委託者は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産において有しない有価証券または第25条の規定により借り入れた有価証券を売り付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、売り付けた有価証券の引渡しまたは買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。

②　前項の売付けの指図は、当該売付けにかかる有価証券の時価総額が信託財産の純資産総額を超えない範囲で行うものとします。

③　信託財産の一部解約等の事由により、前項の売付けにかかる有価証券の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託者は速やかに、その超える額に相当する売付けの一部を決済するための指図をするものとします。

【有価証券の借入れの指図】

第25条　委託者は、信託財産の効率的な運用に資するため、有価証券の借入れの指図をすることができます。なお、当該有価証券の借入れを行うにあたり担保の提供が必要と認めたときは、担保の提供の指図をするものとします。

②　前項の指図は、当該借入れにかかる有価証券の時価総額が信託財産の純資産総額を超えない範囲で行うものとします。

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有価証券の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託者は速やかに、その超える額に相当する借り入れた有価証券の一部を返還するための指図をするものとします。

④　第１項の借入れにかかる品借料は、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26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27条　委託者は、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。

②　前項の予約取引の指図は、信託財産にかかる為替の買予約の合計額と売予約の合計額との差額につき円換算した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、信託財産に属する外貨建資産の為替変動リスクを回避するためにする当該予約取引の指図については、この限りではありません。

③　前項の限度額を超えることとなった場合には、委託者は所定の期間内に、その超える額に相当する為替予約の一部を解消するための外国為替の売買の予約取引の指図をするものとします。

【保管業務の委任】

第28条　受託者は、委託者と協議のうえ、信託財産に属する資産を外国で保管する場合には、その業務を行うに充分な能力を有すると認められる金融機関と保管契約を締結し、これを委任することができます。

②　この保管にかかる費用は受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。

【有価証券の保管】

第29条　受託者は、信託財産に属する有価証券を、法令等に基づき、保管振替機関等に預託し保管させることができます。

【混蔵寄託】

第30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31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。

【有価証券の売却等の指図】

第32条　委託者は、信託財産に属する有価証券の売却等の指図ができます。

【再投資の指図】

第33条　委託者は、前条の規定による売却代金、有価証券にかかる償還金等、株式の清算分配金、有価証券等にかかる利子等、株式の配当金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。

【損益の帰属】

第34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35条　信託財産に属する有価証券について、借替、転換、新株発行または株式割当がある場合で、委託者の申出があるときは、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、株式の清算分配金、有価証券等にかかる利子等、株式の配当金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、受託者がこれを立替えて信託財産に繰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36条　この信託の計算期間は、毎年12月18日から翌年12月17日までとすることを原則とします。

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、第１計算期間の開始日は平成15年12月18日とし、最終計算期間の終了日は、第５条に定める信託期間の終了日とします。

【信託財産に関する報告】

第37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。

【信託事務等の諸費用】

第38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および受託者の立替えた立替金の利息は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。

【信託報酬】

第39条　委託者および受託者は、この信託契約に関しては信託報酬を収受しません。

【利益の留保】

第40条　信託財産から生ずる利益は、信託終了時まで信託財産中に留保し、収益の分配は行いません。

【償還金の委託者への交付と支払いに関する受託者の免責】

第41条　受託者は、信託が終了したときは、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口数で除した額をいいます。以下同じ。）の全額を委託者に交付します。

②　受託者は、前項の規定により委託者に償還金を交付した後は、受益者に対する支払いにつき、その責に任じません。

【償還金の支払いの時期】

第42条　委託者は、受託者より償還金の交付を受けた後、受益証券と引き換えに当該償還金を受益者に対して支払います。

【追加信託金および一部解約金の計理処理】

第43条　追加信託金または信託の一部解約金は、当該金額と元本に相当する金額との差額を、追加信託にあっては追加信託差金、信託の一部解約にあっては解約差金として処理します。

【信託契約の一部解約】

第44条　委託者は、受益者の請求があった場合には、信託の一部を解約します。

②　一部解約の価額は、一部解約を行う日の前営業日の基準価額から当該基準価額に0.1％の率を乗じて得た額を一部解約時の信託財産留保額として控除した価額とします。

【信託契約の解約】

第45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、またはやむを得ない事情が発生したときは、受託者と合意のうえ、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、この信託の受益証券を投資対象とするすべての証券投資信託がその信託を終了させることとなる場合には、この信託契約を解約し、信託を終了させます。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。

③　委託者は、前２項の事項について、あらかじめ、解約しようとする旨を公告し、かつ、その旨を記載した書面をこの信託契約に係る知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託契約に係るすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。

④　前項の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託者に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は１ヵ月を下らないものとします。

⑤　前項の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の２分の１を超えるときは、第１項の信託契約の解約をしません。

⑥　委託者は、この信託契約の解約をしないこととしたときは、解約しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を知られたる受益者に対して交付します。ただし、すべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。

⑦　第４項から前項までの規定は、第２項の規定に基づいてこの信託契約を解約する場合および信託財産の状況に照らし、真に止むを得ない事情が生じている場合であって、１ヵ月を下らずにその公告および書面の交付を行うことが困難な場合には適用しません。

【信託契約に関する監督官庁の命令】

第46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、その命令にしたがい、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、その手続について第50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47条　委託者が監督官庁より登録の取消を受けたとき、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50条第４項に該当する場合を除き、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48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49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背いた場合、その他重要な事由が生じたときは、委託者または受益者は、裁判所に受託者の解任を請求することができます。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50条の規定にしたがい、新受託者を選任します。

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】

第50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、受託者と合意のうえ、この信託約款を変更することができるものとし、あらかじめ、変更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。

②　委託者は、前項の変更事項のうち、その内容が重大なものについて、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面をこの信託約款に係る知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託約款に係るすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。

③　前項の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託者に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は１ヵ月を下らないものとします。

④　前項の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の２分の１を超えるときは、第１項の信託約款の変更をしません。

⑤　委託者は、当該信託約款の変更をしないこととしたときは、変更しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を知られたる受益者に対して交付します。ただし、すべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。

【反対者の買取請求権】

第51条　第45条に規定する信託契約の解約または前条に規定する信託約款の変更を行う場合において、第45条第４項または前条第３項の一定の期間内に委託者に異議を述べた受益者は、受託者に自己の有する受益証券を信託財産をもって買取るべき旨の請求をすることができます。

【利益相反のおそれがある場合の受益者への書面交付】

第52条　委託者は、投資信託及び投資法人に関する法律第13条第１項に定める書面を交付しません。

【運用報告書の交付】

第53条　委託者は、投資信託及び投資法人に関する法律第14条に定める運用報告書を交付しません。

【公告】

第54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55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15年12月18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　井上　恵介

受託者　大阪市中央区北浜四丁目５番33号
住友信託銀行株式会社
取締役社長　高橋　温