

■当ファンドの仕組みは次の通りです。

|            |  |
|------------|--|
| 商品分類       | 追加型投信／内外／資産複合  |
| 信託期間       | 2017年9月14日から2037年9月15日まで   |
| 運用方針       | 投資信託証券への投資を通じて、世界各国の債券、株式および不動産投資信託（リート）等に投資し、信託財産の成長を目指します。   |
| 主要投資対象     | 当ファンドは以下の投資信託証券を主要投資対象とします。<br>国内債券パッシブ・マザーファンド<br>国内債券<br>外国債券パッシブ・マザーファンド<br>先進国債券（除く日本）／為替ヘッジなし<br>ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド<br>為替ヘッジ付き先進国債券（除く日本）／為替ヘッジあり<br>iシェアーズJ.P.モルガン・米ドル建てエマージング・マーケット債券ETF<br>新興国債券／為替ヘッジなし<br>国内株式インデックス・マザーファンド（B号）<br>国内株式<br>外国株式インデックス・マザーファンド<br>先進国株式（除く日本）／為替ヘッジなし<br>エマージング株式インデックス・マザーファンド<br>新興国株式／為替ヘッジなし<br>Jリート・インデックス・マザーファンド<br>国内リート<br>外国リート・インデックス・マザーファンド<br>外国リート／為替ヘッジなし |
| 当ファンドの運用方法 | ■投資信託証券への投資を通じて、世界各国の債券、株式および不動産投資信託（リート）等に分散投資します。<br>■イボットソン・アソシエイツ・ジャパンの助言に基づき、基本資産配分比率を決定します。<br>■安定的な収益の確保と信託財産の成長を目指して運用を行います。<br>■実質組入外貨建資産については、投資信託証券内で対円での為替ヘッジを行っている場合を除き、原則として対円での為替ヘッジは行いません。   |
| 組入制限       | ■外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。  |
| 分配方針       | ■年1回（原則として毎年9月15日。休業日の場合は翌営業日）決算を行い、分配金額を決定します。<br>■分配対象額は、経費控除後の利子、配当等収益と売買益（評価損益を含みます。）等の範囲内とします。<br>■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。<br>※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。  |

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。）

# 三井住友・資産最適化ファンド (2 やや安定型) 【運用報告書(全体版)】

(2022年9月16日から2023年9月15日まで)

第 6 期

決算日 2023年9月15日

## 受益者の皆さまへ

平素は格別のお引立てに預かり、厚くお礼申し上げます。

当ファンドは投資信託証券への投資を通じて、世界各国の債券、株式および不動産投資信託（リート）等に投資し、信託財産の成長を目指します。当期についても、運用方針に沿った運用を行いました。

今後ともご愛顧のほどお願い申し上げます。

## 三井住友DSアセットマネジメント

〒105-6426 東京都港区虎ノ門1-17-1

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

### ■口座残高など、お取引状況についてのお問い合わせ

お取引のある販売会社へお問い合わせください。

### ■当運用報告書についてのお問い合わせ

コールセンター 0120-88-2976

受付時間：午前9時～午後5時(土、日、祝・休日を除く)

## 三井住友・資産最適化ファンド（2やや安定型）

原則として、各表の数量および金額の単位未満は切捨て、比率は四捨五入で表記しています。ただし、単位未満の数値については小数を表記する場合があります。

### ■ 最近5期の運用実績

| 決算期            | 基準価額   |             |                       | 株式組入率<br>株比 | 株式先物率<br>比<br>(買建-売建) | 公社債率<br>組入比率 | 投資信託証券<br>組入比率 | 純資産額  |
|----------------|--------|-------------|-----------------------|-------------|-----------------------|--------------|----------------|-------|
|                | (分配落)  | 税<br>分<br>配 | 進<br>金<br>騰<br>落<br>率 |             |                       |              |                |       |
|                | 円      | 円           | %                     | %           | %                     | %            | %              | 百万円   |
| 2期(2019年9月17日) | 10,310 | 0           | 2.9                   | 32.9        | 2.0                   | 55.5         | 8.2            | 680   |
| 3期(2020年9月15日) | 10,504 | 0           | 1.9                   | 34.4        | 1.6                   | 53.6         | 8.5            | 1,423 |
| 4期(2021年9月15日) | 11,770 | 0           | 12.1                  | 34.1        | 1.2                   | 54.6         | 8.4            | 2,948 |
| 5期(2022年9月15日) | 11,317 | 0           | △3.8                  | 34.1        | 1.0                   | 54.4         | 9.7            | 3,963 |
| 6期(2023年9月15日) | 11,802 | 0           | 4.3                   | 34.8        | 0.6                   | 55.4         | 7.6            | 5,248 |

※基準価額の騰落率は分配金込み。

※当ファンドは親投資信託を組み入れますので、比率は実質比率を記載しています。

※株式組入比率には、新株予約権証券を含みます。

※当ファンドの運用方針に対し適切に比較できる指数がないため、ベンチマークおよび参考指数はありません。

### ■ 当期中の基準価額と市況等の推移

| 年月日                | 基準価額   |      | 株式組入率<br>株比 | 株式先物率<br>比<br>(買建-売建) | 公社債率<br>組入比率 | 投資信託証券<br>組入比率 |
|--------------------|--------|------|-------------|-----------------------|--------------|----------------|
|                    | 騰落率    | 騰落率  |             |                       |              |                |
| (期首)<br>2022年9月15日 | 円      | %    | %           | %                     | %            | %              |
| 9月末                | 11,317 | —    | 34.1        | 1.0                   | 54.4         | 9.7            |
| 10月末               | 10,872 | △3.9 | 33.0        | 1.2                   | 55.6         | 9.3            |
| 11月末               | 11,168 | △1.3 | 33.7        | 1.4                   | 54.6         | 9.5            |
| 12月末               | 11,187 | △1.1 | 33.0        | 1.7                   | 52.7         | 9.5            |
| 2023年1月末           | 10,807 | △4.5 | 33.7        | 0.9                   | 53.4         | 9.3            |
| 2月末                | 11,025 | △2.6 | 34.1        | 1.3                   | 53.4         | 9.5            |
| 3月末                | 11,058 | △2.3 | 33.8        | 1.1                   | 54.9         | 9.6            |
| 4月末                | 11,136 | △1.6 | 34.6        | 1.0                   | 53.3         | 9.4            |
| 5月末                | 11,244 | △0.6 | 33.9        | 1.1                   | 54.1         | 9.6            |
| 6月末                | 11,399 | 0.7  | 34.0        | 1.0                   | 54.1         | 9.6            |
| 7月末                | 11,732 | 3.7  | 34.4        | 1.0                   | 54.8         | 9.6            |
| 8月末                | 11,734 | 3.7  | 34.7        | 0.8                   | 52.9         | 9.4            |
| 8月末                | 11,752 | 3.8  | 34.3        | 1.0                   | 55.8         | 7.6            |
| (期末)<br>2023年9月15日 | 円      | %    | %           | %                     | %            | %              |
|                    | 11,802 | 4.3  | 34.8        | 0.6                   | 55.4         | 7.6            |

※騰落率は期首比です。

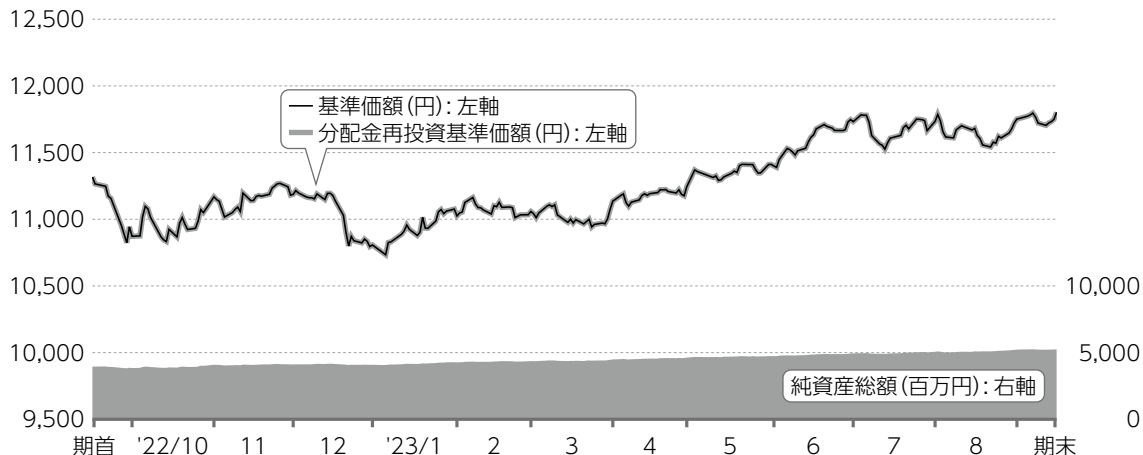
※当ファンドは親投資信託を組み入れますので、比率は実質比率を記載しています。

※株式組入比率には、新株予約権証券を含みます。

# 1 運用経過

基準価額等の推移について（2022年9月16日から2023年9月15日まで）

## 基準価額等の推移



※分配金再投資基準価額は、期首の値が基準価額と同一となるように指数化しています。

|     |                           |
|-----|---------------------------|
| 期首  | 11,317円                   |
| 期末  | 11,802円<br>(既払分配金0円(税引前)) |
| 騰落率 | +4.3%<br>(分配金再投資ベース)      |

## 分配金再投資基準価額について

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と仮定して計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示します。

※分配金を再投資するかどうかについては、受益者の皆さまがご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入価額などによって課税条件も異なります。したがって、受益者の皆さまの損益の状況を示すものではありません。(以下、同じ)

※当ファンドの運用方針に対し適切に比較できる指数がないため、ベンチマークおよび参考指数はありません。

### 基準価額の主な変動要因（2022年9月16日から2023年9月15日まで）

当ファンドは、投資信託証券への投資を通じて、世界各国の債券、株式および不動産投資信託（リート）等に分散投資することにより、安定的な収益の確保と信託財産の成長を目指して運用を行いました。

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

#### 上昇要因

- 国内を含む先進国株式市場が上昇したこと
- 米ドルやユーロ等、主要通貨に対して円安が進行したこと

#### 下落要因

- 日本を含む先進国の金利が上昇（債券価格は下落）したこと
- 国内外のリート市場が下落したこと

投資環境について（2022年9月16日から2023年9月15日まで）

期を通して見ると、国内を含む先進国株式を中心に株式市場は上昇しました。先進国債券市場では、国内外で金利が上昇しました。新興国債券市場は上昇しました。また、リート市場は、国内外で下落しました。外国為替市場では、米ドル、ユーロ等の主要通貨に加え、新興国通貨も円に対して概ね上昇しました。

## 株式市場

### ●先進国外国株式

期を通じて、先進国外国株式市場は上昇しました。

期初から10月にかけては、インフレ加速に伴う欧米中央銀行の一段の利上げが景気後退を招くとの懸念から下落しました。その後は、米国のインフレ鈍化の兆候による利上げペース減速への期待や概ね良好な企業業績を材料に持ち直しました。

2023年3月にかけて欧米の金融不安によるリスク回避の動きが強まり下落する局面もありましたが、その後は米国の堅調な経済指標や利上げ打ち止め観測等が支援材料となり、期末にかけて上昇しました。

### ●国内株式

期を通じて、国内株式市場は上昇しました。

期初から年末にかけては、株価はボックス圏で推移しました。年明け以降、米国の利上げペース減速への期待などから上昇基

調となりました。4月以降は、日銀の金融緩和方針維持による円安進展や海外投資家による日本株買いが好感され、上値を切り上げて推移しました。7月の金融政策決定会合にてイーールドカーブ・コントロール（長短金利操作）の運用柔軟化の決定を無難に消化すると、期末にかけて円安が一段と進行する中、好業績銘柄がけん引する形で上昇しました。

### ●新興国株式

期を通じて、新興国株式市場は小幅に上昇しました。

期初から10月にかけては、インフレ加速を受けた欧米の金融引き締めを背景に投資家のリスク回避姿勢が強まり下落しました。その後は欧米の底堅い経済指標やインフレ減速の兆しが見え始めたことで、反発しました。年明け以降は、米中関係の悪化懸念などから下落する局面もありましたが、底堅い経済指標やインフレのピークアウト観測が支援材料となり、ボックス圏で推移し、期を通してみると小幅上昇となりました。

---

## 債券市場

### ●先進国外国債券

米国や欧州の長期金利(10年国債利回り)は、期を通じて上昇しました。

インフレ懸念が継続し、主要国の中央銀行による金融引き締めが継続される中、欧米金利は上昇しました。期中、F R B(米連邦準備制度理事会)が利上げペースを減速するとの見方が強まった局面や欧米で金融不安が高まった局面では、一時的に金利低下も見られましたが、懸念が和らぎ再びインフレ圧力の根強さや景気の底堅さに注目が戻る中で、期末にかけて金利は上昇しました。

### ●国内債券

日本の長期金利は、期を通じて上昇しました。

日銀の金融緩和政策修正への思惑とともに、金利が上下する展開となりました。12月の金融政策決定会合にて長期金利の許容変動幅の拡大が発表されると、金利は上昇しました。3月に欧米で金融不安が高まった局面では大幅に金利低下する局面もありましたが、7月の金融政策決定会合にてイールドカーブ・コントロールの運用柔軟化が発表されると、期末にかけて金利は上昇基調となりました。

### ●新興国債券

新興国債券市場は、期を通じて上昇しました。

期初から10月にかけては、インフレ加速を受けた欧米の金融引き締めを背景に世界的に株式市場が下落し、投資家のリスク回避姿勢が強まったことから、下落しました。しかし、その後は欧米の底堅い景気やインフレ減速の兆しが見え始めたことで、投資家心理が改善したことなどから反発し、上昇に転じました。

---

## リート市場

### ●グローバルリート

グローバルリート市場は、期を通じて下落しました。

期初から10月にかけては、世界的なインフレの高止まりや欧米中央銀行による積極的な金融引き締めが意識される中、欧米の長期金利が大きく上昇したことが嫌気され、下落しました。その後、F R Bが利上げペースを減速するとの期待から上昇に転じましたが、3月にかけては、欧米の金融不安によるリスク回避の動きを受けて再び下落しました。

期末にかけては、F R Bの利上げ停止観測の高まりや後退を受けて一進一退の展開となり、期を通して見ると下落しました。

### ●国内リート

国内リート市場は、期を通じて下落しました。

期初から10月にかけては、世界的なインフレと海外の金融当局による連続的な利上げを受けて、国内リート市場は下落しました。12月の日銀金融政策決定会合で長期金利の変動許容幅が拡大されると、一段と国内リート市場は低調な推移となりました。

3月の欧米発の金融不安が波及し、一段と弱含む展開となりました。その後、各国金融当局の迅速な対応や国内景気の回復期待等により、国内リート市場は持ち直す動きとなりましたが、期を通して見ると下落しました。

---

## 為替市場

### ●米ドル・円

米ドル・円は、期を通じて、米ドル高・円安となりました。

F R Bが利上げペースを減速するとの見方から、期中に米ドル安・円高が進行する場面もありましたが、米景気が底堅く推移する中、F R Bがタカ派(インフレ抑制を重視する立場)姿勢を維持した一方、日銀は緩和姿勢を維持したことから、金融政策の方向性の違いを背景に、期を通して見ると米ドル高・円安が進行しました。

### ●ユーロ・円

ユーロ・円は、期を通じて、ユーロ高・円安となりました。

ユーロ圏ではインフレが高止まりする中、E C B (欧州中央銀行)が利上げを継続した一方、日銀は緩和姿勢を維持したことから、金融政策の方向性の違いを背景に、ユーロ高・円安が進行しました。

### ●新興国通貨

新興国通貨は一部通貨を除き、概ね円に対して上昇しました。

日銀が緩和姿勢を維持し円が下落したことで、メキシコペソをはじめとする多くの新興国通貨が円に対し上昇しました。ただし、トルコリラ等の一部通貨は、政局・金融政策に対する不透明感等を背景に円に対し下落しました。

ポートフォリオについて（2022年9月16日から2023年9月15日まで）

投資信託証券への投資を通じて、世界各国の債券、株式および不動産投資信託（リート）等に分散投資することにより、長期的な視点を基に安定的な収益の確保と信託財産の成長を目指して運用を行いました。

●資産配分

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

実質組入外貨建資産については、投資信託証券内で対円での為替ヘッジを行っている場合を除き、対円での為替ヘッジを行っておりません。投資信託証券の組入比率は、高位を保ちました。

月次でリバランス（投資配分比率の調整）を行い、毎月定めた資産配分方針を維持しました。時価変動等に伴う配分比率の変化については、基本資産配分比率から許容乖離幅±3%として調整しました。

2023年8月にイボットソン・アソシエイツ・ジャパンの助言に基づいて、基本資産配分の見直しを行いました。リーートの配分を減らし、債券の配分を増やしました。また、リート・債券に関しては、国内リート、海外リート、先進国債券（除く日本、為替ヘッジあり）の組入比率を引き下げ、国内債券、先進国債券（除く日本、為替ヘッジなし）の組入比率を引き上げました。



## 三井住友・資産最適化ファンド（2 やや安定型）

### ●組入れファンドの状況

| 資産区分 | 投資資産                       | 組入れファンド                               | ベンチマーク                               | 期末組入比率 | 基本資産配分      |     |
|------|----------------------------|---------------------------------------|--------------------------------------|--------|-------------|-----|
| 債券   | 国内債券                       | 国内債券パッシブ・マザーファンド                      | NOMURA-BPI(総合)                       | 33.4%  | 合計<br>58.8% | 60% |
|      | 先進国債券(除く日本)/為替ヘッジなし        | 外国債券パッシブ・マザーファンド                      | FTSE世界国債インデックス(除く日本、円換算ベース)          | 8.8%   |             |     |
|      | 為替ヘッジ付き先進国債券(除く日本)/為替ヘッジあり | ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド                 | FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ヘッジ換算ベース)       | 13.7%  |             |     |
|      | 新興国債券/為替ヘッジなし              | iシェアーズJ.P.モルガン・米ドル建てエマーシング・マーケット債券ETF | J.P.モルガンEMBIグローバル・コア・インデックス          | 2.9%   |             |     |
| 株式   | 国内株式                       | 国内株式インデックス・マザーファンド(B号)                | TOPIX(東証株価指数、配当込み)                   | 15.1%  | 合計<br>36.2% | 36% |
|      | 先進国株式(除く日本)/為替ヘッジなし        | 外国株式インデックス・マザーファンド                    | MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円換算ベース)         | 18.1%  |             |     |
|      | 新興国株式/為替ヘッジなし              | エマーシング株式インデックス・マザーファンド                | MSCIエマーシング・マーケット・インデックス(配当込み、円換算ベース) | 3.0%   |             |     |
| リート  | 国内リート                      | Jリート・インデックス・マザーファンド                   | 東証REIT指数(配当込み)                       | 2.0%   | 合計<br>4.0%  | 4%  |
|      | 外国リート/為替ヘッジなし              | 外国リート・インデックス・マザーファンド                  | S&P先進国REIT指数(除く日本、配当込み、円換算ベース)       | 2.0%   |             |     |

### ベンチマークとの差異について(2022年9月16日から2023年9月15日まで)

ベンチマークおよび参考指数を設けていませんので、この項目に記載する事項はありません。

## 分配金について（2022年9月16日から2023年9月15日まで）

（単位：円、1万口当たり、税引前）

| 項目        | 第6期     |
|-----------|---------|
| 当期分配金     | 0       |
| （対基準価額比率） | （0.00%） |
| 当期の収益     | —       |
| 当期の収益以外   | —       |
| 翌期繰越分配対象額 | 1,801   |

※単位未満を切り捨てているため、「当期の収益」と「当期の収益以外」の合計が「当期分配金」と一致しない場合があります。  
 ※「対基準価額比率」は、「当期分配金」（税引前）の期末基準価額（分配金（税引前）込み）に対する比率で、当ファンドの収益率とは異なります。

期間の分配は、複利効果による信託財産の成長を優先するため、見送りいたしました。  
 なお、留保益につきましては、運用の基本方針に基づき運用いたします。

## 2 今後の運用方針

引き続き投資信託証券への投資を通じて、世界各国の債券、株式および不動産投資信託（リート）等に分散投資することにより、長期的な視点を基に安定的な収益の確保と信託財産の成長を目指して運用を行います。

今後も世界各国の債券、株式およびリー

トに分散投資して、信託財産の成長を目指します。原則として、現状の基本資産配分方針を維持する予定ですが、市場環境が大きく変化した際には資産配分方針を変更する場合があります。

## 3 お知らせ

### 約款変更について

該当事項はございません。

## 三井住友・資産最適化ファンド（2やや安定型）

### 1万口当たりの費用明細（2022年9月16日から2023年9月15日まで）

| 項目                 | 金額          | 比率            | 項目の概要   |
|--------------------|-------------|---------------|---|
| <b>(a) 信託報酬</b>    | <b>109円</b> | <b>0.968%</b> | <b>信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率×(経過日数／年日数)</b><br>期中の平均基準価額は11,266円です。  |
| （投信会社）             | (48)        | (0.429)       | 投信会社:ファンド運用の指図等の対価  |
| （販売会社）             | (57)        | (0.506)       | 販売会社:交付運用報告書等各種資料の送付、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）             | (4)         | (0.033)       | 受託会社:ファンド財産の保管および管理、投信会社からの指図の実行等の対価  |
| <b>(b) 売買委託手数料</b> | <b>1</b>    | <b>0.007</b>  | <b>売買委託手数料＝期中の売買委託手数料／期中の平均受益権口数</b><br>売買委託手数料:有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料   |
| （株式）               | (0)         | (0.003)       |   |
| （先物・オプション）         | (0)         | (0.001)       |   |
| （投資信託証券）           | (0)         | (0.003)       |   |
| <b>(c) 有価証券取引税</b> | <b>0</b>    | <b>0.002</b>  | <b>有価証券取引税＝期中の有価証券取引税／期中の平均受益権口数</b><br>有価証券取引税:有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金  |
| （株式）               | (0)         | (0.002)       |   |
| （公社債）              | (-)         | (-)           |   |
| （投資信託証券）           | (0)         | (0.000)       |   |
| <b>(d) その他費用</b>   | <b>4</b>    | <b>0.036</b>  | <b>その他費用＝期中のその他費用／期中の平均受益権口数</b><br>保管費用:海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管および資金の送付金・資産の移転等に要する費用<br>監査費用:監査法人に支払うファンドの監査費用<br>その他:信託事務の処理等に要するその他費用 |
| （保管費用）             | (3)         | (0.029)       |   |
| （監査費用）             | (1)         | (0.007)       |   |
| （その他）              | (0)         | (0.001)       |   |
| <b>合計</b>          | <b>114</b>  | <b>1.013</b>  |   |

※期中の費用(消費税のかかるものは消費税を含む)は、追加・解約によって受益権口数に変動があるため、簡便法により算出しています。

※比率欄は1万口当たりのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

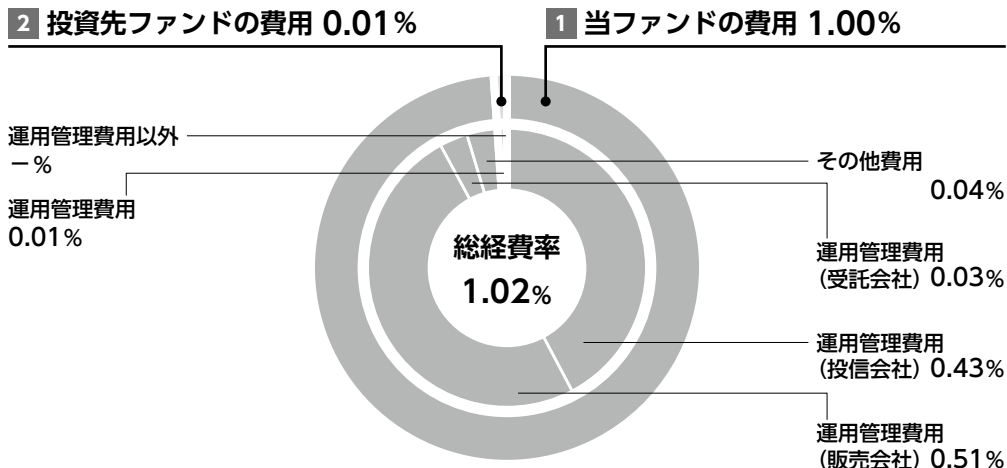
※各項目毎に円未満は四捨五入しています。

※売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、当ファンドが組み入れているマザーファンドが支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

※各項目の費用は、当ファンドが組み入れている投資信託証券が支払った費用を含みません。



## 参考情報 総経費率(年率換算)



|                            |              |
|----------------------------|--------------|
| <b>総経費率(1 + 2)</b>         | <b>1.02%</b> |
| <b>1 当ファンドの費用の比率</b>       | <b>1.00%</b> |
| <b>2 投資先ファンドの運用管理費用の比率</b> | <b>0.01%</b> |
| <b>投資先ファンドの運用管理費用以外の比率</b> | <b>-%</b>    |

※**1**の各費用は、前掲「1万口当たりの費用明細」において用いた簡便法により算出したもので、各比率は、年率換算した値(小数点以下第2位未満を四捨五入)です。「1万口当たりの費用明細」の各比率とは、値が異なる場合があります。

※**2**の投資先ファンド(当ファンドが組み入れている投資信託証券(マザーファンドを除く))の費用は、経費率または信託報酬率で、全額を運用管理費用としています。投資先ファンドへの平均投資比率を勘案して、実質的な費用を計算しています。

※**1**と**2**の費用は、原則として、募集手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を含みません。また、計上された期間が異なる場合があります。

※上記の前提条件で算出している参考値であり、実際に発生した費用の比率とは異なります。

当期中の運用・管理にかかった費用の総額(原則として、募集手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を除く。)を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額(1口当たり)を乗じた数で除した比率に、投資先ファンドの経費率を加えた総経費率(年率)は1.02%です。

## 三井住友・資産最適化ファンド（2やや安定型）

### ■ 当期中の売買及び取引の状況（2022年9月16日から2023年9月15日まで）

#### (1) 投資信託証券

|     |         |  | 買 付   |                 | 売 付 |               |
|-----|---------|--|-------|-----------------|-----|---------------|
|     |         |  | 口 数   | 買 付 額           | 口 数 | 売 付 額         |
| 外 国 | ア メ リ カ | iシェアーズ J.P.モルガン・米ドル建て<br>エマージング・マーケット債券ETF | 2,451 | 千アメリカ・ドル<br>210 | —   | 千アメリカ・ドル<br>— |

※金額は受渡し代金。

#### (2) 親投資信託受益証券の設定、解約状況

|                        | 設 定     |         | 解 約     |         |
|------------------------|---------|---------|---------|---------|
|                        | 口 数     | 金 額     | 口 数     | 金 額     |
|                        | 千口      | 千円      | 千口      | 千円      |
| 国内株式インデックス・マザーファンド（B号） | 38,712  | 136,300 | 29,079  | 110,500 |
| 外国株式インデックス・マザーファンド     | 32,475  | 199,200 | 19,913  | 128,700 |
| ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド  | 381,706 | 477,600 | 723,082 | 887,500 |
| 外国債券パッシブ・マザーファンド       | 160,132 | 334,100 | —       | —       |
| 国内債券パッシブ・マザーファンド       | 802,188 | 983,000 | 14,986  | 18,500  |
| Jリート・インデックス・マザーファンド    | 14,791  | 38,000  | 19,049  | 50,000  |
| 外国リート・インデックス・マザーファンド   | 13,429  | 35,500  | 16,636  | 50,000  |
| エマージング株式インデックス・マザーファンド | 15,442  | 25,700  | 1,060   | 2,000   |

### ■ 親投資信託の株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

（2022年9月16日から2023年9月15日まで）

| 項 目               | 当 期                               |                               |                                       |
|-------------------|-----------------------------------|-------------------------------|---------------------------------------|
|                   | 国 内 株 式<br>インデックス・<br>マザーファンド（B号） | 外 国 株 式<br>インデックス・<br>マザーファンド | エ マ ー ジ ン グ 株 式<br>インデックス・<br>マザーファンド |
| (a) 期中の株式売買金額     | 42,894,442千円                      | 97,433,760千円                  | 10,087,810千円                          |
| (b) 期中の平均組入株式時価総額 | 232,691,804千円                     | 458,842,152千円                 | 22,603,846千円                          |
| (c) 売買高比率(a)／(b)  | 0.18                              | 0.21                          | 0.44                                  |

※(b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

※外貨建資産については、(a)は各月末（ただし、決算日の属する月については決算日）の日本の対顧客電信売買相場の仲値で換算した邦貨金額の合計、(b)は各月末の同仲値で換算した邦貨金額合計の平均です。

## 三井住友・資産最適化ファンド（２やや安定型）

### ■ 利害関係人との取引状況等（2022年9月16日から2023年9月15日まで）

#### (1) 利害関係人との取引状況

##### 三井住友・資産最適化ファンド（２やや安定型）

当期中における利害関係人との取引等はありません。

#### 国内債券パッシブ・マザーファンド

| 区 分   | 買付額等          |                 |               | 売付額等          |                 |               |
|-------|---------------|-----------------|---------------|---------------|-----------------|---------------|
|       | A             | うち利害関係人との取引状況 B | $\frac{B}{A}$ | C             | うち利害関係人との取引状況 D | $\frac{D}{C}$ |
| 公 社 債 | 百万円<br>55,688 | 百万円<br>3,105    | %<br>5.6      | 百万円<br>53,166 | 百万円<br>6,330    | %<br>11.9     |

※平均保有割合 0.8%

※平均保有割合とは、親投資信託の残存口数の合計に対する当該ベビーファンドの親投資信託所有口数の割合。

#### 国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

| 区 分         | 買付額等          |                 |               | 売付額等          |                 |               |
|-------------|---------------|-----------------|---------------|---------------|-----------------|---------------|
|             | A             | うち利害関係人との取引状況 B | $\frac{B}{A}$ | C             | うち利害関係人との取引状況 D | $\frac{D}{C}$ |
| 株 式         | 百万円<br>30,659 | 百万円<br>9,992    | %<br>32.6     | 百万円<br>12,234 | 百万円<br>2,481    | %<br>20.3     |
| 株 式 先 物 取 引 | 48,906        | 696             | 1.4           | 51,215        | 2,349           | 4.6           |

※平均保有割合 0.3%

※平均保有割合とは、親投資信託の残存口数の合計に対する当該ベビーファンドの親投資信託所有口数の割合。

#### Jリート・インデックス・マザーファンド

| 区 分         | 買付額等         |                 |               | 売付額等         |                 |               |
|-------------|--------------|-----------------|---------------|--------------|-----------------|---------------|
|             | A            | うち利害関係人との取引状況 B | $\frac{B}{A}$ | C            | うち利害関係人との取引状況 D | $\frac{D}{C}$ |
| 投 資 信 託 証 券 | 百万円<br>6,659 | 百万円<br>716      | %<br>10.8     | 百万円<br>2,633 | 百万円<br>-        | %<br>-        |

※平均保有割合 1.1%

※平均保有割合とは、親投資信託の残存口数の合計に対する当該ベビーファンドの親投資信託所有口数の割合。

#### 外国債券パッシブ・マザーファンド

#### ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド

#### 外国株式インデックス・マザーファンド

#### エマージング株式インデックス・マザーファンド

#### 外国リート・インデックス・マザーファンド

当期中における利害関係人との取引等はありません。

## 三井住友・資産最適化ファンド（2 やや安定型）

### (2) 利害関係人の発行する有価証券等

#### 国内債券パッシブ・マザーファンド

| 種 類   | 買 付 額    | 売 付 額    | 期 末 保 有 額  |
|-------|----------|----------|------------|
| 公 社 債 | 百万円<br>- | 百万円<br>- | 百万円<br>100 |

#### 国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

| 種 類 | 買 付 額      | 売 付 額     | 期 末 保 有 額    |
|-----|------------|-----------|--------------|
| 株 式 | 百万円<br>274 | 百万円<br>79 | 百万円<br>4,266 |

### (3) 利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

#### 国内債券パッシブ・マザーファンド

| 種 類   | 買 付 額      |
|-------|------------|
| 公 社 債 | 百万円<br>300 |

#### Jリート・インデックス・マザーファンド

| 種 類         | 買 付 額     |
|-------------|-----------|
| 投 資 信 託 証 券 | 百万円<br>93 |

### (4) 売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

#### 三井住友・資産最適化ファンド（2 やや安定型）

| 項 目                         | 当 期   |
|-----------------------------|-------|
| (a) 売 買 委 託 手 数 料 総 額       | 325千円 |
| (b) う ち 利 害 関 係 人 へ の 支 払 額 | 1千円   |
| (c) (b) / (a)               | 0.6%  |

※売買委託手数料総額は、このファンドが組み入れている親投資信託が支払った金額のうち、当ファンドに対応するものです。

利害関係人とは、投資信託および投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人であり、当期における当ファンドに係る利害関係人とは、SMB C日興証券株式会社、株式会社三井住友フィナンシャルグループです。

## 三井住友・資産最適化ファンド（2やや安定型）

### ■ 第一種金融商品取引業、第二種金融商品取引業又は商品取引受託業務を兼業している委託会社の自己取引状況 (2022年9月16日から2023年9月15日まで)

該当事項はございません。また委託会社に売買委託手数料は支払われておりません。

### ■ 組入れ資産の明細（2023年9月15日現在）

#### (1) ファンド・オブ・ファンズが組入れた外貨建ファンドの明細

| ファンド名  | 期首(前期末) |        | 期        |         | 末    |
|--|---------|--------|----------|---------|------|
|  | 口数      | 口数     | 評価額      |         | 組入比率 |
|  |         |        | 外貨建金額    | 邦貨換算金額  |      |
| (アメリカ)                                       | 口       | 口      | 千アメリカ・ドル | 千円      | %    |
| i シェアーズ J.P. モルガン・米ドル建て<br>エマージング・マーケット債券ETF | 9,916   | 12,367 | 1,047    | 154,666 | 2.9  |
| 合計   | 9,916   | 12,367 | 1,047    | 154,666 | 2.9  |

※邦貨換算金額は、期末の時価を日本の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

※組入比率は、純資産総額に対する評価額の比率。

#### (2) 親投資信託残高

| 種類                     | 期首(前期末) |         | 期         |     | 末         |
|------------------------|---------|---------|-----------|-----|-----------|
|                        | 口数      | 口数      | 口数        | 評価額 | 評価額       |
|                        |         | 千口      | 千口        |     | 千円        |
| 国内株式インデックス・マザーファンド（B号） |         | 177,791 | 187,424   |     | 793,669   |
| 外国株式インデックス・マザーファンド     |         | 115,457 | 128,019   |     | 947,936   |
| ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド  |         | 934,024 | 592,648   |     | 719,712   |
| 外国債券パッシブ・マザーファンド       |         | 57,841  | 217,974   |     | 460,819   |
| 国内債券パッシブ・マザーファンド       |         | 655,230 | 1,442,432 |     | 1,751,545 |
| Jリート・インデックス・マザーファンド    |         | 42,983  | 38,725    |     | 103,331   |
| 外国リート・インデックス・マザーファンド   |         | 38,646  | 35,439    |     | 106,517   |
| エマージング株式インデックス・マザーファンド |         | 70,242  | 84,624    |     | 155,845   |

※各親投資信託の期末の受益権総口数は以下の通りです。

|                        |                  |                        |                 |
|------------------------|------------------|------------------------|-----------------|
| 国内株式インデックス・マザーファンド（B号） | 67,862,268,912口  | 外国株式インデックス・マザーファンド     | 80,676,406,829口 |
| ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド  | 15,809,721,819口  | 外国債券パッシブ・マザーファンド       | 79,403,960,652口 |
| 国内債券パッシブ・マザーファンド       | 105,659,583,769口 | Jリート・インデックス・マザーファンド    | 5,033,491,862口  |
| 外国リート・インデックス・マザーファンド   | 9,988,366,894口   | エマージング株式インデックス・マザーファンド | 20,327,562,024口 |



## 三井住友・資産最適化ファンド（2やや安定型）

### ■ 投資信託財産の構成

（2023年9月15日現在）

| 項 目                     | 期 末       |       |
|-------------------------|-----------|-------|
|                         | 評 価 額     | 比 率   |
|                         | 千円        | %     |
| 投 資 証 券                 | 154,666   | 2.9   |
| 国内株式インデックス・マザーファンド（B号）  | 793,669   | 15.0  |
| Jリート・インデックス・マザーファンド     | 103,331   | 2.0   |
| 国内債券パッシブ・マザーファンド        | 1,751,545 | 33.1  |
| 外国株式インデックス・マザーファンド      | 947,936   | 17.9  |
| 外国リート・インデックス・マザーファンド    | 106,517   | 2.0   |
| エマーシング株式インデックス・マザーファンド  | 155,845   | 2.9   |
| ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド   | 719,712   | 13.6  |
| 外国債券パッシブ・マザーファンド        | 460,819   | 8.7   |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他 | 97,878    | 1.8   |
| 投 資 信 託 財 産 総 額         | 5,291,922 | 100.0 |

※期末における外貨建資産（161,986千円）の投資信託財産総額（5,291,922千円）に対する比率は3.1%です。

※外国株式インデックス・マザーファンドにおいて、期末における外貨建資産（597,008,888千円）の投資信託財産総額（597,453,475千円）に対する比率は99.9%です。

※ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンドにおいて、期末における外貨建資産（19,141,228千円）の投資信託財産総額（19,371,535千円）に対する比率は98.8%です。

※外国債券パッシブ・マザーファンドにおいて、期末における外貨建資産（166,906,481千円）の投資信託財産総額（167,944,372千円）に対する比率は99.4%です。

※外国リート・インデックス・マザーファンドにおいて、期末における外貨建資産（29,994,436千円）の投資信託財産総額（30,021,865千円）に対する比率は99.9%です。

※エマーシング株式インデックス・マザーファンドにおいて、期末における外貨建資産（37,367,740千円）の投資信託財産総額（37,496,516千円）に対する比率は99.7%です。

※外貨建資産は、期末の時価を日本の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、期末における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=147.62円、1カナダ・ドル=109.25円、1オーストラリア・ドル=95.17円、1香港・ドル=18.86円、1シンガポール・ドル=108.25円、1ニュージーランド・ドル=87.35円、1台湾・ドル=4.623円、1イギリス・ポンド=183.18円、1エジプト・ポンド=4.769円、1イスラエル・シェケル=38.606円、1スイス・フラン=164.72円、1トルコ・リラ=5.481円、1デンマーク・クローネ=21.06円、1ノルウェー・クローネ=13.75円、1スウェーデン・クローナ=13.21円、1メキシコ・ペソ=8.633円、1フィリピン・ペソ=2.60円、100チリ・ペソ=16.561円、100コロンビア・ペソ=3.762円、1インド・ルピー=1.79円、100インドネシア・ルピア=0.97円、1ブラジル・リアル=30.268円、1チェコ・コルナ=6.403円、100韓国・ウォン=11.12円、1オフショア・人民元=20.249円、1マレーシア・リンギット=31.50円、1南アフリカ・ランド=7.75円、1タイ・バーツ=4.13円、1ポーランド・ズロチ=33.892円、100ハンガリー・フォリント=40.885円、1ユーロ=157.01円です。

## 三井住友・資産最適化ファンド（2やや安定型）

### ■ 資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2023年9月15日現在)

| 項 目                             | 期 末                            |
|---------------------------------|--------------------------------|
| <b>(A) 資 産</b>                  | <b>5, 291, 922, 373円</b>       |
| コーポレート債券等<br>投資証券(評価額)          | 82, 878, 383                   |
| 国内株式インデックス・<br>マザーファンド(B号)(評価額) | 154, 666, 233                  |
| Jリート・インデックス・<br>マザーファンド(評価額)    | 793, 669, 587                  |
| 国内債券パッシブ・マザーファンド(評価額)           | 103, 331, 729                  |
| 外国株式インデックス・<br>マザーファンド(評価額)     | 1, 751, 545, 545               |
| 外国リート・インデックス・<br>マザーファンド(評価額)   | 947, 936, 484                  |
| エマージング株式インデックス・<br>マザーファンド(評価額) | 106, 517, 306                  |
| ヘッジ付き外国債券パッシブ・<br>マザーファンド(評価額)  | 155, 845, 392                  |
| 外国債券パッシブ・マザーファンド(評価額)           | 719, 712, 560                  |
| 未 収 入 金                         | 460, 819, 154                  |
| <b>(B) 負 債</b>                  | <b>15, 000, 000</b>            |
| 未 払 解 約 金                       | 43, 869, 653                   |
| 未 払 信 託 報 酬                     | 20, 167, 618                   |
| そ の 他 未 払 費 用                   | 23, 541, 432                   |
| <b>(C) 純 資 産 総 額(A - B)</b>     | <b>160, 603</b>                |
| 元 本                             | 5, 248, 052, 720               |
| 次 期 繰 越 損 益 金                   | 4, 446, 804, 336               |
| <b>(D) 受 益 権 総 口 数</b>          | <b>801, 248, 384</b>           |
| 1 万 口 当 たり 基 準 価 額(C / D)       | 4, 446, 804, 336 口<br>11, 802円 |

※当期における期首元本額3,502,252,280円、期中追加設定元本額1,371,817,336円、期中一部解約元本額427,265,280円です。  
 ※上記表中の次期繰越損益金がマイナス表示の場合は、当該金額が投資信託財産の計算に関する規則第55条の6第10号に規定する額（元本の欠損）となります。  
 ※上記表中の受益権総口数および1万口当たり基準価額が、投資信託財産の計算に関する規則第55条の6第7号および第11号に規定する受益権の総数および計算口数当たりの純資産の額となります。

### ■ 損益の状況

(自2022年9月16日 至2023年9月15日)

| 項 目                             | 当 期                   |
|---------------------------------|-----------------------|
| <b>(A) 配 当 等 収 益</b>            | <b>6, 212, 460円</b>   |
| 受 取 配 当 金                       | 6, 190, 400           |
| 受 取 利 息                         | 53, 653               |
| 支 払 利 息                         | △ 31, 593             |
| <b>(B) 有 価 証 券 売 買 損 益</b>      | <b>257, 895, 526</b>  |
| 売 買 益                           | 374, 964, 348         |
| 売 買 損                           | △117, 068, 822        |
| <b>(C) 信 託 報 酬 等</b>            | <b>△ 43, 659, 878</b> |
| <b>(D) 当 期 損 益 金(A + B + C)</b> | <b>220, 448, 108</b>  |
| <b>(E) 前 期 繰 越 損 益 金</b>        | <b>94, 953, 675</b>   |
| <b>(F) 追 加 信 託 差 損 益 金</b>      | <b>485, 846, 601</b>  |
| (配 当 等 相 当 額)                   | ( 463, 916, 348)      |
| (売 買 損 益 相 当 額)                 | ( 21, 930, 253)       |
| <b>(G) 合 計(D + E + F)</b>       | <b>801, 248, 384</b>  |
| <b>次 期 繰 越 損 益 金(G)</b>         | <b>801, 248, 384</b>  |
| 追 加 信 託 差 損 益 金                 | 485, 846, 601         |
| (配 当 等 相 当 額)                   | ( 465, 651, 314)      |
| (売 買 損 益 相 当 額)                 | ( 20, 195, 287)       |
| 分 配 準 備 積 立 金                   | 315, 401, 783         |

※有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。  
 ※株式投信の信託報酬等には消費税等相当額が含まれており、公社債投信には内訳の一部に消費税等相当額が含まれています。  
 ※追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。  
 ※分配金の計算過程は以下の通りです。

| 項 目                        | 当 期           |
|----------------------------|---------------|
| (a) 経費控除後の配当等収益            | 77, 681, 002円 |
| (b) 経費控除後の有価証券売買等損益        | 2, 402, 751   |
| (c) 収益調整金                  | 485, 846, 601 |
| (d) 分配準備積立金                | 235, 318, 030 |
| (e) 当期分配対象額(a + b + c + d) | 801, 248, 384 |
| 1 万 口 当 たり 当 期 分 配 対 象 額   | 1, 801. 85    |
| (f) 分配金                    | 0             |
| 1 万 口 当 たり 分 配 金           | 0             |

### ■ 分配金のお知らせ

| 1 万 口 当 たり 分 配 金 (税 引 前) | 当 期 |
|--------------------------|-----|
|                          | 0円  |

上記のほか、投資信託財産の計算に関する規則第58条第1項各号に該当する事項はありません。

## 組入れ投資信託証券の内容（直近決算の情報）

|         |  |
|---------|--|
| ファンド名   | 国内債券バッシブ・マザーファンド   |
| 形態      | 国内籍親投資信託   |
| 運用会社    | 三井住友DSアセットマネジメント株式会社   |
| 運用の基本方針 | <ul style="list-style-type: none"> <li>●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。</li> <li>●日本の公社債および短期金融資産を主要投資対象とします。</li> </ul> |
| 信託財産留保額 | 追加設定時、一部解約時にそれぞれ0.03%  |

## ■ 1万口当たりの費用明細

（2022年5月26日から2023年5月25日まで）

| 項 目            | 金 額       |
|----------------|-----------|
| その他費用<br>(その他) | 0円<br>(0) |
| 合 計            | 0         |

※期中の費用（消費税のかかるものは消費税を含む）は、追加・解約によって受益権口数に変動があるため、簡便法により算出しています。

※各項目毎に円未満は四捨五入しています。

## ■ 組入上位銘柄（基準日：2023年5月25日）

|    | 銘 柄 名     | 組 入 比 率 |
|----|-----------|---------|
| 1  | 448 2年国債  | 3.1%    |
| 2  | 363 10年国債 | 1.2%    |
| 3  | 147 5年国債  | 1.0%    |
| 4  | 149 5年国債  | 1.0%    |
| 5  | 150 5年国債  | 1.0%    |
| 6  | 156 5年国債  | 1.0%    |
| 7  | 145 5年国債  | 0.9%    |
| 8  | 153 5年国債  | 0.9%    |
| 9  | 362 10年国債 | 0.9%    |
| 10 | 148 5年国債  | 0.9%    |
|    | 全 銘 柄 数   | 412銘柄   |

※比率は、純資産総額に対する割合です。

## ■ 損益の状況

（自2022年5月26日 至2023年5月25日）

| 項 目                  | 当 期             |
|----------------------|-----------------|
| (A) 配 当 等 収 益        | 1,110,963,838円  |
| 受 取 利 息              | 1,111,238,739   |
| 支 払 利 息              | △ 274,901       |
| (B) 有 価 証 券 売 買 損 益  | △ 3,268,899,578 |
| 売 買 益                | 259,169,207     |
| 売 買 損                | △ 3,528,068,785 |
| (C) そ の 他 費 用 等      | △ 25,447        |
| (D) 当 期 損 益 金(A+B+C) | △ 2,157,961,187 |
| (E) 前 期 繰 越 損 益 金    | 27,449,593,454  |
| (F) 解 約 差 損 益 金      | △ 7,166,945,374 |
| (G) 追 加 信 託 差 損 益 金  | 6,482,160,830   |
| (H) 合 計(D+E+F+G)     | 24,606,847,723  |
| 次 期 繰 越 損 益 金(H)     | 24,606,847,723  |

※有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

※追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

※解約差損益金とあるのは、中途解約の際、元本から解約価額を差し引いた差額分をいいます。

## 三井住友・資産最適化ファンド（2やや安定型）

|         |  |
|---------|--|
| ファンド名   | 外国債券パッシブ・マザーファンド   |
| 形態      | 国内籍親投資信託   |
| 運用会社    | 三井住友DSアセットマネジメント株式会社   |
| 運用の基本方針 | <ul style="list-style-type: none"> <li>●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。</li> <li>●ベンチマーク採用国の国債を主要投資対象とします。</li> <li>●保有する外貨建て資産については、原則として対円での為替ヘッジを行いません。</li> </ul> |
| 信託財産留保額 | 追加設定時、一部解約時にそれぞれ0.1%   |

### ■ 1万口当たりの費用明細

（2021年12月18日から2022年12月19日まで）

| 項 目    | 金 額 |
|--------|-----|
| その他費用  | 8円  |
| （保管費用） | (8) |
| （その他）  | (0) |
| 合 計    | 8   |

※期中の費用（消費税のかかるものは消費税を含む）は、追加・解約によって受益権口数に変動があるため、簡便法により算出しています。

※各項目毎に円未満は四捨五入しています。

### ■ 組入上位銘柄（基準日：2022年12月19日）

|    | 銘 柄 名                               | 組入比率  |
|----|-------------------------------------|-------|
| 1  | US TREASURY N/B 1.625 05/15/26      | 1.2%  |
| 2  | US TREASURY N/B 2.25 03/31/26       | 1.1%  |
| 3  | US TREASURY N/B 2.875 05/15/28      | 0.8%  |
| 4  | US TREASURY N/B 0.125 02/15/24      | 0.6%  |
| 5  | CHINA GOVERNMENT BOND 2.69 08/12/26 | 0.6%  |
| 6  | US TREASURY N/B 1.125 02/15/31      | 0.6%  |
| 7  | US TREASURY N/B 1.375 08/31/26      | 0.6%  |
| 8  | US TREASURY N/B 2.125 03/31/24      | 0.6%  |
| 9  | CHINA GOVERNMENT BOND 3.02 05/27/31 | 0.5%  |
| 10 | US TREASURY N/B 0.625 12/31/27      | 0.5%  |
|    | 全 銘 柄 数                             | 628銘柄 |

※比率は、純資産総額に対する割合です。

### ■ 損益の状況

（自2021年12月18日 至2022年12月19日）

| 項 目                       | 当 期             |
|---------------------------|-----------------|
| (A) 配 当 等 収 益             | 3,388,011,459円  |
| 受 取 利 息                   | 3,388,241,031   |
| そ の 他 収 益 金               | 87,605          |
| 支 払 利 息                   | △ 317,177       |
| (B) 有 価 証 券 売 買 損 益       | △ 4,218,802,521 |
| 売 買 益                     | 24,469,390,677  |
| 売 買 損                     | △28,688,193,198 |
| (C) そ の 他 費 用 等           | △ 60,550,279    |
| (D) 当 期 損 益 金 (A + B + C) | △ 891,341,341   |
| (E) 前 期 繰 越 損 益 金         | 80,981,208,508  |
| (F) 解 約 差 損 益 金           | △14,987,799,996 |
| (G) 追 加 信 託 差 損 益 金       | 11,644,838,448  |
| (H) 合 計 (D + E + F + G)   | 76,746,905,619  |
| 次 期 繰 越 損 益 金 (H)         | 76,746,905,619  |

※有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

※追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

※解約差損益金とあるのは、中途解約の際、元本から解約価額を差し引いた差額分をいいます。

## 三井住友・資産最適化ファンド（2やや安定型）

|         |  |
|---------|--|
| ファンド名   | ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド  |
| 形態      | 国内籍親投資信託   |
| 運用会社    | 三井住友DSアセットマネジメント株式会社   |
| 運用の基本方針 | <ul style="list-style-type: none"> <li>●FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ換算ベース）をベンチマークとし、ベンチマークの動きに連動する投資成果を目指します。</li> <li>●ベンチマーク採用国の国債を主要投資対象とします。</li> <li>●保有する外貨建て資産については、対円での為替のフルヘッジを原則とします。</li> </ul> |
| 信託財産留保額 | 追加設定時、一部解約時にそれぞれ0.1%   |

### ■ 1万口当たりの費用明細

（2022年8月26日から2023年8月25日まで）

| 項 目    | 金 額 |
|--------|-----|
| その他費用  | 9円  |
| （保管費用） | (9) |
| （その他）  | (0) |
| 合 計    | 9   |

※期中の費用（消費税のかかるものは消費税を含む）は、追加・解約によって受益権口数に変動があるため、簡便法により算出しています。

※各項目毎に円未満は四捨五入しています。

### ■ 組入上位銘柄（基準日：2023年8月25日）

|    | 銘 柄 名                          | 組入比率  |
|----|--------------------------------|-------|
| 1  | US TREASURY N/B 4.125 01/31/25 | 0.9%  |
| 2  | US TREASURY N/B 4.25 12/31/24  | 0.9%  |
| 3  | US TREASURY N/B 1 12/15/24     | 0.9%  |
| 4  | US TREASURY N/B 4.375 10/31/24 | 0.8%  |
| 5  | US TREASURY N/B 4.625 02/28/25 | 0.7%  |
| 6  | US TREASURY N/B 2.75 05/15/25  | 0.7%  |
| 7  | US TREASURY N/B 0.5 03/31/25   | 0.7%  |
| 8  | US TREASURY N/B 1.375 11/15/31 | 0.6%  |
| 9  | US TREASURY N/B 2.875 05/15/32 | 0.6%  |
| 10 | US TREASURY N/B 1.875 02/15/32 | 0.6%  |
|    | 全 銘 柄 数                        | 704銘柄 |

※比率は、純資産総額に対する割合です。

### ■ 損益の状況

（自2022年8月26日 至2023年8月25日）

| 項 目                       | 当 期            |
|---------------------------|----------------|
| (A) 配 当 等 収 益             | 562,389,868円   |
| 受 取 利 息                   | 562,501,773    |
| そ の 他 収 益 金               | 775            |
| 支 払 利 息                   | △ 112,680      |
| (B) 有 価 証 券 売 買 損 益       | △2,619,752,740 |
| 売 買 益                     | 6,033,025,711  |
| 売 買 損                     | △8,652,778,451 |
| (C) そ の 他 費 用 等           | △ 18,158,708   |
| (D) 当 期 損 益 金 (A + B + C) | △2,075,521,580 |
| (E) 前 期 繰 越 損 益 金         | 6,446,821,663  |
| (F) 解 約 差 損 益 金           | △3,596,705,760 |
| (G) 追 加 信 託 差 損 益 金       | 2,643,118,062  |
| (H) 合 計 (D + E + F + G)   | 3,417,712,385  |
| 次 期 繰 越 損 益 金 (H)         | 3,417,712,385  |

※有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

※追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

※解約差損益金とあるのは、中途解約の際、元本から解約価額を差し引いた差額分をいいます。

## 三井住友・資産最適化ファンド（2 やや安定型）

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

### ■ 組入上位銘柄（基準日：2022年9月30日）

|    | 銘柄名                                   | 比率    |
|----|---------------------------------------|-------|
| 1  | BLK CSH FND TREASURY SL AGENCY        | 0.93% |
| 2  | KUWAIT STATE OF (GOVERNMENT) MTN RegS | 0.82% |
| 3  | URUGUAY (ORIENTAL REPUBLIC OF)        | 0.73% |
| 4  | QATAR (STATE OF) RegS                 | 0.57% |
| 5  | ECUADOR REPUBLIC OF (GOVERNMENT) RegS | 0.56% |
| 6  | QATAR (STATE OF) RegS                 | 0.54% |
| 7  | BRAZIL FEDERATIVE REPUBLIC OF (GO)    | 0.52% |
| 8  | KAZAKHSTAN (REPUBLIC OF) MTN RegS     | 0.52% |
| 9  | PETRONAS CAPITAL LTD MTN RegS         | 0.49% |
| 10 | SAUDI ARABIA (KINGDOM OF) MTN RegS    | 0.47% |
|    | 全銘柄数                                  | 573銘柄 |

※比率は純資産総額に対する割合

### ■ 費用明細（2021年11月1日から2022年10月31日まで）

| 項目        | 比率    |
|-----------|-------|
| エクスペンスレシオ | 0.39% |

※エクスペンス・レシオとはファンドの運用管理費用およびその他費用をファンドの平均純資産総額で割ったものです。

※上記費用はファンドの純資産から差し引かれています。

## 三井住友・資産最適化ファンド（2やや安定型）

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

### ■ 1万口当たりの費用明細

（2021年12月1日から2022年11月30日まで）

| 項 目             | 金 額       |
|-----------------|-----------|
| 売買委託手数料<br>（株式） | 1円<br>(0) |
| （先物・オプション）      | (1)       |
| その他費用<br>（その他）  | 0<br>(0)  |
| 合 計             | 1         |

※期中の費用（消費税のかかるものは消費税を含む）は、追加・解約によって受益権口数に変動があるため、簡便法により算出しています。

※各項目毎に円未満は四捨五入しています。

### ■ 組入上位銘柄（基準日：2022年11月30日）

|    | 銘 柄 名             | 業 種    | 組 入 率   |
|----|-------------------|--------|---------|
| 1  | トヨタ自動車            | 輸送用機器  | 3.8%    |
| 2  | ソニーグループ           | 電気機器   | 2.7%    |
| 3  | キーエンス             | 電気機器   | 2.0%    |
| 4  | 日本電信電話            | 情報・通信業 | 1.7%    |
| 5  | 三菱UFJフィナンシャル・グループ | 銀行業    | 1.7%    |
| 6  | 第一三共              | 医薬品    | 1.3%    |
| 7  | 任天堂               | その他製品  | 1.3%    |
| 8  | 日立製作所             | 電気機器   | 1.3%    |
| 9  | 武田薬品工業            | 医薬品    | 1.2%    |
| 10 | ソフトバンクグループ        | 情報・通信業 | 1.2%    |
|    | 全 銘 柄 数           |        | 1,724銘柄 |

※比率は、純資産総額に対する割合です。

※別途、国内株価指数先物を2.0%買建てしています。

### ■ 損益の状況

（自2021年12月1日 至2022年11月30日）

| 項 目                 | 当 期              |
|---------------------|------------------|
| (A) 配 当 等 収 益       | 5,416,252,082円   |
| 受 取 配 当 金           | 5,415,660,123    |
| 受 取 利 息             | 36,384           |
| そ の 他 収 益 金         | 1,872,280        |
| 支 払 利 息             | △ 1,316,705      |
| (B) 有 価 証 券 売 買 損 益 | 6,363,803,273    |
| 売 買 益               | 21,992,241,699   |
| 売 買 損               | △ 15,628,438,426 |
| (C) 先 物 取 引 等 損 益   | 521,076,300      |
| 取 引 益               | 1,128,293,600    |
| 取 引 損               | △ 607,217,300    |
| (D) そ の 他 費 用 等     | △ 109,623        |
| (E) 当期損益金(A+B+C+D)  | 12,301,022,032   |
| (F) 前期繰越損益金         | 135,881,050,625  |
| (G) 解約差損益金          | △ 16,899,287,962 |
| (H) 追加信託差損益金        | 26,143,257,891   |
| (I) 合 計(E+F+G+H)    | 157,426,042,586  |
| 次 期 繰 越 損 益 金 ( I ) | 157,426,042,586  |

※有価証券売買損益および先物取引等損益は期末の評価換えによるものを含みます。

※追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

※解約差損益金とあるのは、中途解約の際、元本から解約価額を差し引いた差額分をいいます。

## 三井住友・資産最適化ファンド（2やや安定型）

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

### ■ 1万口当たりの費用明細

（2021年12月1日から2022年11月30日まで）

| 項 目        | 金 額  |
|------------|------|
| 売買委託手数料    | 3円   |
| （株式）       | (2)  |
| （先物・オプション） | (1)  |
| （投資信託証券）   | (0)  |
| 有価証券取引税    | 4    |
| （株式）       | (4)  |
| （投資信託証券）   | (0)  |
| その他費用      | 22   |
| （保管費用）     | (20) |
| （その他）      | (2)  |
| 合 計        | 29   |

※期中の費用（消費税のかかるものは消費税を含む）は、追加・解約によって受益権口数に変動があるため、簡便法により算出しています。

※各項目毎に円未満は四捨五入しています。

### ■ 組入上位銘柄（基準日：2022年11月30日）

|    | 銘柄名                         | 業 種                    | 組 入 率 |
|----|-----------------------------|------------------------|-------|
| 1  | APPLE INC                   | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     | 4.5%  |
| 2  | MICROSOFT CORP              | ソフトウェア・サービス            | 3.4%  |
| 3  | AMAZON.COM INC              | 小売                     | 1.7%  |
| 4  | ALPHABET INC-CL A           | メディア・娯楽                | 1.1%  |
| 5  | ALPHABET INC-CL C           | メディア・娯楽                | 1.1%  |
| 6  | UNITEDHEALTH GROUP INC      | ヘルスケア機器・サービス           | 1.0%  |
| 7  | TESLA INC                   | 自動車・自動車部品              | 0.9%  |
| 8  | EXXON MOBIL CORP            | エネルギー                  | 0.9%  |
| 9  | JOHNSON & JOHNSON           | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | 0.9%  |
| 10 | BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B | 各種金融                   | 0.8%  |
|    | 全銘柄数                        | 1,273銘柄                |       |

※比率は、純資産総額に対する割合です。

※別途、外国株価指数先物を4.7%買建てしています。

### ■ 損益の状況

（自2021年12月1日 至2022年11月30日）

| 項 目                 | 当 期              |
|---------------------|------------------|
| (A) 配 当 等 収 益       | 7,287,501,862円   |
| 受 取 配 当 金           | 7,253,557,434    |
| 受 取 利 息             | 8,351,669        |
| そ の 他 収 益 金         | 26,025,121       |
| 支 払 利 息             | △ 432,362        |
| (B) 有 価 証 券 売 買 損 益 | 11,547,232,777   |
| 売 買 益               | 99,265,619,371   |
| 売 買 損               | △ 87,718,386,594 |
| (C) 先 物 取 引 等 損 益   | △ 84,643,124     |
| 取 引 益               | 2,643,294,548    |
| 取 引 損               | △ 2,727,937,672  |
| (D) そ の 他 費 用 等     | △ 145,059,032    |
| (E) 当期損益金(A+B+C+D)  | 18,605,032,483   |
| (F) 前期繰越損益金         | 293,167,362,270  |
| (G) 解約差損益金          | △ 50,863,192,984 |
| (H) 追加信託差損益金        | 109,106,116,764  |
| (I) 合 計(E+F+G+H)    | 370,015,318,533  |
| 次 期 繰 越 損 益 金(I)    | 370,015,318,533  |

※有価証券売買損益および先物取引等損益は期末の評価換えによるものを含みます。

※追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

※解約差損益金とあるのは、中途解約の際、元本から解約価額を差し引いた差額分をいいます。



## 三井住友・資産最適化ファンド（2やや安定型）

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

### ■ 1万口当たりの費用明細

（2021年12月1日から2022年11月30日まで）

| 項 目        | 金 額  |
|------------|------|
| 売買委託手数料    | 25円  |
| （株式）       | (18) |
| （新株予約権証券）  | (0)  |
| （先物・オプション） | (5)  |
| （投資信託証券）   | (2)  |
| 有価証券取引税    | 6    |
| （株式）       | (6)  |
| （新株予約権証券）  | (0)  |
| （投資信託証券）   | (0)  |
| その他費用      | 19   |
| （保管費用）     | (18) |
| （その他）      | (1)  |
| 合 計        | 51   |

※期中の費用（消費税のかかるものは消費税を含む）は、追加・解約によって受益権口数に変動があるため、簡便法により算出しています。

※各項目毎に円未満は四捨五入しています。

### ■ 組入上位銘柄（基準日：2022年11月30日）

|    | 銘柄名                          | 業 種                | 組 入 率 |
|----|------------------------------|--------------------|-------|
| 1  | TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC | 半導体・半導体製造装置        | 5.0%  |
| 2  | CHINAAMC ETF SERIES - CH-CWV | —                  | 4.1%  |
| 3  | ISHRS MSCI SAUDI ARABIA ETF  | —                  | 3.4%  |
| 4  | TENCENT HOLDINGS LTD         | メディア・娯楽            | 3.0%  |
| 5  | SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD   | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 | 2.8%  |
| 6  | ALIBABA GROUP HOLDING LTD    | 小売                 | 2.0%  |
| 7  | RELIANCE INDUSTRIES LTD      | エネルギー              | 1.3%  |
| 8  | MEITUAN-CLASS B              | 小売                 | 1.1%  |
| 9  | ISHARES MSCI UAE ETF         | —                  | 1.0%  |
| 10 | INFOSYS LTD                  | ソフトウェア・サービス        | 0.9%  |
|    | 全銘柄数                         | 826銘柄              |       |

※比率は、純資産総額に対する割合です。

※別途、外国株価指数先物を19.9%買建てしています。

### ■ 損益の状況

（自2021年12月1日 至2022年11月30日）

| 項 目                 | 当 期             |
|---------------------|-----------------|
| (A) 配 当 等 収 益       | 556,596,958円    |
| 受 取 配 当 金           | 547,919,936     |
| 受 取 利 息             | 4,844,360       |
| そ の 他 収 益 金         | 4,323,205       |
| 支 払 利 息             | △ 490,543       |
| (B) 有 価 証 券 売 買 損 益 | △ 73,764,003    |
| 売 買 損 益             | 4,577,160,267   |
| 売 買 損 益             | △ 4,650,924,270 |
| (C) 先 物 取 引 等 損 益   | △ 829,599,240   |
| 取 引 益               | 292,520,767     |
| 取 引 損               | △ 1,122,120,007 |
| (D) そ の 他 費 用 等     | △ 25,739,377    |
| (E) 当期損益金(A+B+C+D)  | △ 372,505,662   |
| (F) 前期繰越損益金         | 7,067,369,472   |
| (G) 解約差損益金          | △ 1,362,991,688 |
| (H) 追加信託差損益金        | 5,110,611,871   |
| (I) 合 計 (E+F+G+H)   | 10,442,483,993  |
| 次 期 繰 越 損 益 金 (I)   | 10,442,483,993  |

※有価証券売買損益および先物取引等損益は期末の評価換えによるものを含みます。

※追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

※解約差損益金とあるのは、中途解約の際、元本から解約価額を差し引いた差額分をいいます。

## 三井住友・資産最適化ファンド（2やや安定型）

|         |   |
|---------|---|
| ファンド名   | Jリート・インデックス・マザーファンド   |
| 形態      | 国内籍親投資信託  |
| 運用会社    | 三井住友DSアセットマネジメント株式会社  |
| 運用の基本方針 | <ul style="list-style-type: none"> <li>●東証REIT指数（配当込み）をベンチマークとし、ベンチマークの動きに連動する投資成果を目指します。</li> <li>●日本の取引所に上場（上場予定を含みます。）している不動産投資信託（REIT）を主要投資対象とします。</li> </ul> |
| 信託財産留保額 | 追加設定時、一部解約時にそれぞれ0.15%   |

### ■ 1万口当たりの費用明細

（2023年2月28日から2023年8月25日まで）

| 項 目                               | 金 額              |
|-----------------------------------|------------------|
| 売買委託手数料<br>（先物・オプション）<br>（投資信託証券） | 5円<br>(0)<br>(5) |
| その他費用<br>（その他）                    | 0<br>(0)         |
| 合 計                               | 5                |

※期中の費用（消費税のかかるものは消費税を含む）は、追加・解約によって受益権口数に変動があるため、簡便法により算出しています。

※各項目毎に円未満は四捨五入しています。

### ■ 組入上位銘柄（基準日：2023年8月25日）

|                   | 銘 柄 名             | 組入比率 |
|-------------------|-------------------|------|
| 1                 | 日本ビルファンド投資法人      | 6.4% |
| 2                 | ジャパンリアルエステイト投資法人  | 5.6% |
| 3                 | 野村不動産マスターファンド投資法人 | 5.1% |
| 4                 | 日本プロロジスリート投資法人    | 4.7% |
| 5                 | 日本都市ファンド投資法人      | 4.4% |
| 6                 | GLP投資法人           | 4.4% |
| 7                 | 大和ハウスリート投資法人      | 3.9% |
| 8                 | オリックス不動産投資法人      | 3.4% |
| 9                 | ユナイテッド・アーバン投資法人   | 3.2% |
| 10                | アドバンス・レジデンス投資法人   | 3.1% |
| 全銘柄数（新投資口発行銘柄を含む） |                   | 60銘柄 |

※比率は、純資産総額に対する割合です。

### ■ 損益の状況

（自2023年2月28日 至2023年8月25日）

| 項 目                 | 当 期            |
|---------------------|----------------|
| (A) 配 当 等 収 益       | 166,504,623円   |
| 受 取 配 当 金           | 166,516,885    |
| 受 取 利 息             | 337            |
| そ の 他 収 益 金         | 17,136         |
| 支 払 利 息             | △ 29,735       |
| (B) 有 価 証 券 売 買 損 益 | 243,060,396    |
| 売 買 益               | 438,376,434    |
| 売 買 損               | △ 195,316,038  |
| (C) 先 物 取 引 等 損 益   | 1,196,400      |
| 取 引 益               | 1,510,800      |
| 取 引 損               | △ 314,400      |
| (D) そ の 他 費 用 等     | △ 2,482        |
| (E) 当期損益金(A+B+C+D)  | 410,758,937    |
| (F) 前期繰越損益金         | 7,069,820,345  |
| (G) 解約差損益金          | △1,387,219,750 |
| (H) 追加信託差損益金        | 2,146,147,514  |
| (I) 合 計(E+F+G+H)    | 8,239,507,046  |
| 次 期 繰 越 損 益 金 (I)   | 8,239,507,046  |

※有価証券売買損益および先物取引等損益は期末の評価換えによるものを含みます。

※追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

※解約差損益金とあるのは、中途解約の際、元本から解約価額を差し引いた差額分をいいます。

## 三井住友・資産最適化ファンド（2やや安定型）

|         |   |
|---------|---|
| ファンド名   | 外国リート・インデックス・マザーファンド  |
| 形態      | 国内籍親投資信託  |
| 運用会社    | 三井住友DSアセットマネジメント株式会社  |
| 運用の基本方針 | <ul style="list-style-type: none"> <li>● S &amp; P 先進国 R E I T 指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）をベンチマークとし、ベンチマークの動きに連動する投資成果を目指します。</li> <li>● 日本を除く世界各国の不動産投資信託（R E I T）などを主要投資対象とします。</li> <li>● 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。</li> </ul> |
| 信託財産留保額 | 追加設定時、一部解約時にそれぞれ0.15%   |

### ■ 1万口当たりの費用明細

（2023年2月28日から2023年8月25日まで）

| 項 目                 | 金 額       |
|---------------------|-----------|
| 売買委託手数料<br>（投資信託証券） | 3円<br>(3) |
| 有価証券取引税<br>（投資信託証券） | 1<br>(1)  |
| その他費用<br>（保管費用）     | 7<br>(6)  |
| （その他）               | (1)       |
| 合 計                 | 11        |

※期中の費用（消費税のかかるものは消費税を含む）は、追加・解約によって受益権口数に変動があるため、簡便法により算出しています。

※各項目毎に円未満は四捨五入しています。

### ■ 組入上位銘柄（基準日：2023年8月25日）

|    | 銘 柄 名                     | 組 入 比 率 |
|----|---------------------------|---------|
| 1  | PROLOGIS INC              | 8.8%    |
| 2  | EQUINIX INC               | 5.6%    |
| 3  | PUBLIC STORAGE            | 3.4%    |
| 4  | WELLTOWER INC             | 3.1%    |
| 5  | REALTY INCOME CORP        | 3.0%    |
| 6  | DIGITAL REALTY TRUST INC  | 2.9%    |
| 7  | SIMON PROPERTY GROUP INC  | 2.8%    |
| 8  | VICI PROPERTIES INC       | 2.4%    |
| 9  | EXTRA SPACE STORAGE INC   | 2.1%    |
| 10 | AVALONBAY COMMUNITIES INC | 2.0%    |
|    | 全 銘 柄 数                   | 319銘柄   |

※比率は、純資産総額に対する割合です。

### ■ 損益の状況

（自2023年2月28日 至2023年8月25日）

| 項 目                       | 当 期             |
|---------------------------|-----------------|
| (A) 配 当 等 収 益             | 600,428,867円    |
| 受 取 配 当 金                 | 598,233,331     |
| 受 取 利 息                   | 2,036,237       |
| そ の 他 収 益 金               | 181,902         |
| 支 払 利 息                   | △ 22,603        |
| (B) 有 価 証 券 売 買 損 益       | 430,286,911     |
| 売 買 益                     | 2,816,100,487   |
| 売 買 損                     | △ 2,385,813,576 |
| (C) そ の 他 費 用 等           | △ 6,958,662     |
| (D) 当 期 損 益 金 (A + B + C) | 1,023,757,116   |
| (E) 前 期 繰 越 損 益 金         | 17,332,341,775  |
| (F) 解 約 差 損 益 金           | △ 1,482,527,433 |
| (G) 追 加 信 託 差 損 益 金       | 2,452,254,230   |
| (H) 合 計 (D + E + F + G)   | 19,325,825,688  |
| 次 期 繰 越 損 益 金 (H)         | 19,325,825,688  |

※有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

※追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

※解約差損益金とあるのは、中途解約の際、元本から解約価額を差し引いた差額分をいいます。