

【表紙】

| | |
|--|---|
| 【提出書類】 | 有価証券届出書 |
| 【提出先】 | 関東財務局長殿 |
| 【提出日】 | 平成28年3月17日提出 |
| 【発行者名】 | 三井住友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 横山 邦男 |
| 【本店の所在の場所】 | 東京都港区愛宕二丁目5番1号 |
| 【事務連絡者氏名】 | 三島 克哉 |
| 【電話番号】 | 03-5405-0228 |
| 【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券に係るファンドの名称】 | 三井住友・DC年金プラン・ファンド（ターゲット・イヤー型）2010 三井住友・DC年金プラン・ファンド（ターゲット・イヤー型）2020 三井住友・DC年金プラン・ファンド（ターゲット・イヤー型）2030 三井住友・DC年金プラン・ファンド（ターゲット・イヤー型）2040 |
| 【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券の金額】 | 継続募集額(平成28年3月18日から平成29年3月16日まで) 三井住友・DC年金プラン・ファンド（ターゲット・イヤー型）2010 1兆5,000億円を上限とします。 三井住友・DC年金プラン・ファンド（ターゲット・イヤー型）2020 1兆5,000億円を上限とします。 三井住友・DC年金プラン・ファンド（ターゲット・イヤー型）2030 1兆5,000億円を上限とします。 三井住友・DC年金プラン・ファンド（ターゲット・イヤー型）2040 1兆5,000億円を上限とします。 |
| 【縦覧に供する場所】 | 該当事項はありません。 |

第一部【証券情報】

（１）【ファンドの名称】

三井住友・DC年金プラン・ファンド（ターゲット・イヤー型）2010

三井住友・DC年金プラン・ファンド（ターゲット・イヤー型）2020

三井住友・DC年金プラン・ファンド（ターゲット・イヤー型）2030

三井住友・DC年金プラン・ファンド（ターゲット・イヤー型）2040

以下上記ファンドを総称して、「当ファンド」ということがあり、また、それぞれを各ファンドということがあります。また、各ファンドをそれぞれ<2010>、<2020>、<2030>、<2040>と略称することがあります。

（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アセットマネジメント株式会社は、やむを得ない事情等がある場合を除き、当該振替受益権を表示する受益証券を発行しません。

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

（３）【発行（売出）価額の総額】

各ファンド1兆5,000億円を上限とします。

（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「TY2010」、「TY2020」、「TY2030」、「TY2040」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 | 電話番号 | インターネット・ホームページ・アドレス |
|--------------------|--------------|---|
| 三井住友アセットマネジメント株式会社 | 0120-88-2976 | http://www.smam-jp.com |

お問い合わせは、原則として営業日の午前9時～午後5時までとさせていただきます。

（５）【申込手数料】

無手数料です。

（６）【申込単位】

お申込単位の詳細は、お申込みの販売会社または前記「（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。

（７）【申込期間】

平成28年 3月18日から平成29年 3月16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 わが国以外の地域における募集
ありません。

八 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。

二 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、他の投資信託への投資を通じて、実質的に日本を含む世界各国の株式および公社債に投資し、信託財産の成長を目指して運用を行います。

ロ 各ファンドにつき定めるターゲット・イヤー 到達後は、流動性を重視した安定的な運用を行います。

各ファンドのターゲット・イヤーは次の通りです。

< 2 0 1 0 > …… 西暦2010年、 < 2 0 2 0 > …… 西暦2020年

< 2 0 3 0 > …… 西暦2030年、 < 2 0 4 0 > …… 西暦2040年

ハ 委託会社は、受託会社と合意の上、各ファンドとも金3,000億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。

（イ）当ファンドが該当する商品分類

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

（ロ）当ファンドが該当する属性区分

| 項目 | 該当する属性区分 | 内容 |
|--------|-----------------------------------|--|
| 投資対象資産 | その他資産（投資信託証券（資産複合（株式、債券）資産配分変更型）） | 目論見書または信託約款において、主として投資信託証券に投資する旨の記載があるものをいいます。「投資信託証券」以下のカッコ内は投資信託証券の先の実質投資対象について記載していません。なお、組み入れる資産そのものは投資信託証券ですが、投資信託証券の先の実質投資対象は株式および債券であり、ファンドの収益は株式市場、債券市場の動向に左右されるものであるため、商品分類上の投資対象資産（収益の源泉）は「資産複合」となります。 |
| 決算頻度 | 年1回 | 目論見書または信託約款において、年1回決算する旨の記載があるものをいいます。 |
| 投資対象地域 | グローバル（日本を含む） | 目論見書または信託約款において、組入資産による投資収益が日本を含む世界の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。 |
| 投資形態 | ファンド・オブ・ファンズ | 一般社団法人投資信託協会「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・ファンズをいいます。 |

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

商品分類表

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

属性区分表

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

（注）当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

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

（２）【ファンドの沿革】

| | |
|------------|---|
| 平成13年3月13日 | 信託契約締結、設定、運用開始。 （設定時の委託会社はさくら投信投資顧問株式会社） |
| 平成14年12月1日 | 三井住友アセットマネジメント株式会社が、合併によりファンドの委託会社としての業務を承継。「DC年金プラン・ファンド（ターゲット・イヤー型）2010」、「DC年金プラン・ファンド（ターゲット・イヤー型）2020」、「DC年金プラン・ファンド（ターゲット・イヤー型）2030」、「DC年金プラン・ファンド（ターゲット・イヤー型）2040」から「三井住友・DC年金プラン・ファンド（ターゲット・イヤー型）2010」、「三井住友・DC年金プラン・ファンド（ターゲット・イヤー型）2020」、「三井住友・DC年金プラン・ファンド（ターゲット・イヤー型）2030」、「三井住友・DC年金プラン・ファンド（ターゲット・イヤー型）2040」に名称を変更。 |

（３）【ファンドの仕組み】

イ 当ファンドの関係法人とその役割

（イ）委託会社 「三井住友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、日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社に委託することがあります。また、外国における資産の保管は、その業務を行うに十分な能力を有すると認められる外国の金融機関が行う場合があります。

（ハ）販売会社

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

運営の仕組み



□ 委託会社の概況

（イ）資本金の額

2,000百万円（平成28年 1月29日現在）

（ロ）会社の沿革

昭和60年 7月15日 三生投資顧問株式会社設立
 昭和62年 2月20日 証券投資顧問業の登録
 昭和62年 6月10日 投資一任契約にかかる業務の認可
 平成11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
 平成11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
 平成12年 1月27日 証券投資信託委託業の認可取得
 平成14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
 平成25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

（ハ）大株主の状況

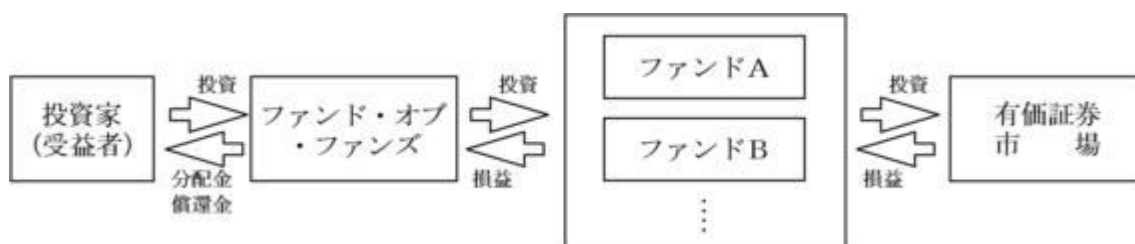
（平成28年 1月29日現在）

| 名称 | 住所 | 所有 株式数 | 比率 (%) |
|----------------|---------------------|-----------|-----------|
| 株式会社三井住友銀行 | 東京都千代田区丸の内一丁目1番2号 | 7,056 | 40.0 |
| 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 | 4,851 | 27.5 |
| 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 | 4,851 | 27.5 |
| 三井生命保険株式会社 | 東京都千代田区大手町二丁目1番1号 | 882 | 5.0 |

八 ファンドの運用形態（ファンド・オブ・ファンズによる運用）

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

〔ファンド・オブ・ファンズによる運用〕



2 【投資方針】

（1）【投資方針】

イ 基本方針

各ファンドのターゲット・イヤーに向けた信託財産の成長を目指して運用を行います。ターゲット・イヤー到達後は、流動性を重視した安定的な運用を行います。

ロ 投資態度

（イ）投資信託への投資を通じて、国内株式・国内債券・外国株式・外国債券への分散投資を行いま

す（グローバル・バランス型ファンド）。

（ロ）投資資産配分（基本アロケーション）は、国内外の経済・金融市場動向見通し等の分析を基に、各資産クラスの期待収益率等を予測した結果、ターゲット・イヤーに向けた信託財産の成長に最適と考えられる比率とし、原則として1年（計算期間）毎に見直します。

各ファンドのターゲット・イヤーに近づくにつれ、安定資産等の比率を引き上げていきます。概ね、ターゲット・イヤーまでの期間が長いほど、リターン（収益）の高い運用を目指しますが、それに伴いリスク（損益の変動幅）が大きくなる傾向があります。

ターゲット・イヤー到達後の安定運用期間においても国内債券および短期金融資産の他、国内外の株式および外国債券への配分が予定されています。

（ハ）期中の基本アロケーションとの乖離については、原則として四半期毎に見直し、必要に応じてリバランスを実施します。

（二）主要投資対象とする投資信託は、下記の通りとします。ただし、運用状況等により変更となる場合があります。

a．S M A M・国内株式パッシブ・ファンド（適格機関投資家専用）

| | |
|---------|--|
| 運用会社 | 三井住友アセットマネジメント株式会社 |
| 主要運用対象 | 国内株式 |
| 運用の基本方針 | T O P I X（東証株価指数、配当込み）と連動する投資成果を目指して運用を行います。 |

b．S M A M・年金国内債券パッシブファンド＜適格機関投資家限定＞

| | |
|---------|--|
| 運用会社 | 三井住友アセットマネジメント株式会社 |
| 主要運用対象 | 国内債券 |
| 運用の基本方針 | N O M U R A - B P I（総合）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。 |

c．S M A M・外国株式パッシブ・ファンド（適格機関投資家専用）

| | |
|---------|---|
| 運用会社 | 三井住友アセットマネジメント株式会社 |
| 主要運用対象 | 外国株式 |
| 運用の基本方針 | M S C I コクサイインデックス（配当込み、円ベース）と連動する投資成果を目指して運用を行います。 |

d．S M A M・年金外国債券パッシブ・ファンド＜適格機関投資家限定＞

| | |
|---------|--|
| 運用会社 | 三井住友アセットマネジメント株式会社 |
| 主要運用対象 | 外国債券 |
| 運用の基本方針 | シティ世界国債インデックス（除く日本、円ベース）と連動する投資成果を目指した運用を行います。 |

e．S M A M・マネーインカムファンド＜適格機関投資家限定＞

| | |
|---------|--------------------|
| 運用会社 | 三井住友アセットマネジメント株式会社 |
| 主要運用対象 | 円貨建の短期公社債および短期金融商品 |
| 運用の基本方針 | 安定した収益の確保を目指します。 |

上記ファンドの詳細に関しましては、後述の〔参考情報：投資対象とする投資信託の概要〕をご覧ください。

★ ファンドの特色

1

他の投資信託への投資を通じて、国内株式・国内債券・外国株式・外国債券への分散投資を行います（グローバル・バランス型ファンド）。

2

各ファンドのターゲット・イヤーに向けた信託財産の成長を目指して運用を行います。ターゲット・イヤー到達後は、流動性を重視した安定的な運用を行います。

3

ファンド・オブ・ファンズという形態で運用されます。

- 「ファンド・オブ・ファンズ」においては、株式や債券などの有価証券に直接投資するのではなく、複数の他の投資信託（ファンド）を組み入れることにより運用を行います（投資信託に投資する投資信託）。

種々の特徴を持った投資信託を購入することにより、効率的に資産配分を行います。

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

ファンドのしくみ

■ファンド・オブ・ファンズ方式で運用を行います。



各ファンドのターゲット・イヤー

<2010> …… 西暦2010年、 <2020> …… 西暦2020年

<2030> …… 西暦2030年、 <2040> …… 西暦2040年

■投資資産配分（基本アロケーション）は、国内外の経済・金融市場動向見通し等の分析を基に、各資産クラスの期待収益率等を予測した結果、ターゲット・イヤーに向けた信託財産の成長に最適と考えられる比率とし、原則として1年（計算期間）毎に見直します。

- 各ファンドのターゲット・イヤーに近づくにつれ、安定資産等の比率を引き上げていきます。概ね、ターゲット・イヤーまでの期間が長いほど、リターン（収益）の高い運用を目指しますが、それに伴いリスク（損益の変動幅）が大きくなる傾向があります。
- ターゲット・イヤー到達後の安定運用期間においても国内債券および短期金融資産の他、国内外の株式および外国債券への配分が予定されています。

※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。

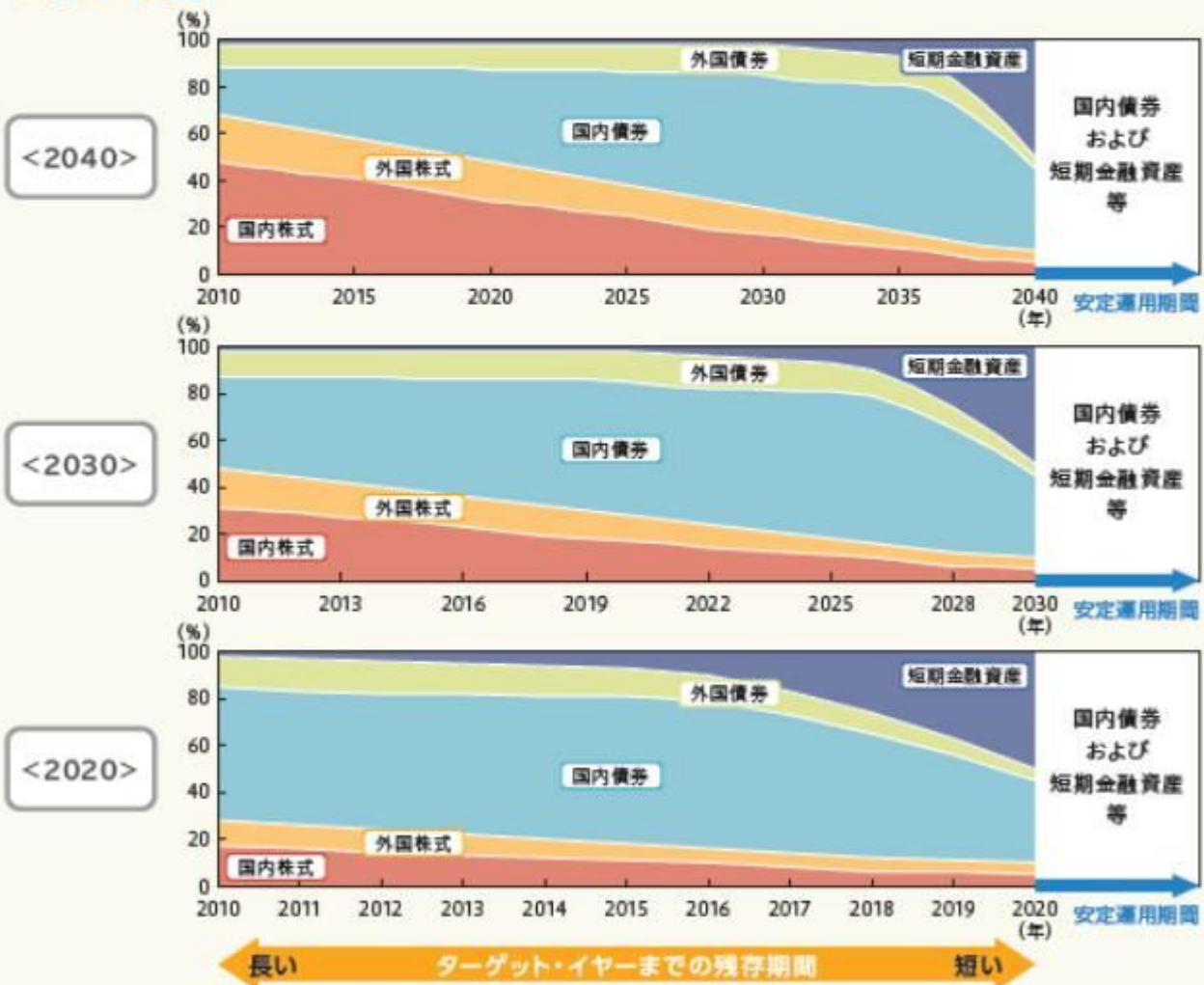
基本的な投資資産配分

▶基本アロケーション

■2016年1月末現在、各ファンドの基本アロケーションは以下の通りです。

| | <2040> | <2030> | <2020> | <2010> 安定運用期間 |
|--------|--------|--------|--------|------------------|
| 国内株式 | 41% | 25% | 11% | 5% |
| 外国株式 | 17% | 13% | 7% | 5% |
| 国内債券 | 30% | 48% | 63% | 35% |
| 外国債券 | 10% | 12% | 12% | 5% |
| 短期金融資産 | 2% | 2% | 7% | 50% |

▶イメージ図



※上記の図は、各決算時点での基本資産配分を表しています。また、現時点で予定している基本資産配分をもとに作成したイメージ図であり、将来、実際に上記の通りの運用を行うことを保証するものではありません。

<2010>

安定運用期間

(国内債券および短期金融資産等による運用)
※ターゲット・イヤー到達(2010年12月決算時)

★ 追加的記載事項

■投資対象とする投資信託の運用プロセス

▶ SMAM・国内株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)

- 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)と連動する投資成果を目指して運用を行います。
- ポートフォリオの作成にあたっては、東証1部銘柄の中から、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、マルチファクターモデルを活用した最適化法*1により、推定トラッキングエラーの低減のみならず制約条件を加えることで、実績トラッキングエラーを抑えることを目指してポートフォリオを構築します。
- TOPIX(東証株価指数、配当込み)との連動性を随時チェックし、必要に応じてマルチファクターモデルを使用してポートフォリオのリバランスを行います。

▶ SMAM・年金国内債券パッシブファンド<適格機関投資家限定>

- 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、NOMURA-BPI(総合)と連動する投資成果を目指して運用を行います。
- ポートフォリオの作成にあたっては、層化抽出法*2により、マルチファクターモデルおよび委託会社独自のリスクモデルを併用して、ファンド規模に応じデュレーション、満期構成、セクター(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。なお事業債の銘柄選択については、委託会社クレジットアナリストの調査結果に基づき、将来的に格下げによりベンチマークから外れる可能性が高い銘柄については、組入対象から除外することがあります。
- NOMURA-BPI(総合)との連動性を随時チェックし、必要に応じてマルチファクターモデルおよび委託会社独自のリスクモデルを使用してポートフォリオのリバランスを行います。

▶ SMAM・外国株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)

- 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)と連動する投資成果を目指して運用を行います。
- ポートフォリオの作成にあたっては、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、マルチファクターモデルを活用した最適化法により推定トラッキングエラーの低減のみならず、制約条件を加えることで実績トラッキングエラーを抑えることを目指してポートフォリオを構築します。
- MSCIコクサイインデックス(配当込み、円ベース)との連動性を随時チェックし、必要に応じてマルチファクターモデルを使用してポートフォリオのリバランスを行います。



*1 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一部の銘柄を抽出してポートフォリオを構築する方法です。信用不安が懸念される銘柄を排除することや少額でもポートフォリオを構築することができるメリットがあります。

*2 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ファンド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。

▶ SMAM・年金外国債券パッシブ・ファンド<適格機関投資家限定>

- 主として日本を除く世界各国の債券に投資し、シティ世界国債インデックス（除く日本、円ベース）と連動する投資成果を目指した運用を行います。
- ポートフォリオの作成にあたっては、層化抽出法により、マルチファクターモデルおよび委託会社独自のリスクモデルを併用して、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ベンチマークに近づけたポートフォリオを構築します。
- ベンチマークとの連動性を随時チェックし、必要に応じてマルチファクターモデルおよび委託会社独自のリスクモデルを使用してポートフォリオのリバランスを行います。

▶ SMAM・マネーインカムファンド<適格機関投資家限定>

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

※実際の運用は、各投資信託がそれぞれ投資対象とするマザーファンドで行います。

- ・TOPIX(東証株価指数)、NOMURA-BPI(総合)、MSCIコクサイインデックス、シティ世界国債インデックスは、それぞれ東京証券取引所、野村證券株式会社、MSCI Inc.、Citigroup Index LLCが公表している指数で各社の知的財産です。
- ・指数を公表する各社は当ファンドの運用と何ら関係ありません。

(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。）とします。

1. 有価証券
2. 金銭債権
3. 約束手形

ロ 投資対象とする有価証券

委託会社は、信託金を、主として別に定める証券投資信託の受益証券ならびに次の有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図します。

1. コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等
2. 外国または外国の者の発行する本邦通貨表示の証券で、前号の性質を有するもの。

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

主要投資対象となるファンドの名称、運用会社、主要運用対象、運用の基本方針に関しましては、上記「(1) 投資方針」の記載をご覧ください。

(3) 【運用体制】

イ 運用体制

当ファンドの運用は、次のプロセスに基づいて行われます。

(イ) 計画 (Plan)

国内外のエコノミスト、アナリスト、ファンドマネージャーが、マクロ経済環境、市場環境に関する分析・検討を行います。

これを元に、担当運用グループは投資政策委員会にて、運用方針を決定し月次運用計画を策定します。

(ロ) 実行 (Do)

担当運用グループは、月次運用計画に基づき、ファンドのポートフォリオの構築、およびポートフォリオ管理の一環として日々のリスクモニタリングを行います。

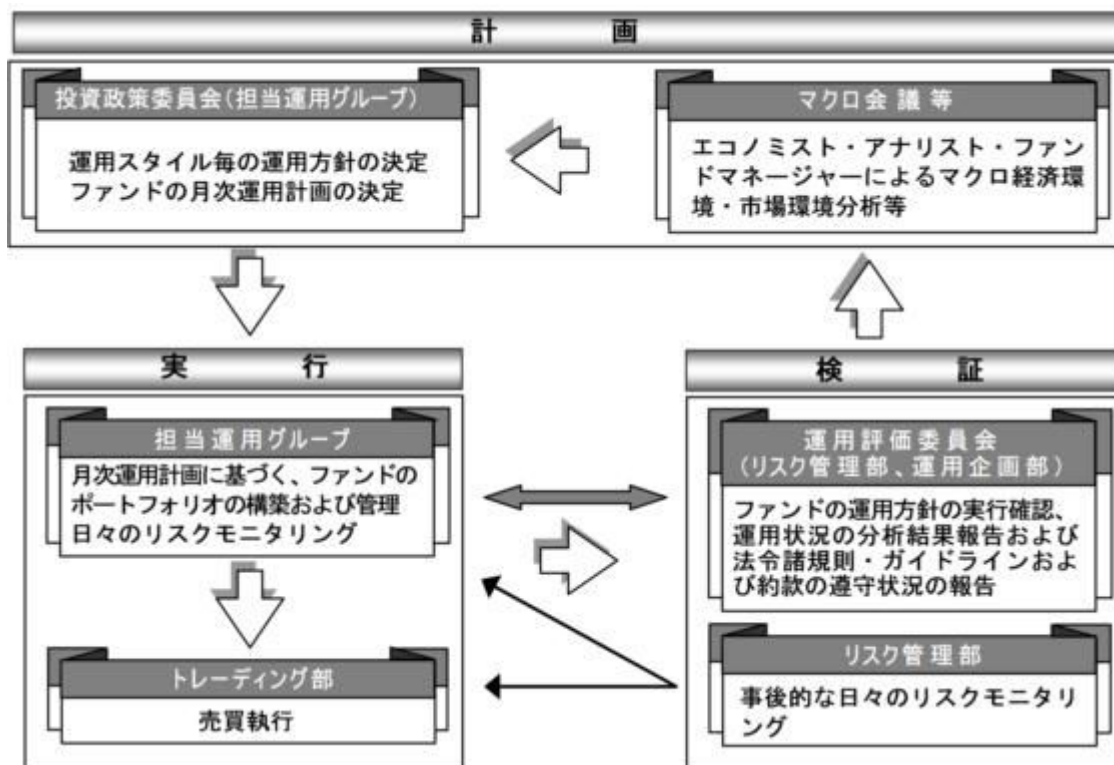
売買執行については、組織的に分離されたトレーディング部が、最良と思われる手法をもって売買を執行します。

(ハ) 検証 (Check)

運用部門から組織的に分離されたリスク管理部が、約款の遵守状況等、ファンドの運営状況を日々モニタリングし、抵触があった場合直ちに担当運用グループへ状況確認がなされます。担当運用グループは対応結果をリスク管理部へ報告します。

運用評価委員会では、ファンドの運用方針の実行状況、運用状況の分析結果を確認します。また、運用の分析、評価結果、運用リスク状況、法令諸規則、運用ガイドライン、約款の遵守状況についても報告されます。

【ファンドの運用体制】



リスク管理部は9名程度、運用企画部は11名程度で構成されています。

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

ロ 委託会社によるファンドの関係法人（販売会社を除く）に対する管理体制

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

（４）【分配方針】

毎年１回（原則として12月20日。休業日の場合は翌営業日となります。）決算を行い、以下の方針に基づき分配金額を決定します。

- イ 分配対象額は、繰越分を含めた利子・配当収入と売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。
- ロ 分配金額は委託会社が基準価額水準、市況動向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は、委託会社の判断により分配を行わない場合もあるため、将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。
- ハ 留保益の運用については特に制限を設けず、委託会社の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。

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

（５）【投資制限】

ファンドの信託約款に基づく投資制限

- イ 投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。
- ロ 投資信託証券への投資を除いては、ＣＰ、預金、指定金銭信託、コール・ローンおよび手形割引市場において売買される手形以外には投資を行いません。
- ハ 外貨建資産への直接投資は行いません。

二 資金の借入れ

- （イ）委託会社は、信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性に資するため、一部解約に伴う支払資金の手当て（一部解約に伴う支払資金の手当てのために借り入れた資金の返済を含みます。）を目的として、または再投資にかかる収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金の借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。
 - （ロ）一部解約に伴う支払資金の手当てにかかる借入期間は、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償還金の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。ただし、資金借入額は、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%を超えないこととします。
 - （ハ）収益分配金の再投資にかかる借入期間は信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。
- （二）借入金の利息は信託財産中より支弁します。

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。

〔参考情報：投資対象とする投資信託の概要〕

〔S M A M・国内株式パッシブ・ファンド（適格機関投資家専用）〕

(1) 運用会社等

- イ 委託会社 三井住友アセットマネジメント株式会社
 ロ 受託会社 三井住友信託銀行株式会社

(2) 投資方針等

イ 基本方針

S M A M・国内株式パッシブ・ファンド（適格機関投資家専用）は、国内株式インデックス・マザーファンド（B号）（以下「マザーファンド」といいます。）受益証券への投資を通じて、主としてわが国の株式に投資し、T O P I X（東証株価指数、配当込み）と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) 主としてマザーファンド受益証券への投資を通じて、東京証券取引所第1部に上場している株式に投資を行い、T O P I X（東証株価指数、配当込み）と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（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。

マザーファンドにおいては、主として東京証券取引所第1部に上場している株式に投資を行い、T O P I X（東証株価指数、配当込み）と連動する投資成果を目指して運用を行います。

東証株価指数（T O P I X）は、東京証券取引所の知的財産で、この指数の算出、数値の公表、利用など株価指数に関するすべての権利は東京証券取引所が有しています。東京証券取引所は、T O P I Xの算出もしくは公表の方法の変更、T O P I Xの算出もしくは公表の停止またはT O P I Xの商標の変更もしくは使用の停止を行う権利を有しています。また、東京証券取引所は「S M A M・国内株式パッシブ・ファンド（適格機関投資家専用）」および当ファンドとは何ら関係なく、その運用成果に対して一切の責任を負うものではありません。

ハ 主な投資制限

- (イ) 外貨建資産への投資は行いません。
 (ロ) 株式への実質投資割合には制限を設けません。

(3) その他

- イ 信託報酬 このファンドの信託財産の純資産総額に年0.081%（税抜き0.075%）を乗じて得た額
- ロ 手数料 取得申込時および換金時には手数料はかかりません。
- ハ 信託財産留保額 取得申込時および解約請求時にそれぞれ受付日の翌営業日の基準価額に対して0.08%

二 決算日 毎年1回（原則として11月30日）

〔SMAM・年金国内債券パッシブファンド＜適格機関投資家限定＞〕

(1) 運用会社等

- イ 委託会社 三井住友アセットマネジメント株式会社
 ロ 受託会社 三井住友信託銀行株式会社

(2) 投資方針等

イ 基本方針

SMAM・年金国内債券パッシブファンド＜適格機関投資家限定＞は、国内債券（NOMURA - BPI）マザーファンド（以下「マザーファンド」といいます。）受益証券への投資を通じて、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) 主としてマザーファンド受益証券およびわが国の公社債に投資を行い、NOMURA - BPI（総合）に連動する投資成果を目指します。
 (ロ) マザーファンド受益証券の組入比率は、原則として高位を保ちます。ただし、ファンド設定当初や解約・償還への対応などの事情により変更することもあります。
 (ハ) 運用の効率化を図るため、有価証券先物取引等を利用することもあります。

マザーファンドにおいては、主としてわが国の公社債および短期金融資産に投資し、安定した利子等収益および売買益の確保を目指すとともに、NOMURA - BPI（総合）の動きに連動する投資成果を目指します。

NOMURA - BPI（総合）は、野村証券株式会社が公表している指数で、その知的財産権は野村証券株式会社およびその許諾者に帰属します。なお、野村証券株式会社およびその許諾者は、NOMURA - BPI（総合）を用いて行われる三井住友アセットマネジメント株式会社の事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。また、野村証券株式会社およびその許諾者は「SMAM・年金国内債券パッシブファンド＜適格機関投資家限定＞」および当ファンドとは何ら関係なく、その運用成果に対して一切の責任を負うものではありません。

八 主な投資制限

- (イ) マザーファンド受益証券への投資割合には、制限を設けません。
 (ロ) 株式への投資は、転換社債の転換および転換社債型新株予約権付社債の新株予約権の行使による取得に限るものとし、かつ、その投資割合は信託財産の純資産総額の10%以下とします。
 (ハ) 同一銘柄の株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。
 (ニ) 同一銘柄の転換社債および転換社債型新株予約権付社債への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。
 (ホ) 外貨建資産への投資は行いません。

(3) その他

- イ 信託報酬 このファンドの信託財産の純資産総額に年0.054%（税抜き0.05%）を乗じて得た額
 ロ 手数料 取得申込時および換金時には手数料はかかりません。
 ハ 信託財産留保額 取得申込時および解約請求時にそれぞれ受付日の基準価額に対して0.03%
 ニ 決算日 毎年1回（原則として6月20日）

〔SMAM・外国株式パッシブ・ファンド（適格機関投資家専用）〕

(1) 運用会社等

- イ 委託会社 三井住友アセットマネジメント株式会社

□ 受託会社 三井住友信託銀行株式会社

(2) 投資方針等

イ 基本方針

S M A M ・外国株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)は、外国株式インデックス・マザーファンド(以下「マザーファンド」といいます。)受益証券への投資を通じて、主として日本を除く世界各国の株式に投資し、M S C I - K O K U S A I インデックス(円ベース)と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) 主としてマザーファンド受益証券への投資を通じて、世界各国の株式に投資し、M S C I - K O K U S A I インデックス(円ベース)と連動する投資成果を目指して運用を行います。

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

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

マザーファンドにおいては、主として日本を除く世界各国の株式に投資し、M S C I - K O K U S A I インデックス(円ベース)と連動する投資成果を目指して運用を行います。

M S C I - K O K U S A I インデックス(円ベース)はM S C I インクの知的財産であり、指数の算出、数値の公表、利用など指数に関するすべての権利は、M S C I インクが有しています。また、M S C I インクは「S M A M ・外国株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)」および当ファンドとは何ら関係なく、その運用成果に対して一切の責任を負うものではありません。

ハ 主な投資制限

(イ) 株式への実質投資割合には制限を設けません。

(ロ) 外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。

(3) その他

イ 信託報酬 このファンドの信託財産の純資産総額に年0.081%(税抜き0.075%)を乗じて得た額

ロ 手数料 取得申込時および換金時には手数料はかかりません。

ハ 信託財産留保額 取得申込時および解約請求時にそれぞれ受付日の翌営業日の基準価額に対して0.15%

ニ 決算日 毎年1回(原則として11月30日)

[S M A M ・年金外国債券パッシブ・ファンド<適格機関投資家限定>]

(1) 運用会社等

イ 委託会社 三井住友アセットマネジメント株式会社

ロ 受託会社 三井住友信託銀行株式会社

(2) 投資方針等

イ 基本方針

S M A M ・年金外国債券パッシブ・ファンド<適格機関投資家限定>は、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。)受益証券への投資を通じて、シティ世界国債インデックス(除く日本、円ベース)と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

マザーファンド受益証券への投資を通じて、あるいは、直接、ベンチマーク採用国の国債等に投資することにより実質的に以下の運用を行います。

(イ) シティ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。

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

最小化します。

- (ハ) ベンチマークの月次の変化状況とポートフォリオのリスク量の状況を勘案しながらリバランスを行います。
- (ニ) 保有する外貨建資産については、原則として対円で為替ヘッジを行いません。
- (ホ) 公社債の組入比率は原則として高位を保ちます。
- (ヘ) 資金動向、市況動向等の急変により上記の運用が困難となった場合、暫定的に上記と異なる運用を行う場合があります。

マザーファンドにおいては、シティ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。

シティ世界国債インデックス(除く日本、円ベース)はCitigroup Index LLCの知的財産であり、指数の算出、数値の公表、利用など指数に関するすべての権利は、Citigroup Index LLCが有しています。

Citigroup Index LLCは「SMAM・年金外国債券パッシブ・ファンド<適格機関投資家限定>」および当ファンドとは何ら関係なく、その運用成果に対して一切の責任を負うものではありません。

八 主な投資制限

- (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の10%以内とします。
- (ロ) 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。
- (ハ) 外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。
- (ニ) 同一発行体の発行する債券への実質投資割合は、国債を除き、取得時において信託財産の純資産総額の5%以内とします。
- (ホ) 同一銘柄の株式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。
- (ヘ) 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、取得時において信託財産の純資産総額の5%以内とします。
- (ト) 同一銘柄の転換社債および転換社債型新株予約権付社債への実質投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の10%以内とします。

(3) その他

- | | | |
|---|---------|---|
| イ | 信託報酬 | このファンドの信託財産の純資産総額に年0.0648%（税抜き0.06%）を乗じて得た額 |
| ロ | 手数料 | 取得申込時および換金時には手数料はかかりません。 |
| ハ | 信託財産留保額 | 取得申込時および解約請求時にそれぞれ受付日の翌営業日の基準価額に対して0.1% |
| ニ | 決算日 | 毎年1回（原則として12月17日） |

〔SMAM・マネーインカムファンド<適格機関投資家限定>〕

(1) 運用会社等

- | | | |
|---|------|--------------------|
| イ | 委託会社 | 三井住友アセットマネジメント株式会社 |
| ロ | 受託会社 | 三井住友信託銀行株式会社 |

(2) 投資方針等

- イ 基本方針

SMAM・マネーインカムファンド<適格機関投資家限定>は、マネーインカム・マザーファンド（以下「マザーファンド」といいます。）を主要投資対象とし、安定した収益の確保を目指して運用を行います。また、市況動向によっては、円貨建の短期公社債および短期金融商品に直接投資を行うことがあります。
- ロ 投資態度

主として、マザーファンドへの投資を通じて、実質的に以下の運用を行います。

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

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

マザーファンドにおいては、円貨建の短期公社債および短期金融商品に投資し、安定した収益の確保を目指して運用を行います。

八 主な投資制限

(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の10%以下とします。

(ロ) 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%以下とします。

(ハ) 外貨建資産への投資は行いません。

(ニ) 同一銘柄の転換社債および転換社債型新株予約権付社債への実質投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の10%以下とします。

(3) その他

イ 信託報酬

このファンドの信託財産の純資産総額に以下の率（信託報酬率）を乗じて得た額。なお、信託報酬率は月次で見直すものとし、各月の最終営業日の翌日から翌月の最終営業日までの信託報酬率は、当該各月の最終5営業日における無担保コール翌日物レート（年率）の平均値（当該平均率）に応じ、次に掲げる率とします。

| 当該平均率の水準 | 信託報酬率 |
|-------------------------|---------------------------|
| 当該平均値が0.25%未満の場合 | 当該平均値に0.4を乗じた率 (下限は0%) |
| 当該平均値が0.25%以上0.50%未満の場合 | 年0.1% |
| 当該平均値が0.50%以上1.00%未満の場合 | 年0.14% |
| 当該平均値が1.00%以上の場合 | 年0.18% |

(注) 上記信託報酬率は税抜き

ロ 手数料

取得申込時および換金時には手数料はかかりません。

ハ 信託財産留保額

解約請求受付日の基準価額に対して0.01%

ニ 決算日

毎年1回（原則として4月13日）

ホ ベンチマーク

ありません。

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、投資信託を組み入れることにより運用を行います。当ファンドが組み入れる投資信託は、主として内外の株式や債券を投資対象としており、その価格は、保有する株式や債券の値動き、当該発行者の経営・財務状況の変化、為替相場の変動等の影響により上下します。当ファンドが組み入れる投資信託の価格の変動により、当ファンドの基準価額も上下します。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。したがって、当ファンドは預貯金とは異なり、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。また、当ファンドは、預貯金や保険契約と異なり、預金保険、貯金保険、保険契約者保護機構の保護の対象ではありません。登録金融機関は、投資者保護基金には加入していません。

当ファンドが有するリスク等（他の投資信託の組入れを通じた実質的なリスク等となります。）のうち主要なものは、以下の通りです。

(イ) 株式市場リスク

内外の政治、経済、社会情勢等の影響により株式相場が下落した場合、ファンドの基準価額が

下落する要因となります。また、個々の株式の価格はその発行企業の事業活動や財務状況、これらに対する外部的評価の変化等によって変動し、ファンドの基準価額が下落する要因となります。特に、企業が倒産や大幅な業績悪化に陥った場合、当該企業の株式の価値が大きく下落し、基準価額が大きく下落する要因となります。

(ロ) 債券市場リスク

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

(ハ) 信用リスク

ファンドが投資している有価証券や金融商品に債務不履行が発生あるいは懸念される場合に、当該有価証券や金融商品の価格が下がったり、投資資金を回収できなくなったりすることがあります。これらはファンドの基準価額が下落する要因となります。有価証券等の格付けが低い場合は、格付けの高い場合に比べてこうしたリスクがより高いものになると想定されます。

(ニ) 為替変動リスク

外貨建資産への投資は、円建資産に投資する場合の通常のリスクのほかに、為替変動による影響を受けます。ファンドが保有する外貨建資産の価格が現地通貨ベースで上昇する場合であっても、当該現地通貨が対円で下落（円高）する場合、円ベースでの評価額は下落することがあります。為替の変動（円高）は、ファンドの基準価額が下落する要因となります。

(ホ) カントリーリスク

海外に投資を行う場合には、投資する有価証券の発行者に起因するリスクのほか、投資先の国の政治・経済・社会状況の不安定化や混乱などによって投資した資金の回収が困難になることや、その影響により投資する有価証券の価格が大きく変動することがあり、基準価額が下落する要因となります。

(ヘ) 市場流動性リスク

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

(ト) 換金制限等に関する留意点

投資資産の市場流動性が低下することにより投資資産の取引等が困難となった場合は、ファンドの換金申込みの受け付けを中止すること、および既に受け付けた換金申込みを取り消すことがあります。

(チ) 収益分配金に関する留意事項

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



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

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

ロ 投資リスクの管理体制

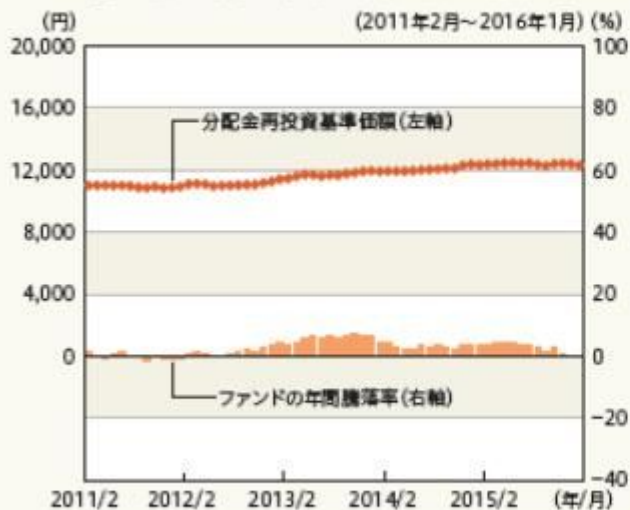
リスク管理の実効性を高め、また、コンプライアンスの徹底を図るために、運用部門から独立し

た組織（リスク管理部および法務コンプライアンス部）を設置し、ファンドの投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる確認等を行っています。リスク管理部では、主に投資信託約款・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を行います。また、法務コンプライアンス部では、主に法令・諸規則等の遵守状況についての確認等を行います。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、運用評価委員会、リスク管理委員会およびコンプライアンス委員会への報告が義務づけられています。

（参考情報）投資リスクの定量的比較

▶<2010>

〔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〕



〔ファンドと他の代表的な
資産クラスとの騰落率の比較〕



▶<2020>

〔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〕



〔ファンドと他の代表的な
資産クラスとの騰落率の比較〕



▶<2030>

〔 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 〕〔 ファンドと他の代表的な
資産クラスとの騰落率の比較 〕

▶<2040>

〔 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 〕〔 ファンドと他の代表的な
資産クラスとの騰落率の比較 〕

※左グラフは2011年2月～2016年1月の各月末におけるファンドの直近1年間の騰落率および分配金再投資基準価額の推移を表示したものです。右グラフは同期間の各月末における直近1年間の騰落率の平均・最大・最小を、ファンドおよび他の代表的な資産クラスについて表示したものです。

※ファンドの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ており、実際の基準価額とは異なります。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、分配金再投資基準価額をもとに計算しており、実際の基準価額をもとに計算したものと異なります。

※右グラフは、ファンドと代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものであり、すべての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。

＜各資産クラスの指数＞

日本株…TOPIX(配当込み)

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)

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)

日本国債…NOMURA-BPI(国債)

先進国債…シティ世界国債インデックス(除く日本、円ベース)

新興国債…JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ダイバーシファイド(円ベース)

※海外の指数は、為替ヘッジなしによる投資を想定して、円ベースとしております。

〔TOPIX(配当込み)〕は、株式会社東京証券取引所が算出、公表する指数で、東京証券取引所第一部に上場している内国普通株式全銘柄を対象としています。

〔MSCIコクサイインデックス(グロス配当込み、円ベース)〕は、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。

〔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)〕は、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。

〔NOMURA-BPI(国債)〕は、野村證券株式会社が公表する指数で、国内で発行された公募固定利付国債を対象としています。

〔シティ世界国債インデックス(除く日本、円ベース)〕は、Citigroup Index LLCが開発した指数で、日本を除く世界の主要国の国債を対象としています。

〔JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ダイバーシファイド(円ベース)〕は、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。

※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】

無手数料です。

(2) 【換金（解約）手数料】

解約手数料はありません。

(3) 【信託報酬等】

純資産総額に年0.5292%（税抜き0.49%）の率を乗じて得た金額が信託報酬として計算され、信託財産の費用として計上されます。なお、各ファンドのターゲット・イヤーに属する決算日の翌日以降年0.432%（税抜き0.4%）となります。

信託報酬は、毎計算期間の最初の6ヵ月終了日と各計算期末または信託終了のときに、信託財産中から支弁するものとします。

信託報酬 = 運用期間中の基準価額 × 信託報酬率

信託報酬の実質的配分は以下の通りです。

< 信託報酬の配分（税抜き） >

| | 委託会社 | 販売会社 | 受託会社 |
|---------------------|--------|-------|--------|
| ターゲットイヤーの 決算日まで | 年0.15% | 年0.3% | 年0.04% |
| ターゲットイヤーの 決算翌日以降 | 年0.06% | | |

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 | ファンド運用の指図等の対価 |
| 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 |

投資対象とする投資信託の信託報酬を含めた総額は、各ファンドの基本アロケーション（平成28年1月末現在）に従った場合、以下の通りとなります。なお、S M A M・マネーインカムファンド<適格機関投資家限定>は、信託報酬が変動するため、その上限額である年0.18%（税抜き）で計算しております。

| | |
|-------------|--------------------------|
| < 2 0 1 0 > | 年0.55944%（税抜き0.518%）程度 |
| < 2 0 2 0 > | 年0.599184%（税抜き0.5548%）程度 |
| < 2 0 3 0 > | 年0.597564%（税抜き0.5533%）程度 |
| < 2 0 4 0 > | 年0.602748%（税抜き0.5581%）程度 |

(4) 【その他の手数料等】

- イ 信託財産の財務諸表の監査に要する費用は、原則として、計算期間を通じて毎日、純資産総額に年0.00324%（税抜き0.003%）以内の率を乗じて得た金額が信託財産の費用として計上され、毎計算期間の最初の6ヵ月終了日と各計算期末または信託終了のときに、信託財産中から支弁するものとします。監査費用は、将来、監査法人との契約等により変更となることがあります。
- 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。

上記口、八にかかる費用に関しましては、その時々取引内容等により金額が決定し、実務上、その発生もしくは請求のつど、信託財産の費用として認識され、その時点の信託財産で負担することとなります。したがって、あらかじめ、その金額、上限額、計算方法等を具体的に記載することはできません。

当ファンドが組み入れる他の投資信託は、その委託会社、受託会社の業務の対価として、信託報酬を支払います。また、その他、当該他の投資信託の諸経費は、その信託財産から支弁されません。この費用は、当該他の投資信託の基準価額に反映され、結果的に当ファンドがその持分に依りて負担することとなります。なお、現在、当ファンドが投資を行っている他の投資信託については、取得時、換金時に手数料はかかりません。

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

（５）【課税上の取扱い】

イ 個別元本について

- （イ）追加型株式投資信託について、受益者毎の信託時の受益権の価額等（申込手数料および当該申込手数料にかかる消費税等相当額は含まれません。）が当該受益者の元本（個別元本）にあたります。
- （ロ）受益者が同一ファンドの受益権を複数回取得した場合、個別元本は、当該受益者が追加信託を行うつど当該受益者の受益権口数で加重平均することにより算出されます。ただし、同一ファンドを複数の販売会社で取得する場合には、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。）

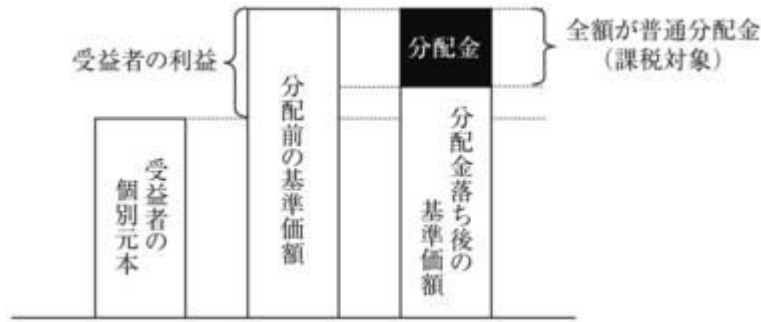
ロ 一部解約時および償還時の課税について

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。

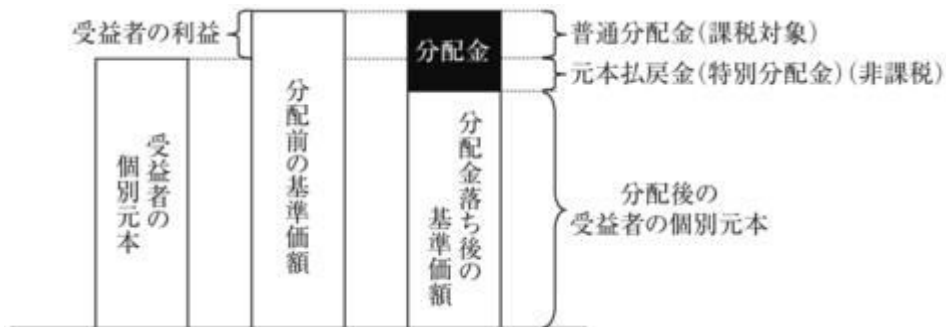
ハ 収益分配金の課税について

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）の区分がありません。

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



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



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

二 個人、法人別の課税の取扱いについて

（イ）個人の受益者に対する課税

・収益分配時

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

・一部解約時および償還時

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

また、一部解約時および償還時の損失については、確定申告により、収益分配金、特定公社債等（公募公社債投資信託を含みます。）の譲渡益および利子等、他の上場株式等にかかる譲渡益および配当等との通算が可能です。

（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。

公募株式投資信託は税法上、少額投資非課税制度「NISA（ニーサ）」の適用対象です。ただし、販売会社によっては当ファンドをNISAの適用対象としない場合があります。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

当ファンドは、受取配当にかかる益金不算入制度、配当控除の適用はありません。

少額投資非課税制度「NISA（ニーサ）」をご利用の場合、毎年、年間120万円の範囲で新た

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5年間非課税となります。
ご利用になれるのは、満20歳以上の方で、販売会社で非課税口座を開設する等、一定の条件に該当する方が対象となります。また、0歳から19歳の方を対象とした「ジュニアNISA」において、平成28年4月1日より年間80万円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5年間非課税となる予定です。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

当ファンドの外貨建資産割合および非株式割合
外貨建資産への直接投資は行いません。

非株式割合に関する制限はありません（約款規定なし）。

上記にかかわらず、確定拠出年金制度における受益者が支払いを受ける収益分配金、一部解約金、償還金はいずれも課税されません。

上記「(5)課税上の取扱い」ほか税制に関する本書の記載は、平成28年1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。

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

5【運用状況】

(1)【投資状況】

三井住友・DC年金プラン・ファンド（ターゲット・イヤー型）2010

平成28年 1月29日現在

| 資産の種類 | 国/地域 | 時価合計 (円) | 投資比率 (%) |
|---------------------|------|-------------|-------------|
| 投資信託受益証券 | 日本 | 516,991,683 | 98.70 |
| 現金・預金・その他の資産(負債控除後) | | 6,816,731 | 1.30 |
| 合計(純資産総額) | | 523,808,414 | 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年金プラン・ファンド（ターゲット・イヤー型）2020

平成28年 1月29日現在

| 資産の種類 | 国/地域 | 時価合計 (円) | 投資比率 (%) |
|---------------------|------|---------------|-------------|
| 投資信託受益証券 | 日本 | 1,204,122,639 | 99.37 |
| 現金・預金・その他の資産(負債控除後) | | 7,666,801 | 0.63 |
| 合計(純資産総額) | | 1,211,789,440 | 100.00 |

三井住友・DC年金プラン・ファンド（ターゲット・イヤー型）2030

平成28年 1月29日現在

| 資産の種類 | 国/地域 | 時価合計 (円) | 投資比率 (%) |
|---------------------|------|---------------|-------------|
| 投資信託受益証券 | 日本 | 1,160,950,957 | 98.98 |
| 現金・預金・その他の資産(負債控除後) | | 11,964,768 | 1.02 |
| 合計(純資産総額) | | 1,172,915,725 | 100.00 |

三井住友・DC年金プラン・ファンド(ターゲット・イヤー型)2040

平成28年 1月29日現在

| 資産の種類 | 国/地域 | 時価合計 (円) | 投資比率 (%) |
|---------------------|------|---------------|-------------|
| 投資信託受益証券 | 日本 | 1,751,955,305 | 99.44 |
| 現金・預金・その他の資産(負債控除後) | | 9,815,991 | 0.56 |
| 合計(純資産総額) | | 1,761,771,296 | 100.00 |

(2)【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

三井住友・DC年金プラン・ファンド(ターゲット・イヤー型)2010

イ 主要投資銘柄

平成28年 1月29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 | 投資信託受益証券 | SMAM・マネーインカムファンド <適格機関投資家限定> | 257,619,034 | 1.0087 | 259,885,308 | 1.0085 | 259,808,795 | 49.60 |
| 日本 | 投資信託受益証券 | SMAM・年金国内債券パッシブ ファンド<適格機関投資家限定> | 145,089,886 | 1.2465 | 180,857,120 | 1.2526 | 181,739,591 | 34.70 |
| 日本 | 投資信託受益証券 | SMAM・年金外国債券パッシブ・ ファンド<適格機関投資家限定> | 14,633,423 | 1.7811 | 26,064,720 | 1.7932 | 26,240,654 | 5.01 |
| 日本 | 投資信託受益証券 | SMAM・外国株式パッシブ・ファ ンド(適格機関投資家専用) | 12,463,025 | 2.1346 | 26,603,611 | 2.0059 | 24,999,581 | 4.77 |
| 日本 | 投資信託受益証券 | SMAM・国内株式パッシブ・ファ ンド(適格機関投資家専用) | 18,162,286 | 1.4653 | 26,614,038 | 1.3326 | 24,203,062 | 4.62 |

以上が、当ファンドが保有する有価証券のすべてです。

ロ 種類別の投資比率

平成28年 1月29日現在

| 種類 | 投資比率(%) |
|----------|---------|
| 投資信託受益証券 | 98.70 |
| 合計 | 98.70 |

三井住友・DC年金プラン・ファンド（ターゲット・イヤー型）2020

イ 主要投資銘柄

平成28年 1月29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 | 投資信託受益 証券 | S M A M・年金国内債券バッシブ ファンド<適格機関投資家限定> | 604,363,508 | 1.2465 | 753,345,760 | 1.2526 | 757,025,730 | 62.47 |
| 日本 | 投資信託受益 証券 | S M A M・年金外国債券バッシブ・ ファンド<適格機関投資家限定> | 84,564,441 | 1.782 | 150,693,833 | 1.7932 | 151,640,955 | 12.51 |
| 日本 | 投資信託受益 証券 | S M A M・国内株式バッシブ・ファ ンド（適格機関投資家専用） | 97,936,667 | 1.4692 | 143,891,255 | 1.3326 | 130,510,402 | 10.77 |
| 日本 | 投資信託受益 証券 | S M A M・外国株式バッシブ・ファ ンド（適格機関投資家専用） | 42,976,548 | 2.1405 | 91,991,300 | 2.0059 | 86,206,657 | 7.11 |
| 日本 | 投資信託受益 証券 | S M A M・マネーインカムファンド <適格機関投資家限定> | 78,075,256 | 1.0087 | 78,760,853 | 1.0085 | 78,738,895 | 6.50 |

以上が、当ファンドが保有する有価証券のすべてです。

ロ 種類別の投資比率

平成28年 1月29日現在

| 種類 | 投資比率（%） |
|----------|---------|
| 投資信託受益証券 | 99.37 |
| 合計 | 99.37 |

三井住友・DC年金プラン・ファンド（ターゲット・イヤー型）2030

イ 主要投資銘柄

平成28年 1月29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 | 投資信託受益 証券 | S M A M・年金国内債券バッシブ ファンド<適格機関投資家限定> | 443,261,128 | 1.2465 | 552,525,439 | 1.2526 | 555,228,888 | 47.34 |
| 日本 | 投資信託受益 証券 | S M A M・国内株式バッシブ・ファ ンド（適格機関投資家専用） | 217,000,034 | 1.4656 | 318,038,533 | 1.3326 | 289,174,245 | 24.65 |
| 日本 | 投資信託受益 証券 | S M A M・外国株式バッシブ・ファ ンド（適格機関投資家専用） | 76,337,020 | 2.1405 | 163,399,391 | 2.0059 | 153,124,428 | 13.06 |
| 日本 | 投資信託受益 証券 | S M A M・年金外国債券バッシブ・ ファンド<適格機関投資家限定> | 78,726,958 | 1.7793 | 140,080,850 | 1.7932 | 141,173,181 | 12.04 |
| 日本 | 投資信託受益 証券 | S M A M・マネーインカムファンド <適格機関投資家限定> | 22,062,683 | 1.0087 | 22,256,812 | 1.0085 | 22,250,215 | 1.90 |

以上が、当ファンドが保有する有価証券のすべてです。

ロ 種類別の投資比率

平成28年 1月29日現在

| 種類 | 投資比率（％） |
|----------|---------|
| 投資信託受益証券 | 98.98 |
| 合計 | 98.98 |

三井住友・DC年金プラン・ファンド（ターゲット・イヤー型）2040

イ 主要投資銘柄

平成28年 1月29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 | 投資信託受益証券 | S M A M ・ 国内株式パッシブ・ファンド（適格機関投資家専用） | 536,381,662 | 1.465 | 785,802,353 | 1.3326 | 714,782,202 | 40.57 |
| 日本 | 投資信託受益証券 | S M A M ・ 年金国内債券パッシブファンド＜適格機関投資家限定＞ | 417,711,005 | 1.2465 | 520,713,526 | 1.2526 | 523,224,804 | 29.70 |
| 日本 | 投資信託受益証券 | S M A M ・ 外国株式パッシブ・ファンド（適格機関投資家専用） | 149,775,411 | 2.1358 | 319,905,145 | 2.0059 | 300,434,496 | 17.05 |
| 日本 | 投資信託受益証券 | S M A M ・ 年金外国債券パッシブ・ファンド＜適格機関投資家限定＞ | 100,038,041 | 1.7819 | 178,258,285 | 1.7932 | 179,388,215 | 10.18 |
| 日本 | 投資信託受益証券 | S M A M ・ マネーインカムファンド＜適格機関投資家限定＞ | 33,837,966 | 1.0088 | 34,135,740 | 1.0085 | 34,125,588 | 1.94 |

以上が、当ファンドが保有する有価証券のすべてです。

ロ 種類別の投資比率

平成28年 1月29日現在

| 種類 | 投資比率（％） |
|----------|---------|
| 投資信託受益証券 | 99.44 |
| 合計 | 99.44 |

【投資不動産物件】

三井住友・DC年金プラン・ファンド（ターゲット・イヤー型）2010

該当事項はありません。

三井住友・DC年金プラン・ファンド（ターゲット・イヤー型）2020

該当事項はありません。

三井住友・DC年金プラン・ファンド（ターゲット・イヤー型）2030

該当事項はありません。

三井住友・DC年金プラン・ファンド（ターゲット・イヤー型）2040

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

三井住友・DC年金プラン・ファンド（ターゲット・イヤー型）2010

該当事項はありません。

三井住友・DC年金プラン・ファンド(ターゲット・イヤー型)2020

該当事項はありません。

三井住友・DC年金プラン・ファンド(ターゲット・イヤー型)2030

該当事項はありません。

三井住友・DC年金プラン・ファンド(ターゲット・イヤー型)2040

該当事項はありません。

(3)【運用実績】

【純資産の推移】

三井住友・DC年金プラン・ファンド(ターゲット・イヤー型)2010

| 年月日 | 純資産総額 (円) | | 1万口当たりの 純資産額(円) | |
|--------------------|--------------|-------------|--------------------|--------|
| | (分配落) | (分配付) | (分配落) | (分配付) |
| 第6期 (平成18年12月20日) | 160,590,675 | 160,590,675 | 11,048 | 11,048 |
| 第7期 (平成19年12月20日) | 217,158,042 | 217,158,042 | 11,245 | 11,245 |
| 第8期 (平成20年12月22日) | 238,566,878 | 238,566,878 | 10,578 | 10,578 |
| 第9期 (平成21年12月21日) | 301,495,735 | 301,495,735 | 10,921 | 10,921 |
| 第10期 (平成22年12月20日) | 324,751,925 | 324,751,925 | 10,941 | 10,941 |
| 第11期 (平成23年12月20日) | 329,392,588 | 329,392,588 | 10,818 | 10,818 |
| 第12期 (平成24年12月20日) | 348,417,250 | 348,417,250 | 11,198 | 11,198 |
| 第13期 (平成25年12月20日) | 406,358,497 | 406,358,497 | 11,884 | 11,884 |
| 第14期 (平成26年12月22日) | 490,170,412 | 490,170,412 | 12,303 | 12,303 |
| 第15期 (平成27年12月21日) | 524,035,669 | 524,035,669 | 12,346 | 12,346 |
| 平成27年 1月末日 | 491,472,347 | | 12,282 | |
| 2月末日 | 493,079,199 | | 12,335 | |
| 3月末日 | 494,711,844 | | 12,355 | |
| 4月末日 | 496,174,221 | | 12,400 | |
| 5月末日 | 498,897,492 | | 12,416 | |
| 6月末日 | 498,996,564 | | 12,368 | |
| 7月末日 | 499,892,449 | | 12,405 | |

| | | | | |
|------------|-------------|--|--------|--|
| 8月末日 | 500,892,786 | | 12,317 | |
| 9月末日 | 504,017,056 | | 12,221 | |
| 10月末日 | 517,956,844 | | 12,362 | |
| 11月末日 | 522,800,588 | | 12,380 | |
| 12月末日 | 525,325,174 | | 12,360 | |
| 平成28年 1月末日 | 523,808,414 | | 12,269 | |

三井住友・DC年金プラン・ファンド（ターゲット・イヤー型）2020

| 年月日 | 純資産総額 （円） | | 1万口当たりの 純資産額（円） | |
|-------------------|---------------|---------------|--------------------|--------|
| | （分配落） | （分配付） | （分配落） | （分配付） |
| 第6期（平成18年12月20日） | 156,345,353 | 156,345,353 | 12,355 | 12,355 |
| 第7期（平成19年12月20日） | 244,051,631 | 244,051,631 | 12,244 | 12,244 |
| 第8期（平成20年12月22日） | 258,579,003 | 258,579,003 | 10,124 | 10,124 |
| 第9期（平成21年12月21日） | 364,838,536 | 364,838,536 | 10,782 | 10,782 |
| 第10期（平成22年12月20日） | 460,154,017 | 460,154,017 | 10,871 | 10,871 |
| 第11期（平成23年12月20日） | 503,354,494 | 503,354,494 | 10,466 | 10,466 |
| 第12期（平成24年12月20日） | 605,756,824 | 605,756,824 | 11,419 | 11,419 |
| 第13期（平成25年12月20日） | 792,418,477 | 792,418,477 | 13,210 | 13,210 |
| 第14期（平成26年12月22日） | 1,042,332,411 | 1,042,332,411 | 14,223 | 14,223 |
| 第15期（平成27年12月21日） | 1,219,971,427 | 1,219,971,427 | 14,395 | 14,395 |
| 平成27年 1月末日 | 1,030,923,746 | | 14,173 | |
| 2月末日 | 1,050,857,695 | | 14,327 | |
| 3月末日 | 1,064,841,394 | | 14,388 | |
| 4月末日 | 1,092,731,596 | | 14,509 | |
| 5月末日 | 1,099,587,487 | | 14,575 | |
| 6月末日 | 1,134,667,256 | | 14,453 | |
| 7月末日 | 1,155,191,227 | | 14,542 | |
| 8月末日 | 1,162,350,380 | | 14,336 | |
| 9月末日 | 1,153,473,314 | | 14,096 | |
| 10月末日 | 1,206,044,968 | | 14,426 | |
| 11月末日 | 1,222,349,164 | | 14,482 | |
| 12月末日 | 1,223,649,680 | | 14,419 | |
| 平成28年 1月末日 | 1,211,789,440 | | 14,215 | |

三井住友・DC年金プラン・ファンド（ターゲット・イヤー型）2030

| 年月日 | 純資産総額 （円） | | 1万口当たりの 純資産額（円） | |
|-----|--------------|-------|--------------------|-------|
| | （分配落） | （分配付） | （分配落） | （分配付） |

| | | | | | |
|------|---------------|---------------|---------------|--------|--------|
| 第6期 | (平成18年12月20日) | 101,147,764 | 101,147,764 | 13,183 | 13,183 |
| 第7期 | (平成19年12月20日) | 149,262,430 | 149,262,430 | 12,809 | 12,809 |
| 第8期 | (平成20年12月22日) | 146,078,912 | 146,078,912 | 9,332 | 9,332 |
| 第9期 | (平成21年12月21日) | 214,049,126 | 214,049,126 | 10,168 | 10,168 |
| 第10期 | (平成22年12月20日) | 266,798,732 | 266,798,732 | 10,308 | 10,308 |
| 第11期 | (平成23年12月20日) | 273,003,638 | 273,003,638 | 9,525 | 9,525 |
| 第12期 | (平成24年12月20日) | 367,329,083 | 367,329,083 | 10,766 | 10,766 |
| 第13期 | (平成25年12月20日) | 541,345,607 | 541,345,607 | 13,445 | 13,445 |
| 第14期 | (平成26年12月22日) | 773,129,050 | 773,129,050 | 14,814 | 14,814 |
| 第15期 | (平成27年12月21日) | 1,197,113,384 | 1,197,113,384 | 15,141 | 15,141 |
| | 平成27年 1月末日 | 804,892,890 | | 14,747 | |
| | 2月末日 | 1,052,154,501 | | 15,098 | |
| | 3月末日 | 1,067,745,790 | | 15,219 | |
| | 4月末日 | 1,095,055,944 | | 15,437 | |
| | 5月末日 | 1,123,638,377 | | 15,614 | |
| | 6月末日 | 1,129,545,198 | | 15,390 | |
| | 7月末日 | 1,158,727,771 | | 15,531 | |
| | 8月末日 | 1,148,238,864 | | 15,107 | |
| | 9月末日 | 1,122,462,534 | | 14,550 | |
| | 10月末日 | 1,194,202,289 | | 15,234 | |
| | 11月末日 | 1,213,566,368 | | 15,372 | |
| | 12月末日 | 1,204,043,957 | | 15,206 | |
| | 平成28年 1月末日 | 1,172,915,725 | | 14,688 | |

三井住友・DC年金プラン・ファンド（ターゲット・イヤー型）2040

| 年月日 | 純資産総額 (円) | | 1万口当たりの 純資産額(円) | | |
|------|---------------|---------------|--------------------|--------|--------|
| | (分配落) | (分配付) | (分配落) | (分配付) | |
| 第6期 | (平成18年12月20日) | 113,160,193 | 113,160,193 | 13,668 | 13,668 |
| 第7期 | (平成19年12月20日) | 143,523,897 | 143,523,897 | 13,111 | 13,111 |
| 第8期 | (平成20年12月22日) | 134,815,396 | 134,815,396 | 8,596 | 8,596 |
| 第9期 | (平成21年12月21日) | 188,270,881 | 188,270,881 | 9,559 | 9,559 |
| 第10期 | (平成22年12月20日) | 231,956,041 | 231,956,041 | 9,713 | 9,713 |
| 第11期 | (平成23年12月20日) | 230,424,744 | 230,424,744 | 8,586 | 8,586 |
| 第12期 | (平成24年12月20日) | 287,659,579 | 287,659,579 | 10,038 | 10,038 |
| 第13期 | (平成25年12月20日) | 445,842,340 | 445,842,340 | 13,541 | 13,541 |
| 第14期 | (平成26年12月22日) | 588,648,311 | 588,648,311 | 15,256 | 15,256 |
| 第15期 | (平成27年12月21日) | 1,837,523,740 | 1,837,523,740 | 15,742 | 15,742 |
| | 平成27年 1月末日 | 614,756,720 | | 15,181 | |
| | 2月末日 | 1,692,602,666 | | 15,702 | |
| | 3月末日 | 1,723,042,376 | | 15,898 | |

| | | | |
|------------|---------------|--|--------|
| 4月末日 | 1,771,588,308 | | 16,234 |
| 5月末日 | 1,792,866,183 | | 16,546 |
| 6月末日 | 1,786,247,452 | | 16,206 |
| 7月末日 | 1,806,373,560 | | 16,402 |
| 8月末日 | 1,765,710,913 | | 15,744 |
| 9月末日 | 1,696,686,598 | | 14,854 |
| 10月末日 | 1,830,075,585 | | 15,892 |
| 11月末日 | 1,864,097,021 | | 16,119 |
| 12月末日 | 1,848,893,834 | | 15,840 |
| 平成28年 1月末日 | 1,761,771,296 | | 14,991 |

【分配の推移】

三井住友・DC年金プラン・ファンド（ターゲット・イヤー型）2010

| | 計算期間 | 1万口当たり分配金（円） |
|------|-------------------------|--------------|
| 第6期 | 平成17年12月21日～平成18年12月20日 | 0 |
| 第7期 | 平成18年12月21日～平成19年12月20日 | 0 |
| 第8期 | 平成19年12月21日～平成20年12月22日 | 0 |
| 第9期 | 平成20年12月23日～平成21年12月21日 | 0 |
| 第10期 | 平成21年12月22日～平成22年12月20日 | 0 |
| 第11期 | 平成22年12月21日～平成23年12月20日 | 0 |
| 第12期 | 平成23年12月21日～平成24年12月20日 | 0 |
| 第13期 | 平成24年12月21日～平成25年12月20日 | 0 |
| 第14期 | 平成25年12月21日～平成26年12月22日 | 0 |
| 第15期 | 平成26年12月23日～平成27年12月21日 | 0 |

三井住友・DC年金プラン・ファンド（ターゲット・イヤー型）2020

| | 計算期間 | 1万口当たり分配金（円） |
|------|-------------------------|--------------|
| 第6期 | 平成17年12月21日～平成18年12月20日 | 0 |
| 第7期 | 平成18年12月21日～平成19年12月20日 | 0 |
| 第8期 | 平成19年12月21日～平成20年12月22日 | 0 |
| 第9期 | 平成20年12月23日～平成21年12月21日 | 0 |
| 第10期 | 平成21年12月22日～平成22年12月20日 | 0 |
| 第11期 | 平成22年12月21日～平成23年12月20日 | 0 |
| 第12期 | 平成23年12月21日～平成24年12月20日 | 0 |
| 第13期 | 平成24年12月21日～平成25年12月20日 | 0 |
| 第14期 | 平成25年12月21日～平成26年12月22日 | 0 |
| 第15期 | 平成26年12月23日～平成27年12月21日 | 0 |

三井住友・DC年金プラン・ファンド（ターゲット・イヤー型）2030

| | 計算期間 | 1万口当たり分配金（円） |
|------|-------------------------|--------------|
| 第6期 | 平成17年12月21日～平成18年12月20日 | 0 |
| 第7期 | 平成18年12月21日～平成19年12月20日 | 0 |
| 第8期 | 平成19年12月21日～平成20年12月22日 | 0 |
| 第9期 | 平成20年12月23日～平成21年12月21日 | 0 |
| 第10期 | 平成21年12月22日～平成22年12月20日 | 0 |
| 第11期 | 平成22年12月21日～平成23年12月20日 | 0 |
| 第12期 | 平成23年12月21日～平成24年12月20日 | 0 |
| 第13期 | 平成24年12月21日～平成25年12月20日 | 0 |
| 第14期 | 平成25年12月21日～平成26年12月22日 | 0 |
| 第15期 | 平成26年12月23日～平成27年12月21日 | 0 |

三井住友・DC年金プラン・ファンド（ターゲット・イヤー型）2040

| | 計算期間 | 1万口当たり分配金（円） |
|------|-------------------------|--------------|
| 第6期 | 平成17年12月21日～平成18年12月20日 | 0 |
| 第7期 | 平成18年12月21日～平成19年12月20日 | 0 |
| 第8期 | 平成19年12月21日～平成20年12月22日 | 0 |
| 第9期 | 平成20年12月23日～平成21年12月21日 | 0 |
| 第10期 | 平成21年12月22日～平成22年12月20日 | 0 |
| 第11期 | 平成22年12月21日～平成23年12月20日 | 0 |
| 第12期 | 平成23年12月21日～平成24年12月20日 | 0 |
| 第13期 | 平成24年12月21日～平成25年12月20日 | 0 |
| 第14期 | 平成25年12月21日～平成26年12月22日 | 0 |
| 第15期 | 平成26年12月23日～平成27年12月21日 | 0 |

【収益率の推移】

三井住友・DC年金プラン・ファンド（ターゲット・イヤー型）2010

| | 収益率（％） |
|------|--------|
| 第6期 | 2.5 |
| 第7期 | 1.8 |
| 第8期 | 5.9 |
| 第9期 | 3.2 |
| 第10期 | 0.2 |
| 第11期 | 1.1 |

| | |
|------|-----|
| 第12期 | 3.5 |
| 第13期 | 6.1 |
| 第14期 | 3.5 |
| 第15期 | 0.3 |

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

三井住友・DC年金プラン・ファンド(ターゲット・イヤー型) 2020

| | 収益率(%) |
|------|--------|
| 第6期 | 6.0 |
| 第7期 | 0.9 |
| 第8期 | 17.3 |
| 第9期 | 6.5 |
| 第10期 | 0.8 |
| 第11期 | 3.7 |
| 第12期 | 9.1 |
| 第13期 | 15.7 |
| 第14期 | 7.7 |
| 第15期 | 1.2 |

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

三井住友・DC年金プラン・ファンド(ターゲット・イヤー型) 2030

| | 収益率(%) |
|------|--------|
| 第6期 | 8.3 |
| 第7期 | 2.8 |
| 第8期 | 27.1 |
| 第9期 | 9.0 |
| 第10期 | 1.4 |
| 第11期 | 7.6 |
| 第12期 | 13.0 |
| 第13期 | 24.9 |
| 第14期 | 10.2 |
| 第15期 | 2.2 |

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

三井住友・DC年金プラン・ファンド(ターゲット・イヤー型) 2040

| | 収益率(%) |
|------|--------|
| 第6期 | 9.8 |
| 第7期 | 4.1 |
| 第8期 | 34.4 |
| 第9期 | 11.2 |
| 第10期 | 1.6 |
| 第11期 | 11.6 |
| 第12期 | 16.9 |
| 第13期 | 34.9 |
| 第14期 | 12.7 |
| 第15期 | 3.2 |

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

(4) 【設定及び解約の実績】

三井住友・DC年金プラン・ファンド(ターゲット・イヤー型) 2010

| | 設定口数(口) | 解約口数(口) |
|------|------------|------------|
| 第6期 | 55,018,651 | 19,583,375 |
| 第7期 | 68,363,183 | 20,609,878 |
| 第8期 | 56,897,891 | 24,476,235 |
| 第9期 | 64,237,153 | 13,713,349 |
| 第10期 | 56,241,790 | 35,487,520 |
| 第11期 | 50,688,810 | 43,023,358 |
| 第12期 | 33,162,080 | 26,499,660 |
| 第13期 | 71,424,035 | 40,643,048 |
| 第14期 | 84,271,259 | 27,787,920 |
| 第15期 | 81,915,864 | 55,862,170 |

(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年金プラン・ファンド(ターゲット・イヤー型) 2020

| | 設定口数(口) | 解約口数(口) |
|------|-------------|------------|
| 第6期 | 45,933,217 | 19,605,145 |
| 第7期 | 83,458,432 | 10,678,494 |
| 第8期 | 83,157,158 | 27,059,755 |
| 第9期 | 95,242,920 | 12,283,196 |
| 第10期 | 111,793,677 | 26,894,086 |
| 第11期 | 87,891,359 | 30,227,601 |
| 第12期 | 85,709,743 | 36,186,583 |

| | | |
|------|-------------|------------|
| 第13期 | 124,684,453 | 55,291,960 |
| 第14期 | 174,116,846 | 41,116,178 |
| 第15期 | 173,855,110 | 59,244,453 |

（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年金プラン・ファンド（ターゲット・イヤー型）2030

| | 設定口数（口） | 解約口数（口） |
|------|-------------|------------|
| 第6期 | 34,029,711 | 3,275,922 |
| 第7期 | 48,479,281 | 8,680,254 |
| 第8期 | 58,044,415 | 18,035,819 |
| 第9期 | 63,896,452 | 9,917,639 |
| 第10期 | 58,503,162 | 10,182,239 |
| 第11期 | 47,890,237 | 20,123,017 |
| 第12期 | 65,335,257 | 10,757,941 |
| 第13期 | 97,849,986 | 36,394,176 |
| 第14期 | 146,378,903 | 27,109,912 |
| 第15期 | 326,685,857 | 57,957,924 |

（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年金プラン・ファンド（ターゲット・イヤー型）2040

| | 設定口数（口） | 解約口数（口） |
|------|-------------|-------------|
| 第6期 | 51,096,621 | 19,739,396 |
| 第7期 | 50,628,800 | 23,956,246 |
| 第8期 | 65,487,055 | 18,108,518 |
| 第9期 | 57,723,829 | 17,613,224 |
| 第10期 | 52,737,375 | 10,883,373 |
| 第11期 | 49,611,557 | 20,043,137 |
| 第12期 | 48,930,836 | 30,725,942 |
| 第13期 | 84,609,174 | 41,944,386 |
| 第14期 | 92,910,684 | 36,318,727 |
| 第15期 | 941,205,290 | 159,802,718 |

（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

S M A M ・国内株式パッシブ・ファンド（適格機関投資家専用）

| 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 | 32,243,256,945 | 100.01 |
| 現金・預金・その他の資産(負債控除後) | | 4,519,328 | 0.01 |
| 合計(純資産総額) | | 32,238,737,617 | 100.00 |

国内株式インデックス・マザーファンド(B号)

平成28年 1月28日現在

| 資産の種類 | 国/地域 | 時価合計 (円) | 投資比率 (%) |
|---------------------|------|-----------------|-------------|
| 株式 | 日本 | 200,780,099,810 | 98.42 |
| 現金・預金・その他の資産(負債控除後) | | 3,219,235,787 | 1.58 |
| 合計(純資産総額) | | 203,999,335,597 | 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 | 3,187,680,000 | 1.56 |
| 合計 | 買建 | | 3,187,680,000 | 1.56 |

SMAM・年金国内債券パッシブファンド<適格機関投資家限定>

平成28年 1月28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 | 32,369,787,208 | 100.01 |
| 現金・預金・その他の資産(負債控除後) | | 1,908,512 | 0.01 |
| 合計(純資産総額) | | 32,367,878,696 | 100.00 |

国内債券(NOMURA-BPI)マザーファンド

平成28年 1月28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 | 86,352,680,290 | 76.17 |
| 地方債証券 | 日本 | 7,297,512,380 | 6.44 |
| 特殊債券 | 日本 | 11,398,792,531 | 10.05 |
| 社債券 | 日本 | 6,022,649,000 | 5.31 |
| | オランダ | 503,538,000 | 0.44 |
| | オーストラリア | 400,981,000 | 0.35 |
| | アメリカ | 201,099,000 | 0.18 |
| | 小計 | 7,128,267,000 | 6.29 |
| 現金・預金・その他の資産(負債控除後) | | 1,190,957,980 | 1.05 |
| 合計(純資産総額) | | 113,368,210,181 | 100.00 |

S M A M ・ 外国株式パッシブ・ファンド（適格機関投資家専用）

平成28年 1月29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 | 21,323,443,812 | 100.01 |
| 現金・預金・その他の資産(負債控除後) | | 3,026,773 | 0.01 |
| 合計(純資産総額) | | 21,320,417,039 | 100.00 |

外国株式インデックス・マザーファンド

平成28年 1月29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 | 90,214,364,623 | 57.63 |
| | イギリス | 11,872,937,570 | 7.58 |
| | スイス | 6,410,544,965 | 4.10 |
| | フランス | 5,752,460,770 | 3.67 |
| | ドイツ | 5,672,350,945 | 3.62 |
| | カナダ | 5,237,854,332 | 3.35 |
| | オーストラリア | 3,660,386,400 | 2.34 |
| | アイルランド | 2,685,866,111 | 1.72 |
| | オランダ | 2,611,455,656 | 1.67 |
| | スペイン | 1,994,454,930 | 1.27 |
| | スウェーデン | 1,787,597,806 | 1.14 |

| | | | |
|---------------------|-----------|-----------------|--------|
| | 香港 | 1,381,397,778 | 0.88 |
| | イタリア | 1,272,586,177 | 0.81 |
| | デンマーク | 1,236,226,612 | 0.79 |
| | ベルギー | 946,695,773 | 0.60 |
| | シンガポール | 869,853,970 | 0.56 |
| | ジャージー | 735,595,609 | 0.47 |
| | フィンランド | 667,138,629 | 0.43 |
| | バミューダ | 504,322,866 | 0.32 |
| | キュラソー | 491,506,313 | 0.31 |
| | イスラエル | 472,198,983 | 0.30 |
| | ノルウェー | 359,343,528 | 0.23 |
| | ケイマン諸島 | 348,976,008 | 0.22 |
| | ルクセンブルグ | 134,350,717 | 0.09 |
| | オーストリア | 113,100,204 | 0.07 |
| | ポルトガル | 101,898,807 | 0.07 |
| | ニュージーランド | 96,769,343 | 0.06 |
| | リベリア | 74,577,444 | 0.05 |
| | 英ヴァージン諸島 | 44,364,634 | 0.03 |
| | パプアニューギニア | 32,648,470 | 0.02 |
| | マン島 | 15,201,125 | 0.01 |
| | モーリシャス | 10,483,710 | 0.01 |
| | 小計 | 147,809,510,808 | 94.43 |
| 投資証券 | アメリカ | 2,667,822,221 | 1.70 |
| | オーストラリア | 580,437,327 | 0.37 |
| | フランス | 245,833,339 | 0.16 |
| | イギリス | 203,718,392 | 0.13 |
| | 香港 | 88,020,025 | 0.06 |
| | シンガポール | 75,580,612 | 0.05 |
| | カナダ | 32,637,794 | 0.02 |
| | 小計 | 3,894,049,710 | 2.49 |
| 現金・預金・その他の資産(負債控除後) | | 4,830,511,616 | 3.08 |
| 合計(純資産総額) | | 156,534,072,134 | 100.00 |

その他以下の取引を行っております。

| 種類 | 買建 / 売建 | 国 / 地域 | 時価合計（円） | 投資比率（％） |
|----------|---------|---------|---------------|---------|
| 株価指数先物取引 | 買建 | アメリカ | 3,341,607,072 | 2.13 |
| | 買建 | ドイツ | 943,376,592 | 0.60 |
| | 買建 | イギリス | 408,132,498 | 0.26 |
| | 買建 | オーストラリア | 210,937,750 | 0.13 |
| 合計 | 買建 | | 4,904,053,912 | 3.12 |

| 種類 | 買建 / 売建 | 国 / 地域 | 時価合計（円） | 投資比率（％） |
|--------|---------|--------|-------------|---------|
| 為替予約取引 | 買建 | | 305,036,300 | 0.19 |

S M A M ・年金外国債券パッシブ・ファンド<適格機関投資家限定>

平成28年 1月29日現在

| 資産の種類 | 国 / 地域 | 時価合計（円） | 投資比率（％） |
|---------------------|--------|---------------|---------|
| 親投資信託受益証券 | 日本 | 2,690,171,711 | 100.01 |
| 現金・預金・その他の資産(負債控除後) | | 237,622 | 0.01 |
| 合計(純資産総額) | | 2,689,934,089 | 100.00 |

外国債券パッシブ・マザーファンド

平成28年 1月29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 | 83,696,046,602 | 42.69 |
| | イタリア | 18,927,440,138 | 9.65 |
| | フランス | 18,705,770,947 | 9.54 |
| | イギリス | 15,800,075,607 | 8.06 |
| | ドイツ | 14,286,128,736 | 7.29 |
| | スペイン | 10,547,301,935 | 5.38 |
| | ベルギー | 5,018,274,069 | 2.56 |
| | オランダ | 4,848,600,410 | 2.47 |
| | カナダ | 3,822,294,533 | 1.95 |

| | | | |
|---------------------|---------|-----------------|--------|
| | オーストラリア | 3,418,379,397 | 1.74 |
| | オーストリア | 2,992,433,875 | 1.53 |
| | メキシコ | 1,833,912,120 | 0.94 |
| | アイルランド | 1,630,753,351 | 0.83 |
| | デンマーク | 1,255,464,591 | 0.64 |
| | ポーランド | 994,557,024 | 0.51 |
| | フィンランド | 980,347,977 | 0.50 |
| | マレーシア | 917,590,605 | 0.47 |
| | スウェーデン | 914,164,967 | 0.47 |
| | 南アフリカ | 757,697,280 | 0.39 |
| | シンガポール | 666,232,121 | 0.34 |
| | スイス | 589,385,529 | 0.30 |
| | ノルウェー | 570,907,018 | 0.29 |
| | 小計 | 193,173,758,832 | 98.54 |
| 現金・預金・その他の資産(負債控除後) | | 2,865,687,302 | 1.46 |
| 合計(純資産総額) | | 196,039,446,134 | 100.00 |

その他以下の取引を行っております。

| 種類 | 買建/ 売建 | 国/地域 | 時価合計(円) | 投資 比率 (%) |
|--------|-----------|------|-------------|-----------------|
| 為替予約取引 | 買建 | | 110,940 | 0.00 |
| | 売建 | | 517,927,231 | 0.26 |

S M A M ・ マネーインカムファンド< 適格機関投資家限定 >

平成28年 1月28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 | 426,400,342 | 100.01 |
| 現金・預金・その他の資産(負債控除後) | | 37,901 | 0.01 |
| 合計(純資産総額) | | 426,362,441 | 100.00 |

マネーインカム・マザーファンド

平成28年 1月28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 | 648,789,300 | 44.70 |
| 特殊債券 | 日本 | 406,535,000 | 28.01 |
| 現金・預金・その他の資産(負債控除後) | | 396,037,667 | 27.29 |

| | | |
|-----------|---------------|--------|
| 合計(純資産総額) | 1,451,361,967 | 100.00 |
|-----------|---------------|--------|

(2) 投資資産

投資有価証券の主要銘柄

S M A M ・ 国内株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)

イ 主要投資銘柄

平成28年 1月28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) | 15,888,856,722 | 2.2906 | 36,395,015,208 | 2.0293 | 32,243,256,945 | 100.01 |

以上が、当ファンドが保有する有価証券のすべてです。

ロ 種類別の投資比率

平成28年 1月28日現在

| 種類 | 投資比率(%) |
|-----------|---------|
| 親投資信託受益証券 | 100.01 |
| 合計 | 100.01 |

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)

平成28年 1月28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 | 1,212,600 | 7,636.15 | 9,259,602,200 | 6,883.00 | 8,346,325,800 | 4.09 |
| 日本 | 株式 | 三菱UFJフィナンシャル・グループ | 銀行業 | 7,721,300 | 785.34 | 6,063,874,000 | 627.00 | 4,841,255,100 | 2.37 |
| 日本 | 株式 | 日本電信電話 | 情報・通信業 | 743,800 | 4,576.00 | 3,403,631,000 | 4,873.00 | 3,624,537,400 | 1.78 |
| 日本 | 株式 | 三井住友フィナンシャルグループ | 銀行業 | 770,600 | 4,679.36 | 3,605,918,619 | 4,050.00 | 3,120,930,000 | 1.53 |
| 日本 | 株式 | KDDI | 情報・通信業 | 978,300 | 3,054.62 | 2,988,337,400 | 2,922.50 | 2,859,081,750 | 1.40 |
| 日本 | 株式 | 本田技研工業 | 輸送用機器 | 877,100 | 3,981.04 | 3,491,778,700 | 3,252.00 | 2,852,329,200 | 1.40 |
| 日本 | 株式 | 日本たばこ産業 | 食料品 | 645,700 | 4,410.14 | 2,847,632,000 | 4,402.00 | 2,842,371,400 | 1.39 |
| 日本 | 株式 | みずほフィナンシャルグループ | 銀行業 | 13,559,200 | 247.37 | 3,354,224,950 | 209.30 | 2,837,940,560 | 1.39 |
| 日本 | 株式 | ソフトバンクグループ | 情報・通信業 | 545,300 | 6,496.65 | 3,542,624,400 | 5,099.00 | 2,780,484,700 | 1.36 |
| 日本 | 株式 | 武田薬品工業 | 医薬品 | 406,600 | 5,975.06 | 2,429,462,900 | 5,668.00 | 2,304,608,800 | 1.13 |

| | | | | | | | | | |
|----|----|-----------------|--------|-----------|-----------|---------------|-----------|---------------|------|
| 日本 | 株式 | セブン&アイ・ホールディングス | 小売業 | 402,400 | 5,507.36 | 2,216,162,200 | 5,055.00 | 2,034,132,000 | 1.00 |
| 日本 | 株式 | 東海旅客鉄道 | 陸運業 | 87,300 | 21,975.67 | 1,918,476,700 | 21,540.00 | 1,880,442,000 | 0.92 |
| 日本 | 株式 | アステラス製薬 | 医薬品 | 1,143,200 | 1,730.74 | 1,978,586,250 | 1,628.00 | 1,861,129,600 | 0.91 |
| 日本 | 株式 | 東日本旅客鉄道 | 陸運業 | 178,200 | 11,586.00 | 2,064,625,200 | 10,370.00 | 1,847,934,000 | 0.91 |
| 日本 | 株式 | NTTドコモ | 情報・通信業 | 742,000 | 2,332.25 | 1,730,533,800 | 2,461.50 | 1,826,433,000 | 0.90 |
| 日本 | 株式 | ファナック | 電気機器 | 99,700 | 21,819.15 | 2,175,369,700 | 18,115.00 | 1,806,065,500 | 0.89 |
| 日本 | 株式 | キヤノン | 電気機器 | 524,500 | 3,705.52 | 1,943,549,300 | 3,308.00 | 1,735,046,000 | 0.85 |
| 日本 | 株式 | 花王 | 化学 | 274,600 | 6,309.08 | 1,732,474,100 | 6,195.00 | 1,701,147,000 | 0.83 |
| 日本 | 株式 | ソニー | 電気機器 | 687,900 | 3,154.78 | 2,170,178,700 | 2,378.00 | 1,635,826,200 | 0.80 |
| 日本 | 株式 | 東京海上ホールディングス | 保険業 | 390,000 | 4,527.91 | 1,765,885,000 | 4,083.00 | 1,592,370,000 | 0.78 |
| 日本 | 株式 | 三菱地所 | 不動産業 | 715,000 | 2,576.97 | 1,842,536,000 | 2,146.50 | 1,534,747,500 | 0.75 |
| 日本 | 株式 | 日産自動車 | 輸送用機器 | 1,368,600 | 1,308.50 | 1,790,823,450 | 1,101.50 | 1,507,512,900 | 0.74 |
| 日本 | 株式 | ブリヂストン | ゴム製品 | 344,700 | 4,374.62 | 1,507,934,800 | 4,150.00 | 1,430,505,000 | 0.70 |
| 日本 | 株式 | 日立製作所 | 電気機器 | 2,487,000 | 722.20 | 1,796,131,800 | 573.30 | 1,425,797,100 | 0.70 |
| 日本 | 株式 | 村田製作所 | 電気機器 | 102,300 | 18,942.03 | 1,937,769,700 | 13,620.00 | 1,393,326,000 | 0.68 |
| 日本 | 株式 | 富士重工業 | 輸送用機器 | 307,800 | 5,071.76 | 1,561,090,500 | 4,519.00 | 1,390,948,200 | 0.68 |
| 日本 | 株式 | 三菱商事 | 卸売業 | 722,100 | 2,065.71 | 1,491,654,700 | 1,840.00 | 1,328,664,000 | 0.65 |
| 日本 | 株式 | 三井不動産 | 不動産業 | 510,000 | 3,089.17 | 1,575,480,000 | 2,574.00 | 1,312,740,000 | 0.64 |
| 日本 | 株式 | キーエンス | 電気機器 | 22,100 | 66,447.72 | 1,468,494,800 | 57,360.00 | 1,267,656,000 | 0.62 |
| 日本 | 株式 | パナソニック | 電気機器 | 1,113,700 | 1,388.92 | 1,546,850,750 | 1,086.00 | 1,209,478,200 | 0.59 |

□ 種別・業種別の投資比率

平成28年 1月28日現在

| 種類 | 国内 / 外国 | 業種 | 投資比率 (%) |
|-------|---------|----------|----------|
| 株式 | 国内 | 水産・農林業 | 0.10 |
| | | 鉱業 | 0.33 |
| | | 建設業 | 2.91 |
| | | 食料品 | 4.79 |
| | | 繊維製品 | 0.74 |
| | | パルプ・紙 | 0.24 |
| | | 化学 | 5.95 |
| | | 医薬品 | 5.49 |
| | | 石油・石炭製品 | 0.46 |
| | | ゴム製品 | 0.94 |
| | | ガラス・土石製品 | 0.94 |
| | | 鉄鋼 | 1.15 |
| | | 非鉄金属 | 0.85 |
| | | 金属製品 | 0.65 |
| | | 機械 | 4.37 |
| | | 電気機器 | 11.01 |
| 輸送用機器 | 10.45 | | |

| | | |
|----|------------|-------|
| | 精密機器 | 1.57 |
| | その他製品 | 1.48 |
| | 電気・ガス業 | 2.09 |
| | 陸運業 | 4.56 |
| | 海運業 | 0.22 |
| | 空運業 | 0.71 |
| | 倉庫・運輸関連業 | 0.21 |
| | 情報・通信業 | 7.62 |
| | 卸売業 | 4.02 |
| | 小売業 | 4.82 |
| | 銀行業 | 8.62 |
| | 証券、商品先物取引業 | 1.15 |
| | 保険業 | 2.45 |
| | その他金融業 | 1.32 |
| | 不動産業 | 2.58 |
| | サービス業 | 3.63 |
| 合計 | | 98.42 |

S M A M ・ 年 金 国 内 債 券 パ ッ シ ブ フ ァ ン ド < 適 格 機 関 投 資 家 限 定 >

イ 主要投資銘柄

平成28年 1月28日現在

| 国/地域 | 種類 | 銘柄名 | 数量 | 帳簿単価 (円) | 帳簿価額 (円) | 評価額 単価 (円) | 評価額 (円) | 投資 比率 (%) |
|------|-----------|-------------------------|----------------|-------------|----------------|------------------|----------------|-----------------|
| 日本 | 親投資信託受益証券 | 国内債券(NOMURA-BPI)マザーファンド | 23,968,742,842 | 1.3233 | 31,717,837,403 | 1.3505 | 32,369,787,208 | 100.01 |

以上が、当ファンドが保有する有価証券のすべてです。

ロ 種類別の投資比率

平成28年 1月28日現在

| 種類 | 投資比率(%) |
|-----------|---------|
| 親投資信託受益証券 | 100.01 |
| 合計 | 100.01 |

国内債券(NOMURA-BPI)マザーファンド

イ 主要投資銘柄(上位30銘柄)

平成28年 1月28日現在

| 国/地域 | 種類 | 銘柄名 | 数量 | 帳簿単価 (円) | 帳簿価額 (円) | 評価額 単価 (円) | 評価額 (円) | 利率 (%) | 償還期限 | 投資 比率 (%) |
|------|----|-----|----|-------------|-------------|------------------|------------|-----------|------|-----------------|
|------|----|-----|----|-------------|-------------|------------------|------------|-----------|------|-----------------|

| | | | | | | | | | | |
|----|------|----------------|---------------|--------|---------------|--------|---------------|-------|------------|------|
| 日本 | 国債証券 | 第293回利付国債(10年) | 1,836,000,000 | 105.32 | 1,933,726,280 | 104.32 | 1,915,351,920 | 1.800 | 2018/6/20 | 1.69 |
| 日本 | 国債証券 | 第301回利付国債(10年) | 1,503,000,000 | 105.69 | 1,588,600,900 | 105.10 | 1,579,743,180 | 1.500 | 2019/6/20 | 1.39 |
| 日本 | 国債証券 | 第306回利付国債(10年) | 1,450,000,000 | 106.15 | 1,539,175,000 | 105.78 | 1,533,810,000 | 1.400 | 2020/3/20 | 1.35 |
| 日本 | 国債証券 | 第300回利付国債(10年) | 1,420,000,000 | 105.48 | 1,497,915,400 | 104.72 | 1,487,095,000 | 1.500 | 2019/3/20 | 1.31 |
| 日本 | 国債証券 | 第296回利付国債(10年) | 1,426,000,000 | 104.82 | 1,494,733,200 | 103.99 | 1,482,897,400 | 1.500 | 2018/9/20 | 1.31 |
| 日本 | 国債証券 | 第297回利付国債(10年) | 1,344,000,000 | 104.81 | 1,408,646,400 | 104.06 | 1,398,633,600 | 1.400 | 2018/12/20 | 1.23 |
| 日本 | 国債証券 | 第305回利付国債(10年) | 1,325,000,000 | 105.45 | 1,397,212,500 | 105.04 | 1,391,859,500 | 1.300 | 2019/12/20 | 1.23 |
| 日本 | 国債証券 | 第310回利付国債(10年) | 1,325,000,000 | 104.60 | 1,385,950,000 | 104.58 | 1,385,738,000 | 1.000 | 2020/9/20 | 1.22 |
| 日本 | 国債証券 | 第299回利付国債(10年) | 1,225,000,000 | 104.74 | 1,283,065,000 | 104.09 | 1,275,212,750 | 1.300 | 2019/3/20 | 1.12 |
| 日本 | 国債証券 | 第122回利付国債(5年) | 1,240,000,000 | 100.08 | 1,241,103,600 | 100.40 | 1,245,046,800 | 0.100 | 2019/12/20 | 1.10 |
| 日本 | 国債証券 | 第292回利付国債(10年) | 1,200,000,000 | 104.62 | 1,255,440,000 | 103.66 | 1,243,956,000 | 1.700 | 2018/3/20 | 1.10 |
| 日本 | 国債証券 | 第125回利付国債(5年) | 1,200,000,000 | 100.28 | 1,203,438,100 | 100.44 | 1,205,280,000 | 0.100 | 2020/9/20 | 1.06 |
| 日本 | 国債証券 | 第315回利付国債(10年) | 1,130,000,000 | 106.29 | 1,201,077,000 | 106.42 | 1,202,636,400 | 1.200 | 2021/6/20 | 1.06 |
| 日本 | 国債証券 | 第329回利付国債(10年) | 1,105,000,000 | 104.09 | 1,150,194,500 | 105.55 | 1,166,371,700 | 0.800 | 2023/6/20 | 1.03 |
| 日本 | 国債証券 | 第317回利付国債(10年) | 1,095,000,000 | 105.90 | 1,159,606,200 | 106.16 | 1,162,517,700 | 1.100 | 2021/9/20 | 1.03 |
| 日本 | 国債証券 | 第338回利付国債(10年) | 1,125,000,000 | 99.90 | 1,123,875,000 | 102.15 | 1,149,288,750 | 0.400 | 2025/3/20 | 1.01 |
| 日本 | 国債証券 | 第328回利付国債(10年) | 1,050,000,000 | 102.60 | 1,077,313,400 | 104.01 | 1,092,178,500 | 0.600 | 2023/3/20 | 0.96 |
| 日本 | 国債証券 | 第340回利付国債(10年) | 1,070,000,000 | 100.87 | 1,079,350,450 | 101.89 | 1,090,223,000 | 0.400 | 2025/9/20 | 0.96 |
| 日本 | 国債証券 | 第313回利付国債(10年) | 1,020,000,000 | 106.66 | 1,087,932,000 | 106.64 | 1,087,728,000 | 1.300 | 2021/3/20 | 0.96 |
| 日本 | 国債証券 | 第339回利付国債(10年) | 1,030,000,000 | 100.12 | 1,031,276,200 | 102.02 | 1,050,898,700 | 0.400 | 2025/6/20 | 0.93 |
| 日本 | 国債証券 | 第312回利付国債(10年) | 985,000,000 | 105.86 | 1,042,721,000 | 105.80 | 1,042,189,100 | 1.200 | 2020/12/20 | 0.92 |
| 日本 | 国債証券 | 第333回利付国債(10年) | 1,000,000,000 | 102.24 | 1,022,441,500 | 104.07 | 1,040,730,000 | 0.600 | 2024/3/20 | 0.92 |
| 日本 | 国債証券 | 第123回利付国債(5年) | 1,010,000,000 | 100.02 | 1,010,243,800 | 100.43 | 1,014,373,300 | 0.100 | 2020/3/20 | 0.89 |
| 日本 | 国債証券 | 第330回利付国債(10年) | 935,000,000 | 103.98 | 972,219,500 | 105.58 | 987,191,700 | 0.800 | 2023/9/20 | 0.87 |
| 日本 | 国債証券 | 第289回利付国債(10年) | 923,000,000 | 103.72 | 957,335,600 | 102.85 | 949,323,960 | 1.500 | 2017/12/20 | 0.84 |
| 日本 | 国債証券 | 第124回利付国債(5年) | 940,000,000 | 100.06 | 940,617,300 | 100.43 | 944,117,200 | 0.100 | 2020/6/20 | 0.83 |
| 日本 | 国債証券 | 第303回利付国債(10年) | 885,000,000 | 105.54 | 934,059,000 | 105.10 | 930,179,250 | 1.400 | 2019/9/20 | 0.82 |
| 日本 | 国債証券 | 第332回利付国債(10年) | 860,000,000 | 102.31 | 879,904,000 | 104.07 | 895,027,800 | 0.600 | 2023/12/20 | 0.79 |
| 日本 | 国債証券 | 第290回利付国債(10年) | 852,000,000 | 103.80 | 884,376,000 | 103.02 | 877,764,480 | 1.400 | 2018/3/20 | 0.77 |
| 日本 | 国債証券 | 第43回利付国債(20年) | 710,000,000 | 112.01 | 795,299,400 | 110.55 | 784,940,500 | 2.900 | 2019/9/20 | 0.69 |

□ 種類別の投資比率

平成28年 1月28日現在

| 種類 | 投資比率（％） |
|-------|---------|
| 国債証券 | 76.17 |
| 地方債証券 | 6.44 |
| 特殊債券 | 10.05 |
| 社債券 | 6.29 |
| 合計 | 98.95 |

S M A M ・ 外国株式パッシブ・ファンド（適格機関投資家専用）

イ 主要投資銘柄

平成28年 1月29日現在

| 国/地域 | 種類 | 銘柄名 | 数量 | 帳簿単価 (円) | 帳簿価額 (円) | 評価額 単価 (円) | 評価額 (円) | 投資 比率 (%) |
|------|-----------|--------------------|---------------|-------------|----------------|------------------|----------------|-----------------|
| 日本 | 親投資信託受益証券 | 外国株式インデックス・マザーファンド | 8,251,148,788 | 2.8897 | 23,844,166,994 | 2.5843 | 21,323,443,812 | 100.01 |

以上が、当ファンドが保有する有価証券のすべてです。

ロ 種類別の投資比率

平成28年 1月29日現在

| 種類 | 投資比率（％） |
|-----------|---------|
| 親投資信託受益証券 | 100.01 |
| 合計 | 100.01 |

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）

平成28年 1月29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 | 264,257 | 14,191.85 | 3,750,297,091 | 11,372.65 | 3,005,304,564 | 1.92 |
| アメリカ | 株式 | MICROSOFT CORP | ソフトウェア・サービス | 352,232 | 6,515.16 | 2,294,849,953 | 6,291.88 | 2,216,204,241 | 1.42 |
| アメリカ | 株式 | EXXON MOBIL CORPORATION | エネルギー | 193,021 | 9,802.25 | 1,892,041,014 | 9,305.78 | 1,796,211,212 | 1.15 |
| 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 | 128,193 | 12,361.41 | 1,584,646,631 | 12,361.37 | 1,584,641,733 | 1.01 |
| アメリカ | 株式 | GENERAL ELECTRIC CO | 資本財 | 437,776 | 3,665.26 | 1,604,565,322 | 3,409.74 | 1,492,703,520 | 0.95 |
| アメリカ | 株式 | AMAZON.COM INC | 小売 | 18,447 | 81,191.03 | 1,497,731,103 | 76,794.75 | 1,416,632,836 | 0.90 |

| | | | | | | | | | |
|------|----|----------------------------------|------------------------|---------|-----------|---------------|-----------|---------------|------|
| アメリカ | 株式 | WELLS FARGO & COMPANY | 銀行 | 225,859 | 6,678.03 | 1,508,293,416 | 5,912.96 | 1,335,495,323 | 0.85 |
| アメリカ | 株式 | FACEBOOK INC-A | ソフトウェア・サービス | 99,643 | 12,725.80 | 1,268,037,580 | 13,188.12 | 1,314,104,409 | 0.84 |
| スイス | 株式 | NESTLE SA-REGISTERED | 食品・飲料・タバコ | 147,860 | 9,097.22 | 1,345,116,135 | 8,726.90 | 1,290,360,025 | 0.82 |
| アメリカ | 株式 | ALPHABET INC-CL C | ソフトウェア・サービス | 14,364 | 90,600.95 | 1,301,392,066 | 88,351.13 | 1,269,075,706 | 0.81 |
| アメリカ | 株式 | AT&T INC | 電気通信サービス | 285,466 | 4,060.62 | 1,159,170,993 | 4,294.51 | 1,225,936,906 | 0.78 |
| アメリカ | 株式 | ALPHABET INC-CL A | ソフトウェア・サービス | 13,454 | 93,211.35 | 1,254,065,514 | 90,447.02 | 1,216,874,221 | 0.78 |
| アメリカ | 株式 | PROCTER & GAMBLE CO | 家庭用品・パーソナル用品 | 125,660 | 9,153.07 | 1,150,175,974 | 9,647.84 | 1,212,348,002 | 0.77 |
| アメリカ | 株式 | JPMORGAN CHASE & CO | 銀行 | 171,402 | 8,094.65 | 1,387,440,445 | 6,923.43 | 1,186,690,366 | 0.76 |
| アメリカ | 株式 | VERIZON COMMUNICATIONS INC | 電気通信サービス | 188,384 | 5,470.38 | 1,030,533,838 | 5,923.83 | 1,115,956,430 | 0.71 |
| アメリカ | 株式 | PFIZER INC | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | 285,510 | 3,957.33 | 1,129,860,089 | 3,650.27 | 1,042,189,730 | 0.67 |
| スイス | 株式 | ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | 32,530 | 32,829.24 | 1,067,935,487 | 30,770.68 | 1,000,970,285 | 0.64 |
| アメリカ | 株式 | COCA-COLA CO/THE | 食品・飲料・タバコ | 191,306 | 5,211.81 | 997,051,402 | 5,145.43 | 984,352,760 | 0.63 |
| スイス | 株式 | NOVARTIS AG-REG SHS | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | 105,409 | 10,566.84 | 1,113,840,696 | 9,233.58 | 973,303,383 | 0.62 |
| アメリカ | 株式 | CHEVRON CORPORATION | エネルギー | 87,034 | 10,902.59 | 948,896,862 | 10,385.15 | 903,861,180 | 0.58 |
| アメリカ | 株式 | HOME DEPOT INC | 小売 | 59,651 | 16,255.09 | 969,632,685 | 14,779.98 | 881,640,802 | 0.56 |
| アメリカ | 株式 | THE WALT DISNEY CO. | メディア | 74,492 | 13,862.64 | 1,032,656,292 | 11,304.97 | 842,129,907 | 0.54 |
| アメリカ | 株式 | BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B | 各種金融 | 54,952 | 16,248.30 | 892,877,065 | 15,230.82 | 836,964,499 | 0.53 |
| アメリカ | 株式 | PEPSICO INC | 食品・飲料・タバコ | 68,007 | 12,168.28 | 827,528,834 | 11,778.78 | 801,039,593 | 0.51 |
| アメリカ | 株式 | INTEL CORP | 半導体・半導体製造装置 | 220,957 | 4,155.27 | 918,136,517 | 3,622.47 | 800,410,966 | 0.51 |
| アメリカ | 株式 | BANK OF AMERICA CORP | 銀行 | 484,463 | 2,102.60 | 1,018,636,295 | 1,635.37 | 792,276,789 | 0.51 |
| 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 | 130,393 | 6,514.62 | 849,460,848 | 5,946.80 | 775,421,614 | 0.50 |
| アメリカ | 株式 | PHILIP MORRIS INTERNATIONAL INC. | 食品・飲料・タバコ | 71,753 | 10,564.82 | 758,057,951 | 10,764.68 | 772,398,242 | 0.49 |
| アメリカ | 株式 | VISA INC | ソフトウェア・サービス | 90,549 | 9,631.06 | 872,083,667 | 8,379.91 | 758,793,113 | 0.48 |
| アメリカ | 株式 | COMCAST CORP-CL A | メディア | 115,400 | 7,424.72 | 856,813,589 | 6,540.27 | 754,747,816 | 0.48 |

□ 種類別・業種別の投資比率

平成28年 1月29日現在

| 種類 | 国内 / 外国 | 業種 | 投資比率 (%) |
|--------------------|---------|------------------------|-------------|
| 株式 | 外国 | エネルギー | 6.59 |
| | | 素材 | 3.96 |
| | | 資本財 | 6.74 |
| | | 商業・専門サービス | 0.88 |
| | | 運輸 | 1.69 |
| | | 自動車・自動車部品 | 1.55 |
| | | 耐久消費財・アパレル | 1.79 |
| | | 消費者サービス | 1.82 |
| | | メディア | 2.88 |
| | | 小売 | 3.95 |
| | | 食品・生活必需品小売り | 2.20 |
| | | 食品・飲料・タバコ | 6.97 |
| | | 家庭用品・パーソナル用品 | 1.90 |
| | | ヘルスケア機器・サービス | 3.63 |
| | | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | 9.80 |
| | | 銀行 | 8.22 |
| | | 各種金融 | 4.01 |
| | | 保険 | 4.22 |
| | | 不動産 | 0.68 |
| | | ソフトウェア・サービス | 8.58 |
| テクノロジー・ハードウェアおよび機器 | 3.90 | | |
| 電気通信サービス | 3.40 | | |
| 公益事業 | 3.40 | | |
| 半導体・半導体製造装置 | 1.66 | | |
| 投資証券 | | | 2.49 |
| 合計 | | | 96.91 |

S M A M ・年金外国債券パッシブ・ファンド<適格機関投資家限定>

イ 主要投資銘柄

平成28年 1月29日現在

| 国 / 地域 | 種類 | 銘柄名 | 数量 | 帳簿単価 (円) | 帳簿価額 (円) | 評価額 単価 (円) | 評価額 (円) | 投資 比率 (%) |
|--------|-----------|------------------|---------------|-------------|---------------|------------------|---------------|-----------------|
| 日本 | 親投資信託受益証券 | 外国債券パッシブ・マザーファンド | 1,488,667,872 | 1.8039 | 2,685,407,975 | 1.8071 | 2,690,171,711 | 100.01 |

以上が、当ファンドが保有する有価証券のすべてです。

ロ 種類別の投資比率

平成28年 1月29日現在

| 種類 | 投資比率（％） |
|-----------|---------|
| 親投資信託受益証券 | 100.01 |
| 合計 | 100.01 |

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）

平成28年 1月29日現在

| 国/ 地域 | 種類 | 銘柄名 | 数量 | 帳簿単価 (円) | 帳簿価額 (円) | 評価額 単価 (円) | 評価額 (円) | 利率 (%) | 償還期限 | 投資 比率 (%) |
|----------|------|--------------------------|------------|-------------|---------------|------------------|---------------|-----------|------------|-----------------|
| アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B 2.75 | 11,000,000 | 11,552.52 | 1,270,778,077 | 12,050.17 | 1,325,518,973 | 2.750 | 2042/11/15 | 0.68 |
| アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B 2.5 | 7,000,000 | 12,332.51 | 863,276,203 | 12,650.74 | 885,552,171 | 2.500 | 2024/5/15 | 0.45 |
| アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B 2.375 | 7,000,000 | 12,202.20 | 854,154,295 | 12,523.26 | 876,628,561 | 2.375 | 2024/8/15 | 0.45 |
| アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B 2.25 | 7,000,000 | 12,060.55 | 844,239,178 | 12,390.11 | 867,308,355 | 2.250 | 2024/11/15 | 0.44 |
| アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B 2.125 | 7,000,000 | 11,910.41 | 833,729,158 | 12,242.80 | 856,996,633 | 2.125 | 2025/5/15 | 0.44 |
| アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B 3.625 | 6,000,000 | 13,666.80 | 820,008,524 | 14,218.27 | 853,096,686 | 3.625 | 2043/8/15 | 0.44 |
| アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B 2 | 7,000,000 | 11,795.21 | 825,664,863 | 12,126.66 | 848,866,233 | 2.000 | 2025/2/15 | 0.43 |
| アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B 2 | 7,000,000 | 11,770.66 | 823,946,243 | 12,100.22 | 847,015,411 | 2.000 | 2025/8/15 | 0.43 |
| イタリア | 国債証券 | BTPS 6 | 4,100,000 | 19,836.33 | 813,289,856 | 20,117.19 | 824,805,167 | 6.000 | 2031/5/1 | 0.42 |
| アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B 2.75 | 6,200,000 | 12,608.25 | 781,711,617 | 12,911.37 | 800,505,016 | 2.750 | 2023/11/15 | 0.41 |
| アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B 3.625 | 6,000,000 | 13,062.45 | 783,747,524 | 13,198.43 | 791,906,249 | 3.625 | 2020/2/15 | 0.40 |
| アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B 3.875 | 6,000,000 | 12,871.71 | 772,302,646 | 12,906.64 | 774,398,981 | 3.875 | 2018/5/15 | 0.40 |
| フランス | 国債証券 | FRANCE O.A.T. 3.5 | 5,000,000 | 15,214.48 | 760,724,261 | 15,268.01 | 763,400,703 | 3.500 | 2020/4/25 | 0.39 |
| フランス | 国債証券 | FRANCE O.A.T. 3.75 | 5,000,000 | 15,155.93 | 757,796,695 | 15,178.40 | 758,920,140 | 3.750 | 2019/10/25 | 0.39 |
| フランス | 国債証券 | FRANCE O.A.T. 3.25 | 4,800,000 | 15,514.51 | 744,696,534 | 15,645.35 | 750,977,252 | 3.250 | 2021/10/25 | 0.38 |
| アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B 1.875 | 6,000,000 | 12,273.97 | 736,438,247 | 12,305.13 | 738,307,958 | 1.875 | 2017/10/31 | 0.38 |
| アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B 1.875 | 6,000,000 | 12,268.30 | 736,098,300 | 12,298.52 | 737,911,350 | 1.875 | 2017/9/30 | 0.38 |
| アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B 0.875 | 6,000,000 | 12,080.38 | 724,823,399 | 12,111.55 | 726,693,103 | 0.875 | 2017/4/30 | 0.37 |
| アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B 0.75 | 6,000,000 | 12,079.44 | 724,766,737 | 12,096.44 | 725,786,578 | 0.750 | 2017/1/15 | 0.37 |
| アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B 1 | 6,000,000 | 11,810.32 | 708,619,265 | 11,976.51 | 718,591,040 | 1.000 | 2019/11/30 | 0.37 |
| フランス | 国債証券 | FRANCE O.A.T. 5.5 | 3,500,000 | 19,932.29 | 697,630,268 | 20,369.77 | 712,942,162 | 5.500 | 2029/4/25 | 0.36 |
| フランス | 国債証券 | FRANCE O.A.T. 5.75 | 3,200,000 | 21,401.62 | 684,852,072 | 21,971.27 | 703,080,958 | 5.750 | 2032/10/25 | 0.36 |
| アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B 2.625 | 5,500,000 | 12,562.92 | 690,960,910 | 12,760.28 | 701,815,605 | 2.625 | 2020/11/15 | 0.36 |
| フランス | 国債証券 | FRANCE O.A.T. 3.75 | 5,000,000 | 13,942.61 | 697,130,666 | 13,893.04 | 694,652,478 | 3.750 | 2017/4/25 | 0.35 |
| イタリア | 国債証券 | BTPS 5.25 | 3,700,000 | 18,284.39 | 676,522,719 | 18,561.95 | 686,792,328 | 5.250 | 2029/11/1 | 0.35 |
| フランス | 国債証券 | FRANCE O.A.T. 4.25 | 4,000,000 | 16,905.86 | 676,234,588 | 17,160.55 | 686,422,252 | 4.250 | 2023/10/25 | 0.35 |
| イタリア | 国債証券 | BTPS 4.25 | 4,500,000 | 15,060.11 | 677,704,979 | 15,111.39 | 680,012,667 | 4.250 | 2019/9/1 | 0.35 |
| アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B 2 | 5,500,000 | 11,998.23 | 659,902,985 | 12,301.35 | 676,574,550 | 2.000 | 2023/2/15 | 0.35 |
| フランス | 国債証券 | FRANCE O.A.T. 3.5 | 4,000,000 | 16,411.15 | 656,446,095 | 16,768.14 | 670,725,742 | 3.500 | 2026/4/25 | 0.34 |

| | | | | | | | | | | |
|------|------|-------------------|-----------|-----------|-------------|-----------|-------------|-------|------------|------|
| フランス | 国債証券 | FRANCE O.A.T. 2.5 | 4,500,000 | 14,739.59 | 663,281,928 | 14,841.36 | 667,861,619 | 2.500 | 2020/10/25 | 0.34 |
|------|------|-------------------|-----------|-----------|-------------|-----------|-------------|-------|------------|------|

□ 種類別の投資比率

平成28年 1月29日現在

| 種類 | 投資比率(%) |
|------|---------|
| 国債証券 | 98.54 |
| 合計 | 98.54 |

S M A M ・ マネーインカムファンド<適格機関投資家限定>

イ 主要投資銘柄

平成28年 1月28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 | マネーインカム・マザーファンド | 421,344,212 | 1.0119 | 426,358,242 | 1.0120 | 426,400,342 | 100.01 |

以上が、当ファンドが保有する有価証券のすべてです。

□ 種類別の投資比率

平成28年 1月28日現在

| 種類 | 投資比率(%) |
|-----------|---------|
| 親投資信託受益証券 | 100.01 |
| 合計 | 100.01 |

マネーインカム・マザーファンド

イ 主要投資銘柄

平成28年 1月28日現在

| 国/地域 | 種類 | 銘柄名 | 数量 | 帳簿単価(円) | 帳簿価額(円) | 評価額単価(円) | 評価額(円) | 利率(%) | 償還期限 | 投資比率(%) |
|------|------|---------------------------|-------------|---------|-------------|----------|-------------|-------|------------|---------|
| 日本 | 国債証券 | 第338回利付国債(2年) | 215,000,000 | 100.09 | 215,195,650 | 100.01 | 215,030,100 | 0.100 | 2016/3/15 | 14.82 |
| 日本 | 特殊債券 | 第16回政府保証日本政策投資銀行債券 | 200,000,000 | 102.04 | 204,096,000 | 101.82 | 203,658,000 | 1.800 | 2017/2/28 | 14.03 |
| 日本 | 国債証券 | 第283回利付国債(10年) | 200,000,000 | 101.89 | 203,780,000 | 101.15 | 202,312,000 | 1.800 | 2016/9/20 | 13.94 |
| 日本 | 国債証券 | 第280回利付国債(10年) | 190,000,000 | 102.10 | 193,991,900 | 100.73 | 191,398,400 | 1.900 | 2016/6/20 | 13.19 |
| 日本 | 特殊債券 | 第23回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 100,000,000 | 101.74 | 101,747,000 | 101.45 | 101,458,000 | 1.700 | 2016/12/28 | 6.99 |
| 日本 | 特殊債券 | 第19回政府保証国民生活債券 | 100,000,000 | 101.70 | 101,706,000 | 101.41 | 101,419,000 | 1.700 | 2016/12/19 | 6.99 |

| | | | | | | | | | | |
|----|------|------------------|------------|--------|------------|--------|------------|-------|-----------|------|
| 日本 | 国債証券 | 第98回利付国債 (5年) | 40,000,000 | 100.35 | 40,140,000 | 100.12 | 40,048,800 | 0.300 | 2016/6/20 | 2.76 |
|----|------|------------------|------------|--------|------------|--------|------------|-------|-----------|------|

以上が、当ファンドが保有する有価証券のすべてです。

□ 種類別の投資比率

平成28年 1月28日現在

| 種類 | 投資比率(%) |
|------|---------|
| 国債証券 | 44.70 |
| 特殊債券 | 28.01 |
| 合計 | 72.71 |

参考情報

基準日:2016年1月29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

▶<2010>



| 決算期 | 分配金 |
|----------|-----|
| 2015年12月 | 0円 |
| 2014年12月 | 0円 |
| 2013年12月 | 0円 |
| 2012年12月 | 0円 |
| 2011年12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。

▶<2020>



| 決算期 | 分配金 |
|----------|-----|
| 2015年12月 | 0円 |
| 2014年12月 | 0円 |
| 2013年12月 | 0円 |
| 2012年12月 | 0円 |
| 2011年12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。

▶<2030>



| 決算期 | 分配金 |
|----------|-----|
| 2015年12月 | 0円 |
| 2014年12月 | 0円 |
| 2013年12月 | 0円 |
| 2012年12月 | 0円 |
| 2011年12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。

▶<2040>



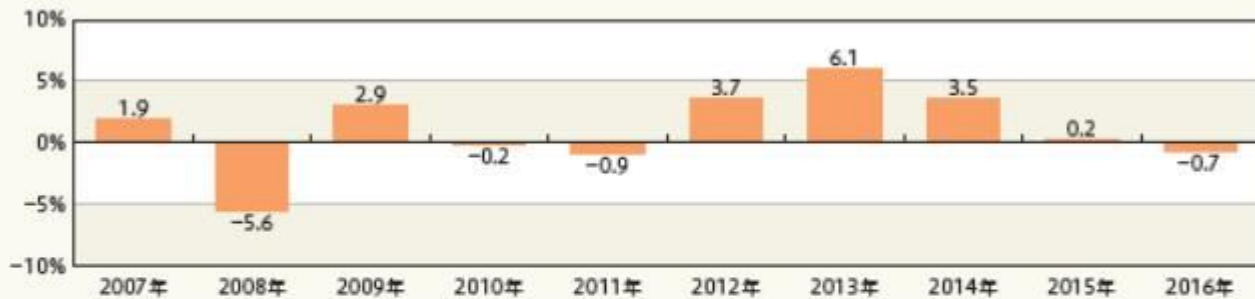
※基準価額は、1万口当たり、信託報酬控除後です。

| 決算期 | 分配金 |
|----------|-----|
| 2015年12月 | 0円 |
| 2014年12月 | 0円 |
| 2013年12月 | 0円 |
| 2012年12月 | 0円 |
| 2011年12月 | 0円 |
| 設定来累計 | 0円 |

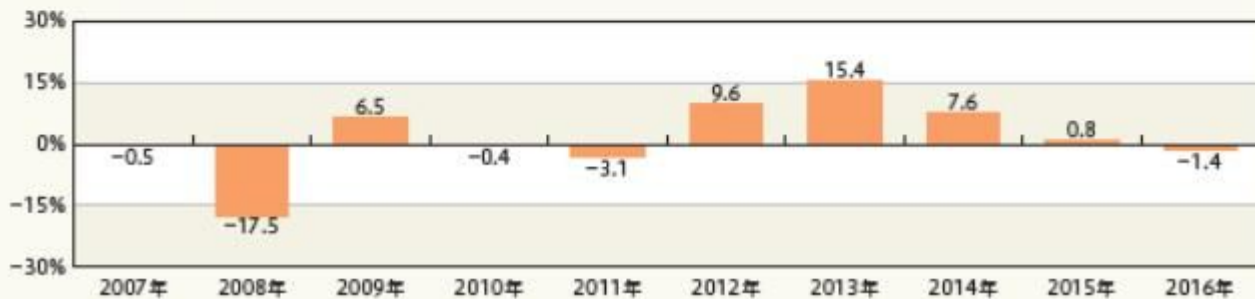
※分配金は1万口当たり、税引前です。
※直近5計算期間を記載しています。

★年間収益率の推移(暦年ベース)

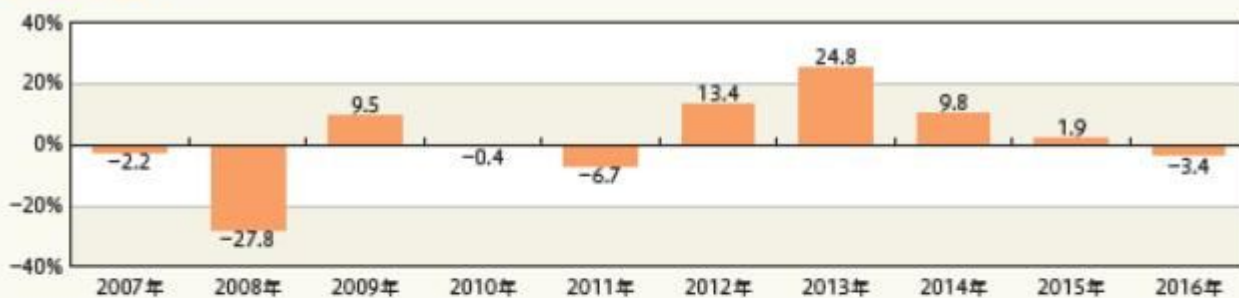
▶<2010>



▶<2020>



▶<2030>



▶<2040>



※2016年のファンドの収益率は、年初から2016年1月29日までの騰落率を表示しています。

※ファンドにはベンチマークはありません。

第2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

イ 申込方法

(イ) 当ファンドの募集は、確定拠出年金および変額保険・変額年金の特別勘定による取得の申込みのみを対象とします。

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

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

販売会社によっては一部のファンド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または委託会社にお問い合わせください。

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

なお、取引所等における取引の停止、決済機能の停止、その他やむを得ない事情があるときは、取得申込みの受け付けを中止させていただく場合、既に受け付けた取得申込みを取り消させていただく場合があります。

(ハ) 当ファンドの取得申込者は販売会社に、取得申込みと同時にまたはあらかじめ当該取得申込者が受益権の振替を行うための振替機関等の口座を申し出るものとし、当該口座に当該取得申込者にかかる口数の増加の記載または記録が行われます。

販売会社は、当該取得申込みの代金の支払いと引換えに、当該口座に当該取得申込者にかかる口数の増加の記載または記録を行うことができます。

ファンドのお買付けに関しましては、クーリング・オフ制度の適用はありません。

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。

八 申込手数料
無手数料です。

二 申込単位
お申込単位の詳細は、取扱いの販売会社または委託会社にお問い合わせください。

ホ 照会先
申込単位の詳細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 | 電話番号 | インターネット・ ホームページ・アドレス |
|--------------------|--------------|-------------------------|
| 三井住友アセットマネジメント株式会社 | 0120-88-2976 | http://www.smam-jp.com |

お問い合わせは、原則として営業日の午前9時～午後5時までとさせていただきます。

ヘ 申込取扱場所・払込取扱場所
販売会社において申込み・払込みを取り扱います。

ト 払込期日
取得申込者は、申込金額（取得申込受付日の翌営業日の基準価額×申込口数）を、販売会社の指定の期日までに、指定の方法でお支払いください。
各取得申込みにかかる発行価額の総額は、追加信託が行われる日に、委託会社の指定する口座を経由して、受託会社の指定するファンド口座に払い込まれます。

2【換金（解約）手続等】

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

お買付けの販売会社にお申し出ください。

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

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

一部解約金は、解約請求受付日から起算して6営業日目からお支払いします。

一部解約価額は、解約請求受付日の翌営業日の基準価額となります。

一部解約価額は、委託会社の営業日において日々算出されますので、委託会社（電話：0120-88-2976）にお問い合わせいただければ、いつでもお知らせします。

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

3【資産管理等の概要】

（1）【資産の評価】

イ 基準価額の算出方法

基準価額とは、信託財産に属する資産（受入担保金代用有価証券を除きます。）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。)

□ 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「TY2010」、「TY2020」、「TY2030」、「TY2040」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 | 電話番号 | インターネット・ホームページ・アドレス |
|--------------------|--------------|------------------------|
| 三井住友アセットマネジメント株式会社 | 0120-88-2976 | http://www.smam-jp.com |

お問い合わせは、原則として営業日の午前9時～午後5時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】

平成13年3月13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12月21日から翌年12月20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、受託会社は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て）に支払われます。
- ただし、分配金自動再投資コースにかかる収益分配金は、原則として、税金を差し引いた後、累積投資契約に基づいて、毎計算期間終了日の翌営業日に再投資され、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い前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者として）に支払われます。
- 八 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。

二 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でも、何らの意思表示もない場合は、自動的に1年間更新されます。販売契約の内容は、必要に応じて、委託会社と販売会社との合意により変更されることがあります。

へ 委託会社の事業の譲渡および承継に伴う取扱い

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

ト 公告

委託会社が受益者に対してする公告は、日本経済新聞に掲載します。

チ 運用にかかる報告書の開示方法

委託会社は毎決算後、投資信託及び投資法人に関する法律の規定に従い、期中の運用経過のほか、信託財産の内容、有価証券売買状況などを記載した運用報告書（全体版）および運用報告書（全体版）の記載事項のうち重要なものを記載した交付運用報告書を作成します。交付運用報告書は、原則として、あらかじめ受益者が申し出た住所に販売会社から届けられます。なお、運用報告書（全体版）は、委託会社のホームページで閲覧できます。

4【受益者の権利等】

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

イ 分配金請求権

受益者は、委託会社の決定した収益分配金を持分にに応じて請求する権利を有します。収益分配金は、原則として、税金を差し引いた後、毎計算期間終了日後1ヵ月以内の委託会社の指定する日（原則として決算日から起算して5営業日目まで）から、販売会社において、決算日の振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（当該収益分配金にかかる決算日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該収益分配金にかかる決算日以前に設定された受益権で取得申込代金支払い前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者とします。）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て）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関する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場合は、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、委託会社に対し、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15期（平成26年12月23日から平成27年12月21日まで）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

1【財務諸表】

【三井住友・DC年金プラン・ファンド（ターゲット・イヤー型）2010】

（1）【貸借対照表】

（単位：円）

| | 第14期 （平成26年12月22日現在） | 第15期 （平成27年12月21日現在） |
|-----------------|-------------------------|-------------------------|
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| コール・ローン | 13,536,984 | 7,051,630 |
| 投資信託受益証券 | 485,909,114 | 521,086,746 |
| 未収入金 | 1,640,000 | - |
| 未収利息 | 3 | 1 |
| 流動資産合計 | 501,086,101 | 528,138,377 |
| 資産合計 | 501,086,101 | 528,138,377 |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 未払金 | 7,270,000 | 1,210,000 |
| 未払解約金 | 2,631,698 | 1,789,724 |
| 未払受託者報酬 | 100,646 | 109,491 |
| 未払委託者報酬 | 905,855 | 985,332 |
| その他未払費用 | 7,490 | 8,161 |
| 流動負債合計 | 10,915,689 | 4,102,708 |
| 負債合計 | 10,915,689 | 4,102,708 |
| 純資産の部 | | |
| 元本等 | | |
| 元本 | 398,408,082 | 424,461,776 |
| 剰余金 | | |
| 期末剰余金又は期末欠損金（ ） | 91,762,330 | 99,573,893 |
| 元本等合計 | 490,170,412 | 524,035,669 |
| 純資産合計 | 490,170,412 | 524,035,669 |
| 負債純資産合計 | 501,086,101 | 528,138,377 |

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

| | 第14期 | | 第15期 | |
|---|------|------------------------------|------|------------------------------|
| | 自 | 平成25年12月21日 至 平成26年12月22日 | 自 | 平成26年12月23日 至 平成27年12月21日 |
| 営業収益 | | | | |
| 受取利息 | | 1,062 | | 434 |
| 有価証券売買等損益 | | 18,005,447 | | 3,867,632 |
| 営業収益合計 | | 18,006,509 | | 3,868,066 |
| 営業費用 | | | | |
| 受託者報酬 | | 190,918 | | 215,754 |
| 委託者報酬 | | 1,718,160 | | 1,941,689 |
| その他費用 | | 14,196 | | 16,057 |
| 営業費用合計 | | 1,923,274 | | 2,173,500 |
| 営業利益又は営業損失（ ） | | 16,083,235 | | 1,694,566 |
| 経常利益又は経常損失（ ） | | 16,083,235 | | 1,694,566 |
| 当期純利益又は当期純損失（ ） | | 16,083,235 | | 1,694,566 |
| 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（ ） | | 436,169 | | 182,081 |
| 期首剰余金又は期首欠損金（ ） | | 64,433,754 | | 91,762,330 |
| 剰余金増加額又は欠損金減少額 | | 16,936,446 | | 19,181,175 |
| 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 | | 16,936,446 | | 19,181,175 |
| 剰余金減少額又は欠損金増加額 | | 5,254,936 | | 12,882,097 |
| 当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額 | | 5,254,936 | | 12,882,097 |
| 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（ ） | | 91,762,330 | | 99,573,893 |

（ 3 ）【注記表】

（ 重要な会計方針の注記 ）

| 項 目 | 第15期 | |
|----------------------------|--|--|
| | 自 平成26年12月23日 至 平成27年12月21日 | |
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法 | <p>投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p> | |
| 2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項 | <p>計算期間の取扱い</p> <p>当計算期間は前期末および当期末が休日のため、平成26年12月23日から平成27年12月21日までとなっております。</p> | |

（ 貸借対照表に関する注記 ）

| 項 目 | 第14期 | | 第15期 | |
|-----------------------|-------------------|--------------|-------------------|--------------|
| | （平成26年12月22日現在） | | （平成27年12月21日現在） | |
| 1. 当計算期間の末日における受益権の総数 | | 398,408,082口 | | 424,461,776口 |
| 2. 1単位当たり純資産の額 | 1口当たり純資産額 | 1.2303円 | 1口当たり純資産額 | 1.2346円 |
| | (10,000口当たりの純資産額) | 12,303円 | (10,000口当たりの純資産額) | 12,346円 |

（ 損益及び剰余金計算書に関する注記 ）

| 項目 | 第14期 | 第15期 |
|----------|---|--|
| | 自 平成25年12月21日 至 平成26年12月22日 | 自 平成26年12月23日 至 平成27年12月21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(870円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(15,646,196円)、収益調整金(48,471,626円)、および分配準備積立金(27,643,638円)より、分配対象収益は91,762,330円(1万口当たり2,303.19円)ですが、分配を行っておりません。 | 計算期間末における費用控除後の配当等収益(217円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(1,512,268円)、収益調整金(60,352,395円)、および分配準備積立金(37,709,013円)より、分配対象収益は99,573,893円(1万口当たり2,345.85円)ですが、分配を行っておりません。 |

(金融商品に関する注記)

. 金融商品の状況に関する事項

| 項目 | 第15期 |
|------------------------|---|
| | 自 平成26年12月23日 至 平成27年12月21日 |
| 1. 金融商品に対する取組方針 | 当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。 |
| 2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク | <p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、投資信託受益証券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p> |

| 項目 | 第15期 自 平成26年12月23日 至 平成27年12月21日 |
|---------------------------|--|
| 3.金融商品に係るリスク管理体制 | <p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する委員会をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用グループに是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用グループは、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。その後、当該関連運用グループの対処の実施や対処方針の決定等に関し、必要に応じてリスク管理を行う部署が当該部署の担当役員、当該関連運用グループの担当役員およびリスク管理委員会へ報告を行う体制となっております。</p> <p>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する部会にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。</p> |
| 4.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | <p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない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認める評価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。</p> |

・金融商品の時価等に関する事項

| 項目 | 第15期 (平成27年12月21日現在) |
|-------------------|---|
| 1.貸借対照表計上額、時価及び差額 | <p>金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p> |
| 2.時価の算定方法 | <p>(1) 有価証券（投資信託受益証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p> |

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

第14期（自 平成25年12月21日 至 平成26年12月22日）

| 種 類 | 当計算期間の損益に含まれた評価差額 |
|----------|-------------------|
| 投資信託受益証券 | 16,555,139円 |
| 合計 | 16,555,139円 |

第15期（自 平成26年12月23日 至 平成27年12月21日）

| 種 類 | 当計算期間の損益に含まれた評価差額 |
|----------|-------------------|
| 投資信託受益証券 | 2,898,681円 |
| 合計 | 2,898,681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）

該当事項はありません。

（その他の注記）

| 項 目 | 第14期 （平成26年12月22日現在） | 第15期 （平成27年12月21日現在） |
|-----------|-------------------------|-------------------------|
| 期首元本額 | 341,924,743円 | 398,408,082円 |
| 期中追加設定元本額 | 84,271,259円 | 81,915,864円 |
| 期中一部解約元本額 | 27,787,920円 | 55,862,170円 |

（4）【附属明細表】

有価証券明細表

(a) 株式

該当事項はありません。

(b)株式以外の有価証券

(単位：円)

| 種類 | 銘柄 | 券面総額 | 評価額 | 備考 |
|----------|--------------------------------------|-------------|-------------|----|
| 投資信託受益証券 | S M A M ・ 国内株式パッシブ・ファンド（適格機関投資家専用） | 17,370,094 | 25,534,038 | |
| | S M A M ・ 外国株式パッシブ・ファンド（適格機関投資家専用） | 11,694,524 | 25,032,128 | |
| | S M A M ・ 年金外国債券パッシブ・ファンド＜適格機関投資家限定＞ | 14,233,850 | 25,364,720 | |
| | S M A M ・ 年金国内債券パッシブファンド＜適格機関投資家限定＞ | 147,235,398 | 183,528,923 | |
| | S M A M ・ マネーインカムファンド＜適格機関投資家限定＞ | 259,344,704 | 261,626,937 | |
| 合計 | | 449,878,570 | 521,086,746 | |

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。

【三井住友・DC年金プラン・ファンド（ターゲット・イヤー型）2020】

（１）【貸借対照表】

（単位：円）

| | 第14期 （平成26年12月22日現在） | 第15期 （平成27年12月21日現在） |
|-----------------|-------------------------|-------------------------|
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| コール・ローン | 5,681,624 | 13,465,243 |
| 投資信託受益証券 | 1,041,036,358 | 1,210,066,656 |
| 未収利息 | 1 | 3 |
| 流動資産合計 | 1,046,717,983 | 1,223,531,902 |
| 資産合計 | 1,046,717,983 | 1,223,531,902 |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 未払金 | 1,780,000 | 440,000 |
| 未払解約金 | 48,006 | - |
| 未払受託者報酬 | 207,524 | 253,189 |
| 未払委託者報酬 | 2,334,534 | 2,848,358 |
| その他未払費用 | 15,508 | 18,928 |
| 流動負債合計 | 4,385,572 | 3,560,475 |
| 負債合計 | 4,385,572 | 3,560,475 |
| 純資産の部 | | |
| 元本等 | | |
| 元本 | 732,860,365 | 847,471,022 |
| 剰余金 | | |
| 期末剰余金又は期末欠損金（ ） | 309,472,046 | 372,500,405 |
| 元本等合計 | 1,042,332,411 | 1,219,971,427 |
| 純資産合計 | 1,042,332,411 | 1,219,971,427 |
| 負債純資産合計 | 1,046,717,983 | 1,223,531,902 |

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

| | 第14期 | | 第15期 | |
|---|------|------------------------------|------|------------------------------|
| | 自 | 平成25年12月21日 至 平成26年12月22日 | 自 | 平成26年12月23日 至 平成27年12月21日 |
| 営業収益 | | | | |
| 受取利息 | | 2,165 | | 699 |
| 有価証券売買等損益 | | 75,341,384 | | 18,360,298 |
| 営業収益合計 | | 75,343,549 | | 18,360,997 |
| 営業費用 | | | | |
| 受託者報酬 | | 381,377 | | 482,461 |
| 委託者報酬 | | 4,290,366 | | 5,427,663 |
| その他費用 | | 28,489 | | 36,069 |
| 営業費用合計 | | 4,700,232 | | 5,946,193 |
| 営業利益又は営業損失（ ） | | 70,643,317 | | 12,414,804 |
| 経常利益又は経常損失（ ） | | 70,643,317 | | 12,414,804 |
| 当期純利益又は当期純損失（ ） | | 70,643,317 | | 12,414,804 |
| 一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（ ） | | 1,018,258 | | 920,421 |
| 期首剰余金又は期首欠損金（ ） | | 192,558,780 | | 309,472,046 |
| 剰余金増加額又は欠損金減少額 | | 60,549,249 | | 76,640,258 |
| 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 | | 60,549,249 | | 76,640,258 |
| 剰余金減少額又は欠損金増加額 | | 13,261,042 | | 25,106,282 |
| 当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額 | | 13,261,042 | | 25,106,282 |
| 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（ ） | | 309,472,046 | | 372,500,405 |

(3)【注記表】

(重要な会計方針の注記)

| 項目 | 第15期 | |
|----------------------------|--|--|
| | 自 平成26年12月23日 至 平成27年12月21日 | |
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法 | <p>投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p> | |
| 2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項 | <p>計算期間の取扱い</p> <p>当計算期間は前期末および当期末が休日のため、平成26年12月23日から平成27年12月21日までとなっております。</p> | |

(貸借対照表に関する注記)

| 項目 | 第14期 | | 第15期 | |
|-----------------------|-------------------|----------|-------------------|----------|
| | (平成26年12月22日現在) | | (平成27年12月21日現在) | |
| 1. 当計算期間の末日における受益権の総数 | 732,860,365口 | | 847,471,022口 | |
| 2. 1単位当たり純資産の額 | 1口当たり純資産額 | 1.4223円 | 1口当たり純資産額 | 1.4395円 |
| | (10,000口当たりの純資産額) | 14,223円) | (10,000口当たりの純資産額) | 14,395円) |

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

| 項目 | 第14期 | 第15期 |
|----------|--|--|
| | 自 平成25年12月21日 至 平成26年12月22日 | 自 平成26年12月23日 至 平成27年12月21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（2,165円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（69,622,894円）、収益調整金（193,550,796円）、および分配準備積立金（105,959,146円）より、分配対象収益は369,135,001円（1万口当たり5,036.88円）ですが、分配を行っておりません。 | 計算期間末における費用控除後の配当等収益（699円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（11,493,684円）、収益調整金（264,245,014円）、および分配準備積立金（162,618,655円）より、分配対象収益は438,358,052円（1万口当たり5,172.52円）ですが、分配を行っておりません。 |

（金融商品に関する注記）

．金融商品の状況に関する事項

| 項目 | 第15期 |
|-----------------------|---|
| | 自 平成26年12月23日 至 平成27年12月21日 |
| 1.金融商品に対する取組方針 | 当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。 |
| 2.金融商品の内容及び金融商品に係るリスク | <p>(1)金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、投資信託受益証券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2)金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p> |

| 項目 | 第15期 自 平成26年12月23日 至 平成27年12月21日 |
|---------------------------|--|
| 3.金融商品に係るリスク管理体制 | <p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する委員会をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用グループに是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用グループは、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。その後、当該関連運用グループの対処の実施や対処方針の決定等に関し、必要に応じてリスク管理を行う部署が当該部署の担当役員、当該関連運用グループの担当役員およびリスク管理委員会へ報告を行う体制となっております。</p> <p>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する部会にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。</p> |
| 4.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | <p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない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認める評価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。</p> |

・金融商品の時価等に関する事項

| 項目 | 第15期 (平成27年12月21日現在) |
|-------------------|---|
| 1.貸借対照表計上額、時価及び差額 | <p>金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p> |
| 2.時価の算定方法 | <p>(1) 有価証券（投資信託受益証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p> |

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

第14期（自 平成25年12月21日 至 平成26年12月22日）

| 種 類 | 当計算期間の損益に含まれた評価差額 |
|----------|-------------------|
| 投資信託受益証券 | 73,138,653円 |
| 合計 | 73,138,653円 |

第15期（自 平成26年12月23日 至 平成27年12月21日）

| 種 類 | 当計算期間の損益に含まれた評価差額 |
|----------|-------------------|
| 投資信託受益証券 | 15,251,889円 |
| 合計 | 15,251,889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）

該当事項はありません。

（その他の注記）

| 項 目 | 第14期 （平成26年12月22日現在） | 第15期 （平成27年12月21日現在） |
|-----------|-------------------------|-------------------------|
| 期首元本額 | 599,859,697円 | 732,860,365円 |
| 期中追加設定元本額 | 174,116,846円 | 173,855,110円 |
| 期中一部解約元本額 | 41,116,178円 | 59,244,453円 |

（4）【附属明細表】

有価証券明細表

(a) 株式

該当事項はありません。

(b)株式以外の有価証券

(単位：円)

| 種類 | 銘柄 | 券面総額 | 評価額 | 備考 |
|----------|--------------------------------------|-------------|---------------|----|
| 投資信託受益証券 | S M A M ・ 国内株式パッシブ・ファンド（適格機関投資家専用） | 96,191,330 | 141,401,255 | |
| | S M A M ・ 外国株式パッシブ・ファンド（適格機関投資家専用） | 43,073,148 | 92,198,073 | |
| | S M A M ・ 年金外国債券パッシブ・ファンド＜適格機関投資家限定＞ | 87,182,108 | 155,358,516 | |
| | S M A M ・ 年金国内債券パッシブファンド＜適格機関投資家限定＞ | 601,779,350 | 750,117,959 | |
| | S M A M ・ マネーインカムファンド＜適格機関投資家限定＞ | 70,371,584 | 70,990,853 | |
| 合計 | | 898,597,520 | 1,210,066,656 | |

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。

【三井住友・DC年金プラン・ファンド（ターゲット・イヤー型）2030】

（１）【貸借対照表】

（単位：円）

| | 第14期 （平成26年12月22日現在） | 第15期 （平成27年12月21日現在） |
|-----------------|-------------------------|-------------------------|
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| コール・ローン | 23,689,551 | 9,081,071 |
| 投資信託受益証券 | 754,888,842 | 1,192,242,951 |
| 未収入金 | - | 210,000 |
| 未収利息 | 6 | 2 |
| 流動資産合計 | 778,578,399 | 1,201,534,024 |
| 資産合計 | 778,578,399 | 1,201,534,024 |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 未払金 | 2,660,000 | 10,000 |
| 未払解約金 | 964,873 | 1,314,125 |
| 未払受託者報酬 | 148,041 | 251,244 |
| 未払委託者報酬 | 1,665,397 | 2,826,490 |
| その他未払費用 | 11,038 | 18,781 |
| 流動負債合計 | 5,449,349 | 4,420,640 |
| 負債合計 | 5,449,349 | 4,420,640 |
| 純資産の部 | | |
| 元本等 | | |
| 元本 | 521,905,300 | 790,633,233 |
| 剰余金 | | |
| 期末剰余金又は期末欠損金（ ） | 251,223,750 | 406,480,151 |
| 元本等合計 | 773,129,050 | 1,197,113,384 |
| 純資産合計 | 773,129,050 | 1,197,113,384 |
| 負債純資産合計 | 778,578,399 | 1,201,534,024 |

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

| | 第14期 | | 第15期 | |
|---|------|------------------------------|------|------------------------------|
| | 自 | 平成25年12月21日 至 平成26年12月22日 | 自 | 平成26年12月23日 至 平成27年12月21日 |
| 営業収益 | | | | |
| 受取利息 | | 1,875 | | 1,305 |
| 有価証券売買等損益 | | 70,403,753 | | 25,074,109 |
| 営業収益合計 | | 70,405,628 | | 25,075,414 |
| 営業費用 | | | | |
| 受託者報酬 | | 268,818 | | 463,876 |
| 委託者報酬 | | 3,024,069 | | 5,218,478 |
| その他費用 | | 20,032 | | 34,666 |
| 営業費用合計 | | 3,312,919 | | 5,717,020 |
| 営業利益又は営業損失（ ） | | 67,092,709 | | 19,358,394 |
| 経常利益又は経常損失（ ） | | 67,092,709 | | 19,358,394 |
| 当期純利益又は当期純損失（ ） | | 67,092,709 | | 19,358,394 |
| 一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（ ） | | 1,008,775 | | 2,163,088 |
| 期首剰余金又は期首欠損金（ ） | | 138,709,298 | | 251,223,750 |
| 剰余金増加額又は欠損金減少額 | | 55,805,249 | | 166,359,178 |
| 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 | | 55,805,249 | | 166,359,178 |
| 剰余金減少額又は欠損金増加額 | | 9,374,731 | | 28,298,083 |
| 当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額 | | 9,374,731 | | 28,298,083 |
| 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（ ） | | 251,223,750 | | 406,480,151 |

(3) 【注記表】

(重要な会計方針の注記)

| 項 目 | 第15期 | |
|----------------------------|--|--|
| | 自 平成26年12月23日 至 平成27年12月21日 | |
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法 | <p>投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p> | |
| 2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項 | <p>計算期間の取扱い</p> <p>当計算期間は前期末および当期末が休日のため、平成26年12月23日から平成27年12月21日までとなっております。</p> | |

(貸借対照表に関する注記)

| 項 目 | 第14期 | | 第15期 | |
|-----------------------|-------------------|---------|-------------------|---------|
| | (平成26年12月22日現在) | | (平成27年12月21日現在) | |
| 1. 当計算期間の末日における受益権の総数 | 521,905,300口 | | 790,633,233口 | |
| 2. 1単位当たり純資産の額 | 1口当たり純資産額 | 1.4814円 | 1口当たり純資産額 | 1.5141円 |
| | (10,000口当たりの純資産額) | 14,814円 | (10,000口当たりの純資産額) | 15,141円 |

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

| 項目 | 第14期 | 第15期 |
|----------|---|--|
| | 自 平成25年12月21日 至 平成26年12月22日 | 自 平成26年12月23日 至 平成27年12月21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（1,875円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（66,082,059円）、収益調整金（190,246,414円）、および分配準備積立金（87,099,856円）より、分配対象収益は343,430,204円（1万口当たり6,580.28円）ですが、分配を行っておりません。 | 計算期間末における費用控除後の配当等収益（733円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（17,194,573円）、収益調整金（378,986,841円）、および分配準備積立金（141,277,077円）より、分配対象収益は537,459,224円（1万口当たり6,797.79円）ですが、分配を行っておりません。 |

（金融商品に関する注記）

. 金融商品の状況に関する事項

| 項目 | 第15期 |
|------------------------|---|
| | 自 平成26年12月23日 至 平成27年12月21日 |
| 1. 金融商品に対する取組方針 | 当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。 |
| 2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク | <p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、投資信託受益証券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p> |

| 項目 | 第15期 自 平成26年12月23日 至 平成27年12月21日 |
|---------------------------|--|
| 3.金融商品に係るリスク管理体制 | <p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する委員会をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用グループに是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用グループは、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。その後、当該関連運用グループの対処の実施や対処方針の決定等に関し、必要に応じてリスク管理を行う部署が当該部署の担当役員、当該関連運用グループの担当役員およびリスク管理委員会へ報告を行う体制となっております。</p> <p>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する部会にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。</p> |
| 4.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | <p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない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認める評価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。</p> |

・金融商品の時価等に関する事項

| 項目 | 第15期 (平成27年12月21日現在) |
|-------------------|---|
| 1.貸借対照表計上額、時価及び差額 | 金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 |
| 2.時価の算定方法 | <p>(1) 有価証券（投資信託受益証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p> |

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

第14期（自 平成25年12月21日 至 平成26年12月22日）

| 種 類 | 当計算期間の損益に含まれた評価差額 |
|----------|-------------------|
| 投資信託受益証券 | 68,476,715円 |
| 合計 | 68,476,715円 |

第15期（自 平成26年12月23日 至 平成27年12月21日）

| 種 類 | 当計算期間の損益に含まれた評価差額 |
|----------|-------------------|
| 投資信託受益証券 | 21,566,281円 |
| 合計 | 21,566,281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）

該当事項はありません。

（その他の注記）

| 項 目 | 第14期 （平成26年12月22日現在） | 第15期 （平成27年12月21日現在） |
|-----------|-------------------------|-------------------------|
| 期首元本額 | 402,636,309円 | 521,905,300円 |
| 期中追加設定元本額 | 146,378,903円 | 326,685,857円 |
| 期中一部解約元本額 | 27,109,912円 | 57,957,924円 |

（4）【附属明細表】

有価証券明細表

(a) 株式

該当事項はありません。

(b)株式以外の有価証券

(単位：円)

| 種類 | 銘柄 | 券面総額 | 評価額 | 備考 |
|----------|------------------------------------|-------------|---------------|----|
| 投資信託受益証券 | S M A M・国内株式パッシブ・ファンド（適格機関投資家専用） | 210,192,645 | 308,983,188 | |
| | S M A M・外国株式パッシブ・ファンド（適格機関投資家専用） | 76,952,625 | 164,717,093 | |
| | S M A M・年金外国債券パッシブ・ファンド<適格機関投資家限定> | 72,351,768 | 128,930,850 | |
| | S M A M・年金国内債券パッシブファンド<適格機関投資家限定> | 455,110,206 | 567,294,871 | |
| | S M A M・マネーインカムファンド<適格機関投資家限定> | 22,122,273 | 22,316,949 | |
| 合計 | | 836,729,517 | 1,192,242,951 | |

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。

【三井住友・DC年金プラン・ファンド（ターゲット・イヤー型）2040】

（１）【貸借対照表】

（単位：円）

| | 第14期 （平成26年12月22日現在） | 第15期 （平成27年12月21日現在） |
|-----------------|-------------------------|-------------------------|
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| コール・ローン | 5,310,387 | 24,350,124 |
| 投資信託受益証券 | 585,659,654 | 1,819,415,613 |
| 未収入金 | 150,000 | 1,720,000 |
| 未収利息 | 1 | 6 |
| 流動資産合計 | 591,120,042 | 1,845,485,743 |
| 資産合計 | 591,120,042 | 1,845,485,743 |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 未払金 | 890,000 | 1,200,000 |
| 未払解約金 | 149,614 | 1,971,860 |
| 未払受託者報酬 | 116,212 | 388,663 |
| 未払委託者報酬 | 1,307,251 | 4,372,394 |
| その他未払費用 | 8,654 | 29,086 |
| 流動負債合計 | 2,471,731 | 7,962,003 |
| 負債合計 | 2,471,731 | 7,962,003 |
| 純資産の部 | | |
| 元本等 | | |
| 元本 | 385,837,486 | 1,167,240,058 |
| 剰余金 | | |
| 期末剰余金又は期末欠損金（ ） | 202,810,825 | 670,283,682 |
| 元本等合計 | 588,648,311 | 1,837,523,740 |
| 純資産合計 | 588,648,311 | 1,837,523,740 |
| 負債純資産合計 | 591,120,042 | 1,845,485,743 |

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

| | 第14期 | | 第15期 | |
|---|------|------------------------------|------|------------------------------|
| | 自 | 平成25年12月21日 至 平成26年12月22日 | 自 | 平成26年12月23日 至 平成27年12月21日 |
| 営業収益 | | | | |
| 受取利息 | | 1,464 | | 2,987 |
| 有価証券売買等損益 | | 66,844,213 | | 37,215,959 |
| 営業収益合計 | | 66,845,677 | | 37,218,946 |
| 営業費用 | | | | |
| 受託者報酬 | | 212,478 | | 681,444 |
| 委託者報酬 | | 2,390,213 | | 7,666,107 |
| その他費用 | | 15,822 | | 50,986 |
| 営業費用合計 | | 2,618,513 | | 8,398,537 |
| 営業利益又は営業損失（ ） | | 64,227,164 | | 28,820,409 |
| 経常利益又は経常損失（ ） | | 64,227,164 | | 28,820,409 |
| 当期純利益又は当期純損失（ ） | | 64,227,164 | | 28,820,409 |
| 一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（ ） | | 1,034,701 | | 7,212,233 |
| 期首剰余金又は期首欠損金（ ） | | 116,596,811 | | 202,810,825 |
| 剰余金増加額又は欠損金減少額 | | 35,912,762 | | 533,728,533 |
| 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 | | 35,912,762 | | 533,728,533 |
| 剰余金減少額又は欠損金増加額 | | 12,891,211 | | 87,863,852 |
| 当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額 | | 12,891,211 | | 87,863,852 |
| 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（ ） | | 202,810,825 | | 670,283,682 |

（ 3 ）【注記表】

（ 重要な会計方針の注記 ）

| 項 目 | 第15期 | |
|----------------------------|--|--|
| | 自 平成26年12月23日 至 平成27年12月21日 | |
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法 | <p>投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p> | |
| 2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項 | <p>計算期間の取扱い</p> <p>当計算期間は前期末および当期末が休日のため、平成26年12月23日から平成27年12月21日までとなっております。</p> | |

（ 貸借対照表に関する注記 ）

| 項 目 | 第14期 | | 第15期 | |
|-----------------------|-------------------|--------------|-------------------|----------------|
| | （平成26年12月22日現在） | | （平成27年12月21日現在） | |
| 1. 当計算期間の末日における受益権の総数 | | 385,837,486口 | | 1,167,240,058口 |
| 2. 1単位当たり純資産の額 | 1口当たり純資産額 | 1.5256円 | 1口当たり純資産額 | 1.5742円 |
| | (10,000口当たりの純資産額) | 15,256円) | (10,000口当たりの純資産額) | 15,742円) |

（ 損益及び剰余金計算書に関する注記 ）

| 項目 | 第14期 | 第15期 |
|----------|---|--|
| | 自 平成25年12月21日 至 平成26年12月22日 | 自 平成26年12月23日 至 平成27年12月21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(1,464円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(63,190,999円)、収益調整金(142,682,349円)、および分配準備積立金(79,416,586円)より、分配対象収益は285,291,398円(1万口当たり7,394.06円)ですが、分配を行っておりません。 | 計算期間末における費用控除後の配当等収益(2,114円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(21,606,062円)、収益調整金(740,091,372円)、および分配準備積立金(122,966,733円)より、分配対象収益は884,666,281円(1万口当たり7,579.10円)ですが、分配を行っておりません。 |

(金融商品に関する注記)

. 金融商品の状況に関する事項

| 項目 | 第15期 |
|------------------------|---|
| | 自 平成26年12月23日 至 平成27年12月21日 |
| 1. 金融商品に対する取組方針 | 当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。 |
| 2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク | <p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、投資信託受益証券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p> |

| 項目 | 第15期 自 平成26年12月23日 至 平成27年12月21日 |
|---------------------------|--|
| 3.金融商品に係るリスク管理体制 | <p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する委員会をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用グループに是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用グループは、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。その後、当該関連運用グループの対処の実施や対処方針の決定等に関し、必要に応じてリスク管理を行う部署が当該部署の担当役員、当該関連運用グループの担当役員およびリスク管理委員会へ報告を行う体制となっております。</p> <p>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する部会にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。</p> |
| 4.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | <p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない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認める評価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。</p> |

・金融商品の時価等に関する事項

| 項目 | 第15期 (平成27年12月21日現在) |
|-------------------|---|
| 1.貸借対照表計上額、時価及び差額 | <p>金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p> |
| 2.時価の算定方法 | <p>(1) 有価証券（投資信託受益証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p> |

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

第14期（自 平成25年12月21日 至 平成26年12月22日）

| 種 類 | 当計算期間の損益に含まれた評価差額 |
|----------|-------------------|
| 投資信託受益証券 | 65,277,175円 |
| 合計 | 65,277,175円 |

第15期（自 平成26年12月23日 至 平成27年12月21日）

| 種 類 | 当計算期間の損益に含まれた評価差額 |
|----------|-------------------|
| 投資信託受益証券 | 28,872,223円 |
| 合計 | 28,872,223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）

該当事項はありません。

（その他の注記）

| 項 目 | 第14期 （平成26年12月22日現在） | 第15期 （平成27年12月21日現在） |
|-----------|-------------------------|-------------------------|
| 期首元本額 | 329,245,529円 | 385,837,486円 |
| 期中追加設定元本額 | 92,910,684円 | 941,205,290円 |
| 期中一部解約元本額 | 36,318,727円 | 159,802,718円 |

（4）【附属明細表】

有価証券明細表

(a) 株式

該当事項はありません。

(b)株式以外の有価証券

(単位：円)

| 種類 | 銘柄 | 券面総額 | 評価額 | 備考 |
|----------|--------------------------------------|---------------|---------------|----|
| 投資信託受益証券 | S M A M ・ 国内株式パッシブ・ファンド（適格機関投資家専用） | 515,861,058 | 758,315,755 | |
| | S M A M ・ 外国株式パッシブ・ファンド（適格機関投資家専用） | 149,600,847 | 320,220,613 | |
| | S M A M ・ 年金外国債券パッシブ・ファンド＜適格機関投資家限定＞ | 102,460,067 | 182,583,839 | |
| | S M A M ・ 年金国内債券パッシブファンド＜適格機関投資家限定＞ | 419,766,831 | 523,239,354 | |
| | S M A M ・ マネーインカムファンド＜適格機関投資家限定＞ | 34,750,250 | 35,056,052 | |
| 合計 | | 1,222,439,053 | 1,819,415,613 | |

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年金プラン・ファンド（ターゲット・イヤー型）2010」、「三井住友・DC年金プラン・ファンド（ターゲット・イヤー型）2020」、「三井住友・DC年金プラン・ファンド（ターゲット・イヤー型）2030」および「三井住友・DC年金プラン・ファンド（ターゲット・イヤー型）2040」は、「SMAM・国内株式パッシブ・ファンド（適格機関投資家専用）」、「SMAM・年金国内債券パッシブファンド＜適格機関投資家限定＞」、「SMAM・外国株式パッシブ・ファンド（適格機関投資家専用）」、「SMAM・年金外国債券パッシブ・ファンド＜適格機関投資家限定＞」および「SMAM・マネーインカムファンド＜適格機関投資家限定＞」投資信託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「投資信託受益証券」はこれらの投資信託の受益証券です。

なお、以下に記載した状況は、監査の対象外です。

SMAM・国内株式パッシブ・ファンド（適格機関投資家専用）

貸借対照表

(単位：円)

| | (平成26年12月19日現在) | (平成27年12月18日現在) |
|-----------|-----------------|-----------------|
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| 親投資信託受益証券 | 51,465,116,868 | 34,761,858,085 |
| 流動資産合計 | 51,465,116,868 | 34,761,858,085 |
| 資産合計 | 51,465,116,868 | 34,761,858,085 |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 未払受託者報酬 | 1,107,152 | 753,626 |
| 未払委託者報酬 | 968,750 | 659,417 |
| その他未払費用 | 30,852 | 30,672 |
| 流動負債合計 | 2,106,754 | 1,443,715 |

| | （平成26年12月19日現在） | （平成27年12月18日現在） |
|-------------|-----------------|-----------------|
| 負債合計 | 2,106,754 | 1,443,715 |
| 純資産の部 | | |
| 元本等 | | |
| 元本 | 38,863,813,165 | 23,646,117,924 |
| 剰余金 | | |
| 剰余金又は欠損金（ ） | 12,599,196,949 | 11,114,296,446 |
| 元本等合計 | 51,463,010,114 | 34,760,414,370 |
| 純資産合計 | 51,463,010,114 | 34,760,414,370 |
| 負債純資産合計 | 51,465,116,868 | 34,761,858,085 |

注記表

（重要な会計方針の注記）

| 項目 | 自平成27年12月1日 至平成27年12月18日 |
|-----------------|---|
| 有価証券の評価基準及び評価方法 | <p>親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p> |

（貸借対照表に関する注記）

| 項目 | （平成26年12月19日現在） | （平成27年12月18日現在） |
|-----------------------|--|--|
| 1. 当計算期間の末日における受益権の総数 | 38,863,813,165口 | 23,646,117,924口 |
| 2. 1単位当たり純資産の額 | 1口当たり純資産額 1.3242円 (10,000口当たりの純資産額 13,242円) | 1口当たり純資産額 1.4700円 (10,000口当たりの純資産額 14,700円) |

（金融商品に関する注記）

. 金融商品の状況に関する事項

| 項目 | 自平成27年12月1日 至平成27年12月18日 |
|----|-----------------------------|
| | |

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

・金融商品の時価等に関する事項

| 項目 | (平成27年12月18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。 |

(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)

該当事項はありません。

(その他の注記)

| 項目 | (平成26年12月19日現在) | (平成27年12月18日現在) |
|-----------|-----------------|-----------------|
| 期首元本額 | 39,886,737,708円 | 23,955,799,828円 |
| 期中追加設定元本額 | 14,845,640円 | 3,620,186円 |
| 期中一部解約元本額 | 1,037,770,183円 | 313,302,090円 |

附属明細表

有価証券明細表

(a) 株式

該当事項はありません。

(b)株式以外の有価証券

(単位：円)

| 種類 | 銘柄 | 券面総額 | 評価額 | 備考 |
|-----------|------------------------|----------------|----------------|----|
| 親投資信託受益証券 | 国内株式インデックス・マザーファンド（B号） | 15,529,779,345 | 34,761,858,085 | |
| 合計 | | 15,529,779,345 | 34,761,858,085 | |

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

(参考)

S M A M・国内株式パッシブ・ファンド（適格機関投資家専用）は、「国内株式インデックス・マザーファンド（B号）」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）

貸借対照表

(単位：円)

| | (平成26年12月19日現在) | (平成27年12月18日現在) |
|----------|-----------------|-----------------|
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| コール・ローン | 5,221,673,004 | 2,797,289,336 |
| 株式 | 265,203,072,840 | 214,240,794,730 |
| 派生商品評価勘定 | 44,053,160 | 2,070,160 |
| 未収入金 | - | 851,360 |
| 未収配当金 | 21,732,725 | 19,364,700 |
| 未収利息 | 1,430 | 766 |
| 前払金 | - | 7,440,000 |
| 差入委託証拠金 | 123,800,000 | - |
| 流動資産合計 | 270,614,333,159 | 217,067,811,052 |
| 資産合計 | 270,614,333,159 | 217,067,811,052 |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 派生商品評価勘定 | 517,880 | 9,701,320 |
| 前受金 | 43,599,000 | - |
| 未払金 | - | 51,430,000 |
| 未払解約金 | 30,000 | 93,592,122 |

| | （平成26年12月19日現在） | （平成27年12月18日現在） |
|-------------|-----------------|-----------------|
| 流動負債合計 | 44,146,880 | 154,723,442 |
| 負債合計 | 44,146,880 | 154,723,442 |
| 純資産の部 | | |
| 元本等 | | |
| 元本 | 134,290,845,936 | 96,905,986,483 |
| 剰余金 | | |
| 剰余金又は欠損金（ ） | 136,279,340,343 | 120,007,101,127 |
| 元本等合計 | 270,570,186,279 | 216,913,087,610 |
| 純資産合計 | 270,570,186,279 | 216,913,087,610 |
| 負債純資産合計 | 270,614,333,159 | 217,067,811,052 |

注記表

（重要な会計方針の注記）

| 項目 | 自平成27年12月1日 至平成27年12月18日 |
|----------------------|--|
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法 | <p>株式は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p> |
| 2. デリバティブの評価基準及び評価方法 | <p>先物取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場によっております。</p> |
| 3. 収益及び費用の計上基準 | <p>受取配当金の計上基準</p> <p>受取配当金は原則として、配当落ち日において、確定配当金額または予想配当金額を計上しております。なお、配当金額が未確定の場合は、入金日基準で計上しております。</p> |

（貸借対照表に関する注記）

| 項目 | （平成26年12月19日現在） | （平成27年12月18日現在） |
|---------|---|---|
| 1. 担保資産 | <p>代用として、担保に供している資産は次の通りであります。</p> <p>株式 3,781,000,000円</p> | <p>代用として、担保に供している資産は次の通りであります。</p> <p>株式 3,829,000,000円</p> |

| | | |
|-----------------------|--|--|
| 2. 当計算期間の末日における受益権の総数 | 134,290,845,936口 | 96,905,986,483口 |
| 3. 1単位当たり純資産の額 | 1口当たり純資産額 (10,000口当たりの純資産額) 2.0148円 20,148円) | 1口当たり純資産額 (10,000口当たりの純資産額) 2.2384円 22,384円) |

(金融商品に関する注記)

. 金融商品の状況に関する事項

| 項目 | 自 平成27年12月 1日 至 平成27年12月18日 |
|------------------------|---|
| 1. 金融商品に対する取組方針 | 当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。 |
| 2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク | <p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、株式を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、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。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p> |

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

・金融商品の時価等に関する事項

| 項目 | (平成27年12月18日現在) |
|-------------------|---|
| 1.貸借対照表計上額、時価及び差額 | 金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 |
| 2.時価の算定方法 | <p>(1) 有価証券（株式） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p> |

(デリバティブ取引に関する注記)

(平成26年12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 | | 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 | 5,308,944,720 | - | 5,352,480,000 | 43,535,280 |
| | 東証株価指数先物 | 5,308,944,720 | - | 5,352,480,000 | 43,535,280 |
| 合計 | | 5,308,944,720 | - | 5,352,480,000 | 43,535,280 |

（平成27年12月18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 | 2,721,926,160 | - | 2,714,295,000 | 7,631,160 |
| | 東証株価指数先物 | 2,721,926,160 | - | 2,714,295,000 | 7,631,160 |
| 合計 | | 2,721,926,160 | - | 2,714,295,000 | 7,631,160 |

（注）1．時価の算定方法

(1) 株価指数先物取引の時価の算定方法について

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います。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います。

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）

該当事項はありません。

（その他の注記）

| （平成26年12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 | 137,241,405,220円 |
| 同期中における追加設定元本額 | 598,965,986円 |
| 同期中における一部解約元本額 | 3,549,525,270円 |

| | |
|------------------------------------|-----------------|
| 平成26年12月19日現在における元本の内訳 | |
| 三井住友・日本株式インデックス年金ファンド | 9,382,897,834円 |
| 三井住友・DC年金バランス30(債券重点型) | 428,942,345円 |
| 三井住友・DC年金バランス50(標準型) | 2,220,145,291円 |
| 三井住友・DC年金バランス70(株式重点型) | 1,685,954,988円 |
| スミセイ・DCバランスファンド(機動的資産配分型) | 78,506,259円 |
| スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2020 | 6,553,383円 |
| スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2025 | 11,651,025円 |
| スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2030 | 12,073,659円 |
| スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2035 | 18,172,736円 |
| スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2040 | 9,258,206円 |
| スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2045 | 19,632,467円 |
| 国内株式指数ファンド(TOPIX) | 1,846,775,110円 |
| 三井住友・DC日本株式インデックスファンドS | 590,981,548円 |
| SMAM・国内株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用) | 25,543,536,266円 |
| バランスファンドVA(安定運用型)〈適格機関投資家限定〉 | 301,514,598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〉 | 29,902,554,426円 |
| SMAM・バランスファンドVA25〈適格機関投資家専用〉 | 10,641,634,750円 |
| SMAM・バランスファンドVA37.5〈適格機関投資家専用〉 | 4,764,295,415円 |
| SMAM・バランスファンドVA50〈適格機関投資家専用〉 | 17,520,518,753円 |
| SMAM・バランスファンドVL30〈適格機関投資家限定〉 | 103,726,785円 |
| SMAM・バランスファンドVL50〈適格機関投資家限定〉 | 398,636,465円 |
| 世界6資産バランスファンドVA〈適格機関投資家限定〉 | 48,266,767円 |
| SMAM・バランスファンドVA75〈適格機関投資家専用〉 | 2,008,659,813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〉 | 96,939,284円 |
| SMAM・インデックス・バランスVA25〈適格機関投資家専用〉 | 631,148,654円 |
| SMAM・インデックス・バランスVA50〈適格機関投資家専用〉 | 2,028,456,159円 |
| SMAM・バランスファンドVA40〈適格機関投資家専用〉 | 3,540,303,075円 |
| SMAM・バランスファンドVA35〈適格機関投資家専用〉 | 6,173,058,649円 |
| SMAM・バランスVA株40T〈適格機関投資家限定〉 | 448,414,724円 |
| 三井住友・5資産バランスファンド・VAS(適格機関投資家専用) | 5,072,681,210円 |
| SMAM・グローバルバランス40VA〈適格機関投資家限定〉 | 120,311,735円 |
| SMAM・バランスファンドVA20〈適格機関投資家専用〉 | 229,839,533円 |
| 三井住友・7資産バランスファンド・VAS(適格機関投資家専用) | 4,046,903,029円 |
| SMAM・アセットバランスファンドVA20A〈適格機関投資家専用〉 | 176,214,003円 |
| SMAM・アセットバランスファンドVA35A〈適格機関投資家専用〉 | 89,393,967円 |
| SMAM・アセットバランスファンドVA50A〈適格機関投資家専用〉 | 37,655,174円 |
| SMAM・アセットバランスファンドVA20L〈適格機関投資家専用〉 | 418,009,634円 |
| SMAM・アセットバランスファンドVA25L〈適格機関投資家専用〉 | 715,144,856円 |
| SMAM・アセットバランスファンドVA20T〈適格機関投資家専用〉 | 297,790,547円 |
| SMAM・アセットバランスファンドVA20A2〈適格機関投資家専用〉 | 201,087,008円 |
| SMAM・アセットバランスファンドVA35A2〈適格機関投資家専用〉 | 102,539,216円 |
| SMAM・アセットバランスファンドVA50A2〈適格機関投資家専用〉 | 13,787,833円 |
| SMAM・アセットバランスファンドVA30L2〈適格機関投資家専用〉 | 147,931,998円 |
| SMAM・アセットバランスファンドVA25L2〈適格機関投資家専用〉 | 1,770,415,440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) | 325,932,390円 |
| SMAM・アセットバランスファンドVA20T2〈適格機関投資家専用〉 | 58,134,050円 |
| SMAM・FG新興国重視型バランス20VA〈適格機関投資家限定〉 | 631,285円 |

| | |
|--|------------------|
| S M A M ・ F G グローバルバランス 2 5 V A < 適格機関投資家限定 > | 3,145,074円 |
| S M A M ・ グローバル・マルチアセット・グロース・ファンド(安定成長型) < 適格機関投資家限定 > | 88,520円 |
| 合計 | 134,290,845,936円 |

(平成27年12月18日現在)

| | |
|---|-----------------|
| 開示対象ファンドの | |
| 期首における当該親投資信託の元本額 | 97,649,281,775円 |
| 同期中における追加設定元本額 | 800,619,711円 |
| 同期中における一部解約元本額 | 1,543,915,003円 |
| 平成27年12月18日現在における元本の内訳 | |
| 三井住友・日本株式インデックス年金ファンド | 9,447,463,495円 |
| 三井住友・DC年金バランス30(債券重点型) | 445,479,800円 |
| 三井住友・DC年金バランス50(標準型) | 2,320,617,897円 |
| 三井住友・DC年金バランス70(株式重点型) | 1,711,260,187円 |
| S M A M ・ グローバルバランスファンド(機動的資産配分型) | 100,347,097円 |
| スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2020 | 7,312,741円 |
| スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2025 | 16,120,471円 |
| スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2030 | 54,889,113円 |
| スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2035 | 39,324,306円 |
| スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2040 | 23,674,982円 |
| スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2045 | 53,206,129円 |
| 国内株式指数ファンド(T O P I X) | 2,160,007,942円 |
| 三井住友・DC日本株式インデックスファンドS | 817,754,630円 |
| アセットアロケーション・ファンド(安定型) | 290,282,628円 |
| アセットアロケーション・ファンド(安定成長型) | 510,799,989円 |
| アセットアロケーション・ファンド(成長型) | 634,812,135円 |
| S M A M ・ 国内株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用) | 15,529,779,345円 |
| バランスファンドVA(安定運用型) < 適格機関投資家限定 > | 133,865,301円 |
| S M A M ・ バランスファンドVA安定成長型 < 適格機関投資家限定 > | 15,829,088,154円 |
| S M A M ・ バランスファンドVA25 < 適格機関投資家専用 > | 7,058,035,025円 |
| S M A M ・ バランスファンドVA37.5 < 適格機関投資家専用 > | 3,716,619,363円 |
| S M A M ・ バランスファンドVA50 < 適格機関投資家専用 > | 13,875,729,303円 |
| S M A M ・ バランスファンドVL30 < 適格機関投資家限定 > | 77,363,005円 |
| S M A M ・ バランスファンドVL50 < 適格機関投資家限定 > | 319,250,671円 |
| 世界6資産バランスファンドVA < 適格機関投資家限定 > | 21,805,774円 |
| S M A M ・ バランスファンドVA75 < 適格機関投資家専用 > | 1,524,494,427円 |
| S M A M ・ バランスファンドVL国際分散型 < 適格機関投資家限定 > | 78,999,123円 |
| S M A M ・ インデックス・バランスVA25 < 適格機関投資家専用 > | 524,915,239円 |
| S M A M ・ インデックス・バランスVA50 < 適格機関投資家専用 > | 1,672,830,912円 |
| S M A M ・ バランスファンドVA40 < 適格機関投資家専用 > | 2,703,796,162円 |
| S M A M ・ バランスファンドVA35 < 適格機関投資家専用 > | 4,874,911,467円 |
| S M A M ・ バランスVA株40T < 適格機関投資家限定 > | 122,119,741円 |
| 三井住友・5資産バランスファンド・VAS(適格機関投資家専用) | 3,449,367,622円 |

| | |
|--|-----------------|
| SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定> | 99,843,434円 |
| SMAM・バランスファンドVA20<適格機関投資家専用> | 170,845,899円 |
| 三井住友・7資産バランスファンド・VAS(適格機関投資家専用) | 3,011,596,233円 |
| SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用> | 146,753,322円 |
| SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用> | 72,044,856円 |
| SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用> | 32,805,640円 |
| SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用> | 325,447,289円 |
| SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用> | 581,438,114円 |
| SMAM・アセットバランスファンドVA20T<適格機関投資家専用> | 235,844,490円 |
| SMAM・アセットバランスファンドVA20A2<適格機関投資家専用> | 160,023,807円 |
| SMAM・アセットバランスファンドVA35A2<適格機関投資家専用> | 81,748,634円 |
| SMAM・アセットバランスファンドVA50A2<適格機関投資家専用> | 12,531,577円 |
| SMAM・アセットバランスファンドVA30L2<適格機関投資家専用> | 121,022,504円 |
| SMAM・アセットバランスファンドVA25L2<適格機関投資家専用> | 1,412,407,936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) | 262,199,422円 |
| SMAM・アセットバランスファンドVA20T2<適格機関投資家専用> | 29,807,987円 |
| SMAM・FG新興国重視型バランス20VA<適格機関投資家限定> | 305,920円 |
| SMAM・FGグローバルバランス25VA<適格機関投資家限定> | 2,473,721円 |
| SMAM・グローバル・マルチアセット・グロース・ファンド(安定成長型)<適格機関投資家限定> | 310,886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> | 210,636円 |
| 合計 | 96,905,986,483円 |

附属明細表

有価証券明細表

(a)株式

(単位:円)

| 銘柄 | 株数 | 評価額 | | 備考 |
|----------------|---------|----------|-------------|----|
| | | 単価 | 金額 | |
| 極洋 | 51,000 | 262.00 | 13,362,000 | |
| 日本水産 | 120,800 | 470.00 | 56,776,000 | |
| マルハニチロ | 21,500 | 1,999.00 | 42,978,500 | |
| サカタのタネ | 16,800 | 2,703.00 | 45,410,400 | |
| ホクト | 10,700 | 2,361.00 | 25,262,700 | |
| 住石ホールディングス | 35,700 | 114.00 | 4,069,800 | |
| 日鉄鉱業 | 30,000 | 543.00 | 16,290,000 | |
| 三井松島産業 | 75,000 | 134.00 | 10,050,000 | |
| 国際石油開発帝石 | 558,600 | 1,141.00 | 637,362,600 | |
| 日本海洋掘削 | 2,900 | 2,655.00 | 7,699,500 | |
| 石油資源開発 | 16,600 | 3,175.00 | 52,705,000 | |
| K&Oエナジーグループ | 7,000 | 1,719.00 | 12,033,000 | |
| ショーボンドホールディングス | 9,800 | 4,430.00 | 43,414,000 | |
| ミライト・ホールディングス | 32,500 | 987.00 | 32,077,500 | |

| | | | |
|-----------------|---------|-----------|-------------|
| ダイセキ環境ソリューション | 3,400 | 1,375.00 | 4,675,000 |
| 安藤・間 | 69,200 | 689.00 | 47,678,800 |
| 東急建設 | 34,000 | 916.00 | 31,144,000 |
| コムシスホールディングス | 47,600 | 1,712.00 | 81,491,200 |
| ミサワホーム | 13,600 | 874.00 | 11,886,400 |
| 高松コンストラクショングループ | 7,600 | 2,596.00 | 19,729,600 |
| 東建コーポレーション | 3,900 | 9,230.00 | 35,997,000 |
| 大成建設 | 548,000 | 797.00 | 436,756,000 |
| 大林組 | 317,000 | 1,153.00 | 365,501,000 |
| 清水建設 | 323,000 | 1,036.00 | 334,628,000 |
| 飛鳥建設 | 76,100 | 199.00 | 15,143,900 |
| 長谷工コーポレーション | 123,800 | 1,360.00 | 168,368,000 |
| 松井建設 | 14,200 | 753.00 | 10,692,600 |
| 銭高組 | 17,000 | 557.00 | 9,469,000 |
| 鹿島建設 | 496,000 | 726.00 | 360,096,000 |
| 不動テトラ | 81,700 | 143.00 | 11,683,100 |
| 鉄建建設 | 64,000 | 290.00 | 18,560,000 |
| 西松建設 | 124,000 | 462.00 | 57,288,000 |
| 三井住友建設 | 412,900 | 115.00 | 47,483,500 |
| 大豊建設 | 41,000 | 601.00 | 24,641,000 |
| 前田建設工業 | 67,000 | 790.00 | 52,930,000 |
| 佐田建設 | 9,400 | 486.00 | 4,568,400 |
| ナカノフドー建設 | 9,800 | 755.00 | 7,399,000 |
| 奥村組 | 102,000 | 675.00 | 68,850,000 |
| 東鉄工業 | 12,400 | 2,860.00 | 35,464,000 |
| イチケン | 14,000 | 426.00 | 5,964,000 |
| 戸田建設 | 124,000 | 670.00 | 83,080,000 |
| 熊谷組 | 153,000 | 332.00 | 50,796,000 |
| 青木あすなろ建設 | 8,500 | 816.00 | 6,936,000 |
| 北野建設 | 22,000 | 322.00 | 7,084,000 |
| 植木組 | 19,000 | 275.00 | 5,225,000 |
| 三井ホーム | 16,000 | 559.00 | 8,944,000 |
| 矢作建設工業 | 15,500 | 816.00 | 12,648,000 |
| ピーエス三菱 | 16,100 | 391.00 | 6,295,100 |
| 日本ハウスホールディングス | 24,400 | 456.00 | 11,126,400 |
| 大東建託 | 39,800 | 13,875.00 | 552,225,000 |
| 新日本建設 | 14,600 | 678.00 | 9,898,800 |
| N I P P O | 24,000 | 2,023.00 | 48,552,000 |
| 東亜道路工業 | 22,000 | 440.00 | 9,680,000 |
| 前田道路 | 33,000 | 2,118.00 | 69,894,000 |
| 日本道路 | 31,000 | 612.00 | 18,972,000 |
| 東亜建設工業 | 92,000 | 321.00 | 29,532,000 |

| | | | | |
|-----------------|---------|----------|---------------|--|
| 若築建設 | 70,000 | 144.00 | 10,080,000 | |
| 東洋建設 | 34,000 | 527.00 | 17,918,000 | |
| 五洋建設 | 119,800 | 502.00 | 60,139,600 | |
| 大林道路 | 13,000 | 839.00 | 10,907,000 | |
| 世紀東急工業 | 18,300 | 642.00 | 11,748,600 | |
| 福田組 | 17,000 | 1,336.00 | 22,712,000 | |
| 住友林業 | 72,700 | 1,606.00 | 116,756,200 | |
| 日本基礎技術 | 13,800 | 508.00 | 7,010,400 | |
| 日成ビルド工業 | 31,000 | 375.00 | 11,625,000 | |
| ヤマダ・エスバイエルホーム | 66,000 | 81.00 | 5,346,000 | |
| 巴コーポレーション | 17,600 | 371.00 | 6,529,600 | |
| パナホーム | 38,000 | 904.00 | 34,352,000 | |
| 大和ハウス工業 | 313,100 | 3,368.00 | 1,054,520,800 | |
| ライト工業 | 20,500 | 1,115.00 | 22,857,500 | |
| 積水ハウス | 354,600 | 1,965.50 | 696,966,300 | |
| 日特建設 | 13,800 | 490.00 | 6,762,000 | |
| 北陸電気工事 | 4,900 | 996.00 | 4,880,400 | |
| ユアテック | 17,000 | 1,139.00 | 19,363,000 | |
| 中電工 | 14,800 | 2,668.00 | 39,486,400 | |
| 関電工 | 41,000 | 823.00 | 33,743,000 | |
| きんでん | 64,000 | 1,584.00 | 101,376,000 | |
| 東京エネシス | 12,000 | 1,001.00 | 12,012,000 | |
| トーエネック | 16,000 | 846.00 | 13,536,000 | |
| 住友電設 | 8,000 | 1,530.00 | 12,240,000 | |
| 日本電設工業 | 17,100 | 2,558.00 | 43,741,800 | |
| 協和エクシオ | 42,300 | 1,225.00 | 51,817,500 | |
| 新日本空調 | 8,800 | 1,066.00 | 9,380,800 | |
| N D S | 21,000 | 349.00 | 7,329,000 | |
| 九電工 | 19,000 | 2,183.00 | 41,477,000 | |
| 三機工業 | 23,800 | 1,011.00 | 24,061,800 | |
| 日揮 | 107,000 | 1,862.00 | 199,234,000 | |
| 中外炉工業 | 40,000 | 233.00 | 9,320,000 | |
| ヤマト | 12,800 | 492.00 | 6,297,600 | |
| 太平電業 | 15,000 | 1,203.00 | 18,045,000 | |
| 高砂熱学工業 | 31,300 | 1,763.00 | 55,181,900 | |
| 朝日工業社 | 15,000 | 501.00 | 7,515,000 | |
| 明星工業 | 20,900 | 510.00 | 10,659,000 | |
| 大気社 | 13,400 | 2,937.00 | 39,355,800 | |
| ダイダン | 16,000 | 854.00 | 13,664,000 | |
| 日比谷総合設備 | 13,000 | 1,628.00 | 21,164,000 | |
| 東芝プラントシステム | 17,500 | 1,265.00 | 22,137,500 | |
| O S J Bホールディングス | 26,700 | 255.00 | 6,808,500 | |

| | | | |
|-----------------|---------|----------|-------------|
| 東洋エンジニアリング | 58,000 | 319.00 | 18,502,000 |
| 千代田化工建設 | 77,000 | 921.00 | 70,917,000 |
| 新興プランテック | 21,200 | 982.00 | 20,818,400 |
| 日本製粉 | 68,000 | 867.00 | 58,956,000 |
| 日清製粉グループ本社 | 115,500 | 1,962.00 | 226,611,000 |
| 日東富士製粉 | 16,000 | 386.00 | 6,176,000 |
| 昭和産業 | 42,000 | 446.00 | 18,732,000 |
| 鳥越製粉 | 11,300 | 800.00 | 9,040,000 |
| 中部飼料 | 10,900 | 1,001.00 | 10,910,900 |
| フィード・ワン | 70,500 | 135.00 | 9,517,500 |
| 日本甜菜製糖 | 63,000 | 201.00 | 12,663,000 |
| 三井製糖 | 41,000 | 554.00 | 22,714,000 |
| 森永製菓 | 95,000 | 646.00 | 61,370,000 |
| 中村屋 | 31,000 | 470.00 | 14,570,000 |
| 江崎グリコ | 24,500 | 6,470.00 | 158,515,000 |
| 名糖産業 | 5,100 | 1,343.00 | 6,849,300 |
| 不二家 | 72,000 | 203.00 | 14,616,000 |
| 山崎製パン | 78,000 | 2,520.00 | 196,560,000 |
| モロゾフ | 18,000 | 433.00 | 7,794,000 |
| 亀田製菓 | 5,800 | 4,705.00 | 27,289,000 |
| 寿スピリッツ | 2,700 | 5,060.00 | 13,662,000 |
| カルビー | 39,200 | 4,955.00 | 194,236,000 |
| 森永乳業 | 97,000 | 563.00 | 54,611,000 |
| 六甲バター | 5,500 | 1,803.00 | 9,916,500 |
| ヤクルト本社 | 56,800 | 5,960.00 | 338,528,000 |
| 明治ホールディングス | 62,700 | 9,970.00 | 625,119,000 |
| 雪印メグミルク | 25,300 | 3,165.00 | 80,074,500 |
| プリマハム | 65,000 | 324.00 | 21,060,000 |
| 日本ハム | 77,000 | 2,309.00 | 177,793,000 |
| 伊藤ハム | 50,000 | 641.00 | 32,050,000 |
| 林兼産業 | 43,000 | 117.00 | 5,031,000 |
| 丸大食品 | 54,000 | 467.00 | 25,218,000 |
| 米久 | 3,800 | 2,303.00 | 8,751,400 |
| S Foods | 6,700 | 2,104.00 | 14,096,800 |
| サッポロホールディングス | 161,000 | 545.00 | 87,745,000 |
| アサヒグループホールディングス | 199,200 | 3,867.00 | 770,306,400 |
| キリンホールディングス | 429,500 | 1,718.00 | 737,881,000 |
| 宝ホールディングス | 77,000 | 936.00 | 72,072,000 |
| オエノンホールディングス | 38,000 | 236.00 | 8,968,000 |
| 養命酒製造 | 4,200 | 2,000.00 | 8,400,000 |
| コカ・コーラウエスト | 35,800 | 2,572.00 | 92,077,600 |
| コカ・コーライーストジャパン | 37,700 | 1,934.00 | 72,911,800 |

| | | | |
|------------------|---------|----------|---------------|
| サントリー食品インターナショナル | 72,500 | 5,350.00 | 387,875,000 |
| ダイドードリンコ | 5,200 | 5,630.00 | 29,276,000 |
| 伊藤園 | 31,900 | 2,943.00 | 93,881,700 |
| キーコーヒー | 8,400 | 1,911.00 | 16,052,400 |
| 日清オイリオグループ | 55,000 | 476.00 | 26,180,000 |
| 不二製油グループ本社 | 28,700 | 1,849.00 | 53,066,300 |
| J・オイルミルズ | 43,000 | 346.00 | 14,878,000 |
| キッコーマン | 80,000 | 4,125.00 | 330,000,000 |
| 味の素 | 227,000 | 2,736.00 | 621,072,000 |
| キューピー | 54,000 | 2,959.00 | 159,786,000 |
| ハウス食品グループ本社 | 35,800 | 2,346.00 | 83,986,800 |
| カゴメ | 38,200 | 2,109.00 | 80,563,800 |
| 焼津水産化学工業 | 8,000 | 1,018.00 | 8,144,000 |
| アリアケジャパン | 8,600 | 6,660.00 | 57,276,000 |
| ニチレイ | 113,000 | 838.00 | 94,694,000 |
| 東洋水産 | 51,900 | 4,175.00 | 216,682,500 |
| 日清食品ホールディングス | 44,700 | 6,360.00 | 284,292,000 |
| 永谷園ホールディングス | 12,000 | 1,061.00 | 12,732,000 |
| 一正蒲鉾 | 5,000 | 1,081.00 | 5,405,000 |
| フジッコ | 10,200 | 2,150.00 | 21,930,000 |
| ロック・フィールド | 5,400 | 3,005.00 | 16,227,000 |
| 日本たばこ産業 | 626,700 | 4,488.00 | 2,812,629,600 |
| ケンコーマヨネーズ | 4,300 | 2,163.00 | 9,300,900 |
| わらべや日洋 | 5,200 | 2,206.00 | 11,471,200 |
| なとり | 6,500 | 1,763.00 | 11,459,500 |
| ユーグレナ | 35,800 | 1,821.00 | 65,191,800 |
| ミヨシ油脂 | 49,000 | 140.00 | 6,860,000 |
| 理研ビタミン | 3,500 | 3,940.00 | 13,790,000 |
| 片倉工業 | 13,000 | 1,312.00 | 17,056,000 |
| ゲンゼ | 81,000 | 356.00 | 28,836,000 |
| 東洋紡 | 398,000 | 168.00 | 66,864,000 |
| ユニチカ | 288,000 | 59.00 | 16,992,000 |
| 富士紡ホールディングス | 56,000 | 217.00 | 12,152,000 |
| 倉敷紡績 | 101,000 | 206.00 | 20,806,000 |
| シキボウ | 74,000 | 120.00 | 8,880,000 |
| 日本毛織 | 31,000 | 891.00 | 27,621,000 |
| ダイドーリミテッド | 17,000 | 496.00 | 8,432,000 |
| 帝国繊維 | 10,800 | 1,636.00 | 17,668,800 |
| 帝人 | 406,000 | 411.00 | 166,866,000 |
| 東レ | 720,000 | 1,093.00 | 786,960,000 |
| サカイオーベックス | 33,000 | 235.00 | 7,755,000 |
| 住江織物 | 29,000 | 349.00 | 10,121,000 |

| | | | |
|---------------|---------|----------|-------------|
| 芦森工業 | 27,000 | 199.00 | 5,373,000 |
| アツギ | 96,000 | 117.00 | 11,232,000 |
| ダイニック | 35,000 | 174.00 | 6,090,000 |
| セーレン | 24,600 | 1,364.00 | 33,554,400 |
| 小松精練 | 18,100 | 684.00 | 12,380,400 |
| ワコールホールディングス | 59,000 | 1,437.00 | 84,783,000 |
| ホギメディカル | 6,200 | 6,100.00 | 37,820,000 |
| レナウン | 36,200 | 125.00 | 4,525,000 |
| T S Iホールディングス | 45,300 | 829.00 | 37,553,700 |
| 三陽商会 | 58,000 | 289.00 | 16,762,000 |
| オンワードホールディングス | 67,000 | 751.00 | 50,317,000 |
| ルック | 27,000 | 163.00 | 4,401,000 |
| ゴールドウイン | 4,300 | 5,140.00 | 22,102,000 |
| デサント | 23,200 | 1,420.00 | 32,944,000 |
| 特種東海製紙 | 58,000 | 365.00 | 21,170,000 |
| 王子ホールディングス | 402,000 | 483.00 | 194,166,000 |
| 日本製紙 | 50,200 | 1,853.00 | 93,020,600 |
| 三菱製紙 | 165,000 | 83.00 | 13,695,000 |
| 北越紀州製紙 | 61,200 | 716.00 | 43,819,200 |
| 中越パルプ工業 | 44,000 | 203.00 | 8,932,000 |
| 巴川製紙所 | 22,000 | 221.00 | 4,862,000 |
| 大王製紙 | 43,800 | 1,011.00 | 44,281,800 |
| レンゴー | 88,000 | 496.00 | 43,648,000 |
| トーモク | 36,000 | 278.00 | 10,008,000 |
| ザ・パック | 6,800 | 3,190.00 | 21,692,000 |
| クラレ | 155,100 | 1,516.00 | 235,131,600 |
| 旭化成 | 619,000 | 775.50 | 480,034,500 |
| 共和レザー | 7,700 | 935.00 | 7,199,500 |
| 昭和電工 | 656,000 | 146.00 | 95,776,000 |
| 住友化学 | 728,000 | 679.00 | 494,312,000 |
| 住友精化 | 21,000 | 741.00 | 15,561,000 |
| 日産化学工業 | 59,400 | 2,812.00 | 167,032,800 |
| ラサ工業 | 48,000 | 137.00 | 6,576,000 |
| クレハ | 74,000 | 455.00 | 33,670,000 |
| テイカ | 19,000 | 603.00 | 11,457,000 |
| 石原産業 | 180,000 | 100.00 | 18,000,000 |
| 日東エフシー | 6,900 | 881.00 | 6,078,900 |
| 日本曹達 | 64,000 | 705.00 | 45,120,000 |
| 東ソー | 267,000 | 622.00 | 166,074,000 |
| トクヤマ | 162,000 | 271.00 | 43,902,000 |
| セントラル硝子 | 109,000 | 559.00 | 60,931,000 |
| 東亜合成 | 62,500 | 1,026.00 | 64,125,000 |

| | | | | |
|----------------|---------|----------|---------------|--|
| 大阪ソーダ | 42,000 | 449.00 | 18,858,000 | |
| 関東電化工業 | 24,000 | 793.00 | 19,032,000 | |
| デンカ | 204,000 | 525.00 | 107,100,000 | |
| 信越化学工業 | 177,400 | 6,618.00 | 1,174,033,200 | |
| 日本カーバイド工業 | 41,000 | 174.00 | 7,134,000 | |
| 堺化学工業 | 40,000 | 418.00 | 16,720,000 | |
| エア・ウォーター | 81,000 | 1,891.00 | 153,171,000 | |
| 大陽日酸 | 76,800 | 1,066.00 | 81,868,800 | |
| 日本化学工業 | 41,000 | 279.00 | 11,439,000 | |
| 日本パーカラライジング | 49,800 | 1,237.00 | 61,602,600 | |
| 高压ガス工業 | 16,000 | 669.00 | 10,704,000 | |
| 四国化成工業 | 15,000 | 1,182.00 | 17,730,000 | |
| 戸田工業 | 24,000 | 319.00 | 7,656,000 | |
| ステラ ケミファ | 6,800 | 1,795.00 | 12,206,000 | |
| 保土谷化学工業 | 37,000 | 233.00 | 8,621,000 | |
| 日本触媒 | 14,400 | 8,920.00 | 128,448,000 | |
| 大日精化工業 | 36,000 | 550.00 | 19,800,000 | |
| カネカ | 134,000 | 1,233.00 | 165,222,000 | |
| 三菱瓦斯化学 | 171,000 | 592.00 | 101,232,000 | |
| 三井化学 | 420,000 | 523.00 | 219,660,000 | |
| J S R | 97,800 | 1,829.00 | 178,876,200 | |
| 東京応化工業 | 20,000 | 3,780.00 | 75,600,000 | |
| 大阪有機化学工業 | 9,800 | 634.00 | 6,213,200 | |
| 三菱ケミカルホールディングス | 663,900 | 764.40 | 507,485,160 | |
| 日本合成化学工業 | 24,000 | 870.00 | 20,880,000 | |
| ダイセル | 138,900 | 1,789.00 | 248,492,100 | |
| 住友ベークライト | 94,000 | 498.00 | 46,812,000 | |
| 積水化学工業 | 227,800 | 1,556.00 | 354,456,800 | |
| 日本ゼオン | 86,000 | 952.00 | 81,872,000 | |
| アイカ工業 | 29,900 | 2,409.00 | 72,029,100 | |
| 宇部興産 | 528,000 | 250.00 | 132,000,000 | |
| 積水樹脂 | 14,700 | 1,635.00 | 24,034,500 | |
| タキロン | 25,000 | 609.00 | 15,225,000 | |
| 旭有機材工業 | 40,000 | 225.00 | 9,000,000 | |
| 日立化成 | 48,700 | 1,928.00 | 93,893,600 | |
| ニチバン | 12,000 | 613.00 | 7,356,000 | |
| リケンテクノス | 18,500 | 421.00 | 7,788,500 | |
| 大倉工業 | 29,000 | 357.00 | 10,353,000 | |
| 積水化成成品工業 | 28,000 | 410.00 | 11,480,000 | |
| 群栄化学工業 | 30,000 | 307.00 | 9,210,000 | |
| ミライアル | 5,400 | 1,099.00 | 5,934,600 | |
| ダイキョーニシカワ | 3,300 | 8,840.00 | 29,172,000 | |

| | | | |
|------------------|---------|-----------|---------------|
| 日本化薬 | 64,000 | 1,338.00 | 85,632,000 |
| カーリットホールディングス | 11,600 | 516.00 | 5,985,600 |
| 日本精化 | 10,000 | 906.00 | 9,060,000 |
| A D E K A | 48,500 | 1,707.00 | 82,789,500 |
| 日油 | 76,000 | 933.00 | 70,908,000 |
| 新日本理化 | 20,400 | 186.00 | 3,794,400 |
| 花王 | 266,500 | 6,038.00 | 1,609,127,000 |
| 第一工業製薬 | 25,000 | 351.00 | 8,775,000 |
| 三洋化成工業 | 30,000 | 987.00 | 29,610,000 |
| 大日本塗料 | 63,000 | 231.00 | 14,553,000 |
| 日本ペイントホールディングス | 76,500 | 2,802.00 | 214,353,000 |
| 関西ペイント | 111,700 | 1,807.00 | 201,841,900 |
| 中国塗料 | 29,000 | 851.00 | 24,679,000 |
| 日本特殊塗料 | 7,900 | 1,083.00 | 8,555,700 |
| 藤倉化成 | 16,400 | 562.00 | 9,216,800 |
| 太陽ホールディングス | 7,300 | 4,570.00 | 33,361,000 |
| D I C | 395,000 | 338.00 | 133,510,000 |
| サカティクス | 19,800 | 1,267.00 | 25,086,600 |
| 東洋インキS Cホールディングス | 93,000 | 483.00 | 44,919,000 |
| T & K T O K A | 4,000 | 2,312.00 | 9,248,000 |
| 富士フィルムホールディングス | 226,600 | 4,852.00 | 1,099,463,200 |
| 資生堂 | 188,500 | 2,592.00 | 488,592,000 |
| ライオン | 115,000 | 1,164.00 | 133,860,000 |
| 高砂香料工業 | 6,600 | 2,904.00 | 19,166,400 |
| マンダム | 9,200 | 4,835.00 | 44,482,000 |
| ミルボン | 5,800 | 4,970.00 | 28,826,000 |
| ファンケル | 23,300 | 1,708.00 | 39,796,400 |
| コーセー | 16,000 | 11,310.00 | 180,960,000 |
| シーズ・ホールディングス | 13,500 | 2,013.00 | 27,175,500 |
| ポーラ・オルビスホールディングス | 10,100 | 8,240.00 | 83,224,000 |
| ノエビアホールディングス | 6,200 | 3,605.00 | 22,351,000 |
| エステー | 9,300 | 1,182.00 | 10,992,600 |
| コニシ | 7,900 | 2,604.00 | 20,571,600 |
| 長谷川香料 | 11,600 | 1,552.00 | 18,003,200 |
| 星光P M C | 6,200 | 1,229.00 | 7,619,800 |
| 小林製薬 | 15,000 | 9,850.00 | 147,750,000 |
| 荒川化学工業 | 9,500 | 1,193.00 | 11,333,500 |
| メック | 8,800 | 837.00 | 7,365,600 |
| 日本高純度化学 | 3,800 | 2,278.00 | 8,656,400 |
| J C U | 3,100 | 4,230.00 | 13,113,000 |
| 新田ゼラチン | 8,300 | 711.00 | 5,901,300 |
| デクセリアルズ | 21,900 | 1,314.00 | 28,776,600 |

| | | | |
|-----------|-----------|-----------|---------------|
| アース製薬 | 6,900 | 5,100.00 | 35,190,000 |
| イハラケミカル工業 | 15,500 | 1,606.00 | 24,893,000 |
| 北興化学工業 | 14,000 | 444.00 | 6,216,000 |
| 大成ラミック | 3,000 | 3,065.00 | 9,195,000 |
| クミアイ化学工業 | 20,400 | 1,124.00 | 22,929,600 |
| 日本農薬 | 22,900 | 739.00 | 16,923,100 |
| アキレス | 93,000 | 154.00 | 14,322,000 |
| 有沢製作所 | 15,900 | 781.00 | 12,417,900 |
| 日東電工 | 76,600 | 8,596.00 | 658,453,600 |
| きもと | 23,000 | 266.00 | 6,118,000 |
| 藤森工業 | 8,400 | 2,986.00 | 25,082,400 |
| 前澤化成工業 | 7,800 | 1,138.00 | 8,876,400 |
| J S P | 6,600 | 2,482.00 | 16,381,200 |
| エフピコ | 8,700 | 4,430.00 | 38,541,000 |
| 天馬 | 7,100 | 2,400.00 | 17,040,000 |
| 信越ポリマー | 20,700 | 686.00 | 14,200,200 |
| 東リ | 30,000 | 341.00 | 10,230,000 |
| ニフコ | 19,000 | 5,350.00 | 101,650,000 |
| 日本バルカー工業 | 45,000 | 303.00 | 13,635,000 |
| ユニ・チャーム | 201,000 | 2,399.50 | 482,299,500 |
| 協和発酵キリン | 118,000 | 2,147.00 | 253,346,000 |
| 武田薬品工業 | 394,700 | 5,981.00 | 2,360,700,700 |
| アステラス製薬 | 1,109,500 | 1,701.00 | 1,887,259,500 |
| 大日本住友製薬 | 70,000 | 1,464.00 | 102,480,000 |
| 塩野義製薬 | 144,500 | 5,402.00 | 780,589,000 |
| 田辺三菱製薬 | 114,900 | 2,087.00 | 239,796,300 |
| あすか製薬 | 13,100 | 1,531.00 | 20,056,100 |
| 日本新薬 | 23,000 | 4,890.00 | 112,470,000 |
| 中外製薬 | 98,400 | 4,455.00 | 438,372,000 |
| 科研製薬 | 17,300 | 8,420.00 | 145,666,000 |
| エーザイ | 122,100 | 8,077.00 | 986,201,700 |
| ロート製薬 | 48,600 | 2,355.00 | 114,453,000 |
| 小野薬品工業 | 45,100 | 21,525.00 | 970,777,500 |
| 久光製薬 | 30,800 | 5,060.00 | 155,848,000 |
| 持田製薬 | 7,000 | 8,280.00 | 57,960,000 |
| 参天製薬 | 182,300 | 1,997.00 | 364,053,100 |
| 扶桑薬品工業 | 43,000 | 289.00 | 12,427,000 |
| 日本ケミファ | 17,000 | 632.00 | 10,744,000 |
| ツムラ | 31,400 | 3,455.00 | 108,487,000 |
| 日医工 | 23,400 | 2,944.00 | 68,889,600 |
| キッセイ薬品工業 | 17,600 | 2,976.00 | 52,377,600 |
| 生化学工業 | 19,200 | 1,706.00 | 32,755,200 |

| | | | |
|------------------|-----------|----------|---------------|
| 栄研化学 | 8,600 | 2,185.00 | 18,791,000 |
| 鳥居薬品 | 6,500 | 2,718.00 | 17,667,000 |
| JCRファーマ | 7,700 | 2,734.00 | 21,051,800 |
| 東和薬品 | 4,600 | 7,540.00 | 34,684,000 |
| 富士製薬工業 | 3,500 | 2,185.00 | 7,647,500 |
| 沢井製薬 | 16,900 | 8,300.00 | 140,270,000 |
| ゼリア新薬工業 | 20,700 | 1,590.00 | 32,913,000 |
| 第一三共 | 333,300 | 2,528.50 | 842,749,050 |
| キョーリン製薬ホールディングス | 26,500 | 2,590.00 | 68,635,000 |
| 大幸薬品 | 5,500 | 1,705.00 | 9,377,500 |
| ダイト | 4,800 | 3,250.00 | 15,600,000 |
| 大塚ホールディングス | 213,000 | 4,422.00 | 941,886,000 |
| 大正製薬ホールディングス | 23,700 | 8,400.00 | 199,080,000 |
| 日本コークス工業 | 84,700 | 102.00 | 8,639,400 |
| 昭和シェル石油 | 99,100 | 1,040.00 | 103,064,000 |
| ニチレキ | 13,000 | 933.00 | 12,129,000 |
| 東燃ゼネラル石油 | 148,000 | 1,086.00 | 160,728,000 |
| ユシロ化学工業 | 5,300 | 1,397.00 | 7,404,100 |
| ピーピー・カストロール | 4,700 | 1,293.00 | 6,077,100 |
| 富士石油 | 22,900 | 370.00 | 8,473,000 |
| MORESCO | 3,500 | 1,673.00 | 5,855,500 |
| 出光興産 | 51,600 | 1,919.00 | 99,020,400 |
| JXホールディングス | 1,172,400 | 491.30 | 576,000,120 |
| コスモエネルギーホールディングス | 30,000 | 1,589.00 | 47,670,000 |
| 横浜ゴム | 59,800 | 1,945.00 | 116,311,000 |
| 東洋ゴム工業 | 45,100 | 2,409.00 | 108,645,900 |
| ブリヂストン | 334,300 | 4,311.00 | 1,441,167,300 |
| 住友ゴム工業 | 92,700 | 1,628.00 | 150,915,600 |
| 藤倉ゴム工業 | 11,700 | 570.00 | 6,669,000 |
| オカモト | 31,000 | 1,122.00 | 34,782,000 |
| ニッタ | 10,800 | 3,270.00 | 35,316,000 |
| 住友理工 | 21,600 | 1,042.00 | 22,507,200 |
| 三ツ星ベルト | 25,000 | 934.00 | 23,350,000 |
| バンドー化学 | 36,000 | 510.00 | 18,360,000 |
| 日東紡績 | 66,000 | 325.00 | 21,450,000 |
| 旭硝子 | 523,000 | 698.00 | 365,054,000 |
| 日本板硝子 | 483,000 | 100.00 | 48,300,000 |
| 石塚硝子 | 19,000 | 236.00 | 4,484,000 |
| 日本山村硝子 | 50,000 | 183.00 | 9,150,000 |
| 日本電気硝子 | 206,000 | 618.00 | 127,308,000 |
| 住友大阪セメント | 198,000 | 457.00 | 90,486,000 |
| 太平洋セメント | 617,000 | 364.00 | 224,588,000 |

| | | | |
|--------------------|-----------|----------|---------------|
| 日本ヒューム | 11,300 | 730.00 | 8,249,000 |
| 日本コンクリート工業 | 23,500 | 345.00 | 8,107,500 |
| 三谷セキサン | 5,600 | 1,591.00 | 8,909,600 |
| アジアパイルホールディングス | 13,700 | 549.00 | 7,521,300 |
| 東海カーボン | 84,000 | 345.00 | 28,980,000 |
| 日本カーボン | 51,000 | 329.00 | 16,779,000 |
| 東洋炭素 | 6,300 | 1,879.00 | 11,837,700 |
| ノリタケカンパニーリミテド | 59,000 | 273.00 | 16,107,000 |
| TOTO | 72,600 | 4,045.00 | 293,667,000 |
| 日本碍子 | 125,000 | 2,768.00 | 346,000,000 |
| 日本特殊陶業 | 85,300 | 3,245.00 | 276,798,500 |
| MARUWA | 4,000 | 2,755.00 | 11,020,000 |
| 品川リフラクトリーズ | 31,000 | 256.00 | 7,936,000 |
| 黒崎播磨 | 26,000 | 280.00 | 7,280,000 |
| ニッカトー | 6,800 | 419.00 | 2,849,200 |
| フジインコーポレーテッド | 8,900 | 1,726.00 | 15,361,400 |
| ニチアス | 49,000 | 808.00 | 39,592,000 |
| ニチハ | 13,500 | 1,821.00 | 24,583,500 |
| 新日鐵住金 | 446,600 | 2,357.50 | 1,052,859,500 |
| 神戸製鋼所 | 1,807,000 | 132.00 | 238,524,000 |
| 中山製鋼所 | 125,000 | 81.00 | 10,125,000 |
| 合同製鐵 | 60,000 | 230.00 | 13,800,000 |
| ジェイ エフ イー ホールディングス | 270,800 | 1,858.00 | 503,146,400 |
| 日新製鋼 | 45,400 | 1,252.00 | 56,840,800 |
| 東京製鐵 | 54,700 | 767.00 | 41,954,900 |
| 共英製鋼 | 10,500 | 2,183.00 | 22,921,500 |
| 大和工業 | 22,000 | 3,025.00 | 66,550,000 |
| 東京鐵鋼 | 23,000 | 576.00 | 13,248,000 |
| 大阪製鐵 | 6,300 | 2,162.00 | 13,620,600 |
| 淀川製鋼所 | 14,400 | 2,476.00 | 35,654,400 |
| 東洋鋼鈹 | 25,900 | 429.00 | 11,111,100 |
| 丸一鋼管 | 33,000 | 3,500.00 | 115,500,000 |
| モリ工業 | 20,000 | 356.00 | 7,120,000 |
| 大同特殊鋼 | 168,000 | 468.00 | 78,624,000 |
| 日本高周波鋼業 | 54,000 | 97.00 | 5,238,000 |
| 日本冶金工業 | 79,400 | 143.00 | 11,354,200 |
| 山陽特殊製鋼 | 59,000 | 570.00 | 33,630,000 |
| 愛知製鋼 | 57,000 | 564.00 | 32,148,000 |
| 日立金属 | 113,300 | 1,504.00 | 170,403,200 |
| 日本金属 | 34,000 | 134.00 | 4,556,000 |
| 大平洋金属 | 68,000 | 320.00 | 21,760,000 |
| 新日本電工 | 58,800 | 218.00 | 12,818,400 |

| | | | |
|------------------|---------|-----------|-------------|
| 栗本鐵工所 | 53,000 | 221.00 | 11,713,000 |
| 三菱製鋼 | 69,000 | 234.00 | 16,146,000 |
| 日亜鋼業 | 19,700 | 293.00 | 5,772,100 |
| シンニッタン | 11,100 | 623.00 | 6,915,300 |
| 大紀アルミニウム工業所 | 20,000 | 312.00 | 6,240,000 |
| 日本軽金属ホールディングス | 225,800 | 212.00 | 47,869,600 |
| 三井金属鉱業 | 257,000 | 218.00 | 56,026,000 |
| 東邦亜鉛 | 54,000 | 268.00 | 14,472,000 |
| 三菱マテリアル | 619,000 | 391.00 | 242,029,000 |
| 住友金属鉱山 | 274,000 | 1,377.50 | 377,435,000 |
| D O W Aホールディングス | 128,000 | 847.00 | 108,416,000 |
| 古河機械金属 | 155,000 | 228.00 | 35,340,000 |
| 大阪チタニウムテクノロジーズ | 10,100 | 2,496.00 | 25,209,600 |
| 東邦チタニウム | 17,800 | 988.00 | 17,586,400 |
| U A C J | 139,000 | 289.00 | 40,171,000 |
| 古河電気工業 | 314,000 | 265.00 | 83,210,000 |
| 住友電気工業 | 397,000 | 1,667.00 | 661,799,000 |
| フジクラ | 139,000 | 671.00 | 93,269,000 |
| 昭和電線ホールディングス | 134,000 | 72.00 | 9,648,000 |
| タツタ電線 | 22,500 | 455.00 | 10,237,500 |
| リョービ | 61,000 | 505.00 | 30,805,000 |
| アーレスティ | 12,900 | 739.00 | 9,533,100 |
| アサヒホールディングス | 15,000 | 1,846.00 | 27,690,000 |
| 稲葉製作所 | 6,300 | 1,280.00 | 8,064,000 |
| 宮地エンジニアリンググループ | 35,000 | 193.00 | 6,755,000 |
| トーカロ | 7,500 | 2,507.00 | 18,802,500 |
| S U M C O | 78,100 | 988.00 | 77,162,800 |
| 川田テクノロジーズ | 2,100 | 3,850.00 | 8,085,000 |
| 東洋製罐グループホールディングス | 70,500 | 2,316.00 | 163,278,000 |
| ホッカンホールディングス | 32,000 | 327.00 | 10,464,000 |
| コロナ | 6,900 | 1,175.00 | 8,107,500 |
| 横河ブリッジホールディングス | 19,000 | 1,385.00 | 26,315,000 |
| 駒井ハルテック | 24,000 | 255.00 | 6,120,000 |
| 三和ホールディングス | 100,900 | 972.00 | 98,074,800 |
| 文化シャッター | 27,700 | 1,039.00 | 28,780,300 |
| 三協立山 | 12,900 | 1,635.00 | 21,091,500 |
| アルインコ | 7,100 | 1,126.00 | 7,994,600 |
| L I X I Lグループ | 138,000 | 2,718.00 | 375,084,000 |
| 日本フィルコン | 12,300 | 507.00 | 6,236,100 |
| ノーリツ | 19,700 | 1,840.00 | 36,248,000 |
| 長府製作所 | 10,600 | 2,833.00 | 30,029,800 |
| リンナイ | 18,500 | 10,620.00 | 196,470,000 |

| | | | |
|--------------|---------|-----------|-------------|
| 日東精工 | 20,000 | 324.00 | 6,480,000 |
| 岡部 | 21,400 | 932.00 | 19,944,800 |
| ジーテクト | 10,400 | 1,741.00 | 18,106,400 |
| 東ブレ | 19,000 | 2,787.00 | 52,953,000 |
| 高周波熱錬 | 19,100 | 950.00 | 18,145,000 |
| 東京製網 | 75,000 | 204.00 | 15,300,000 |
| パイオラックス | 5,000 | 6,480.00 | 32,400,000 |
| 日本発條 | 93,800 | 1,200.00 | 112,560,000 |
| アドバネクス | 2,700 | 1,781.00 | 4,808,700 |
| 三益半導体工業 | 8,400 | 1,177.00 | 9,886,800 |
| 日本製鋼所 | 165,000 | 427.00 | 70,455,000 |
| 三浦工業 | 44,800 | 1,699.00 | 76,115,200 |
| タクマ | 37,000 | 1,018.00 | 37,666,000 |
| ツガミ | 29,000 | 518.00 | 15,022,000 |
| オークマ | 64,000 | 1,009.00 | 64,576,000 |
| 東芝機械 | 52,000 | 404.00 | 21,008,000 |
| アマダホールディングス | 145,800 | 1,148.00 | 167,378,400 |
| アイダエンジニアリング | 25,900 | 1,262.00 | 32,685,800 |
| 滝澤鉄工所 | 38,000 | 160.00 | 6,080,000 |
| 富士機械製造 | 32,000 | 1,195.00 | 38,240,000 |
| 牧野フライス製作所 | 49,000 | 916.00 | 44,884,000 |
| オーエスジー | 45,300 | 2,243.00 | 101,607,900 |
| 旭ダイヤモンド工業 | 26,500 | 1,375.00 | 36,437,500 |
| D M G 森精機 | 54,800 | 1,435.00 | 78,638,000 |
| ソディック | 19,200 | 923.00 | 17,721,600 |
| ディスコ | 12,600 | 11,520.00 | 145,152,000 |
| 日東工器 | 6,100 | 2,701.00 | 16,476,100 |
| パンチ工業 | 4,200 | 958.00 | 4,023,600 |
| O K K | 49,000 | 149.00 | 7,301,000 |
| 島精機製作所 | 13,800 | 1,976.00 | 27,268,800 |
| 日阪製作所 | 14,000 | 965.00 | 13,510,000 |
| やまびこ | 18,100 | 1,027.00 | 18,588,700 |
| ペガサスミシン製造 | 12,700 | 481.00 | 6,108,700 |
| ナブテスコ | 52,600 | 2,471.00 | 129,974,600 |
| 三井海洋開発 | 11,300 | 1,780.00 | 20,114,000 |
| レオン自動機 | 9,700 | 828.00 | 8,031,600 |
| S M C | 29,700 | 31,530.00 | 936,441,000 |
| 新川 | 11,100 | 587.00 | 6,515,700 |
| ホソカワミクロン | 19,000 | 632.00 | 12,008,000 |
| ユニオンツール | 4,200 | 3,290.00 | 13,818,000 |
| オイレス工業 | 12,900 | 2,122.00 | 27,373,800 |
| 日精エー・エス・ビー機械 | 3,900 | 2,177.00 | 8,490,300 |

| | | | |
|--------------|---------|----------|---------------|
| サトーホールディングス | 13,400 | 2,413.00 | 32,334,200 |
| 日精樹脂工業 | 8,200 | 971.00 | 7,962,200 |
| ワイエイシイ | 5,700 | 949.00 | 5,409,300 |
| 小松製作所 | 485,800 | 1,931.00 | 938,079,800 |
| 住友重機械工業 | 289,000 | 534.00 | 154,326,000 |
| 日立建機 | 44,200 | 1,804.00 | 79,736,800 |
| 日工 | 18,000 | 405.00 | 7,290,000 |
| 巴工業 | 5,000 | 1,572.00 | 7,860,000 |
| 井関農機 | 105,000 | 188.00 | 19,740,000 |
| TOWA | 10,700 | 799.00 | 8,549,300 |
| 丸山製作所 | 29,000 | 201.00 | 5,829,000 |
| 北川鉄工所 | 48,000 | 274.00 | 13,152,000 |
| クボタ | 476,000 | 1,947.50 | 927,010,000 |
| 三菱化工機 | 36,000 | 260.00 | 9,360,000 |
| 月島機械 | 17,600 | 1,104.00 | 19,430,400 |
| 帝国電機製作所 | 8,700 | 906.00 | 7,882,200 |
| 新東工業 | 22,000 | 1,006.00 | 22,132,000 |
| 澁谷工業 | 8,700 | 1,763.00 | 15,338,100 |
| アイチ コーポレーション | 15,300 | 830.00 | 12,699,000 |
| 小森コーポレーション | 23,900 | 1,429.00 | 34,153,100 |
| 鶴見製作所 | 7,500 | 2,039.00 | 15,292,500 |
| 住友精密工業 | 19,000 | 448.00 | 8,512,000 |
| 酒井重工業 | 24,000 | 226.00 | 5,424,000 |
| 荏原製作所 | 220,000 | 571.00 | 125,620,000 |
| 西島製作所 | 12,300 | 1,037.00 | 12,755,100 |
| 北越工業 | 11,700 | 831.00 | 9,722,700 |
| ダイキン工業 | 137,700 | 8,548.00 | 1,177,059,600 |
| オルガノ | 20,000 | 484.00 | 9,680,000 |
| トーヨーカネツ | 58,000 | 259.00 | 15,022,000 |
| 栗田工業 | 59,600 | 2,545.00 | 151,682,000 |
| 椿本チエイン | 55,000 | 902.00 | 49,610,000 |
| 大同工業 | 23,000 | 225.00 | 5,175,000 |
| 日本コンベヤ | 39,000 | 179.00 | 6,981,000 |
| 木村化工機 | 11,500 | 433.00 | 4,979,500 |
| アネスト岩田 | 16,400 | 1,040.00 | 17,056,000 |
| ダイフク | 46,600 | 1,975.00 | 92,035,000 |
| 加藤製作所 | 24,000 | 523.00 | 12,552,000 |
| 油研工業 | 22,000 | 256.00 | 5,632,000 |
| タダノ | 46,000 | 1,452.00 | 66,792,000 |
| フジテック | 27,500 | 1,236.00 | 33,990,000 |
| C K D | 26,500 | 1,210.00 | 32,065,000 |
| キトー | 13,400 | 1,048.00 | 14,043,200 |

| | | | |
|---------------|-----------|----------|-------------|
| 平和 | 28,700 | 2,339.00 | 67,129,300 |
| 理想科学工業 | 10,400 | 1,954.00 | 20,321,600 |
| SANKYO | 26,300 | 4,735.00 | 124,530,500 |
| 日本金銭機械 | 9,600 | 1,212.00 | 11,635,200 |
| マースエンジニアリング | 5,800 | 2,065.00 | 11,977,000 |
| 福島工業 | 5,800 | 2,640.00 | 15,312,000 |
| ダイコク電機 | 4,700 | 1,514.00 | 7,115,800 |
| 竹内製作所 | 14,000 | 2,566.00 | 35,924,000 |
| アマノ | 28,800 | 1,601.00 | 46,108,800 |
| JUKI | 14,500 | 1,100.00 | 15,950,000 |
| サンデンホールディングス | 58,000 | 374.00 | 21,692,000 |
| 蛇の目マシン工業 | 10,700 | 840.00 | 8,988,000 |
| マックス | 14,000 | 1,215.00 | 17,010,000 |
| グローリー | 32,300 | 3,615.00 | 116,764,500 |
| 新晃工業 | 7,400 | 1,482.00 | 10,966,800 |
| 大和冷機工業 | 16,100 | 939.00 | 15,117,900 |
| セガサミーホールディングス | 101,300 | 1,161.00 | 117,609,300 |
| 日本ピストンリング | 4,500 | 2,031.00 | 9,139,500 |
| リケン | 43,000 | 423.00 | 18,189,000 |
| T P R | 11,400 | 3,415.00 | 38,931,000 |
| ホンザキ電機 | 20,700 | 7,840.00 | 162,288,000 |
| 大豊工業 | 8,300 | 1,474.00 | 12,234,200 |
| 日本精工 | 193,700 | 1,409.00 | 272,923,300 |
| NTN | 234,000 | 518.00 | 121,212,000 |
| ジェイテクト | 100,500 | 2,048.00 | 205,824,000 |
| 不二越 | 89,000 | 546.00 | 48,594,000 |
| 日本トムソン | 32,000 | 539.00 | 17,248,000 |
| THK | 63,000 | 2,185.00 | 137,655,000 |
| ユーシン精機 | 4,100 | 2,273.00 | 9,319,300 |
| 前澤給装工業 | 4,800 | 1,540.00 | 7,392,000 |
| イーグル工業 | 11,500 | 2,293.00 | 26,369,500 |
| 日本ピラー工業 | 10,700 | 1,053.00 | 11,267,100 |
| キッツ | 46,100 | 535.00 | 24,663,500 |
| 日立工機 | 23,700 | 886.00 | 20,998,200 |
| マキタ | 61,600 | 6,750.00 | 415,800,000 |
| 日立造船 | 74,900 | 666.00 | 49,883,400 |
| 三菱重工業 | 1,684,000 | 551.50 | 928,726,000 |
| I H I | 726,000 | 330.00 | 239,580,000 |
| 日清紡ホールディングス | 52,500 | 1,298.00 | 68,145,000 |
| イビデン | 61,900 | 1,741.00 | 107,767,900 |
| コニカミノルタ | 236,100 | 1,197.00 | 282,611,700 |
| ブラザー工業 | 121,600 | 1,407.00 | 171,091,200 |

| | | | |
|-------------------|-----------|----------|---------------|
| ミネベア | 152,000 | 1,075.00 | 163,400,000 |
| 日立製作所 | 2,413,000 | 693.10 | 1,672,450,300 |
| 東芝 | 1,992,000 | 282.50 | 562,740,000 |
| 三菱電機 | 1,008,000 | 1,264.00 | 1,274,112,000 |
| 富士電機 | 284,000 | 521.00 | 147,964,000 |
| 東洋電機製造 | 23,000 | 442.00 | 10,166,000 |
| 安川電機 | 116,900 | 1,599.00 | 186,923,100 |
| シンフォニアテクノロジー | 67,000 | 196.00 | 13,132,000 |
| 明電舎 | 86,000 | 479.00 | 41,194,000 |
| オリジン電気 | 18,000 | 318.00 | 5,724,000 |
| 山洋電気 | 25,000 | 759.00 | 18,975,000 |
| デンヨー | 8,700 | 1,929.00 | 16,782,300 |
| 東芝テック | 68,000 | 411.00 | 27,948,000 |
| マブチモーター | 27,000 | 6,580.00 | 177,660,000 |
| 日本電産 | 113,900 | 8,772.00 | 999,130,800 |
| 東光高岳 | 6,000 | 1,526.00 | 9,156,000 |
| ダイヘン | 57,000 | 564.00 | 32,148,000 |
| 田淵電機 | 11,300 | 773.00 | 8,734,900 |
| JVCケンウッド | 69,600 | 305.00 | 21,228,000 |
| ミマキエンジニアリング | 7,500 | 477.00 | 3,577,500 |
| 第一精工 | 4,500 | 1,587.00 | 7,141,500 |
| 日新電機 | 22,400 | 971.00 | 21,750,400 |
| 大崎電気工業 | 19,000 | 685.00 | 13,015,000 |
| オムロン | 108,100 | 4,165.00 | 450,236,500 |
| 日東工業 | 15,100 | 2,114.00 | 31,921,400 |
| I D E C | 13,700 | 1,061.00 | 14,535,700 |
| ジーエス・ユアサ コーポレーション | 184,000 | 452.00 | 83,168,000 |
| サクサホールディングス | 27,000 | 239.00 | 6,453,000 |
| メルコホールディングス | 5,700 | 2,251.00 | 12,830,700 |
| テクノメディカ | 2,600 | 2,855.00 | 7,423,000 |
| 日本電気 | 1,300,000 | 387.00 | 503,100,000 |
| 富士通 | 914,000 | 624.10 | 570,427,400 |
| 沖電気工業 | 410,000 | 151.00 | 61,910,000 |
| 電気興業 | 26,000 | 553.00 | 14,378,000 |
| サンケン電気 | 53,000 | 454.00 | 24,062,000 |
| アイホン | 6,000 | 2,006.00 | 12,036,000 |
| ルネサスエレクトロニクス | 49,200 | 781.00 | 38,425,200 |
| セイコーエプソン | 140,500 | 1,862.00 | 261,611,000 |
| ワコム | 75,400 | 470.00 | 35,438,000 |
| アルバック | 16,100 | 3,255.00 | 52,405,500 |
| アクセル | 5,300 | 1,365.00 | 7,234,500 |
| E I Z O | 9,500 | 2,956.00 | 28,082,000 |

| | | | |
|------------------|-----------|-----------|---------------|
| ジャパンディスプレイ | 177,600 | 342.00 | 60,739,200 |
| 日本信号 | 25,700 | 1,273.00 | 32,716,100 |
| 京三製作所 | 21,000 | 357.00 | 7,497,000 |
| 能美防災 | 10,600 | 1,570.00 | 16,642,000 |
| ホーチキ | 7,900 | 1,076.00 | 8,500,400 |
| エレコム | 8,800 | 1,575.00 | 13,860,000 |
| 日本無線 | 26,000 | 371.00 | 9,646,000 |
| パナソニック | 1,080,500 | 1,247.50 | 1,347,923,750 |
| シャープ | 722,000 | 120.00 | 86,640,000 |
| アンリツ | 56,300 | 777.00 | 43,745,100 |
| 富士通ゼネラル | 29,000 | 1,591.00 | 46,139,000 |
| 日立国際電気 | 22,000 | 1,693.00 | 37,246,000 |
| ソニー | 667,500 | 2,998.50 | 2,001,498,750 |
| T D K | 57,000 | 7,780.00 | 443,460,000 |
| 帝国通信工業 | 29,000 | 207.00 | 6,003,000 |
| ミツミ電機 | 36,200 | 610.00 | 22,082,000 |
| タムラ製作所 | 36,000 | 354.00 | 12,744,000 |
| アルプス電気 | 79,800 | 3,245.00 | 258,951,000 |
| 池上通信機 | 37,000 | 183.00 | 6,771,000 |
| パイオニア | 153,300 | 331.00 | 50,742,300 |
| 日本電波工業 | 10,800 | 790.00 | 8,532,000 |
| 日本トリム | 2,700 | 4,140.00 | 11,178,000 |
| ローランド ディー . ジー . | 5,000 | 2,639.00 | 13,195,000 |
| フォスター電機 | 11,900 | 2,600.00 | 30,940,000 |
| クラリオン | 51,000 | 419.00 | 21,369,000 |
| S M K | 28,000 | 615.00 | 17,220,000 |
| ヨコオ | 8,700 | 591.00 | 5,141,700 |
| 東光 | 22,000 | 396.00 | 8,712,000 |
| ホシデン | 29,100 | 620.00 | 18,042,000 |
| ヒロセ電機 | 15,300 | 14,380.00 | 220,014,000 |
| 日本航空電子工業 | 27,000 | 1,770.00 | 47,790,000 |
| T O A | 11,300 | 1,293.00 | 14,610,900 |
| 日立マクセル | 15,600 | 2,154.00 | 33,602,400 |
| 古野電気 | 12,500 | 873.00 | 10,912,500 |
| ユニデンホールディングス | 36,000 | 151.00 | 5,436,000 |
| アルパイン | 22,200 | 1,568.00 | 34,809,600 |
| スミダコーポレーション | 9,400 | 786.00 | 7,388,400 |
| アイコム | 5,700 | 2,460.00 | 14,022,000 |
| リオン | 4,400 | 1,900.00 | 8,360,000 |
| 船井電機 | 10,600 | 986.00 | 10,451,600 |
| 横河電機 | 94,600 | 1,408.00 | 133,196,800 |
| 新電元工業 | 32,000 | 459.00 | 14,688,000 |

| | | | |
|------------------|---------|-----------|---------------|
| アズビル | 30,800 | 3,040.00 | 93,632,000 |
| 日本光電工業 | 39,500 | 2,676.00 | 105,702,000 |
| チノー | 4,500 | 1,106.00 | 4,977,000 |
| 共和電業 | 12,500 | 428.00 | 5,350,000 |
| 堀場製作所 | 17,600 | 4,580.00 | 80,608,000 |
| アドバンテスト | 64,500 | 1,043.00 | 67,273,500 |
| 小野測器 | 6,200 | 906.00 | 5,617,200 |
| エスペック | 9,800 | 1,467.00 | 14,376,600 |
| パナソニック デバイスSUNX | 10,100 | 665.00 | 6,716,500 |
| キーエンス | 21,400 | 64,260.00 | 1,375,164,000 |
| 日置電機 | 5,800 | 2,251.00 | 13,055,800 |
| シスメックス | 73,300 | 7,550.00 | 553,415,000 |
| メガチップス | 11,100 | 1,096.00 | 12,165,600 |
| OBARA GROUP | 6,200 | 4,325.00 | 26,815,000 |
| コーセル | 12,500 | 1,089.00 | 13,612,500 |
| 新日本無線 | 8,000 | 569.00 | 4,552,000 |
| オブテックス | 7,000 | 3,030.00 | 21,210,000 |
| 千代田インテグレ | 5,100 | 2,798.00 | 14,269,800 |
| レーザーテック | 10,300 | 1,319.00 | 13,585,700 |
| スタンレー電気 | 67,900 | 2,734.00 | 185,638,600 |
| 岩崎電気 | 37,000 | 244.00 | 9,028,000 |
| ウシオ電機 | 57,600 | 1,677.00 | 96,595,200 |
| ヘリオス テクノ ホールディング | 10,800 | 437.00 | 4,719,600 |
| 日本セラミック | 6,000 | 1,977.00 | 11,862,000 |
| 遠藤照明 | 6,000 | 1,185.00 | 7,110,000 |
| 日本デジタル研究所 | 8,300 | 1,692.00 | 14,043,600 |
| 古河電池 | 8,000 | 802.00 | 6,416,000 |
| 山一電機 | 9,300 | 882.00 | 8,202,600 |
| 図研 | 7,800 | 1,182.00 | 9,219,600 |
| 日本電子 | 38,000 | 785.00 | 29,830,000 |
| カシオ計算機 | 94,600 | 2,693.00 | 254,757,800 |
| ファナック | 96,800 | 21,085.00 | 2,041,028,000 |
| 日本シイエムケイ | 26,900 | 353.00 | 9,495,700 |
| エンプラス | 4,900 | 4,510.00 | 22,099,000 |
| 大真空 | 25,000 | 234.00 | 5,850,000 |
| ローム | 46,500 | 6,310.00 | 293,415,000 |
| 浜松ホトニクス | 73,500 | 3,365.00 | 247,327,500 |
| 三井ハイテック | 14,900 | 748.00 | 11,145,200 |
| 新光電気工業 | 35,000 | 801.00 | 28,035,000 |
| 京セラ | 155,200 | 5,578.00 | 865,705,600 |
| 太陽誘電 | 46,000 | 1,693.00 | 77,878,000 |
| 村田製作所 | 99,200 | 17,365.00 | 1,722,608,000 |

| | | | | |
|---------------------|-----------|----------|---------------|--------------------|
| ユーシン | 13,100 | 719.00 | 9,418,900 | |
| 双葉電子工業 | 16,100 | 1,643.00 | 26,452,300 | |
| 北陸電気工業 | 44,000 | 173.00 | 7,612,000 | |
| ニチコン | 29,000 | 964.00 | 27,956,000 | |
| 日本ケミコン | 76,000 | 223.00 | 16,948,000 | |
| K O A | 13,300 | 1,022.00 | 13,592,600 | |
| 市光工業 | 28,000 | 251.00 | 7,028,000 | |
| 小糸製作所 | 56,600 | 5,000.00 | 283,000,000 | |
| ミツバ | 16,100 | 2,005.00 | 32,280,500 | |
| スター精密 | 17,900 | 1,579.00 | 28,264,100 | |
| S C R E E Nホールディングス | 98,000 | 881.00 | 86,338,000 | |
| キャノン電子 | 8,000 | 1,995.00 | 15,960,000 | |
| キャノン | 509,200 | 3,680.00 | 1,873,856,000 | |
| リコー | 305,500 | 1,216.00 | 371,488,000 | |
| M U T O Hホールディングス | 14,000 | 274.00 | 3,836,000 | |
| 東京エレクトロン | 85,100 | 7,500.00 | 638,250,000 | |
| トヨタ紡織 | 33,300 | 2,555.00 | 85,081,500 | |
| 鬼怒川ゴム工業 | 23,000 | 657.00 | 15,111,000 | |
| ユニプレス | 19,800 | 2,768.00 | 54,806,400 | |
| 豊田自動織機 | 85,800 | 6,460.00 | 554,268,000 | |
| モリタホールディングス | 16,600 | 1,353.00 | 22,459,800 | |
| 三櫻工業 | 14,500 | 740.00 | 10,730,000 | |
| デンソー | 233,600 | 5,790.00 | 1,352,544,000 | |
| 東海理化電機製作所 | 28,100 | 3,015.00 | 84,721,500 | |
| 三井造船 | 373,000 | 189.00 | 70,497,000 | |
| 川崎重工業 | 735,000 | 450.00 | 330,750,000 | |
| 名村造船所 | 28,700 | 1,052.00 | 30,192,400 | |
| サノヤスホールディングス | 16,000 | 254.00 | 4,064,000 | |
| 日本車輛製造 | 44,000 | 295.00 | 12,980,000 | |
| ニチュ三菱フォークリフト | 13,000 | 489.00 | 6,357,000 | |
| 近畿車輛 | 19,000 | 387.00 | 7,353,000 | |
| 日産自動車 | 1,328,100 | 1,257.00 | 1,669,421,700 | |
| いすゞ自動車 | 275,100 | 1,332.50 | 366,570,750 | |
| トヨタ自動車 | 1,205,000 | 7,658.00 | 9,227,890,000 | 代用有価証券 500,000株 |
| 日野自動車 | 134,600 | 1,412.00 | 190,055,200 | |
| 三菱自動車工業 | 376,000 | 1,042.00 | 391,792,000 | |
| エフテック | 6,200 | 1,236.00 | 7,663,200 | |
| 武蔵精密工業 | 10,400 | 2,539.00 | 26,405,600 | |
| 日産車体 | 46,600 | 1,335.00 | 62,211,000 | |
| 新明和工業 | 41,000 | 1,099.00 | 45,059,000 | |
| 極東開発工業 | 18,800 | 1,365.00 | 25,662,000 | |
| 日信工業 | 20,800 | 1,839.00 | 38,251,200 | |

| | | | |
|------------|---------|-----------|---------------|
| トピー工業 | 79,000 | 269.00 | 21,251,000 |
| ティラド | 47,000 | 192.00 | 9,024,000 |
| 曙ブレーキ工業 | 48,800 | 318.00 | 15,518,400 |
| タチエス | 15,200 | 1,947.00 | 29,594,400 |
| NOK | 46,100 | 2,903.00 | 133,828,300 |
| フタバ産業 | 29,800 | 540.00 | 16,092,000 |
| KYB | 106,000 | 382.00 | 40,492,000 |
| シロキ工業 | 25,000 | 380.00 | 9,500,000 |
| 大同メタル工業 | 13,100 | 1,113.00 | 14,580,300 |
| プレス工業 | 51,400 | 529.00 | 27,190,600 |
| ミクニ | 12,500 | 417.00 | 5,212,500 |
| カルソニックカンセイ | 72,000 | 1,074.00 | 77,328,000 |
| 太平洋工業 | 21,300 | 1,367.00 | 29,117,100 |
| ケーヒン | 21,600 | 2,137.00 | 46,159,200 |
| 河西工業 | 12,000 | 1,872.00 | 22,464,000 |
| アイシン精機 | 94,900 | 5,200.00 | 493,480,000 |
| 富士機工 | 13,500 | 481.00 | 6,493,500 |
| マツダ | 299,700 | 2,507.50 | 751,497,750 |
| ダイハツ工業 | 113,200 | 1,595.00 | 180,554,000 |
| 今仙電機製作所 | 10,300 | 1,272.00 | 13,101,600 |
| 本田技研工業 | 851,400 | 3,919.00 | 3,336,636,600 |
| スズキ | 197,900 | 3,666.00 | 725,501,400 |
| 富士重工業 | 298,700 | 4,942.00 | 1,476,175,400 |
| ヤマハ発動機 | 133,700 | 2,831.00 | 378,504,700 |
| ショーワ | 24,700 | 1,170.00 | 28,899,000 |
| TBK | 15,900 | 472.00 | 7,504,800 |
| エクセディ | 12,500 | 2,880.00 | 36,000,000 |
| 豊田合成 | 34,700 | 2,848.00 | 98,825,600 |
| 愛三工業 | 17,200 | 1,240.00 | 21,328,000 |
| ヨロズ | 9,300 | 2,792.00 | 25,965,600 |
| エフ・シー・シー | 15,600 | 2,660.00 | 41,496,000 |
| シマノ | 38,100 | 18,560.00 | 707,136,000 |
| テイ・エス テック | 22,100 | 3,145.00 | 69,504,500 |
| ジャムコ | 4,400 | 4,155.00 | 18,282,000 |
| テルモ | 144,600 | 3,940.00 | 569,724,000 |
| 日機装 | 35,000 | 986.00 | 34,510,000 |
| 島津製作所 | 121,000 | 1,958.00 | 236,918,000 |
| JMS | 24,000 | 318.00 | 7,632,000 |
| 長野計器 | 8,600 | 745.00 | 6,407,000 |
| ブイ・テクノロジー | 2,500 | 4,875.00 | 12,187,500 |
| 東京計器 | 34,000 | 226.00 | 7,684,000 |
| 愛知時計電機 | 17,000 | 328.00 | 5,576,000 |

| | | | |
|-------------------|---------|----------|---------------|
| 東京精密 | 17,900 | 2,700.00 | 48,330,000 |
| マニー | 8,600 | 2,324.00 | 19,986,400 |
| ニコン | 175,900 | 1,619.00 | 284,782,100 |
| トプコン | 31,400 | 2,119.00 | 66,536,600 |
| オリンパス | 140,900 | 4,700.00 | 662,230,000 |
| 理研計器 | 8,300 | 1,450.00 | 12,035,000 |
| タムロン | 7,500 | 2,252.00 | 16,890,000 |
| H O Y A | 220,100 | 4,907.00 | 1,080,030,700 |
| ノーリツ鋼機 | 10,500 | 608.00 | 6,384,000 |
| エー・アンド・デイ | 12,400 | 442.00 | 5,480,800 |
| シチズンホールディングス | 116,300 | 868.00 | 100,948,400 |
| リズム時計工業 | 48,000 | 161.00 | 7,728,000 |
| 大研医器 | 8,200 | 1,045.00 | 8,569,000 |
| メニコン | 4,900 | 3,395.00 | 16,635,500 |
| 松風 | 5,500 | 1,518.00 | 8,349,000 |
| セイコーホールディングス | 60,000 | 716.00 | 42,960,000 |
| ニプロ | 70,600 | 1,321.00 | 93,262,600 |
| パラマウントベッドホールディングス | 10,100 | 4,315.00 | 43,581,500 |
| ニホンフラッシュ | 3,500 | 1,234.00 | 4,319,000 |
| 前田工織 | 11,500 | 1,115.00 | 12,822,500 |
| 永大産業 | 15,000 | 423.00 | 6,345,000 |
| アートネイチャー | 7,900 | 1,102.00 | 8,705,800 |
| ダンロップスポーツ | 6,300 | 998.00 | 6,287,400 |
| バンダイナムコホールディングス | 97,900 | 2,656.00 | 260,022,400 |
| 共立印刷 | 20,300 | 302.00 | 6,130,600 |
| フランスベッドホールディングス | 14,400 | 1,001.00 | 14,414,400 |
| パイロットコーポレーション | 16,700 | 4,960.00 | 82,832,000 |
| 萩原工業 | 2,200 | 2,080.00 | 4,576,000 |
| トッパン・フォームズ | 16,300 | 1,437.00 | 23,423,100 |
| フジシールインターナショナル | 11,700 | 3,680.00 | 43,056,000 |
| タカラトミー | 31,300 | 749.00 | 23,443,700 |
| 廣済堂 | 11,900 | 391.00 | 4,652,900 |
| アーク | 46,900 | 112.00 | 5,252,800 |
| プロネクサス | 9,800 | 940.00 | 9,212,000 |
| ウッドワン | 23,000 | 264.00 | 6,072,000 |
| 大建工業 | 39,000 | 335.00 | 13,065,000 |
| 凸版印刷 | 267,000 | 1,064.00 | 284,088,000 |
| 大日本印刷 | 279,000 | 1,198.00 | 334,242,000 |
| 図書印刷 | 19,000 | 543.00 | 10,317,000 |
| 共同印刷 | 35,000 | 327.00 | 11,445,000 |
| 日本写真印刷 | 16,000 | 2,399.00 | 38,384,000 |
| 宝印刷 | 5,600 | 1,323.00 | 7,408,800 |

| | | | |
|----------------|-----------|-----------|-------------|
| アシックス | 88,400 | 2,527.00 | 223,386,800 |
| ツツミ | 5,000 | 2,565.00 | 12,825,000 |
| 小松ウオール工業 | 3,700 | 2,067.00 | 7,647,900 |
| ヤマハ | 69,400 | 2,904.00 | 201,537,600 |
| 河合楽器製作所 | 3,900 | 2,220.00 | 8,658,000 |
| クリナップ | 12,500 | 715.00 | 8,937,500 |
| ピジョン | 53,900 | 2,944.00 | 158,681,600 |
| キングジム | 7,700 | 811.00 | 6,244,700 |
| リンテック | 23,100 | 2,677.00 | 61,838,700 |
| T A S A K I | 2,200 | 1,647.00 | 3,623,400 |
| イトーキ | 20,500 | 916.00 | 18,778,000 |
| 任天堂 | 58,300 | 16,775.00 | 977,982,500 |
| 三菱鉛筆 | 7,000 | 5,420.00 | 37,940,000 |
| タカラスタANDARD | 38,000 | 965.00 | 36,670,000 |
| コクヨ | 49,800 | 1,343.00 | 66,881,400 |
| ナカバヤシ | 16,000 | 303.00 | 4,848,000 |
| グローブライド | 5,300 | 1,625.00 | 8,612,500 |
| 岡村製作所 | 33,300 | 1,237.00 | 41,192,100 |
| 美津濃 | 51,000 | 567.00 | 28,917,000 |
| アデランス | 15,700 | 837.00 | 13,140,900 |
| 東京電力 | 801,700 | 737.00 | 590,852,900 |
| 中部電力 | 289,800 | 1,636.50 | 474,257,700 |
| 関西電力 | 386,400 | 1,466.00 | 566,462,400 |
| 中国電力 | 129,700 | 1,554.00 | 201,553,800 |
| 北陸電力 | 92,600 | 1,755.00 | 162,513,000 |
| 東北電力 | 235,600 | 1,469.00 | 346,096,400 |
| 四国電力 | 85,100 | 1,816.00 | 154,541,600 |
| 九州電力 | 208,200 | 1,265.00 | 263,373,000 |
| 北海道電力 | 88,600 | 1,137.00 | 100,738,200 |
| 沖縄電力 | 10,000 | 3,130.00 | 31,300,000 |
| 電源開発 | 80,600 | 4,215.00 | 339,729,000 |
| 東京瓦斯 | 1,057,000 | 554.70 | 586,317,900 |
| 大阪瓦斯 | 982,000 | 427.00 | 419,314,000 |
| 東邦瓦斯 | 238,000 | 773.00 | 183,974,000 |
| 北海道瓦斯 | 32,000 | 278.00 | 8,896,000 |
| 広島ガス | 19,800 | 433.00 | 8,573,400 |
| 西部瓦斯 | 105,000 | 268.00 | 28,140,000 |
| 静岡ガス | 26,700 | 760.00 | 20,292,000 |
| メタウォーター | 6,100 | 2,988.00 | 18,226,800 |
| S B S ホールディングス | 10,200 | 958.00 | 9,771,600 |
| 東武鉄道 | 503,000 | 587.00 | 295,261,000 |
| 相鉄ホールディングス | 163,000 | 695.00 | 113,285,000 |

| | | | |
|------------------|---------|-----------|---------------|
| 東京急行電鉄 | 550,000 | 944.00 | 519,200,000 |
| 京浜急行電鉄 | 260,000 | 991.00 | 257,660,000 |
| 小田急電鉄 | 301,000 | 1,232.00 | 370,832,000 |
| 京王電鉄 | 262,000 | 1,027.00 | 269,074,000 |
| 京成電鉄 | 141,000 | 1,482.00 | 208,962,000 |
| 富士急行 | 27,000 | 1,124.00 | 30,348,000 |
| 新京成電鉄 | 14,000 | 435.00 | 6,090,000 |
| 東日本旅客鉄道 | 172,800 | 11,365.00 | 1,963,872,000 |
| 西日本旅客鉄道 | 91,100 | 7,906.00 | 720,236,600 |
| 東海旅客鉄道 | 84,700 | 20,980.00 | 1,777,006,000 |
| 西武ホールディングス | 75,500 | 2,415.00 | 182,332,500 |
| 鴻池運輸 | 13,500 | 1,546.00 | 20,871,000 |
| 西日本鉄道 | 124,000 | 678.00 | 84,072,000 |
| ハマキョウレックス | 7,700 | 2,216.00 | 17,063,200 |
| サカイ引越センター | 2,000 | 6,680.00 | 13,360,000 |
| 近鉄グループホールディングス | 950,000 | 477.00 | 453,150,000 |
| 阪急阪神ホールディングス | 634,000 | 777.00 | 492,618,000 |
| 南海電気鉄道 | 215,000 | 680.00 | 146,200,000 |
| 京阪電気鉄道 | 213,000 | 811.00 | 172,743,000 |
| 神戸電鉄 | 26,000 | 360.00 | 9,360,000 |
| 名古屋鉄道 | 344,000 | 482.00 | 165,808,000 |
| 山陽電気鉄道 | 35,000 | 463.00 | 16,205,000 |
| 日本通運 | 364,000 | 547.00 | 199,108,000 |
| ヤマトホールディングス | 174,900 | 2,488.50 | 435,238,650 |
| 山九 | 127,000 | 588.00 | 74,676,000 |
| 丸全昭和運輸 | 32,000 | 428.00 | 13,696,000 |
| センコー | 43,000 | 785.00 | 33,755,000 |
| トナミホールディングス | 23,000 | 342.00 | 7,866,000 |
| ニッコンホールディングス | 31,000 | 2,317.00 | 71,827,000 |
| 福山通運 | 60,000 | 576.00 | 34,560,000 |
| セイノーホールディングス | 67,400 | 1,254.00 | 84,519,600 |
| 神奈川中央交通 | 12,000 | 693.00 | 8,316,000 |
| 日立物流 | 19,300 | 2,011.00 | 38,812,300 |
| 丸和運輸機関 | 2,500 | 2,491.00 | 6,227,500 |
| C & F ロジホールディングス | 10,200 | 889.00 | 9,067,800 |
| 日本郵船 | 846,000 | 293.00 | 247,878,000 |
| 商船三井 | 458,000 | 298.00 | 136,484,000 |
| 川崎汽船 | 412,000 | 249.00 | 102,588,000 |
| N S ユナイテッド海運 | 48,000 | 216.00 | 10,368,000 |
| 明治海運 | 7,600 | 518.00 | 3,936,800 |
| 飯野海運 | 50,700 | 507.00 | 25,704,900 |
| 乾汽船 | 9,700 | 958.00 | 9,292,600 |

| | | | |
|------------------------|-----------|----------|-------------|
| 日本航空 | 181,400 | 4,190.00 | 760,066,000 |
| A N Aホールディングス | 1,762,000 | 344.50 | 607,009,000 |
| トランコム | 2,800 | 6,420.00 | 17,976,000 |
| 日新 | 41,000 | 365.00 | 14,965,000 |
| 三菱倉庫 | 67,000 | 1,587.00 | 106,329,000 |
| 三井倉庫ホールディングス | 56,000 | 338.00 | 18,928,000 |
| 住友倉庫 | 71,000 | 638.00 | 45,298,000 |
| 澁澤倉庫 | 31,000 | 310.00 | 9,610,000 |
| 東陽倉庫 | 27,000 | 255.00 | 6,885,000 |
| 日本トランスシティ | 25,000 | 426.00 | 10,650,000 |
| 安田倉庫 | 10,000 | 903.00 | 9,030,000 |
| 東洋埠頭 | 36,000 | 183.00 | 6,588,000 |
| 上組 | 112,000 | 1,010.00 | 113,120,000 |
| キューソー流通システム | 3,200 | 2,798.00 | 8,953,600 |
| 郵船ロジスティクス | 9,500 | 1,605.00 | 15,247,500 |
| 近鉄エクスプレス | 16,700 | 2,097.00 | 35,019,900 |
| 東海運 | 15,300 | 289.00 | 4,421,700 |
| エーアイティー | 5,500 | 1,130.00 | 6,215,000 |
| N E C ネットエスアイ | 11,600 | 2,171.00 | 25,183,600 |
| システナ | 10,800 | 1,344.00 | 14,515,200 |
| デジタルアーツ | 5,100 | 2,145.00 | 10,939,500 |
| 新日鉄住金ソリューションズ | 7,800 | 5,650.00 | 44,070,000 |
| I Tホールディングス | 31,300 | 2,906.00 | 90,957,800 |
| 電算システム | 4,000 | 2,012.00 | 8,048,000 |
| グリー | 56,700 | 581.00 | 32,942,700 |
| コーエーテクモホールディングス | 22,000 | 1,799.00 | 39,578,000 |
| 三菱総合研究所 | 4,100 | 3,290.00 | 13,489,000 |
| ボルテージ | 2,300 | 1,185.00 | 2,725,500 |
| ファインデックス | 6,800 | 814.00 | 5,535,200 |
| K L a b | 15,100 | 842.00 | 12,714,200 |
| ポルトゥウィン・ピットクルーホールディングス | 7,500 | 1,128.00 | 8,460,000 |
| ネクソン | 89,700 | 1,998.00 | 179,220,600 |
| アイスタイル | 8,800 | 2,250.00 | 19,800,000 |
| エイチーム | 3,900 | 1,838.00 | 7,168,200 |
| テクノスジャパン | 1,300 | 2,871.00 | 3,732,300 |
| コロプラ | 25,800 | 2,553.00 | 65,867,400 |
| ブロードリーフ | 11,000 | 1,158.00 | 12,738,000 |
| ハーツユナイテッドグループ | 3,200 | 2,335.00 | 7,472,000 |
| ブイキューブ | 2,700 | 2,075.00 | 5,602,500 |
| VOYAGE GROUP | 2,700 | 1,487.00 | 4,014,900 |
| ティーガイア | 9,600 | 1,304.00 | 12,518,400 |
| 日本アジアグループ | 10,300 | 633.00 | 6,519,900 |

| | | | |
|----------------------|---------|----------|-------------|
| 豆蔵ホールディングス | 8,800 | 631.00 | 5,552,800 |
| テクマトリックス | 5,200 | 1,393.00 | 7,243,600 |
| ガンホー・オンライン・エンターテイメント | 163,700 | 352.00 | 57,622,400 |
| GMOペイメントゲートウェイ | 8,300 | 5,850.00 | 48,555,000 |
| インターネットイニシアティブ | 15,400 | 2,374.00 | 36,559,600 |
| SRAホールディングス | 6,000 | 2,876.00 | 17,256,000 |
| 朝日ネット | 12,700 | 523.00 | 6,642,100 |
| gumi | 10,300 | 831.00 | 8,559,300 |
| フェイス | 4,100 | 1,491.00 | 6,113,100 |
| 野村総合研究所 | 65,400 | 4,625.00 | 302,475,000 |
| インタージホールディングス | 6,100 | 1,715.00 | 10,461,500 |
| クレスコ | 3,000 | 1,872.00 | 5,616,000 |
| フジ・メディア・ホールディングス | 97,200 | 1,463.00 | 142,203,600 |
| オービック | 32,300 | 6,550.00 | 211,565,000 |
| ジャストシステム | 17,800 | 968.00 | 17,230,400 |
| ヤフー | 670,900 | 504.00 | 338,133,600 |
| トレンドマイクロ | 45,400 | 5,260.00 | 238,804,000 |
| 日本オラクル | 15,000 | 6,070.00 | 91,050,000 |
| アルファシステムズ | 4,000 | 1,946.00 | 7,784,000 |
| フューチャーアーキテクト | 14,300 | 731.00 | 10,453,300 |
| CAC Holdings | 9,700 | 986.00 | 9,564,200 |
| オービックビジネスコンサルタント | 4,800 | 7,110.00 | 34,128,000 |
| 伊藤忠テクノソリューションズ | 21,700 | 2,417.00 | 52,448,900 |
| アイティフォー | 16,400 | 584.00 | 9,577,600 |
| 大塚商会 | 25,200 | 6,210.00 | 156,492,000 |
| サイボウズ | 19,300 | 314.00 | 6,060,200 |
| 電通国際情報サービス | 6,500 | 2,378.00 | 15,457,000 |
| ウェザーニューズ | 3,300 | 4,335.00 | 14,305,500 |
| CIJ | 14,900 | 501.00 | 7,464,900 |
| WOWOW | 4,600 | 3,065.00 | 14,099,000 |
| フュージョンパートナー | 7,800 | 546.00 | 4,258,800 |
| イマジカ・ロボットホールディングス | 10,600 | 434.00 | 4,600,400 |
| ネットワンシステムズ | 40,800 | 775.00 | 31,620,000 |
| アルゴグラフィックス | 5,500 | 1,860.00 | 10,230,000 |
| マーベラス | 16,400 | 942.00 | 15,448,800 |
| エイベックス・グループ・ホールディングス | 17,800 | 1,332.00 | 23,709,600 |
| 日本ユニシス | 25,800 | 1,322.00 | 34,107,600 |
| 兼松エレクトロニクス | 7,000 | 2,131.00 | 14,917,000 |
| 東京放送ホールディングス | 56,200 | 1,934.00 | 108,690,800 |
| 日本テレビホールディングス | 85,400 | 2,329.00 | 198,896,600 |
| 朝日放送 | 11,400 | 818.00 | 9,325,200 |
| テレビ朝日ホールディングス | 26,200 | 2,151.00 | 56,356,200 |

| | | | |
|----------------------|---------|----------|---------------|
| スカパーJ S A Tホールディングス | 69,700 | 662.00 | 46,141,400 |
| テレビ東京ホールディングス | 8,800 | 2,365.00 | 20,812,000 |
| コネクシオ | 9,500 | 1,134.00 | 10,773,000 |
| 日本通信 | 53,200 | 278.00 | 14,789,600 |
| 日本電信電話 | 721,800 | 4,726.00 | 3,411,226,800 |
| K D D I | 948,800 | 3,069.00 | 2,911,867,200 |
| 光通信 | 11,300 | 8,300.00 | 93,790,000 |
| N T T ドコモ | 720,200 | 2,469.00 | 1,778,173,800 |
| エムティーアイ | 13,300 | 671.00 | 8,924,300 |
| G M O インターネット | 34,800 | 1,711.00 | 59,542,800 |
| カドカワ | 29,100 | 1,876.00 | 54,591,600 |
| 学研ホールディングス | 40,000 | 275.00 | 11,000,000 |
| ゼンリン | 12,900 | 2,491.00 | 32,133,900 |
| アイネット | 7,700 | 1,221.00 | 9,401,700 |
| 松竹 | 64,000 | 1,123.00 | 71,872,000 |
| 東宝 | 66,500 | 3,350.00 | 222,775,000 |
| 東映 | 35,000 | 1,161.00 | 40,635,000 |
| エヌ・ティ・ティ・データ | 57,600 | 5,960.00 | 343,296,000 |
| D T S | 10,500 | 2,902.00 | 30,471,000 |
| スクウェア・エニックス・ホールディングス | 39,800 | 2,967.00 | 118,086,600 |
| シーイーシー | 8,400 | 1,180.00 | 9,912,000 |
| カプコン | 24,400 | 2,973.00 | 72,541,200 |
| ジャステック | 8,000 | 1,005.00 | 8,040,000 |
| S C S K | 22,400 | 4,955.00 | 110,992,000 |
| 日本システムウエア | 5,100 | 896.00 | 4,569,600 |
| アイネス | 13,900 | 1,081.00 | 15,025,900 |
| T K C | 8,800 | 3,240.00 | 28,512,000 |
| 富士ソフト | 14,000 | 2,838.00 | 39,732,000 |
| N S D | 19,400 | 1,750.00 | 33,950,000 |
| コナミホールディングス | 42,400 | 3,030.00 | 128,472,000 |
| J B C C ホールディングス | 11,000 | 758.00 | 8,338,000 |
| ミロク情報サービス | 9,200 | 893.00 | 8,215,600 |
| ソフトバンクグループ | 529,100 | 6,106.00 | 3,230,684,600 |
| 伊藤忠食品 | 2,600 | 4,230.00 | 10,998,000 |
| エレマテック | 4,800 | 2,914.00 | 13,987,200 |
| J A L U X | 3,500 | 2,666.00 | 9,331,000 |
| あらた | 4,600 | 2,831.00 | 13,022,600 |
| 東京エレクトロン デバイス | 4,200 | 1,600.00 | 6,720,000 |
| フィールズ | 6,600 | 2,189.00 | 14,447,400 |
| 双日 | 585,500 | 261.00 | 152,815,500 |
| アルフレッサ ホールディングス | 116,900 | 2,384.00 | 278,689,600 |
| 横浜冷凍 | 23,500 | 1,051.00 | 24,698,500 |

| | | | |
|---------------------|---------|----------|---------------|
| アルコニックス | 6,500 | 1,557.00 | 10,120,500 |
| 神戸物産 | 6,200 | 4,165.00 | 25,823,000 |
| あい ホールディングス | 15,000 | 3,220.00 | 48,300,000 |
| ダイワボウホールディングス | 83,000 | 244.00 | 20,252,000 |
| マクニカ・富士エレホールディングス | 16,200 | 1,563.00 | 25,320,600 |
| バイタルケーエスケー・ホールディングス | 15,600 | 974.00 | 15,194,400 |
| U K Cホールディングス | 6,100 | 2,807.00 | 17,122,700 |
| T O K A Iホールディングス | 46,800 | 542.00 | 25,365,600 |
| 三洋貿易 | 5,900 | 1,411.00 | 8,324,900 |
| ウイン・パートナーズ | 3,700 | 1,737.00 | 6,426,900 |
| シップヘルスケアホールディングス | 18,900 | 2,843.00 | 53,732,700 |
| 小野建 | 9,700 | 1,108.00 | 10,747,600 |
| 佐島電機 | 9,800 | 783.00 | 7,673,400 |
| 伯東 | 8,500 | 1,223.00 | 10,395,500 |
| コンドーテック | 9,900 | 757.00 | 7,494,300 |
| ナガイレーベン | 13,800 | 2,160.00 | 29,808,000 |
| 三菱食品 | 9,900 | 2,941.00 | 29,115,900 |
| 松田産業 | 7,800 | 1,404.00 | 10,951,200 |
| メディパルホールディングス | 93,200 | 2,078.00 | 193,669,600 |
| アドヴァン | 11,100 | 1,045.00 | 11,599,500 |
| S P K | 2,700 | 2,205.00 | 5,953,500 |
| 萩原電気 | 3,200 | 2,230.00 | 7,136,000 |
| アズワン | 7,300 | 4,610.00 | 33,653,000 |
| 尾家産業 | 5,500 | 913.00 | 5,021,500 |
| シモジマ | 7,700 | 1,103.00 | 8,493,100 |
| ドウシシャ | 11,000 | 2,516.00 | 27,676,000 |
| 小津産業 | 2,500 | 2,100.00 | 5,250,000 |
| 高速 | 7,600 | 966.00 | 7,341,600 |
| 黒田電気 | 17,400 | 2,249.00 | 39,132,600 |
| 丸文 | 10,600 | 971.00 | 10,292,600 |
| ハビネット | 9,400 | 1,176.00 | 11,054,400 |
| エクセル | 5,200 | 1,550.00 | 8,060,000 |
| マルカキカイ | 3,900 | 1,748.00 | 6,817,200 |
| ガリバーインターナショナル | 25,600 | 1,106.00 | 28,313,600 |
| 日本エム・ディ・エム | 9,500 | 691.00 | 6,564,500 |
| 進和 | 6,800 | 1,718.00 | 11,682,400 |
| ダイトエレクトロン | 6,700 | 815.00 | 5,460,500 |
| シークス | 6,100 | 3,690.00 | 22,509,000 |
| オーハシテクニカ | 6,600 | 1,360.00 | 8,976,000 |
| 白銅 | 4,200 | 1,207.00 | 5,069,400 |
| 伊藤忠商事 | 732,900 | 1,429.00 | 1,047,314,100 |
| 丸紅 | 920,100 | 625.80 | 575,798,580 |

| | | | |
|-------------------|---------|----------|---------------|
| 高島 | 25,000 | 232.00 | 5,800,000 |
| 長瀬産業 | 55,900 | 1,520.00 | 84,968,000 |
| 蝶理 | 6,800 | 1,674.00 | 11,383,200 |
| 豊田通商 | 103,300 | 2,811.00 | 290,376,300 |
| 三共生興 | 12,800 | 461.00 | 5,900,800 |
| 兼松 | 193,000 | 203.00 | 39,179,000 |
| 三井物産 | 844,400 | 1,427.50 | 1,205,381,000 |
| 日本紙パルプ商事 | 47,000 | 330.00 | 15,510,000 |
| 日立ハイテクノロジーズ | 32,600 | 3,200.00 | 104,320,000 |
| カメイ | 12,200 | 1,180.00 | 14,396,000 |
| スターゼン | 3,900 | 3,400.00 | 13,260,000 |
| 山善 | 35,500 | 1,113.00 | 39,511,500 |
| 住友商事 | 588,500 | 1,251.00 | 736,213,500 |
| 内田洋行 | 27,000 | 469.00 | 12,663,000 |
| 三菱商事 | 700,600 | 1,980.00 | 1,387,188,000 |
| 第一実業 | 24,000 | 530.00 | 12,720,000 |
| キャノンマーケティングジャパン | 27,100 | 1,875.00 | 50,812,500 |
| 西華産業 | 39,000 | 297.00 | 11,583,000 |
| 佐藤商事 | 11,500 | 795.00 | 9,142,500 |
| 菱洋エレクトロ | 11,000 | 1,399.00 | 15,389,000 |
| 東京産業 | 13,200 | 513.00 | 6,771,600 |
| ユアサ商事 | 8,500 | 3,045.00 | 25,882,500 |
| 神鋼商事 | 25,000 | 246.00 | 6,150,000 |
| 阪和興業 | 94,000 | 547.00 | 51,418,000 |
| カナデン | 10,900 | 983.00 | 10,714,700 |
| 菱電商事 | 17,000 | 801.00 | 13,617,000 |
| フルサト工業 | 5,800 | 1,823.00 | 10,573,400 |
| 岩谷産業 | 112,000 | 634.00 | 71,008,000 |
| すてきナイスグループ | 48,000 | 176.00 | 8,448,000 |
| ニチモウ | 21,000 | 197.00 | 4,137,000 |
| 極東貿易 | 19,000 | 250.00 | 4,750,000 |
| 三愛石油 | 24,000 | 1,010.00 | 24,240,000 |
| 稲畑産業 | 21,900 | 1,228.00 | 26,893,200 |
| ワキタ | 19,600 | 1,034.00 | 20,266,400 |
| 東邦ホールディングス | 30,200 | 2,893.00 | 87,368,600 |
| サンゲツ | 34,700 | 2,223.00 | 77,138,100 |
| ミツウロコグループホールディングス | 18,100 | 590.00 | 10,679,000 |
| シナネンホールディングス | 21,000 | 467.00 | 9,807,000 |
| 伊藤忠エネクス | 23,900 | 942.00 | 22,513,800 |
| サンリオ | 29,300 | 2,878.00 | 84,325,400 |
| サンワテクノス | 7,600 | 961.00 | 7,303,600 |
| リョーサン | 15,300 | 3,140.00 | 48,042,000 |

| | | | |
|---------------|---------|----------|-------------|
| 新光商事 | 10,700 | 1,290.00 | 13,803,000 |
| トーヨー | 5,000 | 2,393.00 | 11,965,000 |
| 三信電気 | 13,300 | 1,250.00 | 16,625,000 |
| 東陽テクニカ | 15,200 | 1,069.00 | 16,248,800 |
| モスフードサービス | 11,900 | 3,180.00 | 37,842,000 |
| 加賀電子 | 8,000 | 1,738.00 | 13,904,000 |
| ソーダニッカ | 11,600 | 509.00 | 5,904,400 |
| 立花エレテック | 7,900 | 1,374.00 | 10,854,600 |
| PALTA C | 15,000 | 2,198.00 | 32,970,000 |
| 三谷産業 | 14,100 | 369.00 | 5,202,900 |
| 太平洋興発 | 59,000 | 88.00 | 5,192,000 |
| ヤマタネ | 54,000 | 187.00 | 10,098,000 |
| 日鉄住金物産 | 59,000 | 415.00 | 24,485,000 |
| トラスコ中山 | 10,500 | 4,615.00 | 48,457,500 |
| オートバックスセブン | 36,400 | 2,184.00 | 79,497,600 |
| 加藤産業 | 14,200 | 2,750.00 | 39,050,000 |
| イエローハット | 8,900 | 2,532.00 | 22,534,800 |
| J Kホールディングス | 13,200 | 477.00 | 6,296,400 |
| 日伝 | 4,500 | 3,000.00 | 13,500,000 |
| 杉本商事 | 6,900 | 1,421.00 | 9,804,900 |
| 因幡電機産業 | 12,800 | 3,810.00 | 48,768,000 |
| バイテックホールディングス | 4,200 | 1,225.00 | 5,145,000 |
| ミスミグループ本社 | 105,200 | 1,630.00 | 171,476,000 |
| タキヒヨー | 20,000 | 476.00 | 9,520,000 |
| スズケン | 42,400 | 4,615.00 | 195,676,000 |
| ジェコス | 7,600 | 1,032.00 | 7,843,200 |
| ローソン | 35,400 | 9,680.00 | 342,672,000 |
| サンエー | 6,300 | 5,280.00 | 33,264,000 |
| カワチ薬品 | 7,300 | 2,425.00 | 17,702,500 |
| エービーシー・マート | 12,000 | 6,520.00 | 78,240,000 |
| ハードオフコーポレーション | 5,600 | 1,539.00 | 8,618,400 |
| アスクル | 9,900 | 4,790.00 | 47,421,000 |
| ゲオホールディングス | 18,000 | 2,021.00 | 36,378,000 |
| アダストリア | 8,800 | 5,910.00 | 52,008,000 |
| くらコーポレーション | 5,700 | 4,860.00 | 27,702,000 |
| キャンドウ | 6,000 | 1,571.00 | 9,426,000 |
| パル | 5,700 | 2,901.00 | 16,535,700 |
| エディオン | 38,800 | 915.00 | 35,502,000 |
| サーラコーポレーション | 12,300 | 643.00 | 7,908,900 |
| あみやき亭 | 2,200 | 4,790.00 | 10,538,000 |
| ひらまつ | 16,100 | 732.00 | 11,785,200 |
| ゲンキー | 2,100 | 3,940.00 | 8,274,000 |

| | | | |
|----------------------|---------|-----------|---------------|
| 大黒天物産 | 2,600 | 4,620.00 | 12,012,000 |
| ハニーズ | 9,600 | 1,006.00 | 9,657,600 |
| アルペン | 7,900 | 2,027.00 | 16,013,300 |
| クオール | 9,900 | 1,693.00 | 16,760,700 |
| ジェイアイエヌ | 6,500 | 4,400.00 | 28,600,000 |
| ビックカメラ | 47,700 | 999.00 | 47,652,300 |
| D C Mホールディングス | 46,100 | 798.00 | 36,787,800 |
| Monotaro | 33,200 | 3,525.00 | 117,030,000 |
| アークランドサービス | 1,700 | 5,650.00 | 9,605,000 |
| J.フロント リテイリング | 117,600 | 1,816.00 | 213,561,600 |
| ドトール・日レスホールディングス | 16,400 | 1,830.00 | 30,012,000 |
| マツモトキヨシホールディングス | 19,300 | 6,250.00 | 120,625,000 |
| ブロンコピリー | 4,100 | 2,432.00 | 9,971,200 |
| スタートトゥデイ | 29,400 | 4,035.00 | 118,629,000 |
| トレジャー・ファクトリー | 3,400 | 1,021.00 | 3,471,400 |
| 物語コーポレーション | 2,900 | 5,800.00 | 16,820,000 |
| ココカラファイン | 9,600 | 5,180.00 | 49,728,000 |
| 三越伊勢丹ホールディングス | 185,500 | 1,618.00 | 300,139,000 |
| ウエルシアホールディングス | 8,000 | 6,650.00 | 53,200,000 |
| クリエイトSDホールディングス | 13,800 | 2,840.00 | 39,192,000 |
| チムニー | 2,700 | 3,195.00 | 8,626,500 |
| ジョイフル本田 | 13,900 | 2,457.00 | 34,152,300 |
| キリン堂ホールディングス | 4,100 | 1,307.00 | 5,358,700 |
| ホットランド | 3,100 | 1,515.00 | 4,696,500 |
| すかいらーく | 29,000 | 1,610.00 | 46,690,000 |
| ユナイテッド・スーパーマーケット・ホール | 30,200 | 1,010.00 | 30,502,000 |
| ブックオフコーポレーション | 8,700 | 897.00 | 7,803,900 |
| あさひ | 8,200 | 1,349.00 | 11,061,800 |
| 日本調剤 | 2,600 | 4,745.00 | 12,337,000 |
| コスモス薬品 | 4,800 | 18,690.00 | 89,712,000 |
| セブン&アイ・ホールディングス | 390,600 | 5,454.00 | 2,130,332,400 |
| 薬王堂 | 1,600 | 2,933.00 | 4,692,800 |
| クリエイト・レストランツ・ホールディング | 8,500 | 3,335.00 | 28,347,500 |
| ツルハホールディングス | 20,000 | 10,470.00 | 209,400,000 |
| サンマルクホールディングス | 7,200 | 3,355.00 | 24,156,000 |
| トリドール | 11,700 | 2,131.00 | 24,932,700 |
| クスリのアオキ | 7,400 | 6,050.00 | 44,770,000 |
| メディカルシステムネットワーク | 11,900 | 660.00 | 7,854,000 |
| 総合メディカル | 4,700 | 4,345.00 | 20,421,500 |
| カッパ・クリエイト | 13,600 | 1,201.00 | 16,333,600 |
| ライトオン | 7,600 | 1,434.00 | 10,898,400 |
| 良品計画 | 10,700 | 25,280.00 | 270,496,000 |

| | | | |
|-----------------|---------|-----------|-------------|
| 三城ホールディングス | 16,600 | 464.00 | 7,702,400 |
| アルビス | 3,200 | 2,214.00 | 7,084,800 |
| コナカ | 12,900 | 636.00 | 8,204,400 |
| G-7ホールディングス | 3,700 | 1,614.00 | 5,971,800 |
| コジマ | 20,100 | 274.00 | 5,507,400 |
| コーナン商事 | 13,300 | 1,687.00 | 22,437,100 |
| エコス | 4,300 | 1,567.00 | 6,738,100 |
| ドンキホーテホールディングス | 60,300 | 4,445.00 | 268,033,500 |
| 西松屋チェーン | 18,800 | 1,070.00 | 20,116,000 |
| ゼンショーホールディングス | 48,900 | 1,508.00 | 73,741,200 |
| 幸楽苑ホールディングス | 7,000 | 1,576.00 | 11,032,000 |
| サイゼリヤ | 15,400 | 3,010.00 | 46,354,000 |
| V Tホールディングス | 32,300 | 684.00 | 22,093,200 |
| 魚力 | 4,100 | 1,448.00 | 5,936,800 |
| ユナイテッドアローズ | 13,400 | 4,905.00 | 65,727,000 |
| ハイデイ日高 | 7,300 | 3,365.00 | 24,564,500 |
| 京都きもの友禅 | 9,500 | 946.00 | 8,987,000 |
| コロワイド | 30,900 | 1,806.00 | 55,805,400 |
| 壱番屋 | 4,200 | 5,790.00 | 24,318,000 |
| スギホールディングス | 16,800 | 6,760.00 | 113,568,000 |
| スクロール | 17,100 | 429.00 | 7,335,900 |
| ヨンドシーホールディングス | 7,400 | 2,815.00 | 20,831,000 |
| ファミリーマート | 28,800 | 5,750.00 | 165,600,000 |
| 木曽路 | 11,800 | 2,151.00 | 25,381,800 |
| サトレストランシステムズ | 14,200 | 895.00 | 12,709,000 |
| 千趣会 | 19,200 | 802.00 | 15,398,400 |
| ケーヨー | 21,500 | 495.00 | 10,642,500 |
| 上新電機 | 22,000 | 1,054.00 | 23,188,000 |
| 日本瓦斯 | 10,900 | 2,863.00 | 31,206,700 |
| ベスト電器 | 37,800 | 130.00 | 4,914,000 |
| ロイヤルホールディングス | 15,300 | 2,336.00 | 35,740,800 |
| いなげや | 11,200 | 1,307.00 | 14,638,400 |
| 島忠 | 24,200 | 2,686.00 | 65,001,200 |
| チヨダ | 11,000 | 3,845.00 | 42,295,000 |
| ライフコーポレーション | 6,100 | 3,075.00 | 18,757,500 |
| リンガーハット | 9,000 | 2,705.00 | 24,345,000 |
| A O K Iホールディングス | 21,300 | 1,558.00 | 33,185,400 |
| オークワ | 15,000 | 1,120.00 | 16,800,000 |
| コメリ | 15,000 | 2,468.00 | 37,020,000 |
| 青山商事 | 18,000 | 4,815.00 | 86,670,000 |
| しまむら | 10,800 | 13,590.00 | 146,772,000 |
| 高島屋 | 135,000 | 1,062.00 | 143,370,000 |

| | | | |
|------------------|---------|-----------|-------------|
| 松屋 | 19,300 | 1,219.00 | 23,526,700 |
| エイチ・ツー・オー リテイリング | 48,200 | 2,397.00 | 115,535,400 |
| 近鉄百貨店 | 40,000 | 323.00 | 12,920,000 |
| パルコ | 9,700 | 1,105.00 | 10,718,500 |
| 丸井グループ | 114,600 | 1,944.00 | 222,782,400 |
| アクシアル リテイリング | 7,400 | 4,050.00 | 29,970,000 |
| 井筒屋 | 51,000 | 62.00 | 3,162,000 |
| イオン | 384,400 | 1,831.50 | 704,028,600 |
| ユニーグループ・ホールディングス | 89,900 | 778.00 | 69,942,200 |
| イズミ | 18,600 | 4,745.00 | 88,257,000 |
| 平和堂 | 18,700 | 2,817.00 | 52,677,900 |
| フジ | 10,600 | 2,511.00 | 26,616,600 |
| ヤオコー | 10,500 | 5,040.00 | 52,920,000 |
| ゼビオホールディングス | 12,700 | 2,350.00 | 29,845,000 |
| ケーズホールディングス | 19,800 | 4,250.00 | 84,150,000 |
| Olympicグループ | 9,300 | 613.00 | 5,700,900 |
| 日産東京販売ホールディングス | 19,300 | 309.00 | 5,963,700 |
| アインホールディングス | 11,300 | 5,950.00 | 67,235,000 |
| 元気寿司 | 3,600 | 2,235.00 | 8,046,000 |
| ヤマダ電機 | 283,600 | 526.00 | 149,173,600 |
| アークランドサカモト | 8,300 | 2,651.00 | 22,003,300 |
| ニトリホールディングス | 40,400 | 10,160.00 | 410,464,000 |
| グルメ杵屋 | 8,000 | 1,057.00 | 8,456,000 |
| 愛眼 | 17,400 | 247.00 | 4,297,800 |
| 吉野家ホールディングス | 36,200 | 1,550.00 | 56,110,000 |
| 松屋フーズ | 5,500 | 2,903.00 | 15,966,500 |
| サガミチェーン | 13,400 | 1,301.00 | 17,433,400 |
| 王将フードサービス | 7,100 | 4,130.00 | 29,323,000 |
| プレナス | 10,200 | 2,047.00 | 20,879,400 |
| ミニストップ | 6,900 | 2,291.00 | 15,807,900 |
| アークス | 17,200 | 2,607.00 | 44,840,400 |
| パローホールディングス | 20,500 | 2,827.00 | 57,953,500 |
| ベルク | 4,700 | 4,425.00 | 20,797,500 |
| 大庄 | 6,200 | 1,542.00 | 9,560,400 |
| ファーストリテイリング | 18,700 | 44,070.00 | 824,109,000 |
| サンドラッグ | 19,700 | 7,690.00 | 151,493,000 |
| サックスパー ホールディングス | 9,000 | 1,786.00 | 16,074,000 |
| ヤマザワ | 3,200 | 1,726.00 | 5,523,200 |
| やまや | 2,300 | 2,185.00 | 5,025,500 |
| ベルーナ | 24,200 | 655.00 | 15,851,000 |
| じもとホールディングス | 73,400 | 195.00 | 14,313,000 |
| 足利ホールディングス | 67,400 | 454.00 | 30,599,600 |

| | | | | |
|-------------------|-----------|----------|---------------|--|
| 東京ＴＹフィナンシャルグループ | 13,200 | 3,895.00 | 51,414,000 | |
| 九州フィナンシャルグループ | 143,600 | 832.00 | 119,475,200 | |
| 新生銀行 | 805,000 | 220.00 | 177,100,000 | |
| あおぞら銀行 | 591,000 | 423.00 | 249,993,000 | |
| 三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ | 7,492,300 | 758.20 | 5,680,661,860 | |
| りそなホールディングス | 1,090,000 | 583.20 | 635,688,000 | |
| 三井住友トラスト・ホールディングス | 1,945,000 | 457.10 | 889,059,500 | |
| 三井住友フィナンシャルグループ | 747,700 | 4,543.00 | 3,396,801,100 | |
| 第四銀行 | 117,000 | 518.00 | 60,606,000 | |
| 北越銀行 | 105,000 | 252.00 | 26,460,000 | |
| 西日本シティ銀行 | 305,000 | 307.00 | 93,635,000 | |
| 千葉銀行 | 358,000 | 826.00 | 295,708,000 | |
| 横浜銀行 | 623,000 | 714.50 | 445,133,500 | |
| 常陽銀行 | 334,000 | 544.00 | 181,696,000 | |
| 群馬銀行 | 206,000 | 696.00 | 143,376,000 | |
| 武蔵野銀行 | 15,000 | 4,360.00 | 65,400,000 | |
| 千葉興業銀行 | 26,900 | 684.00 | 18,399,600 | |
| 筑波銀行 | 39,500 | 399.00 | 15,760,500 | |
| 七十七銀行 | 145,000 | 637.00 | 92,365,000 | |
| 青森銀行 | 68,000 | 379.00 | 25,772,000 | |
| 秋田銀行 | 62,000 | 402.00 | 24,924,000 | |
| 山形銀行 | 53,000 | 467.00 | 24,751,000 | |
| 岩手銀行 | 6,400 | 4,845.00 | 31,008,000 | |
| 東邦銀行 | 86,000 | 421.00 | 36,206,000 | |
| 東北銀行 | 56,000 | 156.00 | 8,736,000 | |
| みちのく銀行 | 50,000 | 201.00 | 10,050,000 | |
| ふくおかフィナンシャルグループ | 401,000 | 570.00 | 228,570,000 | |
| 静岡銀行 | 272,000 | 1,160.00 | 315,520,000 | |
| 十六銀行 | 117,000 | 464.00 | 54,288,000 | |
| スルガ銀行 | 98,500 | 2,370.00 | 233,445,000 | |
| 八十二銀行 | 166,000 | 723.00 | 120,018,000 | |
| 山梨中央銀行 | 57,000 | 599.00 | 34,143,000 | |
| 大垣共立銀行 | 126,000 | 478.00 | 60,228,000 | |
| 福井銀行 | 82,000 | 234.00 | 19,188,000 | |
| 北國銀行 | 107,000 | 395.00 | 42,265,000 | |
| 清水銀行 | 3,400 | 3,020.00 | 10,268,000 | |
| 滋賀銀行 | 89,000 | 586.00 | 52,154,000 | |
| 南都銀行 | 90,000 | 369.00 | 33,210,000 | |
| 百五銀行 | 84,000 | 570.00 | 47,880,000 | |
| 京都銀行 | 178,000 | 1,102.00 | 196,156,000 | |
| 紀陽銀行 | 36,400 | 1,729.00 | 62,935,600 | |
| 三重銀行 | 45,000 | 267.00 | 12,015,000 | |

| | | | |
|-----------------|------------|----------|---------------|
| ほくほくフィナンシャルグループ | 629,000 | 241.00 | 151,589,000 |
| 広島銀行 | 274,000 | 682.00 | 186,868,000 |
| 山陰合同銀行 | 57,600 | 961.00 | 55,353,600 |
| 中国銀行 | 65,300 | 1,573.00 | 102,716,900 |
| 鳥取銀行 | 34,000 | 218.00 | 7,412,000 |
| 伊予銀行 | 98,400 | 1,134.00 | 111,585,600 |
| 百十四銀行 | 102,000 | 439.00 | 44,778,000 |
| 四国銀行 | 75,000 | 271.00 | 20,325,000 |
| 阿波銀行 | 78,000 | 685.00 | 53,430,000 |
| 大分銀行 | 54,000 | 464.00 | 25,056,000 |
| 宮崎銀行 | 65,000 | 393.00 | 25,545,000 |
| 佐賀銀行 | 60,000 | 268.00 | 16,080,000 |
| 十八銀行 | 59,000 | 347.00 | 20,473,000 |
| 沖縄銀行 | 7,400 | 4,645.00 | 34,373,000 |
| 琉球銀行 | 19,300 | 1,673.00 | 32,288,900 |
| セブン銀行 | 351,100 | 522.00 | 183,274,200 |
| みずほフィナンシャルグループ | 13,152,900 | 243.40 | 3,201,415,860 |
| 高知銀行 | 41,000 | 142.00 | 5,822,000 |
| 山口フィナンシャルグループ | 87,000 | 1,404.00 | 122,148,000 |
| 長野銀行 | 35,000 | 203.00 | 7,105,000 |
| 名古屋銀行 | 81,000 | 429.00 | 34,749,000 |
| 北洋銀行 | 141,500 | 416.00 | 58,864,000 |
| 愛知銀行 | 3,200 | 6,320.00 | 20,224,000 |
| 第三銀行 | 55,000 | 177.00 | 9,735,000 |
| 中京銀行 | 42,000 | 228.00 | 9,576,000 |
| 東日本銀行 | 48,000 | 381.00 | 18,288,000 |
| 大光銀行 | 36,000 | 242.00 | 8,712,000 |
| 愛媛銀行 | 60,000 | 250.00 | 15,000,000 |
| トマト銀行 | 42,000 | 175.00 | 7,350,000 |
| みなと銀行 | 90,000 | 198.00 | 17,820,000 |
| 京葉銀行 | 78,000 | 552.00 | 43,056,000 |
| 関西アーバン銀行 | 13,900 | 1,327.00 | 18,445,300 |
| 栃木銀行 | 52,000 | 685.00 | 35,620,000 |
| 北日本銀行 | 3,200 | 3,285.00 | 10,512,000 |
| 東和銀行 | 141,000 | 106.00 | 14,946,000 |
| 福島銀行 | 129,000 | 96.00 | 12,384,000 |
| 大東銀行 | 57,000 | 210.00 | 11,970,000 |
| トモニホールディングス | 74,600 | 453.00 | 33,793,800 |
| フィデアホールディングス | 61,600 | 264.00 | 16,262,400 |
| 池田泉州ホールディングス | 100,000 | 485.00 | 48,500,000 |
| F P G | 28,100 | 862.00 | 24,222,200 |
| S B I ホールディングス | 112,300 | 1,318.00 | 148,011,400 |

| | | | |
|---------------------------|-----------|----------|---------------|
| ジャフコ | 15,500 | 4,600.00 | 71,300,000 |
| 大和証券グループ本社 | 874,000 | 752.00 | 657,248,000 |
| 野村ホールディングス | 1,795,500 | 696.30 | 1,250,206,650 |
| 岡三証券グループ | 80,000 | 707.00 | 56,560,000 |
| 丸三証券 | 28,500 | 1,246.00 | 35,511,000 |
| 東洋証券 | 37,000 | 380.00 | 14,060,000 |
| 東海東京フィナンシャル・ホールディングス | 107,100 | 710.00 | 76,041,000 |
| 光世証券 | 23,000 | 177.00 | 4,071,000 |
| 水戸証券 | 28,900 | 408.00 | 11,791,200 |
| いちよし証券 | 21,300 | 1,102.00 | 23,472,600 |
| 松井証券 | 47,100 | 1,117.00 | 52,610,700 |
| だいこう証券ビジネス | 3,900 | 1,097.00 | 4,278,300 |
| マネックスグループ | 111,100 | 318.00 | 35,329,800 |
| カブドットコム証券 | 83,200 | 377.00 | 31,366,400 |
| 極東証券 | 13,000 | 1,574.00 | 20,462,000 |
| 岩井コスモホールディングス | 9,100 | 1,351.00 | 12,294,100 |
| 藍澤証券 | 13,000 | 698.00 | 9,074,000 |
| マネースクウェアHD | 3,800 | 1,448.00 | 5,502,400 |
| マネーパートナーズグループ | 9,600 | 408.00 | 3,916,800 |
| 損保ジャパン日本興亜ホールディングス | 207,200 | 3,777.00 | 782,594,400 |
| アニコムホールディングス | 6,500 | 2,847.00 | 18,505,500 |
| MS&ADインシュアランスグループホールディングス | 278,900 | 3,369.00 | 939,614,100 |
| ソニーフィナンシャルホールディングス | 90,200 | 2,156.00 | 194,471,200 |
| 第一生命保険 | 598,100 | 2,024.00 | 1,210,554,400 |
| 東京海上ホールディングス | 378,500 | 4,525.00 | 1,712,712,500 |
| T&Dホールディングス | 340,000 | 1,598.00 | 543,320,000 |
| 全国保証 | 24,300 | 4,015.00 | 97,564,500 |
| クレディセゾン | 70,800 | 2,427.00 | 171,831,600 |
| アクリーティブ | 9,600 | 494.00 | 4,742,400 |
| 芙蓉総合リース | 10,800 | 5,640.00 | 60,912,000 |
| 興銀リース | 17,800 | 2,494.00 | 44,393,200 |
| 東京センチュリーリース | 21,600 | 4,120.00 | 88,992,000 |
| 日本証券金融 | 40,900 | 636.00 | 26,012,400 |
| アイフル | 156,400 | 392.00 | 61,308,800 |
| ポケットカード | 11,400 | 542.00 | 6,178,800 |
| リコーリース | 7,300 | 3,700.00 | 27,010,000 |
| イオンフィナンシャルサービス | 61,300 | 2,725.00 | 167,042,500 |
| アコム | 188,200 | 600.00 | 112,920,000 |
| ジャックス | 53,000 | 429.00 | 22,737,000 |
| オリエントコーポレーション | 404,100 | 260.00 | 105,066,000 |
| 日立キャピタル | 22,300 | 3,255.00 | 72,586,500 |
| アプラスフィナンシャル | 50,700 | 110.00 | 5,577,000 |

| | | | |
|------------------|---------|----------|---------------|
| オリックス | 660,100 | 1,687.00 | 1,113,588,700 |
| 三菱UFJリース | 234,900 | 619.00 | 145,403,100 |
| 日本取引所グループ | 273,900 | 1,932.00 | 529,174,800 |
| イー・ギャランティ | 3,400 | 2,695.00 | 9,163,000 |
| NECキャピタルソリューション | 4,500 | 1,662.00 | 7,479,000 |
| 日本駐車場開発 | 104,800 | 141.00 | 14,776,800 |
| ヒューリック | 194,900 | 1,077.00 | 209,907,300 |
| 三栄建築設計 | 4,600 | 1,364.00 | 6,274,400 |
| 野村不動産ホールディングス | 62,200 | 2,326.00 | 144,677,200 |
| 三重交通グループホールディングス | 20,400 | 460.00 | 9,384,000 |
| 日本商業開発 | 3,500 | 1,836.00 | 6,426,000 |
| プレサンスコーポレーション | 3,300 | 3,975.00 | 13,117,500 |
| ユニゾホールディングス | 5,900 | 4,650.00 | 27,435,000 |
| 日本管理センター | 6,700 | 1,440.00 | 9,648,000 |
| フージャースホールディングス | 16,100 | 541.00 | 8,710,100 |
| オープンハウス | 13,700 | 2,336.00 | 32,003,200 |
| 東急不動産ホールディングス | 225,800 | 766.00 | 172,962,800 |
| 飯田グループホールディングス | 86,500 | 2,305.00 | 199,382,500 |
| パーク24 | 47,700 | 2,843.00 | 135,611,100 |
| パラカ | 4,400 | 1,587.00 | 6,982,800 |
| 三井不動産 | 495,000 | 3,140.00 | 1,554,300,000 |
| 三菱地所 | 694,000 | 2,544.50 | 1,765,883,000 |
| 平和不動産 | 17,900 | 1,339.00 | 23,968,100 |
| 東京建物 | 101,600 | 1,372.00 | 139,395,200 |
| ダイビル | 24,700 | 986.00 | 24,354,200 |
| 京阪神ビルディング | 19,200 | 693.00 | 13,305,600 |
| 住友不動産 | 224,000 | 3,640.00 | 815,360,000 |
| 大京 | 168,000 | 197.00 | 33,096,000 |
| テーオーシー | 37,100 | 1,016.00 | 37,693,600 |
| 東京楽天地 | 19,000 | 511.00 | 9,709,000 |
| レオパレス21 | 110,800 | 686.00 | 76,008,800 |
| スターツコーポレーション | 10,400 | 2,361.00 | 24,554,400 |
| フジ住宅 | 15,000 | 755.00 | 11,325,000 |
| 空港施設 | 14,800 | 575.00 | 8,510,000 |
| 住友不動産販売 | 6,800 | 2,772.00 | 18,849,600 |
| ゴールドクレスト | 7,600 | 2,259.00 | 17,168,400 |
| 日神不動産 | 16,300 | 420.00 | 6,846,000 |
| タカラレーベン | 42,500 | 706.00 | 30,005,000 |
| サンヨーハウジング名古屋 | 6,600 | 1,160.00 | 7,656,000 |
| イオンモール | 60,800 | 2,131.00 | 129,564,800 |
| ファースト住建 | 4,700 | 1,348.00 | 6,335,600 |
| トーセイ | 15,500 | 754.00 | 11,687,000 |

| | | | |
|------------------|---------|----------|-------------|
| エヌ・ティ・ティ都市開発 | 58,200 | 1,183.00 | 68,850,600 |
| サンフロンティア不動産 | 11,800 | 910.00 | 10,738,000 |
| エフ・ジェー・ネクスト | 9,700 | 510.00 | 4,947,000 |
| 日本空港ビルデング | 29,900 | 5,510.00 | 164,749,000 |
| 日本工営 | 34,000 | 440.00 | 14,960,000 |
| ネクスト | 28,700 | 1,452.00 | 41,672,400 |
| ジェイエイシーリクルートメント | 5,200 | 938.00 | 4,877,600 |
| 日本M&Aセンター | 15,500 | 5,600.00 | 86,800,000 |
| アコーディア・ゴルフ | 27,800 | 1,157.00 | 32,164,600 |
| タケエイ | 9,600 | 1,029.00 | 9,878,400 |
| パソナグループ | 8,500 | 883.00 | 7,505,500 |
| GCAサヴィアン | 9,600 | 1,208.00 | 11,596,800 |
| エス・エム・エス | 12,600 | 2,367.00 | 29,824,200 |
| テンプホールディングス | 69,400 | 1,865.00 | 129,431,000 |
| リニカル | 3,600 | 3,710.00 | 13,356,000 |
| クックパッド | 22,100 | 2,696.00 | 59,581,600 |
| エスクリ | 5,900 | 1,029.00 | 6,071,100 |
| 学情 | 4,900 | 1,252.00 | 6,134,800 |
| スタジオアリス | 5,200 | 2,171.00 | 11,289,200 |
| シミックホールディングス | 5,400 | 1,583.00 | 8,548,200 |
| 総合警備保障 | 33,000 | 5,690.00 | 187,770,000 |
| カカクコム | 72,400 | 2,402.00 | 173,904,800 |
| アイロムグループ | 3,500 | 1,171.00 | 4,098,500 |
| ルネサンス | 7,000 | 1,285.00 | 8,995,000 |
| ディップ | 11,100 | 2,707.00 | 30,047,700 |
| オプトホールディング | 8,100 | 638.00 | 5,167,800 |
| 新日本科学 | 10,700 | 426.00 | 4,558,200 |
| ツクイ | 12,400 | 1,344.00 | 16,665,600 |
| キャリアデザインセンター | 3,600 | 1,298.00 | 4,672,800 |
| エムスリー | 85,900 | 2,627.00 | 225,659,300 |
| ツカダ・グローバルホールディング | 9,600 | 805.00 | 7,728,000 |
| アウトソーシング | 4,700 | 3,235.00 | 15,204,500 |
| ウェルネット | 3,800 | 2,874.00 | 10,921,200 |
| ディー・エヌ・エー | 44,700 | 1,911.00 | 85,421,700 |
| 博報堂DYホールディングス | 136,500 | 1,326.00 | 180,999,000 |
| ぐるなび | 11,800 | 2,650.00 | 31,270,000 |
| エスアールジータカミヤ | 9,700 | 474.00 | 4,597,800 |
| 一休 | 7,000 | 3,415.00 | 23,905,000 |
| ファンコミュニケーションズ | 23,300 | 773.00 | 18,010,900 |
| WDBホールディングス | 4,300 | 1,166.00 | 5,013,800 |
| バリューコマース | 11,400 | 507.00 | 5,779,800 |
| J Pホールディングス | 29,300 | 348.00 | 10,196,400 |

| | | | |
|------------------|---------|-----------|-------------|
| E P Sホールディングス | 10,700 | 1,336.00 | 14,295,200 |
| プレステージ・インターナショナル | 9,500 | 1,185.00 | 11,257,500 |
| アミューズ | 2,800 | 5,890.00 | 16,492,000 |
| ドリームインキュベータ | 3,800 | 2,337.00 | 8,880,600 |
| クイック | 5,800 | 996.00 | 5,776,800 |
| ケネディクス | 132,200 | 460.00 | 60,812,000 |
| 電通 | 110,200 | 6,760.00 | 744,952,000 |
| ぴあ | 3,900 | 2,376.00 | 9,266,400 |
| イオンファンタジー | 3,900 | 2,037.00 | 7,944,300 |
| ネクシィーズ | 4,800 | 765.00 | 3,672,000 |
| みらかホールディングス | 25,400 | 5,350.00 | 135,890,000 |
| アルプス技研 | 4,400 | 2,537.00 | 11,162,800 |
| 日本空調サービス | 6,400 | 1,223.00 | 7,827,200 |
| オリエンタルランド | 106,900 | 7,100.00 | 758,990,000 |
| ダスキン | 28,800 | 2,200.00 | 63,360,000 |
| 明光ネットワークジャパン | 11,400 | 1,401.00 | 15,971,400 |
| ファルコホールディングス | 5,700 | 1,473.00 | 8,396,100 |
| ラウンドワン | 32,300 | 555.00 | 17,926,500 |
| リゾートトラスト | 41,900 | 3,050.00 | 127,795,000 |
| ビー・エム・エル | 5,900 | 3,510.00 | 20,709,000 |
| りらいあコミュニケーションズ | 16,200 | 1,118.00 | 18,111,600 |
| ユー・エス・エス | 120,000 | 1,857.00 | 222,840,000 |
| サイバーエージェント | 24,300 | 5,120.00 | 124,416,000 |
| 楽天 | 463,100 | 1,385.00 | 641,393,500 |
| テー・オー・ダブリュー | 8,100 | 689.00 | 5,580,900 |
| セントラルスポーツ | 4,700 | 2,311.00 | 10,861,700 |
| フルキャストホールディングス | 9,900 | 717.00 | 7,098,300 |
| テクノプロ・ホールディングス | 14,300 | 3,635.00 | 51,980,500 |
| リブセンス | 9,400 | 380.00 | 3,572,000 |
| ジャパンマテリアル | 4,600 | 2,501.00 | 11,504,600 |
| ベクトル | 3,500 | 1,931.00 | 6,758,500 |
| I B J | 2,800 | 1,765.00 | 4,942,000 |
| アサンテ | 4,800 | 1,501.00 | 7,204,800 |
| N・フィールド | 4,200 | 1,392.00 | 5,846,400 |
| リクルートホールディングス | 199,200 | 3,645.00 | 726,084,000 |
| リロ・ホールディング | 3,700 | 13,760.00 | 50,912,000 |
| 東祥 | 3,300 | 3,110.00 | 10,263,000 |
| エイチ・アイ・エス | 16,000 | 3,730.00 | 59,680,000 |
| 共立メンテナンス | 7,400 | 10,010.00 | 74,074,000 |
| イチネンホールディングス | 12,000 | 1,138.00 | 13,656,000 |
| 建設技術研究所 | 7,300 | 1,285.00 | 9,380,500 |
| スペース | 6,000 | 1,416.00 | 8,496,000 |

| | | | | |
|----------------|-------------|----------|-----------------|--|
| 燦ホールディングス | 3,800 | 1,545.00 | 5,871,000 | |
| 東京テアトル | 58,000 | 137.00 | 7,946,000 | |
| よみうりランド | 24,000 | 402.00 | 9,648,000 | |
| 東京都競馬 | 68,000 | 273.00 | 18,564,000 | |
| 常磐興産 | 51,000 | 155.00 | 7,905,000 | |
| カナモト | 13,900 | 2,986.00 | 41,505,400 | |
| 東京ドーム | 79,000 | 571.00 | 45,109,000 | |
| 西尾レントオール | 8,000 | 3,105.00 | 24,840,000 | |
| トランス・コスモス | 11,400 | 3,015.00 | 34,371,000 | |
| 乃村工藝社 | 21,000 | 1,855.00 | 38,955,000 | |
| 藤田観光 | 38,000 | 556.00 | 21,128,000 | |
| KNT-CTホールディングス | 51,000 | 241.00 | 12,291,000 | |
| 日本管財 | 8,900 | 1,949.00 | 17,346,100 | |
| トーカイ | 4,600 | 3,490.00 | 16,054,000 | |
| 白洋舎 | 20,000 | 276.00 | 5,520,000 | |
| セコム | 102,900 | 8,185.00 | 842,236,500 | |
| セントラル警備保障 | 6,000 | 1,756.00 | 10,536,000 | |
| 丹青社 | 18,900 | 984.00 | 18,597,600 | |
| メイテック | 12,400 | 4,215.00 | 52,266,000 | |
| アサツー ディ・ケイ | 17,700 | 3,335.00 | 59,029,500 | |
| 応用地質 | 10,300 | 1,406.00 | 14,481,800 | |
| 船井総研ホールディングス | 12,000 | 2,041.00 | 24,492,000 | |
| オオバ | 7,600 | 472.00 | 3,587,200 | |
| ベネッセホールディングス | 33,400 | 3,400.00 | 113,560,000 | |
| イオンディライト | 9,500 | 3,855.00 | 36,622,500 | |
| ナック | 7,800 | 978.00 | 7,628,400 | |
| ニチイ学館 | 18,000 | 869.00 | 15,642,000 | |
| ダイセキ | 18,700 | 2,025.00 | 37,867,500 | |
| 合 計 | 155,354,500 | | 214,240,794,730 | |

(b) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

S M A M ・年金国内債券パッシブファンド＜適格機関投資家限定＞

貸借対照表

| | （平成26年12月19日現在） | （平成27年12月18日現在） |
|----------------|-----------------------|-----------------------|
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| コール・ローン | 2,001,306 | 4,669 |
| 親投資信託受益証券 | 43,917,747,668 | 32,406,754,029 |
| 未収入金 | - | 4,999,999 |
| 流動資産合計 | 43,919,748,974 | 32,411,758,697 |
| 資産合計 | 43,919,748,974 | 32,411,758,697 |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 未払解約金 | 2,000,000 | 4,999,999 |
| 未払受託者報酬 | 5,709,715 | 4,844,865 |
| 未払委託者報酬 | 5,709,649 | 4,844,803 |
| その他未払費用 | 486,000 | 486,000 |
| 流動負債合計 | 13,905,364 | 15,175,667 |
| 負債合計 | 13,905,364 | 15,175,667 |
| 純資産の部 | | |
| 元本等 | | |
| 元本 | 35,688,617,338 | 25,989,414,850 |
| 剰余金 | | |
| 剰余金又は欠損金（ ） | 8,217,226,272 | 6,407,168,180 |
| 元本等合計 | 43,905,843,610 | 32,396,583,030 |
| 純資産合計 | 43,905,843,610 | 32,396,583,030 |
| 負債純資産合計 | 43,919,748,974 | 32,411,758,697 |

注記表

（重要な会計方針の注記）

| 項目 | 自 平成27年 6月23日 至 平成27年12月18日 |
|-----------------|---|
| 有価証券の評価基準及び評価方法 | <p>親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p> |

（貸借対照表に関する注記）

| 項目 | （平成26年12月19日現在） | （平成27年12月18日現在） |
|----|-----------------|-----------------|
|----|-----------------|-----------------|

| | | |
|-----------------------|--|--|
| 1. 当計算期間の末日における受益権の総数 | 35,688,617,338口 | 25,989,414,850口 |
| 2. 1単位当たり純資産の額 | 1口当たり純資産額 1.2302円 (10,000口当たりの純資産額 12,302円) | 1口当たり純資産額 1.2465円 (10,000口当たりの純資産額 12,465円) |

(金融商品に関する注記)

. 金融商品の状況に関する事項

| 項目 | 自 平成27年 6月23日 至 平成27年12月18日 |
|------------------------|--|
| 1. 金融商品に対する取組方針 | 当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。 |
| 2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク | <p>(1)金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、親投資信託受益証券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2)金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p> |

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

・金融商品の時価等に関する事項

| 項目 | (平成27年12月18日現在) |
|-------------------|--|
| 1.貸借対照表計上額、時価及び差額 | 金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 |
| 2.時価の算定方法 | <p>(1) 有価証券（親投資信託受益証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p> |

(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）

該当事項はありません。

（その他の注記）

| 項 目 | （平成26年12月19日現在） | （平成27年12月18日現在） |
|-----------|-----------------|-----------------|
| 期首元本額 | 34,809,938,556円 | 29,681,762,293円 |
| 期中追加設定元本額 | 1,475,510,646円 | 2,576,006,063円 |
| 期中一部解約元本額 | 596,831,864円 | 6,268,353,506円 |

附属明細表

有価証券明細表

(a) 株式

該当事項はありません。

(b) 株式以外の有価証券

（単位：円）

| 種類 | 銘 柄 | 券面総額 | 評価額 | 備考 |
|-----------|-----------------------------|----------------|----------------|----|
| 親投資信託受益証券 | 国内債券（NOMURA - B P I）マザーファンド | 24,113,962,370 | 32,406,754,029 | |
| 合計 | | 24,113,962,370 | 32,406,754,029 | |

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

（参考）

S M A M ・年金国内債券パッシブファンド<適格機関投資家限定>は、「国内債券（N O M U R A - B P I）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。

国内債券（N O M U R A - B P I）マザーファンド

貸借対照表

| | （単位：円） | |
|-------------|-----------------|-----------------|
| | （平成26年12月19日現在） | （平成27年12月18日現在） |
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| コール・ローン | 1,272,590,405 | 714,443,673 |
| 国債証券 | 109,591,646,730 | 88,456,047,680 |
| 地方債証券 | 8,758,554,475 | 7,278,673,985 |
| 特殊債券 | 13,169,266,811 | 11,306,492,229 |
| 社債券 | 9,133,657,000 | 7,029,207,000 |
| 未収入金 | 402,659,800 | 47,099,100 |
| 未収利息 | 621,405,630 | 466,323,881 |
| 前払費用 | 37,593,110 | 13,901,507 |
| 流動資産合計 | 142,987,373,961 | 115,312,189,055 |
| 資産合計 | 142,987,373,961 | 115,312,189,055 |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 未払解約金 | 862,204,243 | 263,685,026 |
| 流動負債合計 | 862,204,243 | 263,685,026 |
| 負債合計 | 862,204,243 | 263,685,026 |
| 純資産の部 | | |
| 元本等 | | |
| 元本 | 107,215,389,922 | 85,606,537,336 |
| 剰余金 | | |
| 剰余金又は欠損金（ ） | 34,909,779,796 | 29,441,966,693 |
| 元本等合計 | 142,125,169,718 | 115,048,504,029 |
| 純資産合計 | 142,125,169,718 | 115,048,504,029 |
| 負債純資産合計 | 142,987,373,961 | 115,312,189,055 |

注記表

（重要な会計方針の注記）

| | |
|-----|--------------------------------|
| 項 目 | 自 平成27年 6月23日 至 平成27年12月18日 |
|-----|--------------------------------|

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

(貸借対照表に関する注記)

| 項目 | (平成26年12月19日現在) | (平成27年12月18日現在) |
|-----------------------|---|---|
| 1. 当計算期間の末日における受益権の総数 | 107,215,389,922口 | 85,606,537,336口 |
| 2. 1単位当たり純資産の額 | 1口当たり純資産額 1.3256円 (10,000口当たりの純資産額 13,256円) | 1口当たり純資産額 1.3439円 (10,000口当たりの純資産額 13,439円) |

(金融商品に関する注記)

. 金融商品の状況に関する事項

| 項目 | 自平成27年6月23日 至平成27年12月18日 |
|------------------------|--|
| 1. 金融商品に対する取組方針 | 当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。 |
| 2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク | <p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいておりません。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク</p> |

| | |
|---------------------------|--|
| | <p>有価証券およびデリバティブ取引等</p> <p>当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p> |
| 3.金融商品に係るリスク管理体制 | <p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する委員会をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用グループに是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用グループは、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。その後、当該関連運用グループの対処の実施や対処方針の決定等に関し、必要に応じてリスク管理を行う部署が当該部署の担当役員、当該関連運用グループの担当役員およびリスク管理委員会へ報告を行う体制となっております。</p> <p>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する部会にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。</p> |
| 4.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | <p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない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認める評価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。</p> |

・金融商品の時価等に関する事項

| 項目 | (平成27年12月18日現在) |
|-------------------|--|
| 1.貸借対照表計上額、時価及び差額 | 金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 |
| 2.時価の算定方法 | <p>(1) 有価証券（国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p> |

(デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

| （平成26年12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 | 109,171,383,866円 |
| 同期中における追加設定元本額 | 9,669,908,057円 |
| 同期中における一部解約元本額 | 11,625,902,001円 |
| 平成26年12月19日現在における元本の内訳 | |
| 三井住友・DC年金日本債券インデックス・ファンド | 29,281,025,699円 |
| S M A M・国内債券インデックス・ファンド | 44,105,818,912円 |
| 国内債券インデックスファンドV A < 適格機関投資家限定 > | 698,077,848円 |
| S M A M・年金国内債券パッシブファンド < 適格機関投資家限定 > | 33,130,467,463円 |
| 合計 | 107,215,389,922円 |

| （平成27年12月18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 | 95,148,733,046円 |
| 同期中における追加設定元本額 | 6,230,258,239円 |
| 同期中における一部解約元本額 | 15,772,453,949円 |
| 平成27年12月18日現在における元本の内訳 | |
| 三井住友・日本債券インデックス・ファンド | 32,121,312,058円 |
| S M A M・国内債券インデックス・ファンド | 28,897,296,622円 |
| 国内債券インデックスファンドV A < 適格機関投資家限定 > | 473,966,286円 |
| S M A M・年金国内債券パッシブファンド < 適格機関投資家限定 > | 24,113,962,370円 |
| 合計 | 85,606,537,336円 |

附属明細表

有価証券明細表

(a) 株式

該当事項はありません。

(b) 株式以外の有価証券

(単位：円)

| 種類 | 銘柄 | 券面総額 | 評価額 | 備考 |
|----------------|----------------|---------------|---------------|----|
| 国債証券 | 第111回利付国債(5年) | 330,000,000 | 333,217,500 | |
| | 第120回利付国債(5年) | 185,000,000 | 186,385,650 | |
| | 第122回利付国債(5年) | 1,240,000,000 | 1,244,451,600 | |
| | 第123回利付国債(5年) | 1,040,000,000 | 1,043,525,600 | |
| | 第124回利付国債(5年) | 940,000,000 | 943,158,400 | |
| | 第125回利付国債(5年) | 1,320,000,000 | 1,324,369,200 | |
| | 第1回利付国債(40年) | 10,000,000 | 12,864,400 | |
| | 第2回利付国債(40年) | 162,000,000 | 200,019,780 | |
| | 第3回利付国債(40年) | 170,000,000 | 209,982,300 | |
| | 第4回利付国債(40年) | 215,000,000 | 265,942,100 | |
| | 第5回利付国債(40年) | 227,000,000 | 268,125,590 | |
| | 第6回利付国債(40年) | 230,000,000 | 264,960,000 | |
| | 第7回利付国債(40年) | 245,000,000 | 267,638,000 | |
| | 第8回利付国債(40年) | 235,000,000 | 234,701,550 | |
| | 第289回利付国債(10年) | 1,403,000,000 | 1,446,128,220 | |
| | 第290回利付国債(10年) | 1,152,000,000 | 1,189,071,360 | |
| | 第292回利付国債(10年) | 1,350,000,000 | 1,402,528,500 | |
| | 第293回利付国債(10年) | 1,836,000,000 | 1,919,574,720 | |
| | 第296回利付国債(10年) | 1,426,000,000 | 1,485,735,140 | |
| | 第297回利付国債(10年) | 1,344,000,000 | 1,401,173,760 | |
| | 第299回利付国債(10年) | 1,225,000,000 | 1,277,234,000 | |
| | 第300回利付国債(10年) | 1,420,000,000 | 1,489,750,400 | |
| | 第301回利付国債(10年) | 1,503,000,000 | 1,582,027,740 | |
| | 第303回利付国債(10年) | 1,135,000,000 | 1,194,281,050 | |
| | 第305回利付国債(10年) | 1,325,000,000 | 1,392,959,250 | |
| | 第306回利付国債(10年) | 1,450,000,000 | 1,534,462,500 | |
| | 第308回利付国債(10年) | 505,000,000 | 533,774,900 | |
| | 第309回利付国債(10年) | 640,000,000 | 670,726,400 | |
| | 第310回利付国債(10年) | 1,325,000,000 | 1,385,897,000 | |
| | 第312回利付国債(10年) | 985,000,000 | 1,042,208,800 | |
| | 第313回利付国債(10年) | 1,120,000,000 | 1,194,110,400 | |
| | 第315回利付国債(10年) | 1,355,000,000 | 1,441,543,850 | |
| 第317回利付国債(10年) | 1,115,000,000 | 1,183,081,900 | | |

| | | | |
|-------------------|---------------|---------------|--|
| 第3 1 9 回利付国債(10年) | 630,000,000 | 670,131,000 | |
| 第3 2 0 回利付国債(10年) | 480,000,000 | 507,705,600 | |
| 第3 2 1 回利付国債(10年) | 635,000,000 | 673,157,150 | |
| 第3 2 2 回利付国債(10年) | 610,000,000 | 642,854,600 | |
| 第3 2 3 回利付国債(10年) | 70,000,000 | 73,898,300 | |
| 第3 2 4 回利付国債(10年) | 680,000,000 | 713,469,600 | |
| 第3 2 5 回利付国債(10年) | 540,000,000 | 567,221,400 | |
| 第3 2 6 回利付国債(10年) | 780,000,000 | 814,764,600 | |
| 第3 2 7 回利付国債(10年) | 380,000,000 | 399,585,200 | |
| 第3 2 8 回利付国債(10年) | 1,120,000,000 | 1,162,347,200 | |
| 第3 2 9 回利付国債(10年) | 1,220,000,000 | 1,284,464,800 | |
| 第3 3 0 回利付国債(10年) | 950,000,000 | 1,000,720,500 | |
| 第3 3 2 回利付国債(10年) | 840,000,000 | 871,920,000 | |
| 第3 3 3 回利付国債(10年) | 1,050,000,000 | 1,089,784,500 | |
| 第3 3 4 回利付国債(10年) | 700,000,000 | 726,110,000 | |
| 第3 3 5 回利付国債(10年) | 670,000,000 | 689,048,100 | |
| 第3 3 6 回利付国債(10年) | 610,000,000 | 626,994,600 | |
| 第3 3 7 回利付国債(10年) | 270,000,000 | 272,745,900 | |
| 第3 3 8 回利付国債(10年) | 1,160,000,000 | 1,180,508,800 | |
| 第3 3 9 回利付国債(10年) | 1,030,000,000 | 1,046,747,800 | |
| 第3 4 0 回利付国債(10年) | 1,125,000,000 | 1,141,593,750 | |
| 第2 回利付国債(30年) | 150,000,000 | 187,822,500 | |
| 第4 回利付国債(30年) | 160,000,000 | 212,404,800 | |
| 第5 回利付国債(30年) | 110,000,000 | 135,108,600 | |
| 第7 回利付国債(30年) | 180,000,000 | 224,200,800 | |
| 第10 回利付国債(30年) | 230,000,000 | 241,550,600 | |
| 第11 回利付国債(30年) | 150,000,000 | 171,903,000 | |
| 第12 回利付国債(30年) | 230,000,000 | 278,626,600 | |
| 第14 回利付国債(30年) | 250,000,000 | 314,925,000 | |
| 第15 回利付国債(30年) | 250,000,000 | 318,980,000 | |
| 第16 回利付国債(30年) | 195,000,000 | 248,833,650 | |
| 第18 回利付国債(30年) | 190,000,000 | 235,558,200 | |
| 第19 回利付国債(30年) | 160,000,000 | 198,132,800 | |
| 第21 回利付国債(30年) | 102,000,000 | 126,197,460 | |
| 第22 回利付国債(30年) | 149,000,000 | 189,656,140 | |
| 第23 回利付国債(30年) | 151,000,000 | 192,301,520 | |
| 第24 回利付国債(30年) | 135,000,000 | 172,007,550 | |
| 第25 回利付国債(30年) | 185,000,000 | 228,713,650 | |
| 第26 回利付国債(30年) | 209,000,000 | 262,330,530 | |
| 第27 回利付国債(30年) | 206,000,000 | 262,833,340 | |
| 第28 回利付国債(30年) | 271,000,000 | 346,852,900 | |
| 第29 回利付国債(30年) | 210,000,000 | 264,969,600 | |

| | | |
|---------------|-------------|-------------|
| 第30回利付国債(30年) | 255,000,000 | 316,916,550 |
| 第31回利付国債(30年) | 380,000,000 | 464,823,600 |
| 第32回利付国債(30年) | 435,000,000 | 541,635,900 |
| 第33回利付国債(30年) | 375,000,000 | 442,796,250 |
| 第34回利付国債(30年) | 405,000,000 | 495,950,850 |
| 第35回利付国債(30年) | 420,000,000 | 495,835,200 |
| 第36回利付国債(30年) | 340,000,000 | 401,084,400 |
| 第37回利付国債(30年) | 335,000,000 | 387,578,250 |
| 第38回利付国債(30年) | 180,000,000 | 203,844,600 |
| 第39回利付国債(30年) | 205,000,000 | 236,867,250 |
| 第40回利付国債(30年) | 290,000,000 | 327,923,300 |
| 第41回利付国債(30年) | 200,000,000 | 221,418,000 |
| 第42回利付国債(30年) | 290,000,000 | 320,922,700 |
| 第43回利付国債(30年) | 270,000,000 | 298,663,200 |
| 第44回利付国債(30年) | 295,000,000 | 326,175,600 |
| 第45回利付国債(30年) | 305,000,000 | 321,909,200 |
| 第46回利付国債(30年) | 360,000,000 | 379,677,600 |
| 第47回利付国債(30年) | 370,000,000 | 399,193,000 |
| 第48回利付国債(30年) | 335,000,000 | 344,400,100 |
| 第35回利付国債(20年) | 65,000,000 | 67,699,450 |
| 第37回利付国債(20年) | 80,000,000 | 84,386,400 |
| 第39回利付国債(20年) | 223,000,000 | 236,152,540 |
| 第40回利付国債(20年) | 492,000,000 | 523,350,240 |
| 第42回利付国債(20年) | 400,000,000 | 433,916,000 |
| 第43回利付国債(20年) | 710,000,000 | 787,113,100 |
| 第46回利付国債(20年) | 289,000,000 | 317,171,720 |
| 第48回利付国債(20年) | 368,000,000 | 413,352,320 |
| 第50回利付国債(20年) | 223,000,000 | 244,907,520 |
| 第52回利付国債(20年) | 210,000,000 | 234,874,500 |
| 第54回利付国債(20年) | 275,000,000 | 310,706,000 |
| 第56回利付国債(20年) | 320,000,000 | 360,736,000 |
| 第58回利付国債(20年) | 300,000,000 | 337,422,000 |
| 第59回利付国債(20年) | 280,000,000 | 311,984,400 |
| 第61回利付国債(20年) | 140,000,000 | 149,380,000 |
| 第63回利付国債(20年) | 156,000,000 | 175,985,160 |
| 第64回利付国債(20年) | 210,000,000 | 239,051,400 |
| 第65回利付国債(20年) | 370,000,000 | 422,318,000 |
| 第69回利付国債(20年) | 200,000,000 | 232,124,000 |
| 第70回利付国債(20年) | 380,000,000 | 451,892,200 |
| 第72回利付国債(20年) | 300,000,000 | 350,193,000 |
| 第74回利付国債(20年) | 388,000,000 | 454,336,360 |
| 第75回利付国債(20年) | 230,000,000 | 269,893,500 |
| 第78回利付国債(20年) | 340,000,000 | 393,478,600 |

| | | | |
|----------------|-------------|-------------|--|
| 第82回利付国債(20年) | 288,000,000 | 339,494,400 | |
| 第84回利付国債(20年) | 424,000,000 | 496,834,720 | |
| 第85回利付国債(20年) | 332,000,000 | 393,131,160 | |
| 第88回利付国債(20年) | 329,000,000 | 397,149,060 | |
| 第90回利付国債(20年) | 438,000,000 | 525,446,700 | |
| 第92回利付国債(20年) | 280,000,000 | 333,642,400 | |
| 第93回利付国債(20年) | 337,000,000 | 398,647,410 | |
| 第95回利付国債(20年) | 226,000,000 | 275,451,060 | |
| 第97回利付国債(20年) | 380,000,000 | 459,564,400 | |
| 第99回利付国債(20年) | 364,000,000 | 436,570,680 | |
| 第100回利付国債(20年) | 278,000,000 | 337,180,640 | |
| 第102回利付国債(20年) | 335,000,000 | 415,212,400 | |
| 第105回利付国債(20年) | 432,000,000 | 520,110,720 | |
| 第107回利付国債(20年) | 393,000,000 | 474,060,180 | |
| 第109回利付国債(20年) | 490,000,000 | 579,145,700 | |
| 第111回利付国債(20年) | 293,000,000 | 357,996,190 | |
| 第113回利付国債(20年) | 465,000,000 | 562,496,550 | |
| 第114回利付国債(20年) | 388,000,000 | 469,809,800 | |
| 第116回利付国債(20年) | 440,000,000 | 538,722,800 | |
| 第118回利付国債(20年) | 320,000,000 | 383,312,000 | |
| 第119回利付国債(20年) | 335,000,000 | 391,996,900 | |
| 第121回利付国債(20年) | 275,000,000 | 325,633,000 | |
| 第122回利付国債(20年) | 280,000,000 | 327,513,200 | |
| 第123回利付国債(20年) | 195,000,000 | 236,538,900 | |
| 第124回利付国債(20年) | 230,000,000 | 275,622,800 | |
| 第125回利付国債(20年) | 135,000,000 | 165,856,950 | |
| 第126回利付国債(20年) | 210,000,000 | 251,756,400 | |
| 第127回利付国債(20年) | 215,000,000 | 254,740,600 | |
| 第128回利付国債(20年) | 370,000,000 | 438,183,600 | |
| 第129回利付国債(20年) | 10,000,000 | 11,692,700 | |
| 第130回利付国債(20年) | 270,000,000 | 315,700,200 | |
| 第131回利付国債(20年) | 245,000,000 | 282,752,050 | |
| 第132回利付国債(20年) | 275,000,000 | 317,064,000 | |
| 第133回利付国債(20年) | 405,000,000 | 473,161,500 | |
| 第134回利付国債(20年) | 235,000,000 | 274,296,700 | |
| 第135回利付国債(20年) | 90,000,000 | 103,653,900 | |
| 第136回利付国債(20年) | 135,000,000 | 153,501,750 | |
| 第137回利付国債(20年) | 200,000,000 | 230,252,000 | |
| 第138回利付国債(20年) | 130,000,000 | 145,592,200 | |
| 第139回利付国債(20年) | 180,000,000 | 204,406,200 | |
| 第140回利付国債(20年) | 635,000,000 | 730,719,900 | |
| 第141回利付国債(20年) | 135,000,000 | 155,148,750 | |

| | | | |
|--------|------------------------|----------------|----------------|
| | 第142回利付国債(20年) | 320,000,000 | 372,892,800 |
| | 第143回利付国債(20年) | 285,000,000 | 322,474,650 |
| | 第144回利付国債(20年) | 45,000,000 | 50,190,750 |
| | 第145回利付国債(20年) | 530,000,000 | 607,390,600 |
| | 第146回利付国債(20年) | 380,000,000 | 434,830,200 |
| | 第147回利付国債(20年) | 680,000,000 | 765,571,200 |
| | 第148回利付国債(20年) | 460,000,000 | 509,229,200 |
| | 第149回利付国債(20年) | 475,000,000 | 524,756,250 |
| | 第150回利付国債(20年) | 430,000,000 | 466,726,300 |
| | 第151回利付国債(20年) | 635,000,000 | 665,359,350 |
| | 第152回利付国債(20年) | 605,000,000 | 632,170,550 |
| | 第153回利付国債(20年) | 665,000,000 | 705,019,700 |
| | 第154回利付国債(20年) | 360,000,000 | 374,338,800 |
| 国債証券合計 | | 80,872,000,000 | 88,456,047,680 |
| 地方債証券 | 第1回東京都公募公債(20年) | 200,000,000 | 220,126,000 |
| | 第7回東京都公募公債(20年) | 100,000,000 | 117,056,000 |
| | 第8回東京都公募公債(30年) | 100,000,000 | 118,039,000 |
| | 第13回東京都公募公債(30年) | 200,000,000 | 222,614,000 |
| | 第656回東京都公募公債 | 300,000,000 | 309,786,000 |
| | 第660回東京都公募公債 | 200,000,000 | 207,604,000 |
| | 第668回東京都公募公債 | 200,000,000 | 209,580,000 |
| | 第681回東京都公募公債 | 200,000,000 | 211,178,000 |
| | 平成19年度第9回北海道公募公債 | 200,000,000 | 206,102,000 |
| | 平成20年度第7回北海道公募公債 | 200,000,000 | 208,812,000 |
| | 第7回神奈川県公募公債(20年) | 200,000,000 | 238,420,000 |
| | 第56回神奈川県公募公債(5年) | 100,000,000 | 100,495,000 |
| | 第59回神奈川県公募公債(5年) | 100,000,000 | 100,493,000 |
| | 第147回神奈川県公募公債 | 100,000,000 | 102,863,000 |
| | 第192回神奈川県公募公債 | 100,000,000 | 104,379,000 |
| | 第77回大阪府公募公債(5年) | 100,000,000 | 100,244,000 |
| | 第297回大阪府公募公債(10年) | 100,000,000 | 101,704,000 |
| | 第311回大阪府公募公債(10年) | 250,000,000 | 258,450,000 |
| | 第361回大阪府公募公債(10年) | 100,000,000 | 104,639,000 |
| | 第5回兵庫県公募公債(15年) | 100,000,000 | 108,616,000 |
| | 第9回兵庫県公募公債(20年) | 100,000,000 | 120,202,000 |
| | 平成19年度第18回兵庫県公募公債 | 100,000,000 | 103,280,000 |
| | 第7回静岡県公募公債(30年) | 100,000,000 | 112,265,000 |
| | 平成19年度第7回静岡県公募公債 | 100,000,000 | 103,366,000 |
| | 平成20年度第1回静岡県公募公債 | 100,000,000 | 116,969,000 |
| | 平成21年度第7回愛知県公募公債(10年) | 200,000,000 | 210,802,000 |
| | 平成26年度第14回愛知県公募公債(10年) | 100,000,000 | 101,738,000 |

| | | | | |
|---------|---------------------------|---------------|---------------|--|
| | 平成26年度第18回愛知県公募公債(10年) | 100,000,000 | 100,675,000 | |
| | 平成26年度第1回広島県公募公債 | 100,000,000 | 103,044,000 | |
| | 平成21年度第2回埼玉県公募公債 | 146,000,000 | 153,498,560 | |
| | 平成26年度第4回埼玉県公募公債 | 100,000,000 | 102,898,000 | |
| | 平成26年度第5回福岡県公募公債 | 100,000,000 | 101,680,000 | |
| | 平成26年度第3回千葉県公募公債 | 100,000,000 | 102,521,000 | |
| | 第66回共同発行市場公募地方債 | 100,000,000 | 104,066,000 | |
| | 第75回共同発行市場公募地方債 | 300,000,000 | 316,419,000 | |
| | 第115回共同発行市場公募地方債 | 300,000,000 | 313,113,000 | |
| | 第137回共同発行市場公募地方債 | 100,000,000 | 102,121,000 | |
| | 第140回共同発行市場公募地方債 | 100,000,000 | 101,476,000 | |
| | 平成17年度第10回大阪市公募公債 | 92,500,000 | 92,630,425 | |
| | 平成18年度第6回大阪市公募公債 | 200,000,000 | 203,236,000 | |
| | 平成19年度第7回大阪市公募公債 | 100,000,000 | 102,989,000 | |
| | 平成21年度第4回大阪市公募公債 | 200,000,000 | 211,028,000 | |
| | 第464回名古屋市公募公債(10年) | 100,000,000 | 104,239,000 | |
| | 平成19年度第2回京都市公募公債 | 100,000,000 | 103,337,000 | |
| | 平成21年度第1回京都市公募公債 | 100,000,000 | 105,380,000 | |
| | 第16回横浜市公募公債(20年) | 100,000,000 | 121,753,000 | |
| | 平成20年度第3回横浜市公募公債 | 300,000,000 | 312,099,000 | |
| | 平成27年度第5回福岡市公募公債 | 100,000,000 | 100,649,000 | |
| 地方債証券合計 | | 6,888,500,000 | 7,278,673,985 | |
| 特殊債券 | 第2回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債 | 500,000,000 | 519,510,000 | |
| | 第15回政府保証日本政策投資銀行債券 | 100,000,000 | 111,251,000 | |
| | 第22回政府保証日本政策投資銀行債券 | 100,000,000 | 115,026,000 | |
| | 第39回日本政策投資銀行債券 | 100,000,000 | 102,875,000 | |
| | 第4回日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 100,000,000 | 124,646,000 | |
| | 第6回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 200,000,000 | 218,372,000 | |
| | 第10回日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 300,000,000 | 303,063,000 | |
| | 第14回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 290,000,000 | 292,682,500 | |
| | 第22回日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 200,000,000 | 249,802,000 | |
| | 第27回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 200,000,000 | 204,092,000 | |
| | 第27回道路債券 | 100,000,000 | 116,917,000 | |
| | 第30回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 300,000,000 | 306,147,000 | |
| | 第32回道路債券 | 100,000,000 | 117,792,000 | |
| | 第36回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 300,000,000 | 308,160,000 | |
| | 第37回日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 100,000,000 | 121,174,000 | |
| | 第38回日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 100,000,000 | 104,410,000 | |
| | 第42回道路債券 | 100,000,000 | 116,385,000 | |

| | | | |
|-----------------------------|-------------|-------------|--|
| 第5 2 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 100,000,000 | 103,307,000 | |
| 第5 8 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 300,000,000 | 311,787,000 | |
| 第7 9 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 100,000,000 | 119,713,000 | |
| 第9 1 回日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 100,000,000 | 100,026,000 | |
| 第9 2 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 100,000,000 | 119,900,000 | |
| 第9 9 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 100,000,000 | 121,345,000 | |
| 第3 回政府保証地方公共団体金融機構債券 | 700,000,000 | 735,952,000 | |
| 第4 回公営企業債券(20年) | 200,000,000 | 227,480,000 | |
| 第6 回政府保証地方公共団体金融機構債券(4年) | 200,000,000 | 200,372,000 | |
| 第7 回地方公営企業等金融機構債券(5年) | 100,000,000 | 100,262,000 | |
| 第8 回政府保証地方公営企業等金融機構債券 | 100,000,000 | 104,812,000 | |
| 第1 8 回公営企業債券(20年) | 100,000,000 | 121,303,000 | |
| 第2 2 回公営企業債券(20年) | 200,000,000 | 239,068,000 | |
| 第2 8 回公営企業債券 | 100,000,000 | 103,288,000 | |
| 第6 1 回地方公共団体金融機構債券 | 100,000,000 | 102,942,000 | |
| 第8 7 5 回政府保証公営企業債券 | 300,000,000 | 306,837,000 | |
| 第8 7 6 回政府保証公営企業債券 | 101,000,000 | 103,731,040 | |
| 第8 8 2 回政府保証公営企業債券 | 100,000,000 | 103,279,000 | |
| 第1 2 回中小企業債券 | 100,000,000 | 100,389,000 | |
| 第3 4 回株式会社日本政策金融公庫社債 | 100,000,000 | 100,447,000 | |
| 第2 9 回国際協力銀行債券 | 100,000,000 | 102,927,000 | |
| 第1 3 回関西国際空港株式会社社債 | 100,000,000 | 104,355,000 | |
| 第6 回独立行政法人福祉医療機構債券 | 100,000,000 | 115,600,000 | |
| 第1 9 9 回政府保証預金保険機構債 | 100,000,000 | 100,016,000 | |
| 第1 回貸付債権担保住宅金融公庫債券 | 13,737,000 | 14,175,072 | |
| 第1 回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券 | 20,188,000 | 21,148,948 | |
| 第1 回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券 | 24,126,000 | 25,973,810 | |
| 第2 回貸付債権担保住宅金融公庫債券 | 13,126,000 | 13,505,341 | |
| 第2 回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券 | 21,140,000 | 22,266,339 | |
| 第5 回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券 | 21,229,000 | 22,481,298 | |
| 第7 回貸付債権担保住宅金融公庫債券 | 14,565,000 | 15,066,618 | |
| 第9 回貸付債権担保住宅金融公庫債券 | 15,744,000 | 16,244,501 | |
| 第9 回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券 | 22,909,000 | 24,732,556 | |
| 第1 0 回貸付債権担保住宅金融公庫債券 | 16,845,000 | 17,393,304 | |
| 第1 0 回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券 | 23,719,000 | 25,597,307 | |
| 第1 2 回貸付債権担保住宅金融公庫債券 | 18,753,000 | 19,553,378 | |
| 第1 4 回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券 | 33,980,000 | 35,518,954 | |
| 第1 8 回貸付債権担保住宅金融公庫債券 | 20,348,000 | 21,433,362 | |

| | | | |
|-----|-------------------------------------|----------------|----------------|
| | 第29回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 49,004,000 | 52,616,084 |
| | 第30回貸付債権担保住宅金融公庫債券 | 26,616,000 | 28,059,119 |
| | 第32回貸付債権担保住宅金融公庫債券 | 31,126,000 | 32,910,453 |
| | 第32回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 49,639,000 | 52,898,793 |
| | 第35回貸付債権担保住宅金融公庫債券 | 31,633,000 | 33,608,797 |
| | 第37回貸付債権担保住宅金融公庫債券 | 30,147,000 | 32,150,268 |
| | 第37回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 60,257,000 | 63,852,535 |
| | 第40回貸付債権担保住宅金融公庫債券 | 31,077,000 | 33,289,371 |
| | 第42回貸付債権担保住宅金融公庫債券 | 28,704,000 | 31,231,387 |
| | 第48回貸付債権担保住宅金融公庫債券 | 27,712,000 | 30,140,402 |
| | 第49回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 68,505,000 | 73,018,794 |
| | 第51回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 73,028,000 | 77,420,634 |
| | 第55回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 80,230,000 | 84,337,776 |
| | 第57回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 79,561,000 | 83,772,163 |
| | 第59回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 80,199,000 | 84,447,943 |
| | 第67回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 85,536,000 | 88,154,256 |
| | 第69回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 86,494,000 | 90,240,055 |
| | 第70回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 84,666,000 | 88,169,479 |
| | 第73回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 87,231,000 | 91,156,395 |
| | 第88回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 94,109,000 | 95,843,428 |
| | 第130回一般担保住宅金融支援機構債券 | 100,000,000 | 112,404,000 |
| | 第2回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 30,439,000 | 32,837,897 |
| | 第3回貸付債権担保5種住宅金融支援機構債券 | 25,226,000 | 27,220,872 |
| | い第733号商工債 | 200,000,000 | 200,442,000 |
| | い第728号農林債 | 100,000,000 | 100,040,000 |
| | い第735号農林債 | 100,000,000 | 100,202,000 |
| | い第749号農林債 | 100,000,000 | 100,183,000 |
| | い第752号農林債 | 400,000,000 | 400,832,000 |
| | い第753号農林債 | 100,000,000 | 100,115,000 |
| | 第281回信金中金債(5年) | 100,000,000 | 100,193,000 |
| | 第171号商工債(3年) | 300,000,000 | 300,135,000 |
| | 第174号商工債(3年) | 400,000,000 | 399,872,000 |
| | 第184号商工債(3年) | 100,000,000 | 99,913,000 |
| | 第16回政府保証東日本高速道路債券 | 200,000,000 | 207,864,000 |
| | 第46回中日本高速道路株式会社債 | 100,000,000 | 100,387,000 |
| | 特殊債券合計 | 10,712,548,000 | 11,306,492,229 |
| 社債券 | 第23回ゼネラル・エレクトリック・キャピタル・コーポレーション | 100,000,000 | 100,238,000 |
| | 第11回ジェー・ピー・モルガン・チェース・アンド・カンパニー | 100,000,000 | 100,886,000 |
| | 第5回オーストラリア・COMMONWEALTH銀行円貨社債(2011) | 100,000,000 | 100,365,000 |
| | 第7回オーストラリア・COMMONWEALTH銀行円貨社債(2013) | 100,000,000 | 100,177,000 |

| | | | |
|---|-------------|-------------|--|
| 第8回ウエストパック・バンキング・コーポレーション円貨社債 | 100,000,000 | 100,566,000 | |
| 第21回コーペラティブ・セントラル・ライフアイゼン・ボエレンリーバンク・ピー・エー | 100,000,000 | 101,145,000 | |
| 第10回コーペラティブ・セントラル・ライフアイゼン・ボエレンリーバンク・ピー・エー | 200,000,000 | 200,610,000 | |
| 第18回コーペラティブ・セントラル・ライフアイゼン・ボエレンリーバンク・ピー・エー | 200,000,000 | 202,062,000 | |
| 第7回株式会社セブン&アイ・ホールディングス無担保社債 | 100,000,000 | 100,087,000 | |
| 第8回株式会社セブン&アイ・ホールディングス無担保社債 | 100,000,000 | 100,791,000 | |
| 第8回株式会社三菱ケミカルホールディングス無担保社債 | 100,000,000 | 102,788,000 | |
| 第14回武田薬品工業株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 101,315,000 | |
| 第6回株式会社ブリヂストン無担保社債 | 100,000,000 | 100,053,000 | |
| 第63回新日本製鐵株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 105,837,000 | |
| 第61回株式会社神戸製鋼所無担保社債 | 100,000,000 | 99,557,000 | |
| 第44回三菱電機株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 100,323,000 | |
| 第35回富士通株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 100,391,000 | |
| 第12回パナソニック株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 100,136,000 | |
| 第13回パナソニック株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 100,110,000 | |
| 第1回日本生命2011基金特定目的会社特定社債 第1回-B | 100,000,000 | 101,400,000 | |
| 第1回明治安田生命2013基金特定目的会社特定社債 | 100,000,000 | 101,368,000 | |
| 第1回明治安田生命2014基金特定目的会社特定社債 | 100,000,000 | 100,644,000 | |
| 第1回トヨタ自動車株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 106,235,000 | |
| 第3回株式会社みずほコーポレート銀行無担保社債 | 100,000,000 | 104,282,000 | |
| 第25回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債 | 100,000,000 | 104,729,000 | |
| 第57回株式会社東京三菱銀行無担保社債 | 100,000,000 | 113,390,000 | |
| 株式会社三井住友フィナンシャル第1回無担保社債 | 200,000,000 | 200,190,000 | |
| 第4回株式会社りそな銀行無担保社債 | 100,000,000 | 108,416,000 | |
| 第9回三菱UFJ信託銀行株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 106,900,000 | |
| 第6回株式会社セブン銀行無担保社債 | 100,000,000 | 100,421,000 | |
| 第1回株式会社みずほフィナンシャルグループ無担保社債 | 200,000,000 | 200,832,000 | |
| 第20回株式会社三井住友銀行無担保社債 | 100,000,000 | 106,908,000 | |
| 第8回株式会社みずほ銀行無担保社債 | 200,000,000 | 204,628,000 | |
| 第16回株式会社日産フィナンシャルサービス無担保社債 | 100,000,000 | 100,162,000 | |
| 第22回株式会社日産フィナンシャルサービス無担保社債 | 100,000,000 | 100,001,000 | |

| | | | |
|---------------------------|---------------|-----------------|--|
| 第27回トヨタファイナンス株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 102,138,000 | |
| 第113回オリックス株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 102,606,000 | |
| 第23回三菱UFJリース株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 100,873,000 | |
| 第10回野村ホールディングス株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 103,323,000 | |
| 第38回野村ホールディングス株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 100,081,000 | |
| 第65回三菱地所株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 115,000,000 | |
| 第7回東日本旅客鉄道株式会社社債 | 100,000,000 | 105,366,000 | |
| 第24回東日本旅客鉄道株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 109,805,000 | |
| 第32回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債 | 100,000,000 | 115,487,000 | |
| 第69回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債 | 100,000,000 | 104,744,000 | |
| 第10回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 113,189,000 | |
| 第7回東海旅客鉄道株式会社社債 | 100,000,000 | 112,478,000 | |
| 第13回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債 | 100,000,000 | 113,267,000 | |
| 第45回阪急阪神ホールディングス株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 101,422,000 | |
| 第53回日本電信電話株式会社電信電話債券 | 100,000,000 | 102,862,000 | |
| 第63回日本電信電話株式会社電信電話債券 | 100,000,000 | 102,877,000 | |
| 第19回KDDI株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 104,131,000 | |
| 第457回東京電力株式会社社債 | 100,000,000 | 104,003,000 | |
| 第528回東京電力株式会社社債 | 100,000,000 | 104,114,000 | |
| 第536回東京電力株式会社社債 | 100,000,000 | 102,121,000 | |
| 第547回東京電力株式会社社債 | 100,000,000 | 105,253,000 | |
| 第448回関西電力株式会社社債 | 100,000,000 | 104,573,000 | |
| 第491回関西電力株式会社社債 | 100,000,000 | 100,283,000 | |
| 第303回北陸電力株式会社社債 | 100,000,000 | 101,712,000 | |
| 第253回四国電力株式会社社債 | 100,000,000 | 103,658,000 | |
| 第343回九州電力株式会社社債 | 100,000,000 | 106,046,000 | |
| 第38回電源開発株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 102,850,000 | |
| 第19回大阪瓦斯株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 107,002,000 | |
| 社債券合計 | 6,800,000,000 | 7,029,207,000 | |
| 合計 | | 114,070,420,894 | |

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。

S M A M ・ 外国株式パッシブ・ファンド（適格機関投資家専用）

貸借対照表

（平成26年12月22日現在）

（平成27年12月21日現在）

| 資産の部 | | |
|-------------|----------------|----------------|
| 流動資産 | | |
| 親投資信託受益証券 | 33,680,212,761 | 22,256,550,178 |
| 流動資産合計 | 33,680,212,761 | 22,256,550,178 |
| 資産合計 | 33,680,212,761 | 22,256,550,178 |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 未払受託者報酬 | 1,152,639 | 787,237 |
| 未払委託者報酬 | 419,134 | 286,261 |
| その他未払費用 | 37,800 | 37,611 |
| 流動負債合計 | 1,609,573 | 1,111,109 |
| 負債合計 | 1,609,573 | 1,111,109 |
| 純資産の部 | | |
| 元本等 | | |
| 元本 | 15,395,405,944 | 10,397,539,925 |
| 剰余金 | | |
| 剰余金又は欠損金（ ） | 18,283,197,244 | 11,857,899,144 |
| 元本等合計 | 33,678,603,188 | 22,255,439,069 |
| 純資産合計 | 33,678,603,188 | 22,255,439,069 |
| 負債純資産合計 | 33,680,212,761 | 22,256,550,178 |

注記表

（重要な会計方針の注記）

| 項目 | 自 平成27年12月 1日 至 平成27年12月21日 |
|-----------------|---|
| 有価証券の評価基準及び評価方法 | <p>親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p> |

（貸借対照表に関する注記）

| 項目 | （平成26年12月22日現在） | （平成27年12月21日現在） |
|-----------------------|-----------------|-----------------|
| 1. 当計算期間の末日における受益権の総数 | 15,395,405,944口 | 10,397,539,925口 |

| | | | | |
|----------------|--------------------------------|----------------------|--------------------------------|----------------------|
| 2. 1単位当たり純資産の額 | 1口当たり純資産額 (10,000口当たりの純資産額) | 2.1876円 (21,876円) | 1口当たり純資産額 (10,000口当たりの純資産額) | 2.1405円 (21,405円) |
|----------------|--------------------------------|----------------------|--------------------------------|----------------------|

(金融商品に関する注記)

. 金融商品の状況に関する事項

| 項目 | 自 平成27年12月 1日 至 平成27年12月21日 |
|------------------------|---|
| 1. 金融商品に対する取組方針 | 当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。 |
| 2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク | <p>(1)金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、親投資信託受益証券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいておりません。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2)金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p> |

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

・金融商品の時価等に関する事項

| 項目 | (平成27年12月21日現在) |
|-------------------|--|
| 1.貸借対照表計上額、時価及び差額 | 金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 |
| 2.時価の算定方法 | <p>(1) 有価証券（親投資信託受益証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p> |

(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）

該当事項はありません。

（その他の注記）

| 項 目 | （平成26年12月22日現在） | （平成27年12月21日現在） |
|-----------|-----------------|-----------------|
| 期首元本額 | 15,758,169,272円 | 10,592,213,751円 |
| 期中追加設定元本額 | 5,589,086円 | 3,039,914円 |
| 期中一部解約元本額 | 368,352,414円 | 197,713,740円 |

附属明細表

有価証券明細表

(a) 株式

該当事項はありません。

(b) 株式以外の有価証券

（単位：円）

| 種類 | 銘 柄 | 券面総額 | 評価額 | 備考 |
|-----------|--------------------|---------------|----------------|----|
| 親投資信託受益証券 | 外国株式インデックス・マザーファンド | 8,071,571,110 | 22,256,550,178 | |
| 合計 | | 8,071,571,110 | 22,256,550,178 | |

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

（参考）

S M A M ・外国株式パッシブ・ファンド（適格機関投資家専用）は、「外国株式インデックス・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。

外国株式インデックス・マザーファンド

貸借対照表

| | （単位：円） | |
|-------------|-----------------|-----------------|
| | （平成26年12月22日現在） | （平成27年12月21日現在） |
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| 預金 | 271,604,763 | 1,809,998,393 |
| コール・ローン | 163,287,176 | 462,437,299 |
| 株式 | 189,898,544,938 | 154,792,503,533 |
| 投資証券 | 4,582,904,442 | 3,986,261,428 |
| 派生商品評価勘定 | 60,647,555 | 10,917,916 |
| 未収入金 | 4,702,806,928 | 1,017,952,151 |
| 未収配当金 | 246,589,672 | 207,308,009 |
| 未収利息 | 44 | 126 |
| 前払金 | - | 11,641,537 |
| 差入委託証拠金 | 1,132,693,767 | 1,278,986,677 |
| 流動資産合計 | 201,059,079,285 | 163,578,007,069 |
| 資産合計 | 201,059,079,285 | 163,578,007,069 |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 派生商品評価勘定 | 336,208 | 22,561,553 |
| 前受金 | 60,311,347 | - |
| 未払金 | 52,822,098 | 39,515,303 |
| 未払解約金 | 15,622,683 | 2,883,725 |
| 流動負債合計 | 129,092,336 | 64,960,581 |
| 負債合計 | 129,092,336 | 64,960,581 |
| 純資産の部 | | |
| 元本等 | | |
| 元本 | 71,355,249,023 | 59,300,511,881 |
| 剰余金 | | |
| 剰余金又は欠損金（ ） | 129,574,737,926 | 104,212,534,607 |
| 元本等合計 | 200,929,986,949 | 163,513,046,488 |
| 純資産合計 | 200,929,986,949 | 163,513,046,488 |
| 負債純資産合計 | 201,059,079,285 | 163,578,007,069 |

注記表

（重要な会計方針の注記）

| | |
|-----|--------------------------------|
| 項 目 | 自 平成27年12月 1日 至 平成27年12月21日 |
|-----|--------------------------------|

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

(貸借対照表に関する注記)

| 項目 | (平成26年12月22日現在) | (平成27年12月21日現在) |
|-----------------------|--|--|
| 1. 当計算期間の末日における受益権の総数 | 71,355,249,023口 | 59,300,511,881口 |
| 2. 1単位当たり純資産の額 | 1口当たり純資産額 2.8159円 (10,000口当たりの純資産額 28,159円) | 1口当たり純資産額 2.7574円 (10,000口当たりの純資産額 27,574円) |

(金融商品に関する注記)

. 金融商品の状況に関する事項

| 項目 | 自 平成27年12月 1日 至 平成27年12月21日 |
|-----------------|--|
| 1. 金融商品に対する取組方針 | <p>当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。</p> |

| | |
|-----------------------------------|--|
| <p>2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク</p> | <p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、株式、投資証券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。当計算期間については、先物取引、為替予約取引を行っております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p> |
| <p>3. 金融商品に係るリスク管理体制</p> | <p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する委員会をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用グループに是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用グループは、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。その後、当該関連運用グループの対処の実施や対処方針の決定等に関し、必要に応じてリスク管理を行う部署が当該部署の担当役員、当該関連運用グループの担当役員およびリスク管理委員会へ報告を行う体制となっております。</p> <p>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する部会にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。</p> |
| <p>4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明</p> | <p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない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認める評価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。</p> |

・ 金融商品の時価等に関する事項

| | |
|----|-----------------|
| 項目 | (平成27年12月21日現在) |
|----|-----------------|

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

(デリバティブ取引に関する注記)

(平成26年12月22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 | 6,218,636,318 | - | 6,278,947,665 | 60,311,347 |
| | SPMINI 1503 | 4,390,559,658 | - | 4,433,981,177 | 43,421,519 |
| | DJ EUR 1503 | 1,199,475,817 | - | 1,208,602,692 | 9,126,875 |
| | FTSE 1503 | 553,962,763 | - | 558,851,092 | 4,888,329 |
| | SPI200 1503 | 74,638,080 | - | 77,512,704 | 2,874,624 |
| 合計 | | 6,218,636,318 | - | 6,278,947,665 | 60,311,347 |

(平成27年12月21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 | 4,666,410,387 | - | 4,654,768,850 | 11,641,537 |
| | SPMINI 1603 | 3,223,272,507 | - | 3,200,903,624 | 22,368,883 |
| | DJ EUR 1603 | 904,778,111 | - | 909,009,211 | 4,231,100 |
| | FTSE 1603 | 378,618,518 | - | 380,101,487 | 1,482,969 |
| | SPI200 1603 | 159,741,251 | - | 164,754,528 | 5,013,277 |
| | 為替予約取引 | | | | |

| | | | | | |
|-----------|------------|---------------|---|---------------|------------|
| 市場取引以外の取引 | 買建 | 102,113,190 | - | 102,112,800 | 390 |
| | 米ドル | 47,296,470 | - | 47,295,300 | 1,170 |
| | カナダドル | 1,737,440 | - | 1,737,800 | 360 |
| | ユーロ | 10,544,640 | - | 10,544,000 | 640 |
| | 英ポンド | 5,423,250 | - | 5,425,200 | 1,950 |
| | スウェーデンクローナ | 1,559,800 | - | 1,559,800 | - |
| | ノルウェークローネ | 1,940,470 | - | 1,939,000 | 1,470 |
| | デンマーククローネ | 1,942,710 | - | 1,942,600 | 110 |
| | オーストラリアドル | 6,075,370 | - | 6,076,000 | 630 |
| | ニュージーランドドル | 815,440 | - | 815,500 | 60 |
| | 香港ドル | 6,099,600 | - | 6,099,600 | - |
| | イスラエルシケル | 18,678,000 | - | 18,678,000 | - |
| | 売建 | 2,574,090 | - | 2,575,800 | 1,710 |
| | シンガポールドル | 2,574,090 | - | 2,575,800 | 1,710 |
| | 合計 | 4,771,097,667 | - | 4,759,457,450 | 11,643,637 |

(注) 1. 時価の算定方法

(1) 株価指数先物取引の時価の算定方法について

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います。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います。

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) 為替予約取引の時価の算定方法について

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います。

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

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

- ・ 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います。

- ・ 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います。

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

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

| （平成26年12月22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 | 74,690,132,511円 |
| 同期中における追加設定元本額 | 370,426,890円 |
| 同期中における一部解約元本額 | 3,705,310,378円 |
| 平成26年12月22日現在における元本の内訳 | |
| 三井住友・DC外国株式インデックスファンドS | 7,251,639,912円 |
| 三井住友・DC年金バランス30（債券重点型） | 153,435,843円 |
| 三井住友・DC年金バランス50（標準型） | 682,324,481円 |
| 三井住友・DC年金バランス70（株式重点型） | 483,886,866円 |
| スミセイ・DCバランスファンド（機動的資産配分型） | 32,709,007円 |
| スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2020 | 2,372,866円 |
| スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2025 | 4,329,278円 |
| スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2030 | 5,505,839円 |
| スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2035 | 9,167,391円 |
| スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2040 | 5,044,868円 |
| スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2045 | 10,797,705円 |
| 外国株式指数ファンド | 322,926,534円 |
| 三井住友・DC全海外株式インデックスファンド | 40,593,324円 |
| SMAM・外国株式パッシブ・ファンド（適格機関投資家専用） | 11,960,727,569円 |
| バランスファンドVA（安定運用型）＜適格機関投資家限定＞ | 106,020,436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＞ | 10,784,829,076円 |
| SMAM・バランスファンドVA25＜適格機関投資家専用＞ | 5,073,999,698円 |
| SMAM・バランスファンドVA37.5＜適格機関投資家専用＞ | 2,974,729,253円 |
| SMAM・バランスファンドVA50＜適格機関投資家専用＞ | 12,532,500,423円 |
| SMAM・バランスファンドVL30＜適格機関投資家限定＞ | 37,383,387円 |
| SMAM・バランスファンドVL50＜適格機関投資家限定＞ | 191,596,027円 |
| 世界6資産バランスファンドVA＜適格機関投資家限定＞ | 26,226,513円 |
| SMAM・バランスファンドVA75＜適格機関投資家専用＞ | 1,651,214,097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＞ | 103,098,450円 |
| SMAM・インデックス・バランスVA25＜適格機関投資家専用＞ | 302,822,160円 |
| SMAM・インデックス・バランスVA50＜適格機関投資家専用＞ | 1,439,580,239円 |
| SMAM・バランスファンドVA40＜適格機関投資家専用＞ | 2,553,226,704円 |
| SMAM・バランスファンドVA35＜適格機関投資家専用＞ | 3,291,341,974円 |
| SMAM・バランスVA株40T＜適格機関投資家限定＞ | 319,525,250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） | 1,348,758,942円 |
| 三井住友・5資産バランスファンド・VAS（適格機関投資家専用） | 3,560,497,982円 |
| SMAM・グローバルバランス40VA＜適格機関投資家限定＞ | 255,199,579円 |
| SMAM・バランスファンドVA20＜適格機関投資家専用＞ | 167,211,143円 |

| | |
|---|-----------------|
| 三井住友・7資産バランスファンド・V A S（適格機関投資家専用） | 2,904,519,120円 |
| S M A M・アセットバランスファンドV A 2 0 A <適格機関投資家専用> | 42,445,096円 |
| S M A M・アセットバランスファンドV A 3 5 A <適格機関投資家専用> | 25,845,812円 |
| S M A M・アセットバランスファンドV A 5 0 A <適格機関投資家専用> | 11,292,400円 |
| S M A M・アセットバランスファンドV A 2 0 L <適格機関投資家専用> | 100,030,538円 |
| S M A M・アセットバランスファンドV A 2 5 L <適格機関投資家専用> | 220,229,425円 |
| S M A M・アセットバランスファンドV A 2 0 T <適格機関投資家専用> | 213,343,777円 |
| S M A M・F G新興国重視型バランス2 0 V A <適格機関投資家限定> | 443,716円 |
| S M A M・F Gグローバルバランス2 5 V A <適格機関投資家限定> | 4,519,145円 |
| S M A M・グローバル・マルチアセット・グロース・ファンド（安定成長型）<適格機関投資家限定> | 372,779円 |
| S M A M・外国株式インデックスファンドS A <適格機関投資家限定> | 146,984,399円 |
| 合計 | 71,355,249,023円 |

（平成27年12月21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 | 59,908,468,477円 |
| 同期中における追加設定元本額 | 657,137,540円 |
| 同期中における一部解約元本額 | 1,265,094,136円 |
| 平成27年12月21日現在における元本の内訳 | |
| 三井住友・D C外国株式インデックスファンドS | 8,291,004,509円 |
| 三井住友・D C年金バランス3 0（債券重点型） | 177,005,074円 |
| 三井住友・D C年金バランス5 0（標準型） | 795,185,983円 |
| 三井住友・D C年金バランス7 0（株式重点型） | 545,116,725円 |
| S M A M・グローバルバランスファンド（機動的資産配分型） | 28,165,467円 |
| スミセイ・D Cターゲットイヤーファンド2 0 2 0 | 2,642,623円 |
| スミセイ・D Cターゲットイヤーファンド2 0 2 5 | 6,224,551円 |
| スミセイ・D Cターゲットイヤーファンド2 0 3 0 | 26,153,071円 |
| スミセイ・D Cターゲットイヤーファンド2 0 3 5 | 22,791,101円 |
| スミセイ・D Cターゲットイヤーファンド2 0 4 0 | 13,925,777円 |
| スミセイ・D Cターゲットイヤーファンド2 0 4 5 | 32,008,852円 |
| 外国株式指数ファンド | 412,620,099円 |
| 三井住友・D C全海外株式インデックスファンド | 256,397,781円 |
| アセットアロケーション・ファンド（安定型） | 163,597,186円 |
| アセットアロケーション・ファンド（安定成長型） | 294,908,063円 |
| アセットアロケーション・ファンド（成長型） | 333,186,300円 |
| S M A M・外国株式パッシブ・ファンド（適格機関投資家専用） | 8,071,571,110円 |
| バランスファンドV A（安定運用型）<適格機関投資家限定> | 54,850,681円 |
| S M A M・バランスファンドV A安定成長型<適格機関投資家限定> | 5,584,328,588円 |
| S M A M・バランスファンドV A 2 5 <適格機関投資家専用> | 3,745,543,054円 |
| S M A M・バランスファンドV A 3 7 . 5 <適格機関投資家専用> | 2,591,287,198円 |
| S M A M・バランスファンドV A 5 0 <適格機関投資家専用> | 11,083,262,397円 |
| S M A M・バランスファンドV L 3 0 <適格機関投資家限定> | 30,612,843円 |
| S M A M・バランスファンドV L 5 0 <適格機関投資家限定> | 172,983,987円 |

| | |
|--|-----------------|
| 世界6資産バランスファンドVA<適格機関投資家限定> | 13,171,923円 |
| SMAM・バランスファンドVA75<適格機関投資家専用> | 1,391,751,327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> | 94,052,892円 |
| SMAM・インデックス・バランスVA25<適格機関投資家専用> | 279,764,936円 |
| SMAM・インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用> | 1,340,219,139円 |
| SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用> | 2,162,096,036円 |
| SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用> | 2,921,300,474円 |
| SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定> | 98,842,924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) | 1,214,147,161円 |
| 三井住友・5資産バランスファンド・VAS(適格機関投資家専用) | 2,758,301,609円 |
| SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定> | 240,740,755円 |
| SMAM・バランスファンドVA20<適格機関投資家専用> | 137,532,066円 |
| 三井住友・7資産バランスファンド・VAS(適格機関投資家専用) | 2,417,611,204円 |
| SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用> | 38,232,319円 |
| SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用> | 23,003,090円 |
| SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用> | 11,369,463円 |
| SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用> | 86,662,919円 |
| SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用> | 199,455,929円 |
| SMAM・アセットバランスファンドVA20T<適格機関投資家専用> | 189,133,634円 |
| SMAM・FG新興国重視型バランス20VA<適格機関投資家限定> | 243,873円 |
| SMAM・FGグローバルバランス25VA<適格機関投資家限定> | 3,860,854円 |
| SMAM・グローバル・マルチアセット・グロース・ファンド(安定成長型)<適格機関投資家限定> | 129,237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> | 943,377,353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> | 137,744円 |
| 合計 | 59,300,511,881円 |

附属明細表

有価証券明細表

(a)株式

| 通貨 | 銘柄 | 株数 | 評価額 | | 備考 |
|-----|-------------------------------|--------|-------|--------------|----|
| | | | 単価 | 金額 | |
| 米ドル | ANADARKO PETROLEUM CORP | 23,121 | 45.67 | 1,055,936.07 | |
| | ANTERO RESOURCES CORP | 2,800 | 20.82 | 58,296.00 | |
| | APACHE CORPORATION | 17,646 | 42.69 | 753,307.74 | |
| | BAKER HUGHES INC | 19,189 | 43.92 | 842,780.88 | |
| | CABOT OIL & GAS CORPORATION | 19,520 | 15.49 | 302,364.80 | |
| | CAMERON INTERNATIONAL CORP | 8,293 | 61.32 | 508,526.76 | |
| | CHENIERE ENERGY INC | 9,802 | 36.04 | 353,264.08 | |
| | CHESAPEAKE ENERGY CORPORATION | 29,438 | 4.05 | 119,223.90 | |
| | CHEVRON CORPORATION | 84,934 | 89.81 | 7,627,922.54 | |
| | CIMAREX ENERGY CO | 4,508 | 90.82 | 409,416.56 | |
| | CONCHO RESOURCES INC | 5,959 | 91.97 | 548,049.23 | |

| | | | |
|--------------------------------|---------|--------|---------------|
| CONOCOPHILLIPS | 55,899 | 45.93 | 2,567,441.07 |
| CONTINENTAL RESOURCES, INC. | 4,214 | 22.71 | 95,699.94 |
| CORE LABORATORIES N.V. | 2,101 | 108.48 | 227,916.48 |
| DEVON ENERGY CORPORATION | 17,191 | 28.67 | 492,865.97 |
| ENERGEN CORPORATION | 3,391 | 44.00 | 149,204.00 |
| ENSCO PLC-CL A | 9,055 | 14.31 | 129,577.05 |
| EOG RESOURCES INC | 25,111 | 71.43 | 1,793,678.73 |
| EQT CORPORATION | 7,021 | 48.92 | 343,467.32 |
| EXXON MOBIL CORPORATION | 188,621 | 77.28 | 14,576,630.88 |
| FMC TECHNOLOGIES INC | 10,651 | 28.35 | 301,955.85 |
| HALLIBURTON CO | 38,703 | 33.44 | 1,294,228.32 |
| HELMERICH & PAYNE INC | 5,427 | 49.88 | 270,698.76 |
| HESS CORPORATION | 11,965 | 48.50 | 580,302.50 |
| HOLLYFRONTIER CORP | 8,311 | 42.03 | 349,311.33 |
| KINDER MORGAN INC | 84,058 | 15.14 | 1,272,638.12 |
| MARATHON OIL CORP | 30,675 | 12.47 | 382,517.25 |
| MARATHON PETROLEUM CORPORATION | 24,298 | 50.35 | 1,223,404.30 |
| MURPHY OIL CORPORATION | 7,419 | 21.71 | 161,066.49 |
| NATIONAL-OILWELL VARCO INC. | 17,446 | 33.27 | 580,428.42 |
| NOBLE ENERGY INC | 18,748 | 30.96 | 580,438.08 |
| OCCIDENTAL PETROLEUM CORP | 34,553 | 65.96 | 2,279,115.88 |
| OCEANEERING INTL INC | 4,001 | 37.11 | 148,477.11 |
| ONEOK INC | 9,311 | 18.93 | 176,257.23 |
| PHILLIPS 66 | 24,357 | 80.56 | 1,962,199.92 |
| PIONEER NATURAL RESOURCES CO | 6,805 | 121.28 | 825,310.40 |
| PLAINS GP HOLDINGS LP-CL A | 11,469 | 7.50 | 86,017.50 |
| RANGE RESOURCES CORPORATION | 8,475 | 21.33 | 180,771.75 |
| SCHLUMBERGER LTD | 57,401 | 67.34 | 3,865,383.34 |
| SOUTHWESTERN ENERGY COMPANY | 17,747 | 5.54 | 98,318.38 |
| SPECTRA ENERGY CORPORATION | 31,453 | 21.97 | 691,022.41 |
| TESORO CORPORATION | 5,612 | 104.32 | 585,443.84 |
| VALERO ENERGY CORP | 22,528 | 70.03 | 1,577,635.84 |
| WEATHERFORD INTL PLC | 33,009 | 7.88 | 260,110.92 |
| WHITING PETROLEUM CORP | 10,112 | 9.09 | 91,918.08 |
| WILLIAMS COS INC | 32,245 | 21.54 | 694,557.30 |
| AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC | 9,205 | 127.85 | 1,176,859.25 |
| AIRGAS INC | 2,907 | 137.14 | 398,665.98 |
| ALBEMARLE CORPORATION | 5,355 | 51.18 | 274,068.90 |
| ALCOA INC | 59,096 | 9.23 | 545,456.08 |
| ASHLAND INC | 2,663 | 101.10 | 269,229.30 |
| AVERY DENNISON CORP | 4,362 | 62.06 | 270,705.72 |
| AXALTA COATING SYSTEMS LTD | 5,633 | 25.81 | 145,387.73 |

| | | | |
|----------------------------------|--------|--------|--------------|
| BALL CORPORATION | 6,010 | 69.81 | 419,558.10 |
| CELANESE CORPORATION | 6,817 | 65.17 | 444,263.89 |
| CF INDUSTRIES HOLDINGS INC | 10,460 | 41.61 | 435,240.60 |
| CROWN HOLDINGS INC | 6,079 | 48.48 | 294,709.92 |
| DOW CHEMICAL | 51,007 | 49.63 | 2,531,477.41 |
| DU PONT (E.I.) DE NEMOURS | 40,865 | 63.40 | 2,590,841.00 |
| EASTMAN CHEMICAL COMPANY | 7,159 | 66.56 | 476,503.04 |
| ECOLAB INC | 12,053 | 112.62 | 1,357,408.86 |
| FMC CORPORATION | 6,226 | 37.93 | 236,152.18 |
| FREEMONT-MCMORAN INC | 47,325 | 6.21 | 293,888.25 |
| INTERNATIONAL PAPER CO | 18,567 | 36.80 | 683,265.60 |
| INTL FLAVORS & FRAGRANCES | 3,472 | 115.88 | 402,335.36 |
| LYONDELLBASELL INDU-CL A | 18,161 | 87.53 | 1,589,632.33 |
| MARTIN MARIETTA MATERIALS | 2,450 | 139.91 | 342,779.50 |
| MONSANTO CO | 21,175 | 94.84 | 2,008,237.00 |
| MOSAIC CO/THE | 13,768 | 28.54 | 392,938.72 |
| NEWMONT MINING CORP | 22,508 | 17.71 | 398,616.68 |
| NUCOR CORP | 15,086 | 38.87 | 586,392.82 |
| PACKAGING CORP OF AMERICA | 4,571 | 59.86 | 273,620.06 |
| PPG INDUSTRIES INC | 12,275 | 96.29 | 1,181,959.75 |
| PRAXAIR INC | 13,188 | 101.52 | 1,338,845.76 |
| SEALED AIR CORP | 9,368 | 42.69 | 399,919.92 |
| SHERWIN-WILLIAMS CO/THE | 3,569 | 256.23 | 914,484.87 |
| VULCAN MATERIALS CO | 6,171 | 93.84 | 579,086.64 |
| WESTLAKE CHEMICAL CORP | 2,235 | 53.34 | 119,214.90 |
| WESTROCK CO | 12,328 | 44.09 | 543,541.52 |
| 3M COMPANY | 28,430 | 146.92 | 4,176,935.60 |
| ACUITY BRANDS INC | 1,995 | 232.73 | 464,296.35 |
| AERCAP HOLDINGS NV | 4,590 | 40.14 | 184,242.60 |
| AGCO CORP | 3,447 | 43.97 | 151,564.59 |
| AMETEK INC | 10,546 | 52.95 | 558,410.70 |
| BE AEROSPACE INC | 4,300 | 41.22 | 177,246.00 |
| BOEING CO | 29,317 | 139.58 | 4,092,066.86 |
| CATERPILLAR INC | 26,190 | 65.11 | 1,705,230.90 |
| CHICAGO BRIDGE & IRON COMPANY NV | 4,593 | 38.44 | 176,554.92 |
| CUMMINS INC | 7,713 | 85.21 | 657,224.73 |
| DANAHER CORP | 27,635 | 91.23 | 2,521,141.05 |
| DEERE & CO | 14,339 | 74.97 | 1,074,994.83 |
| DOVER CORP | 6,788 | 58.50 | 397,098.00 |
| EATON CORP PLC | 20,739 | 49.74 | 1,031,557.86 |
| EMERSON ELECTRIC CO | 29,543 | 44.59 | 1,317,322.37 |
| FASTENAL COMPANY | 12,202 | 39.09 | 476,976.18 |

| | | | |
|------------------------------|---------|--------|---------------|
| FLOWSERVE CORPORATION | 6,212 | 40.66 | 252,579.92 |
| FLUOR CORP | 6,997 | 45.74 | 320,042.78 |
| GENERAL DYNAMICS CORP | 12,516 | 136.71 | 1,711,062.36 |
| GENERAL ELECTRIC CO | 427,925 | 30.28 | 12,957,569.00 |
| HONEYWELL INTERNATIONAL INC | 33,605 | 101.83 | 3,421,997.15 |
| ILLINOIS TOOL WORKS | 14,797 | 90.92 | 1,345,343.24 |
| INGERSOLL-RAND PLC | 11,563 | 52.62 | 608,445.06 |
| JACOBS ENGINEERING GROUP INC | 5,610 | 40.78 | 228,775.80 |
| L-3 COMMUNICATIONS HLDGS INC | 3,735 | 116.56 | 435,351.60 |
| LOCKHEED MARTIN CORPORATION | 12,607 | 212.18 | 2,674,953.26 |
| MASCO CORP | 15,275 | 27.88 | 425,867.00 |
| NORTHROP GRUMMAN CORP | 8,195 | 184.86 | 1,514,927.70 |
| PACCAR INC | 15,905 | 45.16 | 718,269.80 |
| PARKER HANNIFIN CORPORATION | 6,155 | 93.62 | 576,231.10 |
| PENTAIR PLC-REGISTERED | 8,019 | 48.21 | 386,595.99 |
| PRECISION CASTPARTS CORP | 6,154 | 230.76 | 1,420,097.04 |
| QUANTA SERVICES INC | 8,580 | 19.86 | 170,398.80 |
| RAYTHEON COMPANY | 13,665 | 125.35 | 1,712,907.75 |
| ROCKWELL AUTOMATION INC | 5,939 | 99.62 | 591,643.18 |
| ROCKWELL COLLINS INC. | 5,671 | 88.18 | 500,068.78 |
| ROPER TECHNOLOGIES INC | 4,391 | 183.32 | 804,958.12 |
| SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING | 7,113 | 43.14 | 306,854.82 |
| SNAP-ON INC | 2,746 | 166.69 | 457,730.74 |
| STANLEY BLACK & DECKER INC | 6,822 | 104.56 | 713,308.32 |
| TEXTRON INC | 13,079 | 41.01 | 536,369.79 |
| TRANSDIGM GROUP INC | 2,545 | 219.90 | 559,645.50 |
| UNITED RENTALS INC | 4,660 | 67.18 | 313,058.80 |
| UNITED TECHNOLOGIES CORP | 38,324 | 92.34 | 3,538,838.16 |
| WABTEC CORP | 4,643 | 68.89 | 319,856.27 |
| WW GRAINGER INC | 2,806 | 193.93 | 544,167.58 |
| XYLEM INC | 8,801 | 35.84 | 315,427.84 |
| CINTAS CORP | 3,999 | 88.50 | 353,911.50 |
| DUN & BRADSTREET CORP | 1,471 | 100.97 | 148,526.87 |
| EQUIFAX INC | 5,415 | 109.63 | 593,646.45 |
| IHS INC-CLASS A | 3,017 | 115.70 | 349,066.90 |
| MANPOWERGROUP | 3,518 | 82.55 | 290,410.90 |
| NIELSEN HOLDINGS PLC | 15,701 | 45.64 | 716,593.64 |
| REPUBLIC SERVICES INC | 10,643 | 43.58 | 463,821.94 |
| ROBERT HALF INTL INC | 6,506 | 44.95 | 292,444.70 |
| STERICYCLE, INC. | 3,750 | 116.75 | 437,812.50 |
| THE ADT CORPORATION | 8,262 | 32.63 | 269,589.06 |
| TOWERS WATSON & CO-CL A | 3,130 | 131.95 | 413,003.50 |

| | | | |
|----------------------------------|---------|--------|--------------|
| TYCO INTERNATIONAL PLC | 19,845 | 30.84 | 612,019.80 |
| VERISK ANALYTICS INC | 7,324 | 75.10 | 550,032.40 |
| WASTE MANAGEMENT INC | 20,242 | 52.73 | 1,067,360.66 |
| AMERCO | 290 | 387.45 | 112,360.50 |
| AMERICAN AIRLINES GROUP INC | 7,431 | 41.09 | 305,339.79 |
| C.H.ROBINSON WORLDWIDE, INC. | 6,364 | 62.36 | 396,859.04 |
| CSX CORPORATION | 45,626 | 25.20 | 1,149,775.20 |
| DELTA AIR LINES INC | 8,821 | 49.96 | 440,697.16 |
| EXPEDITORS INTL WASH INC | 8,057 | 45.21 | 364,256.97 |
| FEDEX CORP | 12,319 | 147.15 | 1,812,740.85 |
| HERTZ GLOBAL HOLDINGS INC | 18,331 | 14.29 | 261,949.99 |
| J.B. HUNT TRANSPORT SERVICES INC | 4,585 | 70.62 | 323,792.70 |
| KANSAS CITY SOUTHERN | 5,231 | 70.01 | 366,222.31 |
| NORFOLK SOUTHERN CORP | 13,773 | 84.27 | 1,160,650.71 |
| SOUTHWEST AIRLINES | 7,984 | 42.74 | 341,236.16 |
| UNION PACIFIC CORP | 39,331 | 75.43 | 2,966,737.33 |
| UNITED CONTINENTAL HOLDINGS INC | 3,971 | 56.92 | 226,029.32 |
| UNITED PARCEL SERVICE-CL B | 31,651 | 98.00 | 3,101,798.00 |
| AUTOLIV INC | 3,884 | 123.23 | 478,625.32 |
| BORGWARNER INC | 10,148 | 40.82 | 414,241.36 |
| DELPHI AUTOMOTIVE PLC | 13,056 | 83.51 | 1,090,306.56 |
| FORD MOTOR COMPANY | 166,499 | 13.80 | 2,297,686.20 |
| GENERAL MOTORS CO | 64,362 | 33.67 | 2,167,068.54 |
| GOODYEAR TIRE & RUBBER CO | 12,804 | 31.87 | 408,063.48 |
| HARLEY-DAVIDSON INC | 10,085 | 45.12 | 455,035.20 |
| JOHNSON CONTROLS INC | 30,264 | 38.75 | 1,172,730.00 |
| LEAR CORP | 3,675 | 122.59 | 450,518.25 |
| MOBILEYE NV | 3,705 | 40.62 | 150,497.10 |
| TESLA MOTORS INC | 4,319 | 230.46 | 995,356.74 |
| WABCO HOLDINGS INC | 2,607 | 96.61 | 251,862.27 |
| COACH INC | 11,843 | 31.99 | 378,857.57 |
| D.R.HORTON INC | 14,816 | 30.75 | 455,592.00 |
| FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY | 7,453 | 53.76 | 400,673.28 |
| GARMIN LTD | 5,408 | 35.26 | 190,686.08 |
| HANESBRANDS INC | 17,301 | 28.99 | 501,555.99 |
| HARMAN INTERNATIONAL | 3,248 | 88.84 | 288,552.32 |
| HASBRO INC | 5,206 | 65.83 | 342,710.98 |
| JARDEN CORP | 9,525 | 57.42 | 546,925.50 |
| LEGGETT & PLATT INC | 5,956 | 42.14 | 250,985.84 |
| LENNAR CORP-CL A | 7,512 | 47.49 | 356,744.88 |
| LULULEMON ATHLETICA INC | 5,461 | 50.26 | 274,469.86 |
| MATTEL INC | 15,850 | 26.19 | 415,111.50 |

| | | | |
|--------------------------------|---------|--------|--------------|
| MICHAEL KORS HOLDINGS LIMITED | 9,477 | 39.70 | 376,236.90 |
| MOHAWK INDUSTRIES INC | 2,738 | 188.02 | 514,798.76 |
| NEWELL RUBBERMAID INC | 12,025 | 44.71 | 537,637.75 |
| NIKE INC -CL B | 30,815 | 128.52 | 3,960,343.80 |
| POLARIS INDUSTRIES INC | 3,113 | 84.78 | 263,920.14 |
| PULTE GROUP INC | 13,149 | 17.33 | 227,872.17 |
| PVH CORP | 3,422 | 73.29 | 250,798.38 |
| RALPH LAUREN CORPORATION | 2,738 | 111.66 | 305,725.08 |
| TOLL BROTHERS INC | 7,285 | 32.85 | 239,312.25 |
| UNDER ARMOUR INC | 8,351 | 80.87 | 675,345.37 |
| VF CORP | 15,651 | 62.01 | 970,518.51 |
| WHIRLPOOL CORP | 3,779 | 142.27 | 537,638.33 |
| ARAMARK | 10,000 | 32.17 | 321,700.00 |
| CARNIVAL CORP | 19,432 | 52.41 | 1,018,431.12 |
| CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC | 1,451 | 541.08 | 785,107.08 |
| DARDEN RESTAURANTS INC | 4,717 | 62.50 | 294,812.50 |
| H&R BLOCK INC | 10,337 | 33.22 | 343,395.14 |
| HILTON WORLDWIDE HOLDINGS INC | 22,274 | 21.46 | 478,000.04 |
| LAS VEGAS SANDS CORP | 17,623 | 41.53 | 731,883.19 |
| MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A | 9,857 | 65.11 | 641,789.27 |
| MCDONALD'S CORPORATION | 42,948 | 116.66 | 5,010,313.68 |
| MELCO CROWN ENTERTAINME-ADR | 2,759 | 16.32 | 45,026.88 |
| MGM MIRAGE | 19,554 | 21.17 | 413,958.18 |
| NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDINGS | 7,708 | 56.86 | 438,276.88 |
| ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD | 7,877 | 95.90 | 755,404.30 |
| STARBUCKS CORP | 67,611 | 58.62 | 3,963,356.82 |
| STARWOOD HOTELS & RESORTS | 7,550 | 66.08 | 498,904.00 |
| WYNDHAM WORLDWIDE CORP | 4,993 | 70.86 | 353,803.98 |
| WYNN RESORTS LTD | 3,642 | 63.40 | 230,902.80 |
| YUM! BRANDS INC | 19,665 | 71.84 | 1,412,733.60 |
| CABLEVISION SYSTEMS-NY GRP-A | 9,712 | 31.00 | 301,072.00 |
| CBS CORP-CL B | 20,262 | 45.66 | 925,162.92 |
| CHARTER COMMUNICATTION-A | 3,701 | 178.29 | 659,851.29 |
| COMCAST CORP-CL A | 112,619 | 56.40 | 6,351,711.60 |
| DISCOVERY COMMUNICATIONS INC-A | 5,949 | 26.22 | 155,982.78 |
| DISCOVERY COMMUNICATIONS INC-C | 11,680 | 24.98 | 291,766.40 |
| DISH NETWORK CORP. | 9,834 | 57.16 | 562,111.44 |
| INTERPUBLIC GROUP OF COS INC | 18,385 | 22.68 | 416,971.80 |
| LIBERTY GLOBAL PLC-A | 11,061 | 38.86 | 429,830.46 |
| LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C | 27,500 | 37.53 | 1,032,075.00 |
| LIBERTY MEDIA CORP-A | 3,927 | 38.16 | 149,854.32 |
| LIBERTY MEDIA CORP-C | 9,534 | 36.71 | 349,993.14 |

| | | | |
|--------------------------------------|---------|----------|---------------|
| NEWS CORP-CLASS A | 15,889 | 13.18 | 209,417.02 |
| OMNICOM GROUP | 11,397 | 73.62 | 839,047.14 |
| SCRIPPS NETWORKS INTERACTIVE | 3,392 | 53.89 | 182,794.88 |
| SIRIUS XM HOLDINGS INC | 109,137 | 3.99 | 435,456.63 |
| TEGNA INC | 10,189 | 25.37 | 258,494.93 |
| THE WALT DISNEY CO. | 72,662 | 107.72 | 7,827,150.64 |
| TIME WARNER CABLE, INC. | 12,956 | 181.13 | 2,346,720.28 |
| TIME WARNER INC | 37,035 | 63.51 | 2,352,092.85 |
| TWENTY-FIRST CE CL-A | 56,248 | 27.11 | 1,524,883.28 |
| TWENTY-FIRST CE CL-B | 19,085 | 27.83 | 531,135.55 |
| VIACOM INC-CLASS B | 16,362 | 39.06 | 639,099.72 |
| ADVANCE AUTO PARTS | 3,481 | 149.57 | 520,653.17 |
| AMAZON.COM INC | 18,025 | 664.14 | 11,971,123.50 |
| AUTONATION INC | 3,089 | 59.12 | 182,621.68 |
| AUTOZONE INC | 1,411 | 741.88 | 1,046,792.68 |
| BED BATH & BEYOND INC | 8,340 | 50.16 | 418,334.40 |
| BEST BUY COMPANY INC | 13,895 | 29.04 | 403,510.80 |
| CARMAX INC | 9,696 | 53.49 | 518,639.04 |
| DICK'S SPORTING GOODS INC | 3,694 | 35.66 | 131,728.04 |
| DOLLAR GENERAL CORP | 13,434 | 71.54 | 961,068.36 |
| DOLLAR TREE INC | 9,892 | 76.09 | 752,682.28 |
| EXPEDIA INC | 4,569 | 125.36 | 572,769.84 |
| FOOT LOCKER INC | 6,434 | 64.28 | 413,577.52 |
| GAMESTOP CORP-CL A | 5,557 | 28.76 | 159,819.32 |
| GAP INC/THE | 10,263 | 24.95 | 256,061.85 |
| GENUINE PARTS CO | 6,602 | 83.58 | 551,795.16 |
| HOME DEPOT INC | 58,195 | 130.29 | 7,582,226.55 |
| KOHL'S CORP | 8,569 | 44.41 | 380,549.29 |
| L BRANDS INC | 11,010 | 95.77 | 1,054,427.70 |
| LIBERTY INTERACTIVE CORP QVC GROUP-A | 21,340 | 26.07 | 556,333.80 |
| LKQ CORPORATION | 13,314 | 27.31 | 363,605.34 |
| LOWE'S COMPANIES INC | 41,612 | 73.89 | 3,074,710.68 |
| MACY'S INC | 15,680 | 34.87 | 546,761.60 |
| NETFLIX INC | 18,373 | 118.02 | 2,168,381.46 |
| NORDSTROM INC | 6,499 | 50.58 | 328,719.42 |
| O'REILLY AUTOMOTIVE INC NEW | 4,480 | 251.38 | 1,126,182.40 |
| PRICELINE GROUP INC/THE | 2,286 | 1,285.67 | 2,939,041.62 |
| ROSS STORES INC | 19,002 | 52.95 | 1,006,155.90 |
| SIGNET JEWELERS LTD | 3,437 | 114.97 | 395,151.89 |
| STAPLES INC | 31,615 | 9.42 | 297,813.30 |
| TARGET CORP | 27,175 | 71.37 | 1,939,479.75 |
| TIFFANY & CO | 6,182 | 71.84 | 444,114.88 |

| | | | |
|--------------------------------------|---------|--------|--------------|
| TJX COMPANIES INC | 30,554 | 69.32 | 2,118,003.28 |
| TRACTOR SUPPLY COMPANY | 6,118 | 85.71 | 524,373.78 |
| TRIPADVISOR INC-W/I | 5,032 | 84.35 | 424,449.20 |
| ULTA SALON COSMETICS & FRAGRANCE INC | 2,921 | 184.94 | 540,209.74 |
| COSTCO WHOLESALE CORP | 19,920 | 157.70 | 3,141,384.00 |
| CVS HEALTH CORPORATION | 50,243 | 94.86 | 4,766,050.98 |
| KROGER CO | 42,255 | 40.64 | 1,717,243.20 |
| RITE AID CORP | 43,701 | 7.84 | 342,615.84 |
| SYSCO CORP | 27,526 | 40.55 | 1,116,179.30 |
| WAL-MART STORES INC | 72,531 | 58.85 | 4,268,449.35 |
| WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC | 39,852 | 82.51 | 3,288,188.52 |
| WHOLE FOODS MARKET INC | 17,060 | 32.75 | 558,715.00 |
| ALTRIA GROUP INC | 89,211 | 57.13 | 5,096,624.43 |
| ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO | 28,158 | 35.00 | 985,530.00 |
| BROWN-FORMAN CORPORATION | 5,392 | 100.27 | 540,655.84 |
| BUNGE LIMITED | 6,195 | 66.10 | 409,489.50 |
| CAMPBELL SOUP CO | 9,076 | 52.21 | 473,857.96 |
| COCA-COLA CO/THE | 186,906 | 42.50 | 7,943,505.00 |
| COCA-COLA ENTERPRISES INC | 10,446 | 48.67 | 508,406.82 |
| CONAGRA FOODS INC | 19,161 | 40.59 | 777,744.99 |
| CONSTELLATION BRANDS INC-A | 7,861 | 138.57 | 1,089,298.77 |
| DR.PEPPER SNAPPLE GROUP, INC | 8,846 | 91.64 | 810,647.44 |
| GENERAL MILLS INC | 27,032 | 56.94 | 1,539,202.08 |
| HORMEL FOODS CORPORATION | 6,259 | 78.79 | 493,146.61 |
| JM SMUCKER CO/THE-NEW COM | 5,132 | 121.55 | 623,794.60 |
| KELLOGG CO | 11,879 | 70.78 | 840,795.62 |
| KEURIG GREEN MOUNTAIN INC | 4,945 | 88.25 | 436,396.25 |
| KRAFT HEINZ COMPANY | 27,702 | 70.67 | 1,957,700.34 |
| MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS | 4,945 | 83.68 | 413,797.60 |
| MEAD JOHNSON NUTRITION COMPANY | 9,062 | 77.00 | 697,774.00 |
| MOLSON COORS BREWING COMPANY | 7,228 | 92.55 | 668,951.40 |
| MONDELEZ INTERNATIONAL INC | 73,407 | 43.30 | 3,178,523.10 |
| MONSTER BEVERAGE CORPORATION | 6,708 | 145.84 | 978,294.72 |
| PEPSICO INC | 66,457 | 97.90 | 6,506,140.30 |
| PHILIP MORRIS INTERNATIONAL INC. | 70,103 | 86.92 | 6,093,352.76 |
| REYNOLDS AMERICAN INC | 38,904 | 44.70 | 1,739,008.80 |
| THE HERSHEY COMPANY | 6,597 | 88.76 | 585,549.72 |
| TYSON FOODS INC-CL A | 13,403 | 52.55 | 704,327.65 |
| WHITEWAVE FOODS CO | 7,662 | 37.89 | 290,313.18 |
| CHURCH & DWIGHT CO INC | 5,983 | 83.22 | 497,905.26 |
| CLOROX COMPANY | 5,833 | 127.05 | 741,082.65 |
| COLGATE-PALMOLIVE COMPANY | 38,434 | 65.57 | 2,520,117.38 |

| | | | |
|--------------------------------------|---------|--------|--------------|
| EDGEWELL PERSONAL CARE CO | 2,963 | 75.55 | 223,854.65 |
| ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A | 10,328 | 87.41 | 902,770.48 |
| KIMBERLY-CLARK CORP | 16,529 | 123.54 | 2,041,992.66 |
| PROCTER & GAMBLE CO | 122,760 | 78.13 | 9,591,238.80 |
| ABBOTT LABORATORIES | 67,238 | 43.70 | 2,938,300.60 |
| AETNA INC | 15,937 | 108.47 | 1,728,686.39 |
| AMERISOURCEBERGEN CORP | 9,332 | 101.88 | 950,744.16 |
| ANTHEM INC | 11,660 | 137.75 | 1,606,165.00 |
| BARD(C.R.) INC | 3,414 | 187.31 | 639,476.34 |
| BAXALTA INC | 25,035 | 38.42 | 961,844.70 |
| BAXTER INTERNATIONAL INC | 24,438 | 36.65 | 895,652.70 |
| BECTON DICKINSON & CO | 9,509 | 153.12 | 1,456,018.08 |
| BOSTON SCIENTIFIC CORP | 62,550 | 18.19 | 1,137,784.50 |
| CARDINAL HEALTH INC | 14,789 | 86.61 | 1,280,875.29 |
| CENTENE CORP | 5,330 | 64.75 | 345,117.50 |
| CERNER CORP | 13,636 | 59.02 | 804,796.72 |
| CIGNA CORP | 11,728 | 143.97 | 1,688,480.16 |
| COOPER COMPANIES INC (THE) | 2,282 | 135.69 | 309,644.58 |
| DAVITA HEALTHCARE PARTNERS INC | 7,918 | 67.79 | 536,761.22 |
| DENTSPLY INTERNATIONAL INC | 6,010 | 59.63 | 358,376.30 |
| EDWARDS LIFESCIENCES CORP | 10,124 | 78.23 | 792,000.52 |
| ENVISION HEALTHCARE HOLDINGS | 8,500 | 23.44 | 199,240.00 |
| EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO | 30,786 | 85.63 | 2,636,205.18 |
| HCA HOLDINGS, INC. | 15,366 | 64.47 | 990,646.02 |
| HENRY SCHEIN INC | 3,725 | 152.14 | 566,721.50 |
| HOLOGIC INC | 10,700 | 38.58 | 412,806.00 |
| HUMANA INC. | 6,785 | 175.38 | 1,189,953.30 |
| IMS HEALTH HOLDINGS INC | 7,700 | 25.66 | 197,582.00 |
| INTUITIVE SURGICAL INC | 1,697 | 534.18 | 906,503.46 |
| LABORATORY CRP OF AMR HLDGS | 4,739 | 121.76 | 577,020.64 |
| MALLINCKRODT PLC | 5,503 | 71.24 | 392,033.72 |
| MCKESSON CORP | 10,477 | 193.40 | 2,026,251.80 |
| MEDNAX INC | 4,300 | 71.40 | 307,020.00 |
| MEDTRONIC PLC | 63,927 | 76.31 | 4,878,269.37 |
| PATTERSON COS INC | 4,102 | 44.05 | 180,693.10 |
| QUEST DIAGNOSTICS | 6,376 | 69.48 | 443,004.48 |
| QUINTILES TRANSNATIONAL HOLDINGS INC | 4,422 | 69.52 | 307,417.44 |
| RESMED INC | 5,997 | 54.00 | 323,838.00 |
| ST JUDE MEDICAL INC | 12,789 | 60.87 | 778,466.43 |
| STRYKER CORP | 15,249 | 91.26 | 1,391,623.74 |
| UNITEDHEALTH GROUP INC | 43,446 | 115.82 | 5,031,915.72 |
| UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B | 4,394 | 114.96 | 505,134.24 |

| | | | |
|----------------------------------|---------|--------|---------------|
| VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC | 4,743 | 78.90 | 374,222.70 |
| ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC | 8,027 | 98.96 | 794,351.92 |
| ABBVIE INC | 75,414 | 55.74 | 4,203,576.36 |
| AGILENT TECHNOLOGIES INC | 14,372 | 40.10 | 576,317.20 |
| ALEXION PHARMACEUTICALS INC | 10,233 | 182.13 | 1,863,736.29 |
| ALKERMES PLC | 6,377 | 76.50 | 487,840.50 |
| ALLERGAN PLC | 17,746 | 306.58 | 5,440,568.68 |
| ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC | 3,571 | 88.95 | 317,640.45 |
| AMGEN INC | 34,215 | 158.80 | 5,433,342.00 |
| BIOGEN INC | 10,705 | 293.37 | 3,140,525.85 |
| BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC | 7,516 | 104.44 | 784,971.04 |
| BRISTOL-MYERS SQUIBB CO | 75,262 | 67.64 | 5,090,721.68 |
| CELGENE CORP | 35,938 | 110.14 | 3,958,211.32 |
| ELI LILLY & CO | 45,210 | 84.77 | 3,832,451.70 |
| ENDO INTERNATIONAL PLC | 9,343 | 61.02 | 570,109.86 |
| GILEAD SCIENCES INC | 66,267 | 101.60 | 6,732,727.20 |
| ILLUMINA INC | 6,507 | 181.94 | 1,183,883.58 |
| INCYTE CORP | 7,283 | 113.23 | 824,654.09 |
| ISIS PHARMACEUTICALS INC | 5,769 | 57.84 | 333,678.96 |
| JAZZ PHARMACEUTICALS PLC | 2,928 | 139.96 | 409,802.88 |
| JOHNSON & JOHNSON | 125,332 | 101.95 | 12,777,597.40 |
| MEDIVATION INC | 7,392 | 43.79 | 323,695.68 |
| MERCK & CO. INC. | 127,168 | 51.64 | 6,566,955.52 |
| METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL INC | 1,322 | 331.06 | 437,661.32 |
| MYLAN NV | 18,423 | 53.17 | 979,550.91 |
| PERRIGO CO PLC | 6,780 | 144.33 | 978,557.40 |
| PFIZER INC | 278,732 | 31.99 | 8,916,636.68 |
| REGENERON PHARMACEUTICALS | 3,436 | 544.23 | 1,869,974.28 |
| TARO PHARMACEUTICAL INDUSTRIES | 534 | 155.95 | 83,277.30 |
| THERMO FISHER SCIENTIFIC INC | 17,953 | 134.51 | 2,414,858.03 |
| UNITED THERAPEUTICS CORP | 2,212 | 155.18 | 343,258.16 |
| VERTEX PHARMACEUTICALS INC | 11,194 | 116.51 | 1,304,212.94 |
| WATERS CORP | 3,537 | 129.52 | 458,112.24 |
| ZOETIS INC | 21,076 | 46.60 | 982,141.60 |
| BANK OF AMERICA CORP | 471,963 | 16.76 | 7,910,099.88 |
| BB & T CORPORATION | 36,027 | 37.23 | 1,341,285.21 |
| CIT GROUP INC | 8,202 | 40.26 | 330,212.52 |
| CITIGROUP INC | 136,529 | 51.21 | 6,991,650.09 |
| CITIZENS FINANCIAL GROUP | 22,904 | 25.90 | 593,213.60 |
| COMERICA INC | 8,610 | 40.54 | 349,049.40 |
| FIFTH THIRD BANCORP | 36,500 | 19.73 | 720,327.50 |
| FIRST REPUBLIC BANK/CA | 6,528 | 64.98 | 424,189.44 |

| | | | |
|-----------------------------------|---------|--------|---------------|
| HUNTINGTON BANCSHARES INC | 35,918 | 10.82 | 388,632.76 |
| JPMORGAN CHASE & CO | 167,302 | 64.40 | 10,774,248.80 |
| KEYCORP | 38,474 | 12.67 | 487,465.58 |
| M & T BANK CORP | 6,315 | 120.03 | 757,989.45 |
| NEW YORK COMMUNITY BANCORP | 21,566 | 16.16 | 348,506.56 |
| PEOPLE'S UNITED FINANCIAL INC | 15,218 | 15.90 | 241,966.20 |
| PNC FINANCIAL SERVICES GROUP | 23,213 | 93.75 | 2,176,218.75 |
| REGIONS FINANCIAL CORPORATION | 60,408 | 9.35 | 564,814.80 |
| SIGNATURE BANK | 2,300 | 151.19 | 347,737.00 |
| SUNTRUST BANKS INC | 23,255 | 42.19 | 981,128.45 |
| US BANCORP | 79,834 | 42.36 | 3,381,768.24 |
| WELLS FARGO & COMPANY | 221,059 | 53.79 | 11,890,763.61 |
| AFFILIATED MANAGERS GROUP | 2,457 | 153.75 | 377,763.75 |
| ALLY FINANCIAL INC | 20,464 | 18.40 | 376,537.60 |
| AMERICAN EXPRESS COMPANY | 40,586 | 67.87 | 2,754,571.82 |
| AMERIPRISE FINANCIAL INC | 7,828 | 103.08 | 806,910.24 |
| BANK OF NEW YORK MELLON CORP(THE) | 50,266 | 40.22 | 2,021,698.52 |
| BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B | 53,652 | 129.53 | 6,949,543.56 |
| BLACKROCK INC | 5,525 | 321.47 | 1,776,121.75 |
| CAPITAL ONE FINANCIAL CORP | 24,449 | 72.47 | 1,771,819.03 |
| CME GROUP INC. | 14,570 | 92.55 | 1,348,453.50 |
| DISCOVER FINANCIAL SERVICES | 19,603 | 52.44 | 1,027,981.32 |
| E*TRADE FINANCIAL CORPORATION | 13,758 | 28.82 | 396,505.56 |
| EATON VANCE CORP | 5,530 | 31.39 | 173,586.70 |
| FRANKLIN RESOURCES INC | 17,949 | 35.00 | 628,215.00 |
| GOLDMAN SACHS GROUP INC | 17,756 | 175.49 | 3,116,000.44 |
| INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC | 5,051 | 244.58 | 1,235,373.58 |
| INVESCO LIMITED | 18,708 | 30.74 | 575,083.92 |
| LEGG MASON INC | 4,006 | 37.85 | 151,627.10 |
| LEUCADIA NATIONAL CORPORATION | 15,223 | 16.46 | 250,570.58 |
| MCGRAW HILL FINANCIAL INC | 12,392 | 93.86 | 1,163,113.12 |
| MOODY'S CORP | 7,900 | 97.46 | 769,934.00 |
| MORGAN STANLEY | 65,733 | 31.29 | 2,056,785.57 |
| NASDAQ INC | 5,692 | 55.93 | 318,353.56 |
| NAVIENT CORPORATION | 15,911 | 11.92 | 189,659.12 |
| NORTHERN TRUST CORP | 9,698 | 70.06 | 679,441.88 |
| RAYMOND JAMES FINANCIAL INC | 5,579 | 58.10 | 324,139.90 |
| SCHWAB (CHARLES) CORP | 53,872 | 31.91 | 1,719,055.52 |
| SEI INVESTMENTS COMPANY | 5,892 | 51.69 | 304,557.48 |
| STATE STREET CORP | 18,301 | 64.73 | 1,184,623.73 |
| SYNCHRONY FINANCIAL | 37,799 | 29.51 | 1,115,448.49 |
| T ROWE PRICE GROUP INC | 11,704 | 69.91 | 818,226.64 |

| | | | |
|-----------------------------------|--------|--------|--------------|
| TD AMERITRADE HOLDING CORPORATION | 11,968 | 33.78 | 404,279.04 |
| ACE LIMITED | 14,818 | 113.69 | 1,684,658.42 |
| AFLAC INC | 19,414 | 58.29 | 1,131,642.06 |
| ALLEGHANY CORPORATION | 770 | 474.68 | 365,503.60 |
| ALLSTATE CORP | 18,558 | 61.33 | 1,138,162.14 |
| AMERICAN INTERNATIONAL GROUP | 59,058 | 59.60 | 3,519,856.80 |
| AON PLC | 12,761 | 90.99 | 1,161,123.39 |
| ARCH CAPITAL GROUP LTD. | 5,391 | 70.08 | 377,801.28 |
| ARTHUR J GALLAGHER & CO | 8,087 | 40.08 | 324,126.96 |
| ASSURANT INC | 2,849 | 79.09 | 225,327.41 |
| AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD | 4,260 | 55.68 | 237,196.80 |
| CHUBB CORP | 10,219 | 129.84 | 1,326,834.96 |
| CINCINNATI FINANCIAL CORP | 6,769 | 57.97 | 392,398.93 |
| EVEREST RE GROUP LTD | 2,147 | 181.11 | 388,843.17 |
| FNF GROUP | 11,145 | 32.49 | 362,101.05 |
| HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP | 18,199 | 42.11 | 766,359.89 |
| LINCOLN NATIONAL CORP | 11,366 | 48.67 | 553,183.22 |
| LOEWS CORPORATION | 13,343 | 36.68 | 489,421.24 |
| MARKEL CORP | 630 | 862.35 | 543,280.50 |
| MARSH & MCLENNAN COS | 24,458 | 54.51 | 1,333,205.58 |
| METLIFE INC | 43,253 | 46.45 | 2,009,101.85 |
| PARTNERRE LTD | 2,297 | 139.00 | 319,283.00 |
| PRINCIPAL FINANCIAL GROUP | 13,370 | 43.82 | 585,873.40 |
| PROGRESSIVE CORP | 27,420 | 30.83 | 845,358.60 |
| PRUDENTIAL FINANCIAL INC | 20,554 | 79.55 | 1,635,070.70 |
| RENAISSANCERE HOLDINGS LTD | 2,159 | 110.80 | 239,217.20 |
| TORCHMARK CORPORATION | 5,356 | 55.36 | 296,508.16 |
| TRAVELERS COS INC(THE) | 14,079 | 110.13 | 1,550,520.27 |
| UNUM GROUP | 11,114 | 32.10 | 356,759.40 |
| VOYA FINANCIAL INC | 10,875 | 36.04 | 391,935.00 |
| W.R.BERKLEY CORPORATION | 4,140 | 52.72 | 218,260.80 |
| WILLIS GROUP HOLDINGS PLC | 6,704 | 46.18 | 309,590.72 |
| XL GROUP PLC | 13,694 | 37.66 | 515,716.04 |
| CBRE GROUP INC-A | 14,256 | 33.95 | 483,991.20 |
| CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP | 15,149 | 84.82 | 1,284,938.18 |
| HONGKONG LAND HOLDINGS LTD | 25,000 | 6.91 | 172,750.00 |
| JONES LANG LASALLE INC | 2,108 | 156.70 | 330,323.60 |
| REALOGY HOLDINGS CORP | 6,236 | 37.49 | 233,787.64 |
| WEYERHAEUSER CO | 22,435 | 29.51 | 662,056.85 |
| ACCENTURE PLC-CL A | 28,187 | 101.93 | 2,873,100.91 |
| ACTIVISION BLIZZARD INC | 22,683 | 38.47 | 872,615.01 |
| ADOBE SYSTEMS INC | 22,272 | 91.31 | 2,033,656.32 |

| | | | |
|--|---------|--------|---------------|
| AKAMAI TECHNOLOGIES | 8,580 | 52.32 | 448,905.60 |
| ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP | 2,793 | 266.94 | 745,563.42 |
| ALPHABET INC-CL A | 13,103 | 756.85 | 9,917,005.55 |
| ALPHABET INC-CL C | 13,992 | 739.31 | 10,344,425.52 |
| ANSYS INC | 4,110 | 90.60 | 372,366.00 |
| AUTODESK INC | 10,253 | 59.52 | 610,258.56 |
| AUTOMATIC DATA PROCESSING | 20,799 | 83.28 | 1,732,140.72 |
| CA INC | 14,210 | 28.22 | 401,006.20 |
| CDK GLOBAL INC | 6,408 | 45.76 | 293,230.08 |
| CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES | 2,916 | 80.62 | 235,087.92 |
| CITRIX SYSTEMS INC | 7,141 | 74.71 | 533,504.11 |
| COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS CORPORATION | 27,387 | 58.86 | 1,611,998.82 |
| EBAY INC | 48,699 | 27.46 | 1,337,274.54 |
| ELECTRONIC ARTS INC | 14,215 | 68.98 | 980,550.70 |
| EQUINIX INC | 2,682 | 289.35 | 776,036.70 |
| FACEBOOK INC-A | 97,037 | 104.04 | 10,095,729.48 |
| FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES | 12,749 | 58.52 | 746,071.48 |
| FIREEYE INC | 6,180 | 21.55 | 133,179.00 |
| FISERV INC | 10,686 | 91.46 | 977,341.56 |
| FLEETCOR TECHNOLOGIES INC | 3,361 | 140.32 | 471,615.52 |
| FORTINET INC | 6,500 | 31.22 | 202,930.00 |
| GARTNER INC | 3,469 | 88.94 | 308,532.86 |
| GLOBAL PAYMENTS INC | 5,600 | 63.80 | 357,280.00 |
| INTL BUSINESS MACHINES CORP | 42,266 | 134.90 | 5,701,683.40 |
| INTUIT INC | 12,142 | 95.57 | 1,160,410.94 |
| LINKEDIN CORP-A | 5,151 | 225.80 | 1,163,095.80 |
| MASTERCARD INC-CL A | 45,384 | 96.29 | 4,370,025.36 |
| MICROSOFT CORP | 344,096 | 54.13 | 18,625,916.48 |
| NETSUITE INC | 2,000 | 81.99 | 163,980.00 |
| NUANCE COMMUNICATIONS INC | 11,121 | 20.36 | 226,423.56 |
| ORACLE CORPORATION | 157,835 | 36.35 | 5,737,302.25 |
| PAYCHEX INC | 14,341 | 52.45 | 752,185.45 |
| PAYPAL HOLDINGS INC | 49,713 | 34.98 | 1,738,960.74 |
| RED HAT INC | 8,251 | 81.40 | 671,631.40 |
| SABRE CORP | 8,000 | 28.61 | 228,880.00 |
| SALESFORCE.COM, INC. | 28,429 | 77.03 | 2,189,885.87 |
| SERVICENOW INC | 6,327 | 85.73 | 542,413.71 |
| SPLUNK INC | 5,933 | 53.68 | 318,483.44 |
| SYMANTEC CORPORATION | 31,068 | 20.21 | 627,884.28 |
| SYNOPSYS INC | 7,563 | 44.77 | 338,595.51 |
| TABLEAU SOFTWARE INC-CL A | 2,186 | 88.67 | 193,832.62 |
| TERADATA CORP | 7,209 | 26.19 | 188,803.71 |

| | | | |
|-------------------------------------|---------|--------|---------------|
| TOTAL SYSTEM SERVICES INC | 7,323 | 51.01 | 373,546.23 |
| TWITTER INC | 25,955 | 22.99 | 596,705.45 |
| VANTIV INC-CL A | 6,426 | 46.67 | 299,901.42 |
| VERISIGN INC | 4,574 | 86.44 | 395,376.56 |
| VISA INC | 88,434 | 76.32 | 6,749,282.88 |
| VMWARE INC | 3,826 | 56.86 | 217,546.36 |
| WESTERN UNION COMPANY | 24,601 | 17.80 | 437,897.80 |
| WORKDAY INC-CLASS A | 5,247 | 78.55 | 412,151.85 |
| XEROX CORP | 46,168 | 10.15 | 468,605.20 |
| YAHOO! INC | 40,252 | 32.95 | 1,326,303.40 |
| ZILLOW GROUP INC-C | 5,184 | 24.61 | 127,578.24 |
| AMPHENOL CORPORATION -CL A | 14,435 | 51.64 | 745,423.40 |
| APPLE INC | 258,404 | 106.03 | 27,398,576.12 |
| ARROW ELECTRONICS INC | 4,041 | 53.88 | 217,729.08 |
| AVNET INC | 6,544 | 43.11 | 282,111.84 |
| CDW CORP/DE | 6,500 | 42.41 | 275,665.00 |
| CISCO SYSTEMS INC | 229,502 | 26.27 | 6,029,017.54 |
| CORNING INC | 55,811 | 18.00 | 1,004,598.00 |
| EMC CORP/MASS | 87,226 | 25.35 | 2,211,179.10 |
| F5 NETWORKS INC | 3,338 | 97.63 | 325,888.94 |
| FLEXTRONICS INTL LTD | 27,993 | 10.81 | 302,604.33 |
| FLIR SYSTEMS INC | 7,048 | 27.98 | 197,203.04 |
| HARRIS CORP | 5,694 | 82.71 | 470,950.74 |
| HEWLETT PACKARD ENTERPRISE C | 80,529 | 14.16 | 1,140,290.64 |
| HP INC | 79,679 | 11.51 | 917,105.29 |
| JUNIPER NETWORKS INC | 15,583 | 28.68 | 446,920.44 |
| MOTOROLA SOLUTIONS INC | 7,104 | 67.58 | 480,088.32 |
| NETAPP INC | 13,593 | 27.60 | 375,166.80 |
| PALO ALTO NETWORKS INC | 3,417 | 182.89 | 624,935.13 |
| QORVO INC | 6,774 | 51.63 | 349,741.62 |
| QUALCOMM INC | 71,702 | 47.43 | 3,400,825.86 |
| SANDISK CORP | 9,525 | 73.89 | 703,802.25 |
| SEAGATE TECHNOLOGY | 14,132 | 34.10 | 481,901.20 |
| SKYWORKS SOLUTIONS INC | 8,902 | 76.38 | 679,934.76 |
| TE CONNECTIVITY LTD | 18,035 | 62.75 | 1,131,696.25 |
| TRIMBLE NAVIGATION LTD | 10,452 | 21.54 | 225,136.08 |
| WESTERN DIGITAL CORP | 10,774 | 58.86 | 634,157.64 |
| AT&T INC | 278,546 | 33.60 | 9,359,145.60 |
| CENTURYLINK INC | 26,370 | 25.11 | 662,150.70 |
| FRONTIER COMMUNICATIONS CORPORATION | 48,161 | 4.64 | 223,467.04 |
| LEVEL 3 COMMUNICATIONS INC | 13,658 | 50.85 | 694,509.30 |
| SBA COMMUNICATIONS CORP-CL A | 6,014 | 100.42 | 603,925.88 |

| | | | |
|-----------------------------------|---------|--------|--------------|
| SPRINT CORP | 33,034 | 3.66 | 120,904.44 |
| T-MOBILE US INC | 12,915 | 37.89 | 489,349.35 |
| VERIZON COMMUNICATIONS INC | 184,154 | 45.56 | 8,390,056.24 |
| AES CORPORATION | 29,997 | 9.06 | 271,772.82 |
| AGL RESOURCES INC | 5,474 | 62.88 | 344,205.12 |
| ALLIANT ENERGY CORP | 4,948 | 62.46 | 309,052.08 |
| AMEREN CORPORATION | 11,406 | 43.20 | 492,739.20 |
| AMERICAN ELECTRIC POWER | 21,898 | 56.28 | 1,232,419.44 |
| AMERICAN WATER WORKS CO INC | 8,493 | 59.55 | 505,758.15 |
| CALPINE CORP | 16,738 | 12.88 | 215,585.44 |
| CENTERPOINT ENERGY INC | 17,741 | 17.43 | 309,225.63 |
| CMS ENERGY CORPORATION | 12,676 | 35.61 | 451,392.36 |
| COLUMBIA PIPELINE GROUP | 17,511 | 19.31 | 338,137.41 |
| CONSOLIDATED EDISON INC | 12,922 | 63.29 | 817,833.38 |
| DOMINION RESOURCES INC/VA | 27,128 | 66.90 | 1,814,863.20 |
| DTE ENERGY COMPANY | 7,939 | 78.88 | 626,228.32 |
| DUKE ENERGY CORP | 31,140 | 69.60 | 2,167,344.00 |
| EDISON INTERNATIONAL | 14,671 | 59.66 | 875,271.86 |
| ENTERGY CORP | 8,476 | 66.26 | 561,619.76 |
| EVERSOURCE ENERGY | 14,222 | 50.45 | 717,499.90 |
| EXELON CORP | 38,034 | 26.90 | 1,023,114.60 |
| FIRSTENERGY CORP | 19,917 | 31.01 | 617,626.17 |
| NEXTERA ENERGY INC | 20,489 | 102.11 | 2,092,131.79 |
| NRG ENERGY INC | 16,034 | 10.37 | 166,272.58 |
| OGE ENERGY CORP | 9,238 | 25.47 | 235,291.86 |
| P G & E CORPORATION | 22,419 | 53.11 | 1,190,673.09 |
| PEPCO HOLDINGS INC | 10,600 | 25.84 | 273,904.00 |
| PINNACLE WEST CAPITAL CORPORATION | 4,942 | 62.85 | 310,604.70 |
| PPL CORPORATION | 30,440 | 33.64 | 1,024,001.60 |
| PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP | 22,673 | 37.48 | 849,784.04 |
| SCANA CORP | 6,092 | 60.34 | 367,591.28 |
| SEMPRA ENERGY | 10,620 | 94.41 | 1,002,634.20 |
| SOUTHERN CO | 41,435 | 46.20 | 1,914,297.00 |
| WEC ENERGY GROUP INC | 14,370 | 50.24 | 721,948.80 |
| XCEL ENERGY INC | 23,635 | 35.60 | 841,406.00 |
| ALTERA CORPORATION | 14,215 | 52.85 | 751,262.75 |
| ANALOG DEVICES INC | 14,416 | 55.17 | 795,330.72 |
| APPLIED MATERIALS INC | 54,332 | 18.10 | 983,409.20 |
| AVAGO TECHNOLOGIES LTD. | 11,802 | 140.20 | 1,654,640.40 |
| BROADCOM CORP-CL A | 25,222 | 56.28 | 1,419,494.16 |
| INTEL CORP | 215,490 | 33.86 | 7,297,568.85 |
| KLA-TENCOR CORPORATION | 7,639 | 66.86 | 510,743.54 |

| | | | | |
|-------|------------------------------|------------|--------|------------------------------------|
| | LAM RESEARCH CORP | 6,857 | 77.04 | 528,263.28 |
| | LINEAR TECHNOLOGY CORP | 10,313 | 42.42 | 437,477.46 |
| | MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD | 18,071 | 8.56 | 154,778.11 |
| | MAXIM INTEGRATED PRODUCTS | 13,285 | 37.24 | 494,733.40 |
| | MICROCHIP TECHNOLOGY INC | 10,156 | 46.09 | 468,090.04 |
| | MICRON TECHNOLOGY INC | 50,896 | 14.36 | 730,866.56 |
| | NVIDIA CORP | 24,340 | 32.14 | 782,287.60 |
| | NXP SEMICONDUCTORS NV | 6,231 | 84.10 | 524,027.10 |
| | TEXAS INSTRUMENTS INC | 46,754 | 54.94 | 2,568,664.76 |
| | XILINX INC | 11,585 | 46.52 | 538,934.20 |
| | 米ドル 小計 | 14,402,475 | | 822,391,118.01 (99,739,594,792) |
| カナダドル | ALTAGAS LTD | 5,548 | 31.09 | 172,487.32 |
| | ARC RESOURCES LTD | 16,083 | 16.58 | 266,656.14 |
| | CAMECO CORP | 19,538 | 16.80 | 328,238.40 |
| | CANADIAN NATURAL RESOURCES | 49,141 | 29.15 | 1,432,460.15 |
| | CANADIAN OIL SANDS LTD | 24,518 | 8.49 | 208,157.82 |
| | CENOVUS ENERGY INC | 36,119 | 17.55 | 633,888.45 |
| | CRESCENT POINT ENERGY CORP | 23,425 | 15.68 | 367,304.00 |
| | ENBRIDGE INC | 38,984 | 43.78 | 1,706,719.52 |
| | ENCANA CORP | 34,842 | 7.02 | 244,590.84 |
| | HUSKY ENERGY INC | 15,345 | 14.39 | 220,814.55 |
| | IMPERIAL OIL LTD | 13,562 | 43.41 | 588,726.42 |
| | INTER PIPELINE LTD | 13,880 | 22.34 | 310,079.20 |
| | KEYERA CORP | 7,761 | 40.81 | 316,726.41 |
| | MEG ENERGY CORPORATION | 8,587 | 7.59 | 65,175.33 |
| | PEMBINA PIPELINE CORP | 16,067 | 29.88 | 480,081.96 |
| | PEYTO EXPLORATION & DEV CORP | 6,265 | 24.20 | 151,613.00 |
| | PRAIRIESKY ROYALTY LTD | 6,411 | 21.45 | 137,515.95 |
| | SEVEN GENERATIONS ENERGY-A | 6,800 | 13.42 | 91,256.00 |
| | SUNCOR ENERGY INC | 66,054 | 35.99 | 2,377,283.46 |
| | TOURMALINE OIL CORP | 8,005 | 21.68 | 173,548.40 |
| | TRANSCANADA CORP | 32,655 | 45.73 | 1,493,313.15 |
| | VERESEN INC | 13,299 | 8.57 | 113,972.43 |
| | VERMILION ENERGY INC | 5,586 | 36.72 | 205,117.92 |
| | AGNICO EAGLE MINES LIMITED | 9,597 | 36.31 | 348,467.07 |
| | AGRIUM INC | 6,080 | 129.39 | 786,691.20 |
| | BARRICK GOLD CORP | 53,489 | 10.09 | 539,704.01 |
| | CCL INDUSTRIES INC-CL B | 1,385 | 226.28 | 313,397.80 |
| | ELDORADO GOLD CORPORATION | 26,276 | 4.28 | 112,461.28 |
| | FIRST QUANTUM MINERALS LTD | 32,770 | 4.60 | 150,742.00 |
| | FRANCO-NEVADA CORPORATION | 7,418 | 64.01 | 474,826.18 |

| | | | |
|-------------------------------------|--------|--------|--------------|
| GOLDCORP INC | 38,306 | 16.18 | 619,791.08 |
| KINROSS GOLD CORP | 51,579 | 2.64 | 136,168.56 |
| METHANEX CORPORATION | 3,622 | 44.62 | 161,613.64 |
| POTASH CORP OF SASKATCHEWAN | 37,155 | 24.21 | 899,522.55 |
| SILVER WHEATON CORPORATION | 17,420 | 17.22 | 299,972.40 |
| TECK RESOURCES LIMITED-CL B | 27,750 | 4.60 | 127,650.00 |
| TURQUOISE HILL RESOURCES LTD | 45,107 | 3.26 | 147,048.82 |
| WEST FRASER TIMBER CO LTD | 2,873 | 53.00 | 152,269.00 |
| YAMANA GOLD INC | 51,365 | 2.55 | 130,980.75 |
| BOMBARDIER INC 'B' | 80,493 | 1.36 | 109,470.48 |
| CAE INC | 13,932 | 15.16 | 211,209.12 |
| FINNING INTERNATIONAL INC | 6,639 | 18.41 | 122,223.99 |
| SNC-LAVALIN GROUP INC | 6,787 | 42.33 | 287,293.71 |
| CANADIAN NATL RAILWAY CO | 35,981 | 77.85 | 2,801,120.85 |
| CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD | 7,056 | 175.00 | 1,234,800.00 |
| LINAMAR CORP | 2,200 | 73.14 | 160,908.00 |
| MAGNA INTERNATIONAL INC | 18,503 | 56.95 | 1,053,745.85 |
| GILDAN ACTIVEWEAR INC | 10,518 | 40.22 | 423,033.96 |
| RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC | 8,629 | 51.20 | 441,804.80 |
| SHAW COMMUNICATIONS INC-B | 18,916 | 23.65 | 447,363.40 |
| THOMSON REUTERS CORP | 16,217 | 52.44 | 850,419.48 |
| CANADIAN TIRE CORP -CL A | 3,288 | 118.32 | 389,036.16 |
| DOLLARAMA INC | 5,454 | 79.65 | 434,411.10 |
| ALIMENTATION COUCHE-TARD INC-B | 19,238 | 62.00 | 1,192,756.00 |
| EMPIRE CO LTD A | 7,235 | 25.84 | 186,952.40 |
| JEAN COUTU GROUP INC A | 2,884 | 17.62 | 50,816.08 |
| LOBLAW COMPANIES LTD | 10,287 | 64.89 | 667,523.43 |
| METRO INC | 11,599 | 38.95 | 451,781.05 |
| WESTON (GEORGE) LTD | 2,473 | 107.18 | 265,056.14 |
| SAPUTO INC | 10,903 | 32.76 | 357,182.28 |
| VALEANT PHARMACEUTICALS INTERN | 14,735 | 151.17 | 2,227,489.95 |
| BANK OF MONTREAL | 29,126 | 78.75 | 2,293,672.50 |
| BANK OF NOVA SCOTIA | 54,833 | 56.14 | 3,078,324.62 |
| CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE | 18,202 | 92.46 | 1,682,956.92 |
| NATIONAL BANK OF CANADA | 14,130 | 40.21 | 568,167.30 |
| ROYAL BANK OF CANADA | 67,686 | 74.25 | 5,025,685.50 |
| TORONTO-DOMINION BANK | 83,513 | 54.70 | 4,568,161.10 |
| CI FINANCIAL CORP | 10,961 | 30.66 | 336,064.26 |
| ELEMENT FINANCIAL CORP | 19,611 | 16.59 | 325,346.49 |
| IGM FINANCIAL INC | 5,296 | 35.30 | 186,948.80 |
| ONEX CORPORATION | 3,665 | 83.42 | 305,734.30 |
| FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD | 1,023 | 637.00 | 651,651.00 |

| | | | | |
|-----|--|-----------|--------|----------------------------------|
| | GREAT-WEST LIFECO INC | 14,253 | 34.42 | 490,588.26 |
| | INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANCE AND FINANC | 3,892 | 44.41 | 172,843.72 |
| | INTACT FINANCIAL CORPORATION | 5,933 | 87.76 | 520,680.08 |
| | MANULIFE FINANCIAL CORP | 90,439 | 20.52 | 1,855,808.28 |
| | POWER CORP OF CANADA | 17,850 | 29.26 | 522,291.00 |
| | POWER FINANCIAL CORP | 10,930 | 32.44 | 354,569.20 |
| | SUN LIFE FINANCIAL INC | 27,069 | 43.10 | 1,166,673.90 |
| | BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT INC | 38,895 | 43.79 | 1,703,212.05 |
| | FIRST CAPITAL REALTY INC | 4,000 | 19.37 | 77,480.00 |
| | CGI GROUP INC - CL A | 10,138 | 55.36 | 561,239.68 |
| | CONSTELLATION SOFTWARE | 897 | 584.58 | 524,368.26 |
| | OPEN TEXT CORPORATION | 5,489 | 66.63 | 365,732.07 |
| | BLACKBERRY LIMITED | 22,051 | 12.03 | 265,273.53 |
| | BCE INC | 6,388 | 53.41 | 341,183.08 |
| | ROGERS COMMUNICATIONS -CL B | 16,263 | 48.68 | 791,682.84 |
| | TELUS CORPORATION | 9,642 | 38.43 | 370,542.06 |
| | ATCO LTD-CLASS I | 3,354 | 36.07 | 120,978.78 |
| | CANADIAN UTILITIES LIMITED | 5,884 | 32.31 | 190,112.04 |
| | FORTIS INC | 12,721 | 37.79 | 480,726.59 |
| | カナダドル 小計 | 1,808,768 | | 61,752,129.60 (5,366,260,062) |
| ユーロ | ENI SPA | 116,573 | 13.50 | 1,573,735.50 |
| | GALP ENERGIA SGPS S.A | 18,115 | 10.41 | 188,577.15 |
| | NESTE OYJ | 6,068 | 27.07 | 164,260.76 |
| | OMV AG | 6,699 | 25.54 | 171,092.46 |
| | REPSOL SA | 46,566 | 10.71 | 498,954.69 |
| | SAIPEM | 8,981 | 7.51 | 67,492.21 |
| | TECHNIP S.A. | 4,653 | 45.30 | 210,804.16 |
| | TENARIS S.A. | 19,639 | 10.75 | 211,119.25 |
| | TOTAL SA | 98,476 | 42.01 | 4,136,976.76 |
| | VOPAK | 3,334 | 37.47 | 124,941.65 |
| | AIR LIQUIDE | 15,605 | 104.75 | 1,634,623.75 |
| | AKZO NOBEL | 11,711 | 61.50 | 720,226.50 |
| | ARCELOR MITTAL | 45,118 | 3.58 | 161,928.50 |
| | ARKEMA | 2,963 | 64.30 | 190,520.90 |
| | BASF SE | 41,890 | 70.22 | 2,941,515.80 |
| | CRH PLC | 37,322 | 26.24 | 979,329.28 |
| | EVONIK INDUSTRIES AG | 5,774 | 30.38 | 175,442.99 |
| | FUCHS PETROLUB SE-PREF | 2,585 | 43.81 | 113,248.85 |
| | HEIDELBERGCEMENT AG | 6,427 | 72.53 | 466,150.31 |
| | IMERYS SA | 2,030 | 62.38 | 126,631.40 |
| | K+S AG | 9,644 | 23.22 | 223,981.90 |

| | | | |
|-----------------------------|--------|--------|--------------|
| KONINKLIJKE DSM NV | 7,878 | 46.01 | 362,466.78 |
| LANXESS | 4,066 | 42.87 | 174,329.75 |
| LINDE AG | 8,274 | 131.85 | 1,090,926.90 |
| SOLVAY SA | 3,467 | 96.51 | 334,600.17 |
| STORA ENSO OYJ-R SHS | 25,257 | 8.45 | 213,421.65 |
| SYMRISE AG | 5,820 | 61.07 | 355,427.40 |
| THYSSENKRUPP AG | 17,642 | 17.49 | 308,646.79 |
| UMICORE | 4,218 | 37.89 | 159,820.02 |
| UPM-KYMMENE OYJ | 23,764 | 17.27 | 410,404.28 |
| VOESTALPINE AG | 4,961 | 26.83 | 133,103.63 |
| ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV | 9,167 | 26.52 | 243,154.67 |
| AIRBUS GROUP SE | 27,106 | 63.26 | 1,714,725.56 |
| ALSTOM RGPT | 9,853 | 27.50 | 271,006.76 |
| ANDRITZ AG | 3,965 | 45.02 | 178,504.30 |
| BOSKALIS WESTMINSTER NV | 3,523 | 36.65 | 129,135.56 |
| BOUYGUES SA | 8,455 | 35.58 | 300,871.17 |
| BRENTAG AG | 6,928 | 48.28 | 334,518.48 |
| CNH INDUSTRIAL NV | 44,474 | 6.27 | 279,074.35 |
| COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN | 22,389 | 39.39 | 881,902.71 |
| FERROVIAL SA | 20,422 | 20.68 | 422,326.96 |
| FINMECCANICA SPA | 18,294 | 12.78 | 233,797.32 |
| GEA GROUP AG | 8,548 | 37.11 | 317,259.02 |
| KONE OYJ-B | 15,772 | 38.54 | 607,852.88 |
| KONINKLIJKE PHILIPS NV | 43,022 | 23.54 | 1,012,952.99 |
| LEGRAND SA | 12,536 | 51.65 | 647,484.40 |
| MAN SE | 1,440 | 92.11 | 132,638.40 |
| METSO OYJ | 4,880 | 20.25 | 98,820.00 |
| OCI NV | 3,391 | 22.63 | 76,738.33 |
| OSRAM LICHT AG | 3,738 | 39.07 | 146,062.35 |
| PRYSMIAN SPA | 9,328 | 19.72 | 183,948.16 |
| REXEL SA | 13,762 | 11.72 | 161,359.45 |
| SAFRAN SA | 13,656 | 63.49 | 867,019.44 |
| SCHNEIDER ELECTRIC SE | 25,274 | 52.13 | 1,317,533.62 |
| SIEMENS AG-REG | 35,710 | 89.03 | 3,179,261.30 |
| THALES SA | 4,467 | 69.36 | 309,831.12 |
| VINCI S.A. | 22,117 | 58.40 | 1,291,632.80 |
| WARTSILA OYJ-B SHARES | 6,712 | 41.19 | 276,467.28 |
| ZARDOYA OTIS SA | 6,593 | 10.80 | 71,204.40 |
| ZODIAC AEROSPACE | 10,335 | 21.87 | 226,078.12 |
| BIC | 1,337 | 150.75 | 201,552.75 |
| BUREAU VERITAS SA | 11,223 | 18.38 | 206,278.74 |
| EDEMRED | 8,942 | 16.77 | 150,002.05 |

| | | | |
|---|--------|--------|--------------|
| RANDSTAD HOLDING NV | 6,118 | 56.41 | 345,116.38 |
| ABERTIS INFRASTRUCTURAS SA | 23,172 | 14.11 | 326,956.92 |
| AENA SA | 3,179 | 108.95 | 346,352.05 |
| AEROPORTS DE PARIS (ADP) | 1,346 | 106.40 | 143,214.40 |
| ATLANTIA SPA | 18,617 | 24.35 | 453,323.95 |
| BOLLORE | 39,433 | 4.22 | 166,604.42 |
| DEUTSCHE LUFTHANSA-REG | 12,281 | 14.10 | 173,223.50 |
| DEUTSCHE POST AG-REG | 44,804 | 25.75 | 1,153,927.02 |
| FRAPORT AG | 1,856 | 59.18 | 109,838.08 |
| GROUPE EUROTUNNEL SE | 20,041 | 11.25 | 225,461.25 |
| INTERNATIONAL CONSOLIDATED AIRLINES GROUP | 36,090 | 8.08 | 291,607.20 |
| RYANAIR HOLDINGS PLC | 1,614 | 15.00 | 24,210.00 |
| TNT EXPRESS NV | 20,014 | 7.72 | 154,648.17 |
| BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG | 15,077 | 96.71 | 1,458,096.67 |
| BAYERISCHE MOTOREN WERKE(BMW)AG-PFD | 2,879 | 75.25 | 216,644.75 |
| CONTINENTAL AG | 5,075 | 221.10 | 1,122,082.50 |
| DAIMLER AG | 43,656 | 76.79 | 3,352,344.24 |
| FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV | 40,074 | 12.76 | 511,344.24 |
| MICHELIN (CGDE)-B | 8,300 | 87.50 | 726,250.00 |
| NOKIAN RENKAAT OYJ | 5,578 | 32.97 | 183,906.66 |
| PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE PEF | 7,484 | 49.04 | 367,052.78 |
| PSA PEUGEOT CITROEN | 21,050 | 16.10 | 339,010.25 |
| RENAULT SA | 8,797 | 91.92 | 808,620.24 |
| VALEO | 3,548 | 138.90 | 492,817.20 |
| VOLKSWAGEN AG | 1,615 | 140.20 | 226,423.00 |
| VOLKSWAGEN AG PFD | 7,364 | 130.00 | 957,320.00 |
| ADIDAS AG | 9,550 | 89.03 | 850,236.50 |
| CHRISTIAN DIOR SE | 2,471 | 157.25 | 388,564.75 |
| HERMES INTERNATIONAL | 1,150 | 310.45 | 357,017.50 |
| HUGO BOSS AG | 3,209 | 76.19 | 244,493.71 |
| KERING | 3,490 | 156.00 | 544,440.00 |
| LUXOTTICA GROUP SPA | 7,912 | 59.05 | 467,203.60 |
| LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE | 12,810 | 145.00 | 1,857,450.00 |
| ACCOR SA | 9,735 | 39.03 | 380,005.72 |
| SODEXO | 4,408 | 90.50 | 398,924.00 |
| ALTICE NV -A W/I | 16,172 | 12.28 | 198,592.16 |
| ALTICE NV -B W/I | 4,127 | 12.75 | 52,639.88 |
| AXEL SPRINGER SE | 2,125 | 49.78 | 105,782.50 |
| EUTELSAT COMMUNICATIONS | 7,047 | 27.80 | 195,906.60 |
| JC DECAUX SA | 2,962 | 34.99 | 103,640.38 |
| KABEL DEUTSCHLAND HOLDINGS AG | 1,067 | 112.90 | 120,464.30 |
| LAGARDERE S.C.A. | 4,708 | 26.76 | 126,009.62 |

| | | | |
|---------------------------------------|---------|--------|--------------|
| NUMERICABLE-SFR | 4,599 | 32.72 | 150,479.28 |
| PROSIEBEN SAT.1 MEDIA SE-REG | 9,765 | 46.83 | 457,343.77 |
| PUBLICIS GROUPE | 8,304 | 60.05 | 498,655.20 |
| RELX NV | 45,187 | 15.21 | 687,520.20 |
| RTL GROUP | 1,967 | 75.90 | 149,295.30 |
| SES | 15,312 | 25.10 | 384,331.20 |
| TELENET GROUP HOLDINGS NV | 2,224 | 47.76 | 106,229.36 |
| WOLTERS KLUWER-CVA | 14,127 | 30.53 | 431,367.94 |
| INDITEX | 49,493 | 32.21 | 1,594,416.99 |
| CARREFOUR SA | 25,669 | 26.65 | 684,078.85 |
| CASINO GUICHARD PERRACHON | 2,725 | 44.00 | 119,900.00 |
| COLRUYT NV | 3,273 | 47.69 | 156,089.37 |
| DELHAIZE GROUP | 4,495 | 89.51 | 402,347.45 |
| DISTRIBUIDORA INTERNACIONAL | 29,663 | 5.41 | 160,536.15 |
| JERONIMO MARTINS SGPS S.A. | 11,930 | 11.65 | 139,044.15 |
| KONINKLIJKE AHOLD NV | 37,072 | 19.47 | 721,791.84 |
| METRO AG | 8,566 | 28.65 | 245,415.90 |
| ANHEUSER-BUSCH INBEV NV | 36,693 | 114.75 | 4,210,521.75 |
| DANONE | 26,321 | 61.93 | 1,630,059.53 |
| HEINEKEN HOLDING NV | 4,695 | 70.25 | 329,823.75 |
| HEINEKEN NV | 10,408 | 78.29 | 814,842.32 |
| KERRY GROUP PLC-A | 7,513 | 75.06 | 563,925.78 |
| PERNOD-RICARD SA | 9,604 | 104.15 | 1,000,256.60 |
| REMY COINTREAU | 1,273 | 65.02 | 82,770.46 |
| UNILEVER NV-CVA | 73,480 | 39.57 | 2,907,603.60 |
| BEIERSDORF AG | 4,377 | 82.68 | 361,890.36 |
| HENKEL AG & CO KGAA | 4,785 | 87.27 | 417,586.95 |
| HENKEL AG & CO KGAA | 8,169 | 102.00 | 833,238.00 |
| L'OREAL | 11,279 | 157.75 | 1,779,262.25 |
| ESSILOR INTERNATIONAL | 9,214 | 115.05 | 1,060,070.70 |
| FRESENIUS MEDICAL CARE AG AND CO.KGAA | 9,949 | 76.95 | 765,575.55 |
| FRESENIUS SE & CO KGAA | 16,923 | 64.86 | 1,097,625.78 |
| BAYER AG | 37,754 | 115.85 | 4,373,800.90 |
| GRIFOLS S.A. | 7,297 | 41.96 | 306,182.12 |
| MERCK KGAA | 5,594 | 87.93 | 491,880.42 |
| ORION OYJ | 4,336 | 31.29 | 135,673.44 |
| QIAGEN N.V. | 9,901 | 24.64 | 243,960.64 |
| SANOFI | 53,702 | 78.75 | 4,229,032.50 |
| UCB SA | 6,007 | 81.08 | 487,047.56 |
| ZALANDO SE | 4,200 | 36.13 | 151,746.00 |
| BANCA MONTE DEI PASCHI SIENA | 106,156 | 1.21 | 128,448.76 |
| BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA | 293,080 | 7.04 | 2,063,869.36 |

| | | | |
|------------------------------------|-----------|--------|--------------|
| BANCO COMERCIAL PORTUGUES-R | 2,086,788 | 0.05 | 106,634.86 |
| BANCO DE SABADELL SA | 214,482 | 1.69 | 362,474.58 |
| BANCO ESPIRITO SANTO,S.A(BES) | 187,906 | 0.10 | 18,790.60 |
| BANCO POPOLARE SOCIETA COOPERATIVA | 14,854 | 12.70 | 188,645.80 |
| BANCO POPULAR ESPANOL | 74,427 | 3.23 | 240,548.06 |
| BANCO SANTANDER SA | 653,425 | 4.70 | 3,073,711.20 |
| BANK OF IRELAND | 1,306,054 | 0.33 | 430,997.82 |
| BANKIA SA | 203,996 | 1.13 | 232,147.44 |
| BANKINTER,S.A. | 28,025 | 6.72 | 188,328.00 |
| BNP PARIBAS | 48,398 | 53.19 | 2,574,289.62 |
| CAIXABANK | 126,628 | 3.61 | 457,760.22 |
| COMMERZBANK AG | 46,702 | 9.47 | 442,688.25 |
| CREDIT AGRICOLE SA | 48,700 | 10.57 | 514,759.00 |
| ERSTE GROUP BANK AG | 11,920 | 28.30 | 337,336.00 |
| INTESA SANPAOLO | 580,505 | 3.08 | 1,792,599.44 |
| INTESA SANPAOLO-RSP | 35,545 | 2.84 | 100,947.80 |
| KBC GROUPE SA | 11,308 | 57.60 | 651,340.80 |
| NATIXIS | 41,035 | 5.16 | 211,986.81 |
| RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG | 6,210 | 13.82 | 85,822.20 |
| SOCIETE GENERALE | 33,124 | 42.91 | 1,421,516.46 |
| UNICREDIT SPA | 213,194 | 5.11 | 1,089,421.34 |
| UNIONE DI BANCHE ITALIANE SCPA | 38,951 | 6.17 | 240,522.42 |
| DEUTSCHE BANK AG -REG | 63,021 | 21.75 | 1,370,706.75 |
| DEUTSCHE BOERSE AG | 8,800 | 79.87 | 702,856.00 |
| EURAZEO | 1,835 | 62.14 | 114,026.90 |
| EXOR SPA | 4,723 | 41.05 | 193,879.15 |
| GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA | 3,396 | 76.21 | 258,809.16 |
| ING GROEP NV-CVA | 176,161 | 12.38 | 2,180,873.18 |
| MEDIOBANCA SPA | 26,522 | 8.73 | 231,669.67 |
| WENDEL | 1,155 | 107.95 | 124,682.25 |
| AEGON NV | 83,989 | 5.09 | 427,923.95 |
| AGEAS | 9,255 | 42.68 | 395,003.40 |
| ALLIANZ SE-REG | 20,836 | 161.95 | 3,374,390.20 |
| ASSICURAZIONI GENERALI | 54,245 | 16.88 | 915,655.60 |
| AXA SA | 87,647 | 24.97 | 2,188,983.82 |
| CNP ASSURANCES | 5,841 | 12.12 | 70,822.12 |
| HANNOVER RUECKVERSICHERUNG SE | 2,565 | 108.00 | 277,020.00 |
| MAPFRE SA | 43,669 | 2.37 | 103,495.53 |
| MUENCHENER RUECKVER AG-REG | 7,432 | 186.25 | 1,384,210.00 |
| NN GROUP NV | 10,315 | 31.50 | 324,922.50 |
| SAMPO OYJ-A SHS | 20,443 | 46.59 | 952,439.37 |
| SCOR SE | 7,073 | 34.58 | 244,619.70 |

| | | | |
|--------------------------------|---------|--------|--------------|
| UNIPOLSAI SPA | 49,963 | 2.28 | 114,115.49 |
| DEUTSCHE WOHNEN AG-BR | 16,186 | 25.05 | 405,540.23 |
| VONOVIA SE | 20,759 | 28.16 | 584,677.23 |
| AMADEUS IT HOLDING SA-A SHS | 20,344 | 39.70 | 807,758.52 |
| ATOS SE | 3,724 | 77.22 | 287,567.28 |
| CAP GEMINI SA | 7,368 | 85.48 | 629,816.64 |
| DASSAULT SYSTEMES SA | 5,686 | 72.96 | 414,850.56 |
| GEMALTO | 3,360 | 53.60 | 180,096.00 |
| SAP SE | 44,759 | 72.28 | 3,235,180.52 |
| UNITED INTERNET AG-REG SHARE | 5,350 | 50.33 | 269,265.50 |
| ALCATEL-LUCENT | 127,473 | 3.46 | 441,056.58 |
| INGENICO S.A. | 2,687 | 114.55 | 307,795.85 |
| NOKIA OYJ | 165,983 | 6.36 | 1,055,651.88 |
| DEUTSCHE TELEKOM AG-REG | 147,366 | 16.49 | 2,430,065.34 |
| ELISA OYJ | 5,882 | 34.80 | 204,693.60 |
| ILIAD SA | 1,087 | 216.50 | 235,335.50 |
| KONINKLIJKE KPN NV | 144,663 | 3.38 | 489,394.92 |
| ORANGE S.A. | 90,975 | 15.38 | 1,399,650.37 |
| PROXIMUS SA | 6,318 | 29.65 | 187,328.70 |
| TELECOM ITALIA SPA | 511,319 | 1.14 | 583,926.29 |
| TELECOM ITALIA-RNC | 281,876 | 0.92 | 259,748.73 |
| TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI | 23,592 | 5.03 | 118,856.49 |
| TELEFONICA S.A. | 204,195 | 10.37 | 2,118,523.12 |
| VIVENDI SA | 53,416 | 19.15 | 1,022,916.40 |
| E.ON SE | 90,831 | 8.40 | 763,434.55 |
| EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA | 102,777 | 3.15 | 323,747.55 |
| ELECTRICITE DE FRANCE(EDF) | 10,011 | 13.04 | 130,543.44 |
| ENAGAS | 9,716 | 26.63 | 258,785.66 |
| ENDESA S.A. | 14,071 | 18.59 | 261,650.24 |
| ENEL GREEN POWER SPA | 92,223 | 1.89 | 174,578.13 |
| ENEL SPA | 317,815 | 3.91 | 1,244,563.54 |
| ENGIE | 65,761 | 15.99 | 1,051,518.39 |
| FORTUM OYJ | 19,645 | 13.22 | 259,706.90 |
| GAS NATURAL SDG SA | 15,578 | 18.87 | 294,034.75 |
| IBERDROLA SA | 244,528 | 6.47 | 1,583,563.32 |
| RED ELECTRICA CORPORATION S.A. | 4,803 | 78.39 | 376,507.17 |
| RWE AG | 22,761 | 11.16 | 254,012.76 |
| SNAM SPA | 99,230 | 4.80 | 476,304.00 |
| SUEZ ENVIRONNEMENT SA | 14,573 | 17.03 | 248,178.19 |
| TERNA SPA | 65,557 | 4.69 | 307,724.55 |
| VEOLIA ENVIRONNEMENT | 20,789 | 21.54 | 447,899.00 |
| ASML HOLDING NV | 15,877 | 80.77 | 1,282,385.29 |

| | | | | | |
|------|--|------------|-------|------------------------------------|--|
| | INFINEON TECHNOLOGIES AG | 49,305 | 13.55 | 668,082.75 | |
| | STMICROELECTRONICS NV | 28,920 | 6.06 | 175,486.56 | |
| | ユーロ 小計 | 12,482,167 | | 152,685,779.15 (20,125,512,549) | |
| 英ポンド | AMEC FOSTER WHEELER PLC | 20,038 | 3.91 | 78,468.80 | |
| | BG GROUP PLC | 156,564 | 9.08 | 1,421,601.12 | |
| | BP PLC | 833,367 | 3.39 | 2,827,614.23 | |
| | PETROFAC LIMITED | 9,677 | 7.68 | 74,319.36 | |
| | ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS | 177,996 | 14.63 | 2,604,971.46 | |
| | ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS | 109,661 | 14.69 | 1,610,920.09 | |
| | ANGLO AMERICAN PLC | 59,787 | 2.78 | 166,596.47 | |
| | ANTOFAGASTA PLC | 19,439 | 4.16 | 80,924.55 | |
| | BHP BILLITON PLC | 94,858 | 7.17 | 680,321.57 | |
| | CRODA INTERNATIONAL PLC | 6,446 | 30.10 | 194,024.60 | |
| | FRESNILLO PLC | 11,248 | 6.59 | 74,124.32 | |
| | GLENCORE PLC | 562,016 | 0.80 | 454,446.13 | |
| | JOHNSON MATTHEY PLC | 8,781 | 26.19 | 229,974.39 | |
| | MONDI PLC | 17,394 | 13.24 | 230,296.56 | |
| | RANDGOLD RESOURCES LTD | 4,386 | 40.31 | 176,799.66 | |
| | REXAM PLC | 30,633 | 5.94 | 182,113.18 | |
| | RIO TINTO PLC | 56,451 | 18.62 | 1,051,399.87 | |
| | ASHTED GROUP PLC | 23,485 | 11.10 | 260,683.50 | |
| | BAE SYSTEMS PLC | 145,374 | 4.92 | 715,966.95 | |
| | BUNZL PLC | 15,459 | 18.41 | 284,600.19 | |
| | COBHAM PLC | 52,943 | 2.82 | 149,722.80 | |
| | IMI PLC | 11,445 | 8.47 | 96,996.37 | |
| | MEGGITT PLC | 36,073 | 3.62 | 130,656.40 | |
| | MELROSE INDUSTRIES PLC | 47,845 | 2.84 | 136,262.56 | |
| | ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC | 82,490 | 5.76 | 475,554.85 | |
| | ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC-C ENTITLEMENT | 8,082,420 | 0.00 | 8,082.42 | |
| | SMITHS GROUP PLC | 16,922 | 9.24 | 156,359.28 | |
| | TRAVIS PERKINS PLC | 10,751 | 19.27 | 207,171.77 | |
| | WEIR GROUP PLC/THE | 10,014 | 9.30 | 93,130.20 | |
| | WOLSELEY PLC | 11,740 | 36.51 | 428,627.40 | |
| | AGGREKO PLC | 12,848 | 8.93 | 114,732.64 | |
| | BABCOCK INTERNATIONAL GROUP PLC | 11,442 | 9.76 | 111,731.13 | |
| | CAPITA PLC | 31,057 | 11.83 | 367,404.31 | |
| | EXPERIAN PLC | 43,283 | 11.66 | 504,679.78 | |
| | G4S PLC | 66,661 | 2.17 | 144,987.67 | |
| | INTERTEK GROUP PLC | 6,990 | 27.15 | 189,778.50 | |
| | MERLIN ENTERTAINMENTS PLC | 33,608 | 4.41 | 148,379.32 | |
| | EASYJET PLC | 7,630 | 16.86 | 128,641.80 | |

| | | | |
|-----------------------------------|-----------|-------|--------------|
| ROYAL MAIL PLC | 42,103 | 4.43 | 186,516.29 |
| GKN PLC | 75,574 | 2.96 | 223,850.18 |
| BURBERRY GROUP PLC | 18,883 | 11.88 | 224,330.04 |
| PERSIMMON PLC | 14,611 | 19.45 | 284,183.95 |
| TAYLOR WIMPEY PLC | 151,898 | 1.95 | 297,112.48 |
| CARNIVAL PLC | 8,322 | 36.48 | 303,586.56 |
| COMPASS GROUP PLC | 73,119 | 11.32 | 827,707.08 |
| INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC | 10,045 | 25.23 | 253,435.35 |
| TUI AG-DI | 21,671 | 12.12 | 262,652.52 |
| WHITBREAD PLC | 8,382 | 43.91 | 368,053.62 |
| WILLIAM HILL PLC | 41,877 | 3.80 | 159,300.10 |
| ITV PLC | 177,733 | 2.63 | 468,859.65 |
| PEARSON PLC | 38,947 | 7.48 | 291,518.29 |
| RELX PLC | 51,390 | 11.59 | 595,610.10 |
| SKY PLC | 48,018 | 10.80 | 518,594.40 |
| WPP PLC | 57,526 | 15.10 | 868,642.60 |
| DIXONS CARPHONE PLC | 41,564 | 4.77 | 198,301.84 |
| KINGFISHER PLC | 104,645 | 3.24 | 339,049.80 |
| MARKS & SPENCER GROUP PLC | 71,554 | 4.51 | 322,994.75 |
| NEXT PLC | 6,615 | 72.75 | 481,241.25 |
| SPORTS DIRECT INTERNATIONAL | 11,278 | 5.70 | 64,284.60 |
| SAINSBURY (J) PLC | 64,189 | 2.55 | 163,810.32 |
| TESCO PLC | 382,885 | 1.43 | 549,248.53 |
| WILLIAM MORRISON SUPERMARKETS PLC | 92,309 | 1.46 | 135,417.30 |
| ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC | 15,985 | 33.27 | 531,820.95 |
| BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC | 84,003 | 36.66 | 3,079,969.99 |
| COCA-COLA HBC AG-CDI | 8,704 | 15.00 | 130,560.00 |
| DIAGEO PLC | 115,295 | 18.07 | 2,083,957.12 |
| IMPERIAL TOBACCO GROUP PLC | 43,082 | 34.63 | 1,491,929.66 |
| SABMILLER PLC | 44,506 | 40.48 | 1,801,825.41 |
| TATE & LYLE PLC | 18,101 | 5.89 | 106,614.89 |
| UNILEVER PLC | 58,101 | 28.21 | 1,639,029.21 |
| BARRATT DEVELOPMENTS PLC | 47,273 | 6.04 | 285,528.92 |
| RECKITT BENCKISER GROUP PLC | 28,866 | 61.28 | 1,768,908.48 |
| SMITH & NEPHEW PLC | 42,313 | 11.72 | 495,908.36 |
| ASTRAZENECA PLC | 57,304 | 43.71 | 2,505,044.36 |
| GLAXOSMITHKLINE PLC | 219,198 | 13.34 | 2,924,101.32 |
| SHIRE PLC | 26,463 | 44.20 | 1,169,664.60 |
| BARCLAYS PLC | 755,347 | 2.17 | 1,643,635.07 |
| HSBC HOLDINGS PLC | 883,085 | 5.29 | 4,673,285.82 |
| LLOYDS BANKING GROUP PLC | 2,592,352 | 0.71 | 1,841,606.86 |
| ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP | 157,044 | 2.94 | 461,709.36 |

| | | | | |
|--------|---------------------------------|------------|----------|-----------------------------------|
| | STANDARD CHARTERED PLC | 150,529 | 5.51 | 830,317.96 |
| | 3I GROUP PLC | 42,520 | 4.66 | 198,440.84 |
| | ABERDEEN ASSET MGMT PLC | 49,855 | 2.87 | 143,233.41 |
| | HARGREAVES LANSDOWN PLC | 11,178 | 14.67 | 163,981.26 |
| | ICAP PLC | 27,845 | 5.04 | 140,338.80 |
| | INVESTEC PLC | 24,264 | 4.62 | 112,123.94 |
| | LONDON STOCK EXCHANGE GROUP PLC | 13,647 | 26.98 | 368,196.06 |
| | PROVIDENT FINANCIAL PLC | 7,000 | 32.40 | 226,800.00 |
| | SCHRODERS PLC | 5,835 | 29.10 | 169,798.50 |
| | ADMIRAL GROUP PLC | 8,557 | 16.55 | 141,618.35 |
| | AVIVA PLC | 183,735 | 5.04 | 926,024.40 |
| | DIRECT LINE INSURANCE GROUP | 63,880 | 4.04 | 258,586.24 |
| | LEGAL & GENERAL GROUP PLC | 268,478 | 2.61 | 702,875.40 |
| | OLD MUTUAL PLC | 223,346 | 1.71 | 383,708.42 |
| | PRUDENTIAL PLC | 116,121 | 14.89 | 1,729,041.69 |
| | RSA INSURANCE GROUP PLC | 49,032 | 4.28 | 209,905.99 |
| | ST JAMES'S PLACE PLC | 22,324 | 9.73 | 217,324.14 |
| | STANDARD LIFE PLC | 86,953 | 3.74 | 325,552.03 |
| | AUTO TRADER GROUP PLC | 36,500 | 4.21 | 153,665.00 |
| | SAGE GROUP PLC/THE | 46,719 | 5.90 | 275,642.10 |
| | BT GROUP PLC | 382,693 | 4.58 | 1,753,882.01 |
| | INMARSAT PLC | 20,829 | 11.08 | 230,785.32 |
| | VODAFONE GROUP PLC | 1,201,001 | 2.11 | 2,537,715.11 |
| | CENTRICA PLC | 232,720 | 2.12 | 493,366.40 |
| | NATIONAL GRID PLC | 170,990 | 9.14 | 1,563,532.56 |
| | SEVERN TRENT PLC | 9,897 | 21.31 | 210,905.07 |
| | SSE PLC | 45,022 | 14.85 | 668,576.70 |
| | UNITED UTILITIES GROUP PLC | 29,939 | 9.14 | 273,792.15 |
| | ARM HOLDINGS PLC | 64,682 | 10.19 | 659,109.58 |
| | 英ポンド 小計 | 21,347,473 | | 70,085,307.61 (12,674,927,881) |
| スイスフラン | TRANSOCEAN LTD | 17,883 | 12.37 | 221,212.71 |
| | EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG | 421 | 419.00 | 176,399.00 |
| | GIVAUDAN-REG | 404 | 1,763.00 | 712,252.00 |
| | LAFARGEHOLCIM LTD | 19,645 | 48.57 | 954,157.65 |
| | SIKA AG | 96 | 3,540.00 | 339,840.00 |
| | SYNGENTA AG | 4,141 | 374.50 | 1,550,804.50 |
| | ABB LTD | 98,432 | 17.48 | 1,720,591.36 |
| | GEBERIT AG-REG | 1,786 | 333.00 | 594,738.00 |
| | SCHINDLER HOLDING AG-REG | 819 | 164.50 | 134,725.50 |
| | SCHINDLER HOLDING-PART CERT | 2,055 | 165.10 | 339,280.50 |
| | SULZER AG | 478 | 95.05 | 45,433.90 |

| | | | | |
|----------------|------------------------------------|---------|-----------|----------------------------------|
| | ADECCO SA-REG | 7,984 | 66.85 | 533,730.40 |
| | SGS SA | 247 | 1,862.00 | 459,914.00 |
| | KUEHNE&NAGEL INTL AG-REG | 2,501 | 134.80 | 337,134.80 |
| | CIE FINANCIERE RICHEMONT SA-REGD A | 23,843 | 70.90 | 1,690,468.70 |
| | THE SWATCH GROUP AG-B | 1,413 | 336.90 | 476,039.70 |
| | THE SWATCH GROUP AG-REG | 2,516 | 65.90 | 165,804.40 |
| | DUFREY AG-REG | 1,638 | 116.70 | 191,154.60 |
| | ARYZTA AG | 4,011 | 47.66 | 191,164.26 |
| | BARRY CALLEBAUT AG-REG | 75 | 1,054.00 | 79,050.00 |
| | LINDT & SPRUENGLI AG | 45 | 6,075.00 | 273,375.00 |
| | LINDT & SPRUENGLI AG-REG | 5 | 73,370.00 | 366,850.00 |
| | NESTLE SA-REGISTERED | 144,157 | 73.05 | 10,530,668.85 |
| | SONOVA HOLDING AG | 2,594 | 123.60 | 320,618.40 |
| | ACTELION LTD | 4,637 | 134.90 | 625,531.30 |
| | GALENICA AG-REG | 170 | 1,537.00 | 261,290.00 |
| | LONZA GROUP AG-REG | 2,230 | 157.00 | 350,110.00 |
| | NOVARTIS AG-REG SHS | 102,807 | 84.75 | 8,712,893.25 |
| | ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN | 31,927 | 268.90 | 8,585,170.30 |
| | CREDIT SUISSE GROUP AG-REG | 83,165 | 21.33 | 1,773,909.45 |
| | JULIUS BAER GROUP LTD | 10,048 | 45.88 | 461,002.24 |
| | PARGESA HOLDING SA-BR | 975 | 61.90 | 60,352.50 |
| | PARTNERS GROUP HOLDING AG | 813 | 357.50 | 290,647.50 |
| | UBS GROUP AG | 164,307 | 19.23 | 3,159,623.61 |
| | BALOISE HOLDING AG | 2,242 | 126.60 | 283,837.20 |
| | SWISS LIFE HOLDING AG | 1,353 | 265.70 | 359,492.10 |
| | SWISS RE AG | 16,023 | 97.60 | 1,563,844.80 |
| | ZURICH INSURANCE GROUP AG | 6,863 | 251.70 | 1,727,417.10 |
| | SWISS PRIME SITE-REG | 2,983 | 76.85 | 229,243.55 |
| | SWISSCOM AG-REG | 1,198 | 492.20 | 589,655.60 |
| | スイスフラン 小計 | 768,930 | | 51,439,428.73 (6,288,470,162) |
| スウェーデンク ローナ | LUNDIN PETROLEUM AB | 9,278 | 121.60 | 1,128,204.80 |
| | BOLIDEN AB | 12,521 | 138.10 | 1,729,150.10 |
| | ALFA LAVAL AB | 13,757 | 150.70 | 2,073,179.90 |
| | ASSA ABLOY AB-B | 46,371 | 176.10 | 8,165,933.10 |
| | ATLAS COPCO AB-A SHS | 30,896 | 206.70 | 6,386,203.20 |
| | ATLAS COPCO AB-B SHS | 16,577 | 193.30 | 3,204,334.10 |
| | SANDVIK AB | 45,532 | 73.00 | 3,323,836.00 |
| | SKANSKA AB-B SHS | 18,229 | 161.80 | 2,949,452.20 |
| | SKF AB-B SHARES | 18,017 | 135.70 | 2,444,906.90 |
| | VOLVO AB-B SHS | 69,691 | 78.00 | 5,435,898.00 |
| | SECURITAS AB-B SHS | 12,949 | 126.10 | 1,632,868.90 |

| | | | | | |
|---------------|------------------------------------|-----------|----------|-----------------------------------|--|
| | ELECTROLUX AB-SER B | 11,157 | 200.70 | 2,239,209.90 | |
| | HUSQVARNA AB-B SHS | 18,159 | 55.55 | 1,008,732.45 | |
| | HENNES & MAURITZ AB-B SHS | 43,489 | 299.70 | 13,033,653.30 | |
| | ICA GRUPPEN AB | 3,550 | 306.40 | 1,087,720.00 | |
| | SWEDISH MATCH AB | 8,874 | 292.80 | 2,598,307.20 | |
| | SVENSKA CELLULOSA AB-B SHS | 25,760 | 244.10 | 6,288,016.00 | |
| | GETINGE AB-B SHS | 9,231 | 214.90 | 1,983,741.90 | |
| | NORDEA BANK AB | 139,849 | 91.65 | 12,817,160.85 | |
| | SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN AB-A | 69,802 | 87.00 | 6,072,774.00 | |
| | SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS | 65,961 | 110.90 | 7,315,074.90 | |
| | SWEDBANK AB - A SHARES | 41,709 | 185.50 | 7,737,019.50 | |
| | INDUSTRIVARDEN AB-C SHS | 5,924 | 142.50 | 844,170.00 | |
| | INVESTOR AB-B SHS | 20,877 | 311.80 | 6,509,448.60 | |
| | KINNEVIK INVESTMENT AB-B | 11,257 | 256.40 | 2,886,294.80 | |
| | ERICSSON LM-B SHS | 138,198 | 78.65 | 10,869,272.70 | |
| | HEXAGON AB-B SHS | 11,565 | 310.90 | 3,595,558.50 | |
| | MILLICOM INTL CELLULAR-SDR | 3,357 | 486.00 | 1,631,502.00 | |
| | TELE2 AB-B SHS | 13,516 | 81.65 | 1,103,581.40 | |
| | TELIASONERA AB | 115,646 | 41.78 | 4,831,689.88 | |
| | スウェーデンクローナ 小計 | 1,051,699 | | 132,926,895.08 (1,884,903,372) | |
| ノルウェーク ローネ | STATOIL ASA | 50,036 | 120.80 | 6,044,348.80 | |
| | NORSK HYDRO ASA | 55,126 | 30.65 | 1,689,611.90 | |
| | YARA INTERNATIONAL ASA | 8,259 | 376.00 | 3,105,384.00 | |
| | SCHIBSTED ASA | 4,181 | 285.20 | 1,192,421.20 | |
| | SCIBSTED ASA-B SHS | 4,063 | 275.00 | 1,117,325.00 | |
| | ORKLA ASA | 36,819 | 68.45 | 2,520,260.55 | |
| | DNB ASA | 45,573 | 106.90 | 4,871,753.70 | |
| | GJENSIDIGE FORSIKRING ASA | 9,626 | 139.20 | 1,339,939.20 | |
| | TELENOR ASA | 32,781 | 145.40 | 4,766,357.40 | |
| | ノルウェークローネ 小計 | 246,464 | | 26,647,401.75 (369,332,988) | |
| デンマークク ローネ | CHR HANSEN HOLDING A/S | 4,400 | 422.30 | 1,858,120.00 | |
| | NOVOZYMES A/S-B SHARES | 10,355 | 327.60 | 3,392,298.00 | |
| | VESTAS WIND SYSTEMS A/S | 9,726 | 477.50 | 4,644,165.00 | |
| | ISS A/S | 7,233 | 242.30 | 1,752,555.90 | |
| | A P MOLLER-MAERSK A/S-A | 153 | 8,710.00 | 1,332,630.00 | |
| | A P MOLLER-MAERSK A/S-B | 334 | 8,805.00 | 2,940,870.00 | |
| | DSV A/S | 8,652 | 264.20 | 2,285,858.40 | |
| | PANDORA A/S | 4,768 | 825.50 | 3,935,984.00 | |
| | CARLSBERG AS-B | 5,061 | 605.00 | 3,061,905.00 | |
| | COLOPLAST-B | 5,041 | 538.00 | 2,712,058.00 | |

| | | | | |
|---------------------------|--------------------------------|---------|--------------|----------------------------------|
| | WILLIAM DEMANT HOLDING | 864 | 657.50 | 568,080.00 |
| | NOVO NORDISK A/S-B | 89,489 | 390.70 | 34,963,352.30 |
| | DANSKE BANK A/S | 32,814 | 180.70 | 5,929,489.80 |
| | TRYG A/S | 5,005 | 130.50 | 653,152.50 |
| | TDC A/S | 39,176 | 33.02 | 1,293,591.52 |
| | デンマーククローネ 小計 | 223,071 | | 71,324,110.42 (1,259,583,790) |
| オーストラリア ドル | CALTEX AUSTRALIA LIMITED | 11,155 | 35.90 | 400,464.50 |
| | OIL SEARCH LTD | 62,482 | 6.03 | 376,766.46 |
| | ORIGIN ENERGY LIMITED | 74,346 | 4.47 | 332,326.62 |
| | SANTOS LTD | 77,838 | 3.46 | 269,319.48 |
| | WOODSIDE PETROLEUM LTD | 34,805 | 26.76 | 931,381.80 |
| | ALUMINA LTD | 106,977 | 1.04 | 111,790.96 |
| | AMCOR LIMITED | 51,278 | 13.36 | 685,074.08 |
| | BHP BILLITON LTD | 146,220 | 16.87 | 2,466,731.40 |
| | BORAL LIMITED | 36,380 | 5.58 | 203,000.40 |
| | FORTESCUE METALS GROUP LIMITED | 50,954 | 1.72 | 87,895.65 |
| | ILUKA RESOURCES LIMITED | 22,902 | 5.35 | 122,525.70 |
| | INCITEC PIVOT LTD | 85,406 | 3.80 | 324,542.80 |
| | JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC | 19,258 | 16.68 | 321,223.44 |
| | NEWCREST MINING LIMITED | 33,185 | 12.40 | 411,494.00 |
| | ORICA LIMITED | 17,233 | 15.06 | 259,528.98 |
| | RIO TINTO LIMITED | 19,122 | 42.46 | 811,920.12 |
| | SOUTH32 LTD | 251,285 | 1.04 | 262,592.82 |
| | CIMIC GROUP LTD | 4,188 | 23.66 | 99,088.08 |
| | BRAMBLES LIMITED | 73,679 | 11.07 | 815,626.53 |
| | SEEK LIMITED | 16,538 | 14.50 | 239,801.00 |
| | ASCIANO LTD | 25,174 | 8.76 | 220,524.24 |
| | AURIZON HOLDINGS LTD | 92,162 | 4.91 | 452,515.42 |
| | QANTAS AIRWAYS LIMITED | 24,631 | 3.91 | 96,307.21 |
| | ARISTOCRAT LEISURE LTD | 23,911 | 10.10 | 241,501.10 |
| | CROWN RESORTS LTD | 16,142 | 11.60 | 187,247.20 |
| | FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD | 2,650 | 37.19 | 98,553.50 |
| | TABCORP HOLDINGS LIMITED | 36,322 | 4.54 | 164,901.88 |
| | TATTS GROUP LTD | 66,783 | 4.24 | 283,159.92 |
| | REA GROUP LTD | 2,708 | 52.88 | 143,199.04 |
| | HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD | 23,253 | 3.97 | 92,314.41 |
| WESFARMERS LIMITED | 51,627 | 39.92 | 2,060,949.84 | |
| WOOLWORTHS LIMITED | 55,889 | 23.57 | 1,317,303.73 | |
| COCA-COLA AMATIL LIMITED | 26,498 | 9.00 | 238,482.00 | |
| TREASURY WINE ESTATES LTD | 35,541 | 8.26 | 293,568.66 | |
| COCHLEAR LIMITED | 2,517 | 94.58 | 238,057.86 | |

| | | | | |
|------------|------------------------------------|-----------|--------|----------------------------------|
| | HEALTHSCOPE LTD | 88,691 | 2.61 | 231,483.51 |
| | RAMSAY HEALTH CARE LTD | 6,579 | 65.20 | 428,950.80 |
| | SONIC HEALTHCARE LTD | 18,440 | 17.95 | 330,998.00 |
| | CSL LIMITED | 20,831 | 103.53 | 2,156,633.43 |
| | AUST AND NZ BANKING GROUP LT | 131,402 | 26.48 | 3,479,524.96 |
| | BANK OF QUEENSLAND LIMITED | 14,056 | 13.55 | 190,458.80 |
| | BENDIGO AND ADELAIDE BANK | 18,619 | 11.24 | 209,277.56 |
| | COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL | 76,818 | 81.57 | 6,266,044.26 |
| | NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD | 119,938 | 28.78 | 3,451,815.64 |
| | WESTPAC BANKING CORPORATION | 151,606 | 32.28 | 4,893,841.68 |
| | ASX LTD | 7,982 | 40.64 | 324,388.48 |
| | CHALLENGER FINANCIAL SERVICE | 30,000 | 8.20 | 246,000.00 |
| | MACQUARIE GROUP LTD | 13,452 | 78.30 | 1,053,291.60 |
| | PLATINUM ASSET MANAGEMENT | 7,772 | 7.72 | 59,999.84 |
| | AMP LIMITED | 139,602 | 5.53 | 771,999.06 |
| | INSURANCE AUSTRALIA GROUP LT | 103,748 | 5.32 | 551,939.36 |
| | MEDIBANK PRIVATE LTD | 114,840 | 2.14 | 245,757.60 |
| | QBE INSURANCE GROUP LIMITED | 64,545 | 11.91 | 768,730.95 |
| | SUNCORP GROUP LTD | 57,325 | 11.48 | 658,091.00 |
| | COMPUTERSHARE LIMITED | 21,847 | 11.35 | 247,963.45 |
| | TELSTRA CORPORATION LIMITED | 195,492 | 5.48 | 1,071,296.16 |
| | TPG TELECOM LTD | 13,145 | 10.18 | 133,816.10 |
| | AGL ENERGY LIMITED | 29,931 | 17.47 | 522,894.57 |
| | AUSNET SERVICES | 55,812 | 1.42 | 79,532.10 |
| | オーストラリアドル 小計 | 3,183,512 | | 44,036,409.74 (3,822,800,729) |
| ニュージーランドドル | FLETCHER BUILDING LTD | 34,160 | 7.00 | 239,120.00 |
| | AUCKLAND INTL AIRPORT LTD | 40,835 | 5.31 | 216,833.85 |
| | RYMAN HEALTHCARE LIMITED | 15,480 | 8.35 | 129,258.00 |
| | SPARK NEW ZEALAND LIMITED | 82,677 | 3.14 | 260,019.16 |
| | CONTACT ENERGY LIMITED | 35,357 | 4.70 | 166,177.90 |
| | MERIDIAN ENERGY LTD | 46,571 | 2.30 | 107,113.30 |
| | MIGHTY RIVER POWER | 40,157 | 2.78 | 111,636.46 |
| | ニュージーランドドル 小計 | 295,237 | | 1,230,158.67 (100,331,741) |
| 香港ドル | NWS HOLDINGS LTD | 67,500 | 11.74 | 792,450.00 |
| | CATHAY PACIFIC AIRWAYS | 48,000 | 13.04 | 625,920.00 |
| | MTR CORPORATION | 68,000 | 36.70 | 2,495,600.00 |
| | LI & FUNG LTD | 267,200 | 5.01 | 1,338,672.00 |
| | TECHTRONIC INDUSTRIES CO | 64,500 | 30.90 | 1,993,050.00 |
| | YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG | 40,000 | 25.15 | 1,006,000.00 |
| | GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LIMITED | 100,000 | 23.55 | 2,355,000.00 |

| | | | | | |
|----------|--|-----------|--------|-----------------------------------|--|
| | MGM CHINA HOLDINGS LTD | 44,000 | 9.68 | 425,920.00 | |
| | SANDS CHINA LTD | 112,000 | 26.25 | 2,940,000.00 | |
| | SHANGRI-LA ASIA LTD. | 64,000 | 6.88 | 440,320.00 | |
| | SJM HOLDINGS LIMITED | 92,000 | 5.32 | 489,440.00 | |
| | WYNN MACAU LTD | 78,000 | 9.04 | 705,120.00 | |
| | WH GROUP LIMITED | 257,000 | 4.00 | 1,028,000.00 | |
| | BANK OF EAST ASIA | 53,020 | 27.15 | 1,439,493.00 | |
| | BOC HONG KONG HOLDINGS LTD | 159,500 | 23.65 | 3,772,175.00 | |
| | HANG SENG BANK LTD | 35,400 | 144.60 | 5,118,840.00 | |
| | CHEUNG KONG PROPERTY HOLDING | 121,924 | 50.90 | 6,205,931.60 | |
| | CK HUTCHISON HOLDINGS LTD | 123,924 | 103.00 | 12,764,172.00 | |
| | FIRST PACIFIC COMPANY | 86,000 | 4.87 | 418,820.00 | |
| | HONG KONG EXCHANGES & CLEARING LIMITED | 51,800 | 198.90 | 10,303,020.00 | |
| | AIA GROUP LTD | 545,400 | 46.65 | 25,442,910.00 | |
| | HANG LUNG PROPERTIES LTD | 105,000 | 17.74 | 1,862,700.00 | |
| | HENDERSON LAND DEVELOPMENT | 56,232 | 47.75 | 2,685,078.00 | |
| | HYSAN DEVELOPMENT CO | 29,000 | 31.85 | 923,650.00 | |
| | KERRY PROPERTIES LTD | 27,500 | 21.25 | 584,375.00 | |
| | NEW WORLD DEVELOPMENT | 259,333 | 7.51 | 1,947,590.83 | |
| | SINO LAND CO | 124,200 | 11.62 | 1,443,204.00 | |
| | SUN HUNG KAI PROPERTIES | 77,000 | 94.65 | 7,288,050.00 | |
| | SWIRE PACIFIC LTD 'A' | 25,000 | 84.75 | 2,118,750.00 | |
| | SWIRE PROPERTIES LIMITED | 51,400 | 22.45 | 1,153,930.00 | |
| | WHARF HOLDINGS LTD | 65,000 | 42.50 | 2,762,500.00 | |
| | WHEELLOCK&COMPANY LTD | 46,000 | 31.65 | 1,455,900.00 | |
| | PCCW LIMITED | 172,000 | 4.59 | 789,480.00 | |
| | CHEUNG KONG INFRASTRUCTURE | 27,000 | 71.05 | 1,918,350.00 | |
| | CLP HOLDINGS LTD | 84,600 | 64.75 | 5,477,850.00 | |
| | HK ELECTRIC INVESTMENTS-SS | 148,000 | 6.38 | 944,240.00 | |
| | HONG KONG & CHINA GAS | 312,074 | 14.84 | 4,631,178.16 | |
| | POWER ASSETS HOLDINGS LIMITED | 61,500 | 69.90 | 4,298,850.00 | |
| | ASM PACIFIC TECHNOLOGY | 12,200 | 58.00 | 707,600.00 | |
| | 香港ドル 小計 | 4,162,207 | | 125,094,129.59 (1,957,723,128) | |
| シンガポールドル | KEPPEL CORP LTD | 65,600 | 6.51 | 427,056.00 | |
| | NOBLE GROUP LTD | 245,400 | 0.42 | 104,295.00 | |
| | SEBACORP INDUSTRIES LTD | 42,020 | 3.05 | 128,161.00 | |
| | SEBACORP MARINE LTD | 37,100 | 1.77 | 65,852.50 | |
| | SINGAPORE TECHNOLOGIES ENG | 64,300 | 2.93 | 188,399.00 | |
| | YANGZIJANG SHIPBUILDING HOLDINGS LTD | 90,000 | 1.07 | 96,750.00 | |
| | COMFORTDELGRO CORP LTD | 107,000 | 2.98 | 318,860.00 | |
| | SINGAPORE AIRLINES LTD | 24,266 | 11.10 | 269,352.60 | |

| | | | | | |
|-----------|--|------------|--------|--------------------------------------|--|
| | GENTING SINGAPORE PLC | 258,200 | 0.76 | 196,232.00 | |
| | SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD | 65,950 | 3.93 | 259,183.50 | |
| | JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD | 5,500 | 34.88 | 191,840.00 | |
| | GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD | 353,600 | 0.31 | 111,384.00 | |
| | WILMAR INTERNATIONAL LTD | 85,700 | 2.88 | 246,816.00 | |
| | DBS GROUP HOLDINGS LTD | 78,100 | 16.33 | 1,275,373.00 | |
| | OVERSEA-CHINESE BANKING CORP | 135,100 | 8.68 | 1,172,668.00 | |
| | UNITED OVERSEAS BANK LTD | 59,700 | 19.10 | 1,140,270.00 | |
| | SINGAPORE EXCHANGE LTD | 38,700 | 7.65 | 296,055.00 | |
| | CAPITALAND LTD | 122,300 | 3.25 | 397,475.00 | |
| | CITY DEVELOPMENTS LTD | 21,000 | 7.59 | 159,390.00 | |
| | GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES LIMITED | 134,400 | 2.06 | 276,864.00 | |
| | UOL GROUP LIMITED | 18,800 | 6.08 | 114,304.00 | |
| | SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS | 366,915 | 3.76 | 1,379,600.40 | |
| | STARHUB LIMITED | 24,500 | 3.59 | 87,955.00 | |
| | シンガポールドル 小計 | 2,444,151 | | 8,904,136.00 (764,598,158) | |
| イスラエルシュケル | DELEK GROUP LTD | 213 | 752.20 | 160,218.60 | |
| | ISRAEL CHEMICALS LIMITED | 20,822 | 16.30 | 339,398.60 | |
| | TEVA PHARMACEUTICAL IND LTD | 38,995 | 253.00 | 9,865,735.00 | |
| | BANK HAPOLIM BM | 53,151 | 19.48 | 1,035,381.48 | |
| | BANK LEUMI LE-ISRAEL | 64,754 | 13.31 | 861,875.74 | |
| | MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD | 4,453 | 46.04 | 205,016.12 | |
| | AZRIELI GROUP | 1,863 | 140.00 | 260,820.00 | |
| | NICE SYSTEMS LTD | 2,554 | 224.60 | 573,628.40 | |
| | BEZEQ ISRAELI TELECOMMUNICATION CORP LTD | 96,068 | 8.10 | 778,342.93 | |
| | イスラエルシュケル 小計 | 282,873 | | 14,080,416.87 (438,464,181) | |
| | 合 計 | 62,699,027 | | 154,792,503,533 (154,792,503,533) | |

(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 |
|------------|----------|----------|------------|
| 米ドル | 株式 609銘柄 | 61.0% | 64.4% |
| カナダドル | 株式 91銘柄 | 3.3% | 3.5% |
| ユーロ | 株式 233銘柄 | 12.3% | 13.0% |
| 英ポンド | 株式 109銘柄 | 7.8% | 8.2% |
| スイスフラン | 株式 40銘柄 | 3.8% | 4.1% |
| スウェーデンクローナ | 株式 30銘柄 | 1.2% | 1.2% |
| ノルウェークローネ | 株式 9銘柄 | 0.2% | 0.2% |
| デンマーククローネ | 株式 15銘柄 | 0.8% | 0.8% |
| オーストラリアドル | 株式 59銘柄 | 2.3% | 2.5% |

| | | | | |
|------------|----|------|------|------|
| ニュージーランドドル | 株式 | 7銘柄 | 0.1% | 0.1% |
| 香港ドル | 株式 | 39銘柄 | 1.2% | 1.3% |
| シンガポールドル | 株式 | 23銘柄 | 0.5% | 0.5% |
| イスラエルシケル | 株式 | 9銘柄 | 0.3% | 0.3% |

(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 | 米ドル | AMERICAN CAPITAL AGENCY CORP | 15,293 | 267,627.50 | |
| | | AMERICAN TOWER CORP | 19,334 | 1,828,996.40 | |
| | | ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC | 45,539 | 432,165.11 | |
| | | AVALONBAY COMMUNITIES INC | 5,973 | 1,064,448.33 | |
| | | BOSTON PROPERTIES INC | 6,745 | 857,154.60 | |
| | | BRIXMOR PROPERTY GROUP INC | 7,861 | 196,996.66 | |
| | | CAMDEN PROPERTY TRUST | 4,186 | 312,610.48 | |
| | | DIGITAL REALTY TRUST INC | 5,946 | 444,760.80 | |
| | | DUKE REALTY CORP | 16,643 | 346,673.69 | |
| | | EQUITY RESIDENTIAL | 16,173 | 1,292,222.70 | |
| | | ESSEX PROPERTY TRUST INC | 3,011 | 709,000.17 | |
| | | EXTRA SPACE STORAGE INC | 5,203 | 456,094.98 | |
| | | FEDERAL REALTY INVESTMENT TRUST | 3,095 | 455,707.80 | |
| | | GENERAL GROWTH PROPERTIES | 26,153 | 685,731.66 | |
| | | HCP, INC. | 20,947 | 759,957.16 | |
| | | HOST HOTELS AND RESORTS INC | 34,373 | 526,938.09 | |
| | | HUTCHISON PORT HOLDINGS TRUST | 283,000 | 148,575.00 | |
| | | IRON MOUNTAIN INC | 9,338 | 249,978.26 | |
| | | KIMCO REALTY CORPORATION | 19,336 | 498,482.08 | |
| | | LIBERTY PROPERTY TRUST | 7,065 | 217,813.95 | |
| | | MACERICH COMPANY/THE | 6,260 | 485,212.60 | |
| | | PLUM CREEK TIMBER COMPANY | 8,260 | 382,851.00 | |
| | | PROLOGIS INC | 23,132 | 964,373.08 | |
| | | PUBLIC STORAGE | 6,743 | 1,677,253.82 | |
| | | REALTY INCOME CORPORATION | 10,031 | 512,383.48 | |
| | | REGENCY CENTERS CORP | 4,147 | 278,056.35 | |
| | | SIMON PROPERTY GROUP INC | 14,081 | 2,682,712.12 | |
| | | SL GREEN REALTY CORP | 4,370 | 481,661.40 | |
| | | UDR INC | 12,366 | 449,627.76 | |
| | | VENTAS INC | 15,512 | 836,407.04 | |
| VEREIT INC | 41,004 | 332,542.44 | | | |
| VORNADO REALTY TRUST | 7,967 | 776,782.50 | | | |
| WELLTOWER INC | 16,318 | 1,064,749.50 | | | |
| | | | 725,405 | 22,676,548.51 | |

| | | | |
|-----------|---------------------------------------|-----------|-------------------------------|
| | 米ドル 小計 | | (2,750,211,803) |
| カナダドル | H&R REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 4,711 | 94,691.10 |
| | RIOCAN REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 6,847 | 169,805.60 |
| | SMART REAL ESTATE INVESTMENT | 4,057 | 126,943.53 |
| | カナダドル 小計 | 15,615 | 391,440.23 (34,016,155) |
| ユーロ | FONCIERE DES REGIONS | 1,550 | 126,712.50 |
| | GECINA SA | 1,519 | 173,317.90 |
| | ICADE | 1,873 | 115,564.10 |
| | KLEPIERRE | 9,384 | 379,019.76 |
| | UNIBAIL-RODAMCO SE | 4,575 | 1,068,720.00 |
| | ユーロ 小計 | 18,901 | 1,863,334.26 (245,606,088) |
| 英ポンド | BRITISH LAND CO PLC | 43,052 | 337,097.16 |
| | HAMMERSON PLC | 37,833 | 224,917.18 |
| | INTU PROPERTIES PLC | 38,514 | 120,972.47 |
| | LAND SECURITIES GROUP PLC | 35,900 | 420,389.00 |
| | SEGRO PLC | 36,381 | 154,910.29 |
| | 英ポンド 小計 | 191,680 | 1,258,286.10 (227,561,041) |
| オーストラリアドル | APA GROUP | 53,427 | 451,992.42 |
| | DEXUS PROPERTY GROUP | 42,722 | 328,532.18 |
| | DUET GROUP | 115,000 | 267,950.00 |
| | GOODMAN GROUP | 83,175 | 523,170.75 |
| | GPT GROUP | 74,297 | 355,882.63 |
| | LENDLEASE GROUP | 27,382 | 369,930.82 |
| | MIRVAC GROUP | 186,000 | 368,280.00 |
| | SCENTRE GROUP | 238,066 | 985,593.24 |
| | STOCKLAND | 107,141 | 448,920.79 |
| | SYDNEY AIRPORT | 46,494 | 291,052.44 |
| | TRANSURBAN GROUP | 91,260 | 936,327.60 |
| | VICINITY CENTRES | 149,882 | 421,168.42 |
| | WESTFIELD CORP | 91,040 | 883,088.00 |
| | オーストラリアドル 小計 | 1,305,886 | 6,631,889.29 (575,714,309) |
| 香港ドル | HKT TRUST AND HKT LTD | 121,000 | 1,185,800.00 |
| | LINK REIT | 103,000 | 4,701,950.00 |
| | 香港ドル 小計 | 224,000 | 5,887,750.00 (92,143,287) |
| シンガポールドル | ASCENDAS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 109,000 | 251,790.00 |
| | CAPITALAND COMMERCIAL TRUST | 79,000 | 105,465.00 |

| | | | |
|--|-----------------------|---------|----------------------------------|
| | CAPITALAND MALL TRUST | 99,500 | 194,025.00 |
| | SUNTEC REIT | 101,400 | 159,198.00 |
| | シンガポールドル 小計 | 388,900 | 710,478.00 (61,008,745) |
| | 合計 | | 3,986,261,428 (3,986,261,428) |

（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 |
|-----------|-----------|----------------|------------|
| 米ドル | 投資証券 33銘柄 | 1.7% | 69.0% |
| カナダドル | 投資証券 3銘柄 | 0.0% | 0.9% |
| ユーロ | 投資証券 5銘柄 | 0.2% | 6.2% |
| 英ポンド | 投資証券 5銘柄 | 0.1% | 5.7% |
| オーストラリアドル | 投資証券 13銘柄 | 0.4% | 14.4% |
| 香港ドル | 投資証券 2銘柄 | 0.1% | 2.3% |
| シンガポールドル | 投資証券 4銘柄 | 0.0% | 1.5% |

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。

S M A M ・年金外国債券パッシブ・ファンド<適格機関投資家限定>

貸借対照表

（単位：円）

| | （平成26年12月22日現在） | （平成27年12月21日現在） |
|--------------|-----------------|-----------------|
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| コール・ローン | 65 | 65 |
| 親投資信託受益証券 | 3,065,278,855 | 3,220,109,528 |
| 流動資産合計 | 3,065,278,920 | 3,220,109,593 |
| 資産合計 | 3,065,278,920 | 3,220,109,593 |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 未払受託者報酬 | 18,079 | 15,291 |
| 未払委託者報酬 | 9,038 | 7,644 |
| その他未払費用 | 2,259 | 1,910 |
| 流動負債合計 | 29,376 | 24,845 |
| 負債合計 | 29,376 | 24,845 |
| 純資産の部 | | |
| 元本等 | | |
| 元本 | 1,668,518,902 | 1,807,023,919 |
| 剰余金 | | |
| 剰余金又は欠損金（ ） | 1,396,730,642 | 1,413,060,829 |
| 元本等合計 | 3,065,249,544 | 3,220,084,748 |
| 純資産合計 | 3,065,249,544 | 3,220,084,748 |

(平成26年12月22日現在)

(平成27年12月21日現在)

| | | |
|---------|---------------|---------------|
| 負債純資産合計 | 3,065,278,920 | 3,220,109,593 |
|---------|---------------|---------------|

注記表

(重要な会計方針の注記)

| 項目 | 自平成27年12月18日 至平成27年12月21日 |
|-----------------|---|
| 有価証券の評価基準及び評価方法 | <p>親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額(ただし、売気配相場は使用しない)、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p> |

(貸借対照表に関する注記)

| 項目 | (平成26年12月22日現在) | (平成27年12月21日現在) |
|-----------------------|--|--|
| 1. 当計算期間の末日における受益権の総数 | 1,668,518,902口 | 1,807,023,919口 |
| 2. 1単位当たり純資産の額 | 1口当たり純資産額 1.8371円 (10,000口当たりの純資産額 18,371円) | 1口当たり純資産額 1.7820円 (10,000口当たりの純資産額 17,820円) |

(金融商品に関する注記)

. 金融商品の状況に関する事項

| 項目 | 自平成27年12月18日 至平成27年12月21日 |
|-----------------|--|
| 1. 金融商品に対する取組方針 | <p>当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。</p> |
| | (1) 金融商品の内容 |

| | |
|----------------------------|--|
| 2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク | <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、親投資信託受益証券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2)金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p> |
| 3. 金融商品に係るリスク管理体制 | <p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する委員会をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用グループに是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用グループは、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。その後、当該関連運用グループの対処の実施や対処方針の決定等に関し、必要に応じてリスク管理を行う部署が当該部署の担当役員、当該関連運用グループの担当役員およびリスク管理委員会へ報告を行う体制となっております。</p> <p>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する部会にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。</p> |
| 4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | <p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない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認める評価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。</p> |

金融商品の時価等に関する事項

| 項目 | (平成27年12月21日現在) |
|--------------------|--|
| 1. 貸借対照表計上額、時価及び差額 | 金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 |

| | |
|-----------|--|
| 2.時価の算定方法 | <p>(1) 有価証券（親投資信託受益証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p> |
|-----------|--|

（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）

該当事項はありません。

（その他の注記）

| 項 目 | （平成26年12月22日現在） | （平成27年12月21日現在） |
|-----------|-----------------|-----------------|
| 期首元本額 | 1,668,126,811円 | 1,807,023,919円 |
| 期中追加設定元本額 | 392,091円 | -円 |
| 期中一部解約元本額 | -円 | -円 |

附属明細表

有価証券明細表

(a) 株式

該当事項はありません。

(b) 株式以外の有価証券

（単位：円）

| 種類 | 銘柄 | 券面総額 | 評価額 | 備考 |
|-----------|------------------|---------------|---------------|----|
| 親投資信託受益証券 | 外国債券パッシブ・マザーファンド | 1,793,233,574 | 3,220,109,528 | |
| 合計 | | 1,793,233,574 | 3,220,109,528 | |

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

（参考）

S M A M ・年金外国債券パッシブ・ファンド<適格機関投資家限定>は、「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。

外国債券パッシブ・マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

| | （平成26年12月22日現在） | （平成27年12月21日現在） |
|-------------|-----------------|-----------------|
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| 預金 | - | 708,110,197 |
| コール・ローン | 1,064,816,504 | 508,221,461 |
| 国債証券 | 228,216,325,101 | 194,358,799,433 |
| 未収入金 | 1,578,665,681 | - |
| 未収利息 | 2,197,950,957 | 1,699,971,647 |
| 前払費用 | 45,641,092 | 22,613,579 |
| 流動資産合計 | 233,103,399,335 | 197,297,716,317 |
| 資産合計 | 233,103,399,335 | 197,297,716,317 |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 派生商品評価勘定 | - | 180,000 |
| 未払金 | 1,119,678,341 | - |
| 未払解約金 | 9,784,400 | 100,620,818 |
| 流動負債合計 | 1,129,462,741 | 100,800,818 |
| 負債合計 | 1,129,462,741 | 100,800,818 |
| 純資産の部 | | |
| 元本等 | | |
| 元本 | 125,396,664,411 | 109,818,225,660 |
| 剰余金 | | |
| 剰余金又は欠損金（ ） | 106,577,272,183 | 87,378,689,839 |

| | | |
|---------|-----------------|-----------------|
| 元本等合計 | 231,973,936,594 | 197,196,915,499 |
| 純資産合計 | 231,973,936,594 | 197,196,915,499 |
| 負債純資産合計 | 233,103,399,335 | 197,297,716,317 |

注記表

（重要な会計方針の注記）

| 項目 | 自 平成27年12月18日 至 平成27年12月21日 |
|----------------------------|--|
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法 | <p>国債証券は個別法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p> |
| 2. デリバティブの評価基準及び評価方法 | <p>為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。</p> |
| 3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項 | <p>外貨建資産等の会計処理 「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。</p> |

（貸借対照表に関する注記）

| 項目 | （平成26年12月22日現在） | （平成27年12月21日現在） |
|-----------------------|---|---|
| 1. 当計算期間の末日における受益権の総数 | 125,396,664,411口 | 109,818,225,660口 |
| 2. 1単位当たり純資産の額 | <p>1口当たり純資産額 1.8499円</p> <p>(10,000口当たりの純資産額 18,499円)</p> | <p>1口当たり純資産額 1.7957円</p> <p>(10,000口当たりの純資産額 17,957円)</p> |

（金融商品に関する注記）

・金融商品の状況に関する事項

| 項目 | 自 平成27年12月18日 至 平成27年12月21日 |
|----|--------------------------------|
| | |

| | |
|---------------------------|--|
| 1.金融商品に対する取組方針 | 当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。 |
| 2.金融商品の内容及び金融商品に係るリスク | <p>(1)金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、国債証券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、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。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2)金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p> |
| 3.金融商品に係るリスク管理体制 | <p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する委員会をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用グループに是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用グループは、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。その後、当該関連運用グループの対処の実施や対処方針の決定等に関し、必要に応じてリスク管理を行う部署が当該部署の担当役員、当該関連運用グループの担当役員およびリスク管理委員会へ報告を行う体制となっております。</p> <p>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する部会にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。</p> |
| 4.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | 金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない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認める評価額が含まれております。当該価額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。 |

| 項目 | (平成27年12月21日現在) |
|-------------------|---|
| 1.貸借対照表計上額、時価及び差額 | 金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 |
| 2.時価の算定方法 | (1) 有価証券（国債証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。 |

(デリバティブ取引に関する注記)

(平成26年12月22日現在)

該当事項はありません。

(平成27年12月21日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位：円)

| 区分 | 種類 | 契約額等 | | 時価 | 評価損益 |
|-----------|--------|-------------|-------|-------------|---------|
| | | | うち1年超 | | |
| 市場取引以外の取引 | 為替予約取引 | | | | |
| | 売建 | 180,650,000 | - | 180,830,000 | 180,000 |
| | 英債券 | 180,650,000 | - | 180,830,000 | 180,000 |
| | 合計 | 180,650,000 | - | 180,830,000 | 180,000 |

(注) 1. 時価の算定方法

(1) 為替予約取引の時価の算定方法について

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います。

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

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

- ・ 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います。

・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います。

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

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

| （平成26年12月22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 | 126,245,890,066円 |
| 同期中における追加設定元本額 | 13,610,030円 |
| 同期中における一部解約元本額 | 862,835,685円 |
| 平成26年12月22日現在における元本の内訳 | |
| 三井住友・DC外国債券インデックスファンドS | 5,750,369,855円 |
| 三井住友・DC年金バランス30（債券重点型） | 235,325,474円 |
| 三井住友・DC年金バランス50（標準型） | 689,551,532円 |
| 三井住友・DC年金バランス70（株式重点型） | 366,254,230円 |
| スミセイ・DCバランスファンド（機動的資産配分型） | 53,472,824円 |
| スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2020 | 6,392,117円 |
| スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2025 | 12,135,052円 |
| スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2030 | 10,557,240円 |
| スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2035 | 13,165,584円 |
| スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2040 | 6,561,168円 |
| スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2045 | 13,031,876円 |
| 三井住友・DC年金バランスゼロ（債券型） | 10,802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＞ | 1,656,997,057円 |
| SMAM・バランスファンドVA安定成長型＜適格機関投資家限定＞ | 8,281,231,141円 |
| SMAM・バランスファンドVA25＜適格機関投資家専用＞ | 27,025,046,033円 |
| SMAM・バランスファンドVA37.5＜適格機関投資家専用＞ | 8,402,775,640円 |
| SMAM・バランスファンドVA50＜適格機関投資家専用＞ | 19,054,810,233円 |
| SMAM・バランスファンドVL30＜適格機関投資家限定＞ | 57,188,611円 |
| SMAM・バランスファンドVL50＜適格機関投資家限定＞ | 147,687,231円 |
| 世界6資産バランスファンドVA＜適格機関投資家限定＞ | 26,486,345円 |
| SMAM・バランスファンドVA75＜適格機関投資家専用＞ | 1,234,022,023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＞ | 157,427,139円 |
| SMAM・インデックス・バランスVA25＜適格機関投資家専用＞ | 1,612,883,781円 |
| SMAM・インデックス・バランスVA50＜適格機関投資家専用＞ | 2,200,102,287円 |
| SMAM・バランスファンドVA40＜適格機関投資家専用＞ | 5,808,051,645円 |
| SMAM・バランスファンドVA35＜適格機関投資家専用＞ | 10,071,431,073円 |
| SMAM・バランスVA株40T＜適格機関投資家限定＞ | 492,635,527円 |

| | |
|--|------------------|
| S M A M ・ 外国債券パッシブファンドV A < 適格機関投資家限定 > | 15,637,050,930円 |
| 三井住友・外国債券インデックスファンド・V A S（適格機関投資家専用） | 1,425,184,434円 |
| 三井住友・5資産バランスファンド・V A S（適格機関投資家専用） | 5,455,545,203円 |
| S M A M ・ グローバルバランス40V A < 適格機関投資家限定 > | 261,625,761円 |
| S M A M ・ バランスファンドV A 20 < 適格機関投資家専用 > | 1,013,231,098円 |
| 三井住友・7資産バランスファンド・V A S（適格機関投資家専用） | 4,380,029,786円 |
| S M A M ・ アセットバランスファンドV A 20 A < 適格機関投資家専用 > | 190,654,399円 |
| S M A M ・ アセットバランスファンドV A 35 A < 適格機関投資家専用 > | 58,078,380円 |
| S M A M ・ アセットバランスファンドV A 50 A < 適格機関投資家専用 > | 17,987,803円 |
| S M A M ・ アセットバランスファンドV A 20 L < 適格機関投資家専用 > | 229,155,570円 |
| S M A M ・ アセットバランスファンドV A 25 L < 適格機関投資家専用 > | 777,765,012円 |
| S M A M ・ アセットバランスファンドV A 20 T < 適格機関投資家専用 > | 241,490,693円 |
| S M A M ・ アセットバランスファンドV A 20 A 2 < 適格機関投資家専用 > | 220,365,663円 |
| S M A M ・ アセットバランスファンドV A 35 A 2 < 適格機関投資家専用 > | 66,476,984円 |
| S M A M ・ アセットバランスファンドV A 50 A 2 < 適格機関投資家専用 > | 6,182,104円 |
| S M A M ・ アセットバランスファンドV A 25 L 2 < 適格機関投資家専用 > | 1,949,052,459円 |
| S M A M ・ アセットバランスファンドV A 20 T 2 < 適格機関投資家専用 > | 47,711,844円 |
| S M A M ・ F G 新興国重視型バランス20V A < 適格機関投資家限定 > | 4,096,042円 |
| S M A M ・ F G グローバルバランス25V A < 適格機関投資家限定 > | 28,021,117円 |
| S M A M ・ グローバル・マルチアセット・グロース・ファンド（安定成長型）< 適格機関投資家限定 > | 595,573円 |
| S M A M ・ 年金マルチ・インカム・ダイナミック・アロケーション ・ファンド< 適格機関投資家限定 > | 375,141円 |
| S M A M ・ 年金マルチ・インカム・ダイナミック・アロケーション ・ファンド< 適格機関投資家限定 > | 384,895円 |
| 合計 | 125,396,664,411円 |

(平成27年12月21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 | 109,871,226,104円 |
| 同期中における追加設定元本額 | 9,288,496円 |
| 同期中における一部解約元本額 | 62,288,940円 |
| 平成27年12月21日現在における元本の内訳 | |
| 三井住友・D C 外国債券インデックスファンドS | 7,021,371,084円 |
| 三井住友・D C 年金バランス30（債券重点型） | 275,009,252円 |
| 三井住友・D C 年金バランス50（標準型） | 812,242,498円 |
| 三井住友・D C 年金バランス70（株式重点型） | 440,248,875円 |
| S M A M ・ グローバルバランスファンド（機動的資産配分型） | 66,586,056円 |
| スミセイ・D C ターゲットイヤーファンド2020 | 7,569,069円 |
| スミセイ・D C ターゲットイヤーファンド2025 | 20,169,875円 |
| スミセイ・D C ターゲットイヤーファンド2030 | 55,517,142円 |
| スミセイ・D C ターゲットイヤーファンド2035 | 34,004,666円 |
| スミセイ・D C ターゲットイヤーファンド2040 | 19,416,310円 |
| スミセイ・D C ターゲットイヤーファンド2045 | 41,446,177円 |
| 三井住友・D C 年金バランスゼロ（債券型） | 493,164円 |

| | |
|---|------------------|
| アセットアロケーション・ファンド(安定型) | 107,628,292円 |
| アセットアロケーション・ファンド(安定成長型) | 192,107,445円 |
| アセットアロケーション・ファンド(成長型) | 239,684,090円 |
| S M A M ・ 年金外国債券パッシブ・ファンド<適格機関投資家限定> | 1,793,233,574円 |
| S M A M ・ バランスファンドV A 安定成長型<適格機関投資家限定> | 4,176,339,214円 |
| S M A M ・ バランスファンドV A 2 5 <適格機関投資家専用> | 20,937,582,911円 |
| S M A M ・ バランスファンドV A 3 7 . 5 <適格機関投資家専用> | 7,719,848,688円 |
| S M A M ・ バランスファンドV A 5 0 <適格機関投資家専用> | 17,405,437,026円 |
| S M A M ・ バランスファンドV L 3 0 <適格機関投資家限定> | 48,068,273円 |
| S M A M ・ バランスファンドV L 5 0 <適格機関投資家限定> | 135,765,039円 |
| 世界6資産バランスファンドV A <適格機関投資家限定> | 13,725,292円 |
| S M A M ・ バランスファンドV A 7 5 <適格機関投資家専用> | 1,082,535,022円 |
| S M A M ・ バランスファンドV L 国際分散型<適格機関投資家限定> | 148,494,408円 |
| S M A M ・ インデックス・バランスV A 2 5 <適格機関投資家専用> | 1,542,430,175円 |
| S M A M ・ インデックス・バランスV A 5 0 <適格機関投資家専用> | 1,982,684,676円 |
| S M A M ・ バランスファンドV A 4 0 <適格機関投資家専用> | 5,098,844,222円 |
| S M A M ・ バランスファンドV A 3 5 <適格機関投資家専用> | 9,352,725,148円 |
| S M A M ・ バランスV A 株4 0 T <適格機関投資家限定> | 156,544,043円 |
| S M A M ・ 外国債券パッシブファンドV A <適格機関投資家限定> | 14,571,451,863円 |
| 三井住友・外国債券インデックスファンド・V A S (適格機関投資家専用) | 1,320,543,258円 |
| 三井住友・5資産バランスファンド・V A S (適格機関投資家専用) | 4,412,220,696円 |
| S M A M ・ グローバルバランス4 0 V A <適格機関投資家限定> | 250,050,101円 |
| S M A M ・ バランスファンドV A 2 0 <適格機関投資家専用> | 877,371,625円 |
| 三井住友・7資産バランスファンド・V A S (適格機関投資家専用) | 3,874,461,099円 |
| S M A M ・ アセットバランスファンドV A 2 0 A <適格機関投資家専用> | 185,069,203円 |
| S M A M ・ アセットバランスファンドV A 3 5 A <適格機関投資家専用> | 55,642,262円 |
| S M A M ・ アセットバランスファンドV A 5 0 A <適格機関投資家専用> | 17,748,606円 |
| S M A M ・ アセットバランスファンドV A 2 0 L <適格機関投資家専用> | 209,180,765円 |
| S M A M ・ アセットバランスファンドV A 2 5 L <適格機関投資家専用> | 747,237,993円 |
| S M A M ・ アセットバランスファンドV A 2 0 T <適格機関投資家専用> | 226,773,526円 |
| S M A M ・ アセットバランスファンドV A 2 0 A 2 <適格機関投資家専用> | 204,211,750円 |
| S M A M ・ アセットバランスファンドV A 3 5 A 2 <適格機関投資家専用> | 62,841,155円 |
| S M A M ・ アセットバランスファンドV A 5 0 A 2 <適格機関投資家専用> | 6,703,484円 |
| S M A M ・ アセットバランスファンドV A 2 5 L 2 <適格機関投資家専用> | 1,802,548,503円 |
| S M A M ・ アセットバランスファンドV A 2 0 T 2 <適格機関投資家専用> | 27,895,415円 |
| S M A M ・ F G 新興国重視型バランス2 0 V A <適格機関投資家限定> | 2,420,864円 |
| S M A M ・ F G グローバルバランス2 5 V A <適格機関投資家限定> | 24,446,003円 |
| S M A M ・ 年金マルチ・インカム・ダイナミック・アロケーション・ファンド<適格機関投資家限定> | 75,846円 |
| S M A M ・ 年金マルチ・インカム・ダイナミック・アロケーション・ファンド<適格機関投資家限定> | 10,704,756円 |
| S M A M ・ 年金Wリスクコントロールファンド<適格機関投資家限定> | 875,181円 |
| 合計 | 109,818,225,660円 |

附属明細表

有価証券明細表

(a) 株式

該当事項はありません。

(b) 株式以外の有価証券

| 種類 | 通貨 | 銘柄 | 券面総額 | 評価額 | 備考 |
|-------------------|--------------|-----------------------|--------------|--------------|----|
| 国債証券 | 米ドル | US TREASURY N/B 0.5 | 2,000,000.00 | 1,995,468.76 | |
| | | US TREASURY N/B 0.5 | 4,000,000.00 | 3,972,500.00 | |
| | | US TREASURY N/B 0.625 | 3,000,000.00 | 2,996,484.39 | |
| | | US TREASURY N/B 0.625 | 5,000,000.00 | 4,979,687.50 | |
| | | US TREASURY N/B 0.625 | 4,000,000.00 | 3,976,250.00 | |
| | | US TREASURY N/B 0.625 | 3,000,000.00 | 2,980,781.25 | |
| | | US TREASURY N/B 0.625 | 5,000,000.00 | 4,962,304.70 | |
| | | US TREASURY N/B 0.625 | 3,000,000.00 | 2,964,140.64 | |
| | | US TREASURY N/B 0.75 | 6,000,000.00 | 5,998,593.78 | |
| | | US TREASURY N/B 0.75 | 4,000,000.00 | 3,996,250.00 | |
| | | US TREASURY N/B 0.75 | 5,000,000.00 | 4,986,718.75 | |
| | | US TREASURY N/B 0.75 | 5,000,000.00 | 4,963,671.90 | |
| | | US TREASURY N/B 0.75 | 3,000,000.00 | 2,976,093.75 | |
| | | US TREASURY N/B 0.75 | 4,000,000.00 | 3,964,687.52 | |
| | | US TREASURY N/B 0.875 | 4,000,000.00 | 4,004,687.52 | |
| | | US TREASURY N/B 0.875 | 4,000,000.00 | 4,004,375.00 | |
| | | US TREASURY N/B 0.875 | 5,000,000.00 | 5,003,125.00 | |
| | | US TREASURY N/B 0.875 | 3,000,000.00 | 3,001,875.00 | |
| | | US TREASURY N/B 0.875 | 4,000,000.00 | 4,000,312.52 | |
| | | US TREASURY N/B 0.875 | 6,000,000.00 | 6,000,000.00 | |
| | | US TREASURY N/B 0.875 | 3,000,000.00 | 2,998,359.39 | |
| | | US TREASURY N/B 0.875 | 3,000,000.00 | 2,996,718.75 | |
| | | US TREASURY N/B 0.875 | 4,000,000.00 | 3,990,625.00 | |
| | | US TREASURY N/B 0.875 | 4,000,000.00 | 3,984,687.52 | |
| | | US TREASURY N/B 0.875 | 3,000,000.00 | 2,976,562.50 | |
| | | US TREASURY N/B 0.875 | 2,000,000.00 | 1,979,687.50 | |
| | | US TREASURY N/B 1 | 5,000,000.00 | 5,010,546.90 | |
| | | US TREASURY N/B 1 | 4,000,000.00 | 4,000,937.52 | |
| | | US TREASURY N/B 1 | 4,000,000.00 | 3,993,125.00 | |
| | | US TREASURY N/B 1 | 2,000,000.00 | 1,991,718.76 | |
| | | US TREASURY N/B 1 | 3,000,000.00 | 2,981,484.39 | |
| | | US TREASURY N/B 1 | 3,000,000.00 | 2,955,937.50 | |
| | | US TREASURY N/B 1 | 4,000,000.00 | 3,931,250.00 | |
| US TREASURY N/B 1 | 2,000,000.00 | 1,963,125.00 | | | |

| | | | |
|-----------------------|--------------|--------------|--|
| US TREASURY N/B 1 | 6,000,000.00 | 5,877,187.50 | |
| US TREASURY N/B 1.125 | 2,000,000.00 | 1,997,812.50 | |
| US TREASURY N/B 1.125 | 3,000,000.00 | 2,970,234.39 | |
| US TREASURY N/B 1.125 | 4,000,000.00 | 3,934,375.00 | |
| US TREASURY N/B 1.125 | 2,800,000.00 | 2,744,000.00 | |
| US TREASURY N/B 1.125 | 3,000,000.00 | 2,938,593.75 | |
| US TREASURY N/B 1.25 | 4,000,000.00 | 3,999,062.52 | |
| US TREASURY N/B 1.25 | 3,000,000.00 | 2,997,890.64 | |
| US TREASURY N/B 1.25 | 4,000,000.00 | 3,990,937.52 | |
| US TREASURY N/B 1.25 | 2,000,000.00 | 1,990,468.76 | |
| US TREASURY N/B 1.25 | 2,000,000.00 | 1,981,250.00 | |
| US TREASURY N/B 1.25 | 3,000,000.00 | 2,958,750.00 | |
| US TREASURY N/B 1.375 | 4,000,000.00 | 4,020,000.00 | |
| US TREASURY N/B 1.375 | 4,500,000.00 | 4,518,281.25 | |
| US TREASURY N/B 1.375 | 5,000,000.00 | 5,015,625.00 | |
| US TREASURY N/B 1.375 | 2,000,000.00 | 2,004,375.00 | |
| US TREASURY N/B 1.375 | 5,000,000.00 | 5,003,125.00 | |
| US TREASURY N/B 1.375 | 4,000,000.00 | 3,968,437.52 | |
| US TREASURY N/B 1.375 | 2,000,000.00 | 1,982,187.50 | |
| US TREASURY N/B 1.375 | 4,000,000.00 | 3,960,625.00 | |
| US TREASURY N/B 1.375 | 4,000,000.00 | 3,957,187.52 | |
| US TREASURY N/B 1.375 | 3,000,000.00 | 2,964,843.75 | |
| US TREASURY N/B 1.375 | 2,000,000.00 | 1,974,218.76 | |
| US TREASURY N/B 1.375 | 3,000,000.00 | 2,957,578.14 | |
| US TREASURY N/B 1.375 | 3,000,000.00 | 2,955,937.50 | |
| US TREASURY N/B 1.5 | 5,000,000.00 | 5,038,281.25 | |
| US TREASURY N/B 1.5 | 4,700,000.00 | 4,726,804.71 | |
| US TREASURY N/B 1.5 | 3,000,000.00 | 3,008,437.50 | |
| US TREASURY N/B 1.5 | 3,000,000.00 | 2,997,656.25 | |
| US TREASURY N/B 1.5 | 2,000,000.00 | 1,988,750.00 | |
| US TREASURY N/B 1.5 | 3,000,000.00 | 2,928,046.89 | |
| US TREASURY N/B 1.625 | 5,000,000.00 | 5,038,671.90 | |
| US TREASURY N/B 1.625 | 4,000,000.00 | 4,029,062.52 | |
| US TREASURY N/B 1.625 | 5,000,000.00 | 5,032,031.25 | |
| US TREASURY N/B 1.625 | 2,000,000.00 | 2,011,562.50 | |
| US TREASURY N/B 1.625 | 3,000,000.00 | 3,015,937.50 | |
| US TREASURY N/B 1.625 | 2,000,000.00 | 2,005,468.76 | |
| US TREASURY N/B 1.625 | 2,000,000.00 | 1,997,500.00 | |
| US TREASURY N/B 1.625 | 3,000,000.00 | 2,994,375.00 | |
| US TREASURY N/B 1.625 | 3,000,000.00 | 2,933,906.25 | |
| US TREASURY N/B 1.625 | 3,500,000.00 | 3,413,867.20 | |
| US TREASURY N/B 1.75 | 1,000,000.00 | 1,014,687.50 | |

| | | |
|-----------------------|--------------|--------------|
| US TREASURY N/B 1.75 | 2,300,000.00 | 2,303,054.69 |
| US TREASURY N/B 1.75 | 3,000,000.00 | 2,968,125.00 |
| US TREASURY N/B 1.75 | 2,500,000.00 | 2,471,289.07 |
| US TREASURY N/B 1.75 | 4,000,000.00 | 3,951,562.52 |
| US TREASURY N/B 1.75 | 3,000,000.00 | 2,963,203.14 |
| US TREASURY N/B 1.75 | 3,000,000.00 | 2,952,421.89 |
| US TREASURY N/B 1.75 | 5,000,000.00 | 4,893,750.00 |
| US TREASURY N/B 1.875 | 3,000,000.00 | 3,046,406.25 |
| US TREASURY N/B 1.875 | 6,000,000.00 | 6,092,343.78 |
| US TREASURY N/B 1.875 | 6,000,000.00 | 6,095,625.00 |
| US TREASURY N/B 1.875 | 3,000,000.00 | 3,029,062.50 |
| US TREASURY N/B 1.875 | 3,000,000.00 | 2,999,531.25 |
| US TREASURY N/B 1.875 | 3,000,000.00 | 2,983,828.14 |
| US TREASURY N/B 1.875 | 2,000,000.00 | 1,984,687.50 |
| US TREASURY N/B 1.875 | 3,000,000.00 | 2,974,453.14 |
| US TREASURY N/B 2 | 3,000,000.00 | 3,042,890.64 |
| US TREASURY N/B 2 | 2,300,000.00 | 2,332,164.07 |
| US TREASURY N/B 2 | 4,000,000.00 | 4,052,187.52 |
| US TREASURY N/B 2 | 3,000,000.00 | 3,034,218.75 |
| US TREASURY N/B 2 | 2,000,000.00 | 2,020,000.00 |
| US TREASURY N/B 2 | 3,000,000.00 | 3,024,375.00 |
| US TREASURY N/B 2 | 4,000,000.00 | 4,026,875.00 |
| US TREASURY N/B 2 | 3,000,000.00 | 3,020,156.25 |
| US TREASURY N/B 2 | 4,100,000.00 | 4,123,062.50 |
| US TREASURY N/B 2 | 3,000,000.00 | 3,004,218.75 |
| US TREASURY N/B 2 | 5,500,000.00 | 5,493,554.71 |
| US TREASURY N/B 2 | 7,000,000.00 | 6,881,328.16 |
| US TREASURY N/B 2 | 7,000,000.00 | 6,869,843.75 |
| US TREASURY N/B 2.125 | 3,500,000.00 | 3,566,992.20 |
| US TREASURY N/B 2.125 | 4,000,000.00 | 4,072,187.52 |
| US TREASURY N/B 2.125 | 2,000,000.00 | 2,032,343.76 |
| US TREASURY N/B 2.125 | 5,000,000.00 | 5,079,296.90 |
| US TREASURY N/B 2.125 | 3,000,000.00 | 3,042,656.25 |
| US TREASURY N/B 2.125 | 4,000,000.00 | 4,049,375.00 |
| US TREASURY N/B 2.125 | 3,000,000.00 | 3,028,359.39 |
| US TREASURY N/B 2.125 | 7,000,000.00 | 6,949,687.50 |
| US TREASURY N/B 2.25 | 3,000,000.00 | 3,070,312.50 |
| US TREASURY N/B 2.25 | 2,000,000.00 | 2,055,781.26 |
| US TREASURY N/B 2.25 | 4,000,000.00 | 4,094,062.52 |
| US TREASURY N/B 2.25 | 2,000,000.00 | 2,046,875.00 |
| US TREASURY N/B 2.25 | 2,000,000.00 | 2,044,375.00 |
| US TREASURY N/B 2.25 | 7,000,000.00 | 7,036,093.75 |
| US TREASURY N/B 2.25 | 2,500,000.00 | 2,511,132.82 |

| | | | |
|-----------------------|---------------|---------------|--|
| US TREASURY N/B 2.375 | 4,000,000.00 | 4,091,875.00 | |
| US TREASURY N/B 2.375 | 2,000,000.00 | 2,062,187.50 | |
| US TREASURY N/B 2.375 | 7,000,000.00 | 7,113,750.00 | |
| US TREASURY N/B 2.5 | 3,000,000.00 | 3,069,843.75 | |
| US TREASURY N/B 2.5 | 5,000,000.00 | 5,155,859.40 | |
| US TREASURY N/B 2.5 | 7,000,000.00 | 7,191,406.25 | |
| US TREASURY N/B 2.5 | 3,500,000.00 | 3,207,421.87 | |
| US TREASURY N/B 2.625 | 4,000,000.00 | 4,131,562.52 | |
| US TREASURY N/B 2.625 | 4,000,000.00 | 4,142,812.52 | |
| US TREASURY N/B 2.625 | 4,000,000.00 | 4,170,000.00 | |
| US TREASURY N/B 2.625 | 5,500,000.00 | 5,732,890.62 | |
| US TREASURY N/B 2.75 | 4,000,000.00 | 4,073,750.00 | |
| US TREASURY N/B 2.75 | 5,000,000.00 | 5,131,250.00 | |
| US TREASURY N/B 2.75 | 4,000,000.00 | 4,138,125.00 | |
| US TREASURY N/B 2.75 | 3,000,000.00 | 3,132,421.89 | |
| US TREASURY N/B 2.75 | 6,200,000.00 | 6,504,671.90 | |
| US TREASURY N/B 2.75 | 5,000,000.00 | 5,237,890.65 | |
| US TREASURY N/B 2.75 | 2,000,000.00 | 1,950,468.76 | |
| US TREASURY N/B 2.75 | 11,000,000.00 | 10,706,953.18 | |
| US TREASURY N/B 2.875 | 3,000,000.00 | 3,120,000.00 | |
| US TREASURY N/B 2.875 | 4,000,000.00 | 3,966,562.52 | |
| US TREASURY N/B 3 | 4,000,000.00 | 4,102,500.00 | |
| US TREASURY N/B 3 | 4,500,000.00 | 4,617,773.46 | |
| US TREASURY N/B 3 | 4,000,000.00 | 4,067,812.52 | |
| US TREASURY N/B 3 | 4,000,000.00 | 4,064,062.52 | |
| US TREASURY N/B 3 | 1,000,000.00 | 1,018,046.88 | |
| US TREASURY N/B 3.125 | 3,200,000.00 | 3,282,000.00 | |
| US TREASURY N/B 3.125 | 4,000,000.00 | 4,119,687.52 | |
| US TREASURY N/B 3.125 | 2,000,000.00 | 2,116,093.76 | |
| US TREASURY N/B 3.125 | 5,000,000.00 | 5,337,890.65 | |
| US TREASURY N/B 3.125 | 2,000,000.00 | 2,106,718.76 | |
| US TREASURY N/B 3.125 | 3,000,000.00 | 3,157,031.25 | |
| US TREASURY N/B 3.125 | 4,000,000.00 | 4,173,750.00 | |
| US TREASURY N/B 3.25 | 4,000,000.00 | 4,101,250.00 | |
| US TREASURY N/B 3.25 | 4,000,000.00 | 4,120,937.52 | |
| US TREASURY N/B 3.375 | 5,000,000.00 | 5,355,468.75 | |
| US TREASURY N/B 3.375 | 4,000,000.00 | 4,381,562.52 | |
| US TREASURY N/B 3.5 | 2,500,000.00 | 2,630,078.12 | |
| US TREASURY N/B 3.5 | 4,500,000.00 | 4,853,671.87 | |
| US TREASURY N/B 3.5 | 2,000,000.00 | 2,255,468.76 | |
| US TREASURY N/B 3.625 | 5,000,000.00 | 5,385,156.25 | |
| US TREASURY N/B 3.625 | 6,000,000.00 | 6,496,875.00 | |

| | | | |
|-------|-----------------------|----------------|------------------------------------|
| | US TREASURY N/B 3.625 | 5,000,000.00 | 5,455,859.40 |
| | US TREASURY N/B 3.625 | 6,000,000.00 | 6,899,062.50 |
| | US TREASURY N/B 3.625 | 3,000,000.00 | 3,445,781.25 |
| | US TREASURY N/B 3.75 | 3,000,000.00 | 3,217,265.64 |
| | US TREASURY N/B 3.75 | 2,000,000.00 | 2,341,718.76 |
| | US TREASURY N/B 3.75 | 3,000,000.00 | 3,526,875.00 |
| | US TREASURY N/B 3.875 | 6,000,000.00 | 6,395,625.00 |
| | US TREASURY N/B 3.875 | 2,000,000.00 | 2,382,187.50 |
| | US TREASURY N/B 4 | 2,500,000.00 | 2,687,500.00 |
| | US TREASURY N/B 4.25 | 3,000,000.00 | 3,184,218.75 |
| | US TREASURY N/B 4.25 | 2,000,000.00 | 2,518,906.26 |
| | US TREASURY N/B 4.375 | 1,200,000.00 | 1,541,906.25 |
| | US TREASURY N/B 4.375 | 1,500,000.00 | 1,920,585.94 |
| | US TREASURY N/B 4.375 | 1,500,000.00 | 1,922,812.50 |
| | US TREASURY N/B 4.375 | 2,000,000.00 | 2,570,937.50 |
| | US TREASURY N/B 4.5 | 3,000,000.00 | 3,150,937.50 |
| | US TREASURY N/B 4.5 | 1,500,000.00 | 1,957,382.82 |
| | US TREASURY N/B 4.5 | 1,000,000.00 | 1,307,578.13 |
| | US TREASURY N/B 4.5 | 1,000,000.00 | 1,303,125.00 |
| | US TREASURY N/B 4.625 | 3,000,000.00 | 3,130,312.50 |
| | US TREASURY N/B 4.625 | 3,000,000.00 | 3,978,515.64 |
| | US TREASURY N/B 4.75 | 3,000,000.00 | 3,188,906.25 |
| | US TREASURY N/B 4.75 | 2,500,000.00 | 3,384,375.00 |
| | US TREASURY N/B 5.25 | 1,000,000.00 | 1,319,296.88 |
| | US TREASURY N/B 5.25 | 500,000.00 | 661,757.81 |
| | US TREASURY N/B 5.375 | 1,320,000.00 | 1,812,834.38 |
| | US TREASURY N/B 5.5 | 1,000,000.00 | 1,343,046.88 |
| | US TREASURY N/B 6 | 1,000,000.00 | 1,344,140.63 |
| | US TREASURY N/B 6.125 | 1,000,000.00 | 1,396,093.75 |
| | US TREASURY N/B 6.25 | 800,000.00 | 1,038,875.00 |
| | US TREASURY N/B 6.25 | 1,000,000.00 | 1,466,718.75 |
| | US TREASURY N/B 6.5 | 500,000.00 | 705,078.12 |
| | US TREASURY N/B 8 | 1,300,000.00 | 1,745,250.00 |
| | US TREASURY N/B 8.75 | 1,000,000.00 | 1,109,296.88 |
| | US TREASURY N/B 8.75 | 1,000,000.00 | 1,316,406.25 |
| | US TREASURY N/B 8.875 | 1,100,000.00 | 1,358,156.25 |
| | 米ドル 小計 | 671,320,000.00 | 690,439,421.66 (83,736,493,058) |
| カナダドル | CANADA-GOV'T 0.25 | 1,000,000.00 | 994,900.00 |
| | CANADA-GOV'T 0.75 | 1,000,000.00 | 998,850.00 |
| | CANADA-GOV'T 0.75 | 1,000,000.00 | 993,302.00 |
| | CANADA-GOV'T 1.25 | 2,000,000.00 | 2,023,900.00 |
| | CANADA-GOV'T 1.25 | 2,000,000.00 | 2,032,500.00 |

| | | | | |
|--------|--------------------|----------------|-----------------------------------|--|
| | CANADA-GOV'T 1.25 | 1,000,000.00 | 1,019,130.00 | |
| | CANADA-GOV'T 1.5 | 1,000,000.00 | 1,011,190.00 | |
| | CANADA-GOV'T 1.5 | 2,000,000.00 | 2,023,820.00 | |
| | CANADA-GOV'T 1.5 | 1,000,000.00 | 1,016,740.00 | |
| | CANADA-GOV'T 1.5 | 2,000,000.00 | 2,045,120.00 | |
| | CANADA-GOV'T 1.75 | 1,000,000.00 | 1,037,450.00 | |
| | CANADA-GOV'T 1.75 | 1,000,000.00 | 1,041,170.00 | |
| | CANADA-GOV'T 2.25 | 1,000,000.00 | 1,075,900.00 | |
| | CANADA-GOV'T 2.5 | 2,000,000.00 | 2,193,220.00 | |
| | CANADA-GOV'T 2.75 | 1,000,000.00 | 1,105,000.00 | |
| | CANADA-GOV'T 3.25 | 1,000,000.00 | 1,126,210.00 | |
| | CANADA-GOV'T 3.5 | 2,000,000.00 | 2,246,480.00 | |
| | CANADA-GOV'T 3.5 | 1,500,000.00 | 1,960,500.00 | |
| | CANADA-GOV'T 3.75 | 2,500,000.00 | 2,766,500.00 | |
| | CANADA-GOV'T 4 | 2,000,000.00 | 2,100,420.00 | |
| | CANADA-GOV'T 4 | 3,000,000.00 | 4,102,890.00 | |
| | CANADA-GOV'T 4.25 | 1,500,000.00 | 1,634,850.00 | |
| | CANADA-GOV'T 5 | 1,500,000.00 | 2,251,035.00 | |
| | CANADA-GOV'T 5.75 | 1,500,000.00 | 2,210,745.00 | |
| | CANADA-GOV'T 5.75 | 1,500,000.00 | 2,331,285.00 | |
| | CANADA-GOV'T 8 | 500,000.00 | 833,360.00 | |
| | カナダドル 小計 | 38,500,000.00 | 44,176,467.00 (3,838,934,982) | |
| メキシコペソ | MEXICAN BONOS 6.5 | 30,000,000.00 | 30,948,450.00 | |
| | MEXICAN BONOS 7.25 | 40,000,000.00 | 41,462,080.00 | |
| | MEXICAN BONOS 7.75 | 20,000,000.00 | 21,460,380.00 | |
| | MEXICAN BONOS 8 | 50,000,000.00 | 55,660,350.00 | |
| | MEXICAN BONOS 8 | 20,000,000.00 | 22,432,980.00 | |
| | MEXICAN BONOS 8.5 | 50,000,000.00 | 58,646,750.00 | |
| | MEXICAN BONOS 8.5 | 40,000,000.00 | 47,405,560.00 | |
| | メキシコペソ 小計 | 250,000,000.00 | 278,016,550.00 (1,971,137,339) | |
| ユーロ | BELGIAN 0326 4 | 1,000,000.00 | 1,363,780.00 | |
| | BELGIAN 0.8 | 2,000,000.00 | 1,986,600.00 | |
| | BELGIAN 0291 5.5 | 2,000,000.00 | 2,989,460.00 | |
| | BELGIAN 0300 5.5 | 740,000.00 | 816,797.20 | |
| | BELGIAN 0304 5 | 2,500,000.00 | 3,904,750.00 | |
| | BELGIAN 0308 4 | 1,500,000.00 | 1,851,525.00 | |
| | BELGIAN 0309 4 | 1,500,000.00 | 1,583,295.00 | |
| | BELGIAN 0312 4 | 1,000,000.00 | 1,098,550.00 | |
| | BELGIAN 0315 4 | 1,500,000.00 | 1,708,770.00 | |
| | BELGIAN 0318 3.75 | 2,000,000.00 | 2,359,500.00 | |

| | | |
|-------------------|--------------|--------------|
| BELGIAN 0320 4.25 | 1,500,000.00 | 2,262,075.00 |
| BELGIAN 0321 4.25 | 1,700,000.00 | 2,101,965.00 |
| BELGIAN 0323 3.5 | 2,000,000.00 | 2,116,860.00 |
| BELGIAN 0324 4.5 | 1,000,000.00 | 1,350,080.00 |
| BELGIAN 0325 4.25 | 2,000,000.00 | 2,524,760.00 |
| BELGIAN 0327 3 | 1,000,000.00 | 1,119,300.00 |
| BELGIAN 0328 2.25 | 1,000,000.00 | 1,129,250.00 |
| BELGIAN 0329 1.25 | 1,000,000.00 | 1,039,050.00 |
| BELGIAN 0332 2.6 | 2,000,000.00 | 2,319,160.00 |
| BELGIAN 0333 3 | 500,000.00 | 612,065.00 |
| BELGIAN 3.75 | 1,000,000.00 | 1,427,480.00 |
| BTAN 1 | 2,500,000.00 | 2,552,875.00 |
| BTAN 1.75 | 2,500,000.00 | 2,561,000.00 |
| BTPS 0.75 | 1,000,000.00 | 1,013,000.00 |
| BTPS 1.05 | 1,000,000.00 | 1,023,980.00 |
| BTPS 1.15 | 2,000,000.00 | 2,030,460.00 |
| BTPS 1.35 | 2,000,000.00 | 2,049,900.00 |
| BTPS 1.5 | 2,000,000.00 | 2,029,360.00 |
| BTPS 1.5 | 2,000,000.00 | 2,005,200.00 |
| BTPS 2 | 1,000,000.00 | 1,040,030.00 |
| BTPS 2.15 | 2,000,000.00 | 2,147,360.00 |
| BTPS 2.5 | 1,000,000.00 | 1,072,780.00 |
| BTPS 2.5 | 2,000,000.00 | 2,175,900.00 |
| BTPS 3.25 | 1,500,000.00 | 1,706,850.00 |
| BTPS 3.5 | 1,000,000.00 | 1,063,480.00 |
| BTPS 3.5 | 3,400,000.00 | 3,676,080.00 |
| BTPS 3.5 | 2,000,000.00 | 2,193,560.00 |
| BTPS 3.5 | 1,000,000.00 | 1,191,350.00 |
| BTPS 3.75 | 3,000,000.00 | 3,468,390.00 |
| BTPS 3.75 | 2,000,000.00 | 2,318,060.00 |
| BTPS 3.75 | 3,300,000.00 | 3,835,920.00 |
| BTPS 3.75 | 2,000,000.00 | 2,379,700.00 |
| BTPS 4 | 2,500,000.00 | 2,610,700.00 |
| BTPS 4 | 3,500,000.00 | 4,056,255.00 |
| BTPS 4 | 3,000,000.00 | 3,788,850.00 |
| BTPS 4.25 | 2,400,000.00 | 2,697,312.00 |
| BTPS 4.25 | 4,500,000.00 | 5,136,525.00 |
| BTPS 4.25 | 3,300,000.00 | 3,819,915.00 |
| BTPS 4.5 | 4,000,000.00 | 4,367,880.00 |
| BTPS 4.5 | 3,000,000.00 | 3,337,950.00 |
| BTPS 4.5 | 2,700,000.00 | 3,062,016.00 |
| BTPS 4.5 | 2,700,000.00 | 3,146,256.00 |
| BTPS 4.5 | 1,800,000.00 | 2,223,990.00 |

| | | | |
|----------------------|--------------|--------------|--|
| BTPS 4.5 | 3,000,000.00 | 3,736,590.00 | |
| BTPS 4.5 | 2,000,000.00 | 2,548,760.00 | |
| BTPS 4.75 | 1,000,000.00 | 1,063,680.00 | |
| BTPS 4.75 | 2,000,000.00 | 2,135,060.00 | |
| BTPS 4.75 | 2,600,000.00 | 3,168,152.00 | |
| BTPS 4.75 | 2,500,000.00 | 3,148,325.00 | |
| BTPS 4.75 | 2,000,000.00 | 2,650,200.00 | |
| BTPS 4.75 | 1,000,000.00 | 1,434,580.00 | |
| BTPS 5 | 2,000,000.00 | 2,489,700.00 | |
| BTPS 5 | 3,000,000.00 | 3,908,940.00 | |
| BTPS 5 | 2,470,000.00 | 3,495,297.00 | |
| BTPS 5 | 2,000,000.00 | 2,892,300.00 | |
| BTPS 5 | 2,500,000.00 | 3,613,700.00 | |
| BTPS 5.25 | 3,000,000.00 | 3,250,740.00 | |
| BTPS 5.25 | 3,700,000.00 | 5,174,450.00 | |
| BTPS 5.5 | 2,500,000.00 | 3,222,825.00 | |
| BTPS 5.5 | 2,500,000.00 | 3,230,450.00 | |
| BTPS 5.75 | 2,200,000.00 | 3,326,026.00 | |
| BTPS 6 | 4,100,000.00 | 6,224,948.00 | |
| BTPS 6.5 | 2,960,000.00 | 4,438,727.20 | |
| BTPS 7.25 | 1,000,000.00 | 1,554,500.00 | |
| BTPS 9 | 1,000,000.00 | 1,579,450.00 | |
| BUNDESOBL-162 0.75 | 2,500,000.00 | 2,533,050.00 | |
| BUNDESOBL-163 0.5 | 2,000,000.00 | 2,022,300.00 | |
| BUNDESOBL-164 0.5 | 2,000,000.00 | 2,030,800.00 | |
| BUNDESOBL-165 0.5 | 2,000,000.00 | 2,036,800.00 | |
| BUNDESOBL-166 0.25 | 2,000,000.00 | 2,027,500.00 | |
| BUNDESOBL-167 1 | 2,000,000.00 | 2,074,900.00 | |
| BUNDESOBL-168 1 | 1,000,000.00 | 1,041,330.00 | |
| BUNDESOBL-169 0.5 | 1,000,000.00 | 1,026,230.00 | |
| BUNDESOBL-170 0.25 | 1,000,000.00 | 1,019,100.00 | |
| BUNDESOBL-171 0 | 1,000,000.00 | 1,007,430.00 | |
| BUNDESSCHATZANW 0 | 2,000,000.00 | 2,007,560.00 | |
| DEUTSCHLAND REP 0.5 | 3,000,000.00 | 3,005,490.00 | |
| DEUTSCHLAND REP 1 | 2,000,000.00 | 2,104,760.00 | |
| DEUTSCHLAND REP 1 | 2,000,000.00 | 2,084,960.00 | |
| DEUTSCHLAND REP 1.5 | 2,500,000.00 | 2,734,450.00 | |
| DEUTSCHLAND REP 1.5 | 1,500,000.00 | 1,642,020.00 | |
| DEUTSCHLAND REP 1.5 | 2,000,000.00 | 2,191,200.00 | |
| DEUTSCHLAND REP 1.5 | 2,000,000.00 | 2,193,260.00 | |
| DEUTSCHLAND REP 1.75 | 2,500,000.00 | 2,773,200.00 | |
| DEUTSCHLAND REP 1.75 | 2,000,000.00 | 2,233,100.00 | |

| | | |
|-----------------------|--------------|--------------|
| DEUTSCHLAND REP 2 | 2,000,000.00 | 2,238,760.00 |
| DEUTSCHLAND REP 2 | 1,500,000.00 | 1,701,495.00 |
| DEUTSCHLAND REP 2.25 | 1,500,000.00 | 1,668,720.00 |
| DEUTSCHLAND REP 2.25 | 2,000,000.00 | 2,258,900.00 |
| DEUTSCHLAND REP 2.5 | 2,000,000.00 | 2,261,060.00 |
| DEUTSCHLAND REP 2.5 | 2,200,000.00 | 2,851,486.00 |
| DEUTSCHLAND REP 2.5 | 1,000,000.00 | 1,300,530.00 |
| DEUTSCHLAND REP 3 | 3,000,000.00 | 3,429,240.00 |
| DEUTSCHLAND REP 3.25 | 3,000,000.00 | 3,419,790.00 |
| DEUTSCHLAND REP 3.25 | 2,000,000.00 | 2,363,500.00 |
| DEUTSCHLAND REP 3.25 | 1,500,000.00 | 2,178,870.00 |
| DEUTSCHLAND REP 3.5 | 4,000,000.00 | 4,534,200.00 |
| DEUTSCHLAND REP 3.75 | 2,000,000.00 | 2,086,160.00 |
| DEUTSCHLAND REP 3.75 | 3,500,000.00 | 3,933,475.00 |
| DEUTSCHLAND REP 4 | 3,000,000.00 | 3,267,240.00 |
| DEUTSCHLAND REP 4 | 2,200,000.00 | 3,352,866.00 |
| DEUTSCHLAND REP 4.25 | 2,000,000.00 | 2,141,800.00 |
| DEUTSCHLAND REP 4.25 | 3,200,000.00 | 3,574,080.00 |
| DEUTSCHLAND REP 4.25 | 1,500,000.00 | 2,431,305.00 |
| DEUTSCHLAND REP 4.75 | 1,300,000.00 | 1,920,074.00 |
| DEUTSCHLAND REP 4.75 | 2,100,000.00 | 3,391,458.00 |
| DEUTSCHLAND REP 4.75 | 1,900,000.00 | 3,319,737.00 |
| DEUTSCHLAND REP 5.5 | 1,800,000.00 | 2,951,334.00 |
| DEUTSCHLAND REP 5.625 | 1,580,000.00 | 2,472,352.40 |
| DEUTSCHLAND REP 6.25 | 1,200,000.00 | 1,768,980.00 |
| DEUTSCHLAND REP 6.25 | 1,000,000.00 | 1,717,200.00 |
| DEUTSCHLAND REP 6.5 | 1,000,000.00 | 1,648,580.00 |
| FINNISH GOV'T 1.625 | 1,000,000.00 | 1,092,000.00 |
| FINNISH GOV'T 2.625 | 500,000.00 | 638,050.00 |
| FINNISH GOV'T 2.75 | 600,000.00 | 721,068.00 |
| FINNISH GOV'T 3.375 | 1,200,000.00 | 1,380,180.00 |
| FINNISH GOV'T 3.5 | 1,000,000.00 | 1,184,230.00 |
| FINNISH GOV'T 3.875 | 1,000,000.00 | 1,073,270.00 |
| FINNISH GOV'T 4 | 1,000,000.00 | 1,299,400.00 |
| FRANCE O.A.T. 0 | 2,000,000.00 | 2,000,900.00 |
| FRANCE O.A.T. 0.5 | 2,000,000.00 | 2,046,300.00 |
| FRANCE O.A.T. 0.5 | 3,000,000.00 | 2,916,600.00 |
| FRANCE O.A.T. 1 | 3,000,000.00 | 3,092,040.00 |
| FRANCE O.A.T. 1 | 1,000,000.00 | 1,035,980.00 |
| FRANCE O.A.T. 1 | 1,000,000.00 | 1,039,580.00 |
| FRANCE O.A.T. 1 | 2,000,000.00 | 2,021,160.00 |
| FRANCE O.A.T. 1.75 | 3,000,000.00 | 3,281,700.00 |
| FRANCE O.A.T. 1.75 | 4,000,000.00 | 4,358,920.00 |

| | | | |
|-----------------------|--------------|--------------|--|
| FRANCE O.A.T. 2.25 | 2,300,000.00 | 2,596,700.00 | |
| FRANCE O.A.T. 2.25 | 3,000,000.00 | 3,400,560.00 | |
| FRANCE O.A.T. 2.5 | 4,500,000.00 | 5,035,275.00 | |
| FRANCE O.A.T. 2.5 | 3,000,000.00 | 3,452,490.00 | |
| FRANCE O.A.T. 2.75 | 3,000,000.00 | 3,539,310.00 | |
| FRANCE O.A.T. 3 | 4,000,000.00 | 4,692,000.00 | |
| FRANCE O.A.T. 3.25 | 4,800,000.00 | 5,660,400.00 | |
| FRANCE O.A.T. 3.25 | 1,700,000.00 | 2,235,296.00 | |
| FRANCE O.A.T. 3.5 | 5,000,000.00 | 5,770,250.00 | |
| FRANCE O.A.T. 3.5 | 4,000,000.00 | 5,018,520.00 | |
| FRANCE O.A.T. 3.75 | 5,000,000.00 | 5,273,750.00 | |
| FRANCE O.A.T. 3.75 | 5,000,000.00 | 5,744,400.00 | |
| FRANCE O.A.T. 3.75 | 3,700,000.00 | 4,420,871.00 | |
| FRANCE O.A.T. 4 | 4,000,000.00 | 4,402,880.00 | |
| FRANCE O.A.T. 4 | 2,700,000.00 | 3,873,906.00 | |
| FRANCE O.A.T. 4 | 1,870,000.00 | 2,910,056.60 | |
| FRANCE O.A.T. 4 | 1,500,000.00 | 2,370,675.00 | |
| FRANCE O.A.T. 4.25 | 4,500,000.00 | 4,879,485.00 | |
| FRANCE O.A.T. 4.25 | 4,000,000.00 | 4,511,680.00 | |
| FRANCE O.A.T. 4.25 | 4,400,000.00 | 5,054,632.00 | |
| FRANCE O.A.T. 4.25 | 4,000,000.00 | 5,153,000.00 | |
| FRANCE O.A.T. 4.5 | 2,700,000.00 | 4,216,941.00 | |
| FRANCE O.A.T. 4.75 | 2,600,000.00 | 3,975,140.00 | |
| FRANCE O.A.T. 5.5 | 3,500,000.00 | 5,339,005.00 | |
| FRANCE O.A.T. 5.75 | 3,200,000.00 | 5,256,864.00 | |
| FRANCE O.A.T. 6 | 2,500,000.00 | 3,734,700.00 | |
| FRANCE O.A.T. 8.5 | 850,000.00 | 1,132,769.50 | |
| FRANCE O.A.T. 8.5 | 1,200,000.00 | 1,904,016.00 | |
| IRISH GOVT 2 | 1,000,000.00 | 984,150.00 | |
| IRISH GOVT 3.4 | 1,000,000.00 | 1,198,950.00 | |
| IRISH GOVT 3.9 | 1,000,000.00 | 1,229,050.00 | |
| IRISH GOVT 4.4 | 1,000,000.00 | 1,154,530.00 | |
| IRISH GOVT 4.5 | 1,000,000.00 | 1,130,180.00 | |
| IRISH GOVT 4.5 | 1,490,000.00 | 1,772,399.70 | |
| IRISH GOVT 5 | 1,000,000.00 | 1,232,330.00 | |
| IRISH GOVT 5.4 | 1,500,000.00 | 2,068,950.00 | |
| IRISH GOVT 5.5 | 500,000.00 | 552,075.00 | |
| IRISH GOVT 5.9 | 800,000.00 | 979,344.00 | |
| NETHERLANDS GOVT 0 | 1,000,000.00 | 1,006,830.00 | |
| NETHERLANDS GOVT 0.25 | 1,000,000.00 | 1,016,430.00 | |
| NETHERLANDS GOVT 0.25 | 1,000,000.00 | 958,600.00 | |
| NETHERLANDS GOVT 0.5 | 1,000,000.00 | 1,011,330.00 | |

| | | |
|-----------------------|--------------|--------------|
| NETHERLANDS GOVT 1.25 | 1,500,000.00 | 1,548,480.00 |
| NETHERLANDS GOVT 1.25 | 2,000,000.00 | 2,093,060.00 |
| NETHERLANDS GOVT 1.75 | 2,200,000.00 | 2,428,206.00 |
| NETHERLANDS GOVT 2 | 2,000,000.00 | 2,247,360.00 |
| NETHERLANDS GOVT 2.25 | 2,000,000.00 | 2,269,000.00 |
| NETHERLANDS GOVT 2.5 | 2,000,000.00 | 2,061,440.00 |
| NETHERLANDS GOVT 2.5 | 1,100,000.00 | 1,324,015.00 |
| NETHERLANDS GOVT 2.75 | 500,000.00 | 666,200.00 |
| NETHERLANDS GOVT 3.25 | 1,500,000.00 | 1,767,270.00 |
| NETHERLANDS GOVT 3.5 | 2,000,000.00 | 2,328,000.00 |
| NETHERLANDS GOVT 3.75 | 1,000,000.00 | 1,243,930.00 |
| NETHERLANDS GOVT 3.75 | 2,000,000.00 | 3,074,000.00 |
| NETHERLANDS GOVT 4 | 1,500,000.00 | 1,665,945.00 |
| NETHERLANDS GOVT 4 | 1,500,000.00 | 1,726,425.00 |
| NETHERLANDS GOVT 4 | 1,700,000.00 | 2,560,081.00 |
| NETHERLANDS GOVT 4.5 | 2,000,000.00 | 2,152,100.00 |
| NETHERLANDS GOVT 5.5 | 1,500,000.00 | 2,292,120.00 |
| REP OF AUSTRIA 1.2 | 500,000.00 | 518,440.00 |
| REP OF AUSTRIA 1.65 | 1,000,000.00 | 1,087,380.00 |
| REP OF AUSTRIA 1.75 | 1,000,000.00 | 1,101,150.00 |
| REP OF AUSTRIA 1.95 | 1,000,000.00 | 1,075,380.00 |
| REP OF AUSTRIA 3.15 | 500,000.00 | 680,915.00 |
| REP OF AUSTRIA 3.2 | 1,000,000.00 | 1,041,000.00 |
| REP OF AUSTRIA 3.4 | 1,000,000.00 | 1,213,150.00 |
| REP OF AUSTRIA 3.5 | 2,000,000.00 | 2,393,600.00 |
| REP OF AUSTRIA 3.65 | 1,000,000.00 | 1,218,730.00 |
| REP OF AUSTRIA 3.8 | 500,000.00 | 836,685.00 |
| REP OF AUSTRIA 3.9 | 2,000,000.00 | 2,364,860.00 |
| REP OF AUSTRIA 4.15 | 1,300,000.00 | 1,941,264.00 |
| REP OF AUSTRIA 4.3 | 1,500,000.00 | 1,619,730.00 |
| REP OF AUSTRIA 4.35 | 1,200,000.00 | 1,378,080.00 |
| REP OF AUSTRIA 4.65 | 1,000,000.00 | 1,102,230.00 |
| REP OF AUSTRIA 4.85 | 1,000,000.00 | 1,395,530.00 |
| REP OF AUSTRIA 6.25 | 1,000,000.00 | 1,581,530.00 |
| SPANISH GOV'T 0.5 | 1,000,000.00 | 1,007,250.00 |
| SPANISH GOV'T 1.4 | 2,000,000.00 | 2,068,940.00 |
| SPANISH GOV'T 1.6 | 2,000,000.00 | 1,999,300.00 |
| SPANISH GOV'T 1.95 | 1,000,000.00 | 968,150.00 |
| SPANISH GOV'T 2.1 | 2,000,000.00 | 2,054,760.00 |
| SPANISH GOV'T 2.15 | 2,000,000.00 | 2,082,900.00 |
| SPANISH GOV'T 2.75 | 1,000,000.00 | 1,079,350.00 |
| SPANISH GOV'T 2.75 | 3,000,000.00 | 3,287,490.00 |
| SPANISH GOV'T 3.75 | 2,200,000.00 | 2,419,120.00 |

| | | | | |
|-------|--------------------|----------------|------------------------------------|--|
| | SPANISH GOV'T 3.8 | 3,500,000.00 | 3,645,775.00 | |
| | SPANISH GOV'T 3.8 | 2,000,000.00 | 2,358,060.00 | |
| | SPANISH GOV'T 4 | 3,000,000.00 | 3,433,890.00 | |
| | SPANISH GOV'T 4.1 | 2,000,000.00 | 2,200,660.00 | |
| | SPANISH GOV'T 4.2 | 2,050,000.00 | 2,572,750.00 | |
| | SPANISH GOV'T 4.3 | 3,000,000.00 | 3,437,490.00 | |
| | SPANISH GOV'T 4.4 | 1,000,000.00 | 1,226,300.00 | |
| | SPANISH GOV'T 4.5 | 2,500,000.00 | 2,726,950.00 | |
| | SPANISH GOV'T 4.6 | 3,500,000.00 | 4,023,425.00 | |
| | SPANISH GOV'T 4.65 | 2,000,000.00 | 2,531,300.00 | |
| | SPANISH GOV'T 4.7 | 1,500,000.00 | 2,028,795.00 | |
| | SPANISH GOV'T 4.8 | 3,000,000.00 | 3,774,390.00 | |
| | SPANISH GOV'T 4.85 | 2,000,000.00 | 2,392,600.00 | |
| | SPANISH GOV'T 4.9 | 1,500,000.00 | 2,079,795.00 | |
| | SPANISH GOV'T 5.15 | 1,500,000.00 | 2,018,850.00 | |
| | SPANISH GOV'T 5.15 | 1,000,000.00 | 1,453,580.00 | |
| | SPANISH GOV'T 5.4 | 2,000,000.00 | 2,568,600.00 | |
| | SPANISH GOV'T 5.5 | 3,380,000.00 | 3,672,978.40 | |
| | SPANISH GOV'T 5.5 | 2,000,000.00 | 2,490,900.00 | |
| | SPANISH GOV'T 5.75 | 2,200,000.00 | 3,235,210.00 | |
| | SPANISH GOV'T 5.85 | 2,500,000.00 | 3,220,625.00 | |
| | SPANISH GOV'T 5.9 | 1,500,000.00 | 2,092,875.00 | |
| | SPANISH GOV'T 6 | 2,400,000.00 | 3,477,000.00 | |
| | ユーロ 小計 | 495,890,000.00 | 594,367,432.00 (78,343,571,211) | |
| 英bond | TREASURY 1 | 3,300,000.00 | 3,322,770.00 | |
| | TREASURY 1.25 | 1,500,000.00 | 1,516,950.00 | |
| | TREASURY 1.75 | 2,500,000.00 | 2,535,275.00 | |
| | TREASURY 1.75 | 1,000,000.00 | 1,024,950.00 | |
| | TREASURY 1.75 | 3,000,000.00 | 3,047,490.00 | |
| | TREASURY 2 | 1,000,000.00 | 1,034,600.00 | |
| | TREASURY 2.25 | 2,700,000.00 | 2,823,930.00 | |
| | TREASURY 2.75 | 2,000,000.00 | 2,163,960.00 | |
| | TREASURY 3.25 | 2,000,000.00 | 2,270,200.00 | |
| | TREASURY 3.5 | 1,500,000.00 | 1,784,595.00 | |
| | TREASURY 3.5 | 1,000,000.00 | 1,317,150.00 | |
| | TREASURY 3.75 | 3,000,000.00 | 3,300,450.00 | |
| | TREASURY 3.75 | 2,800,000.00 | 3,132,920.00 | |
| | TREASURY 3.75 | 2,400,000.00 | 2,719,627.20 | |
| | TREASURY 3.75 | 2,300,000.00 | 3,010,999.00 | |
| | TREASURY 4 | 1,500,000.00 | 1,735,380.00 | |
| | TREASURY 4 | 2,000,000.00 | 2,853,760.00 | |

| | | | |
|------------|-----------------------|---------------|-----------------------------------|
| | TREASURY 4.25 | 1,300,000.00 | 1,613,963.00 |
| | TREASURY 4.25 | 2,000,000.00 | 2,534,060.00 |
| | TREASURY 4.25 | 2,500,000.00 | 3,206,000.00 |
| | TREASURY 4.25 | 1,500,000.00 | 1,954,845.00 |
| | TREASURY 4.25 | 2,000,000.00 | 2,632,060.00 |
| | TREASURY 4.25 | 2,400,000.00 | 3,284,208.00 |
| | TREASURY 4.25 | 1,900,000.00 | 2,669,253.00 |
| | TREASURY 4.25 | 2,100,000.00 | 3,081,141.00 |
| | TREASURY 4.5 | 2,700,000.00 | 3,012,606.00 |
| | TREASURY 4.5 | 2,500,000.00 | 3,288,300.00 |
| | TREASURY 4.5 | 2,000,000.00 | 2,763,340.00 |
| | TREASURY 4.75 | 2,700,000.00 | 3,105,216.00 |
| | TREASURY 4.75 | 2,300,000.00 | 3,048,535.00 |
| | TREASURY 4.75 | 1,500,000.00 | 2,084,070.00 |
| | TREASURY 5 | 2,500,000.00 | 2,742,300.00 |
| | TREASURY 5 | 2,500,000.00 | 3,174,750.00 |
| | TREASURY 6 | 1,200,000.00 | 1,748,520.00 |
| | TREASURY 8 | 1,620,000.00 | 2,193,156.00 |
| | TREASURY 8.75 | 800,000.00 | 911,576.00 |
| | UNITED KINGDOM G 2 | 1,500,000.00 | 1,519,230.00 |
| | 英債券 小計 | 75,020,000.00 | 90,162,135.20 (16,305,822,150) |
| スイスフラン | SWISS (GOVT) 2.25 | 900,000.00 | 1,025,370.00 |
| | SWISS (GOVT) 3 | 500,000.00 | 540,650.00 |
| | SWISS (GOVT) 3 | 1,000,000.00 | 1,133,000.00 |
| | SWISS (GOVT) 4 | 500,000.00 | 660,050.00 |
| | SWISS (GOVT) 4 | 700,000.00 | 1,039,150.00 |
| | SWISS (GOVT) 4.25 | 500,000.00 | 537,800.00 |
| | スイスフラン 小計 | 4,100,000.00 | 4,936,020.00 (603,428,445) |
| スウェーデンクローナ | SWEDISH GOVRNMNT 1.5 | 8,000,000.00 | 8,442,960.00 |
| | SWEDISH GOVRNMNT 2.5 | 5,000,000.00 | 5,685,600.00 |
| | SWEDISH GOVRNMNT 3.5 | 11,000,000.00 | 13,041,820.00 |
| | SWEDISH GOVRNMNT 3.5 | 6,000,000.00 | 7,571,520.00 |
| | SWEDISH GOVRNMNT 3.75 | 8,200,000.00 | 8,768,260.00 |
| | SWEDISH GOVRNMNT 4.25 | 12,000,000.00 | 13,709,400.00 |
| | SWEDISH GOVRNMNT 5 | 5,000,000.00 | 6,168,500.00 |
| | スウェーデンクローナ 小計 | 55,200,000.00 | 63,388,060.00 (898,842,690) |
| ノルウェークローネ | NORWEGIAN GOV'T 2 | 10,000,000.00 | 10,521,000.00 |
| | NORWEGIAN GOV'T 3 | 4,000,000.00 | 4,505,600.00 |
| | NORWEGIAN GOV'T 3.75 | 11,000,000.00 | 12,579,600.00 |
| | NORWEGIAN GOV'T 4.25 | 6,000,000.00 | 6,301,200.00 |

| | | | |
|--------------|-----------------------|---------------|----------------------------------|
| | NORWEGIAN GOV'T 4.5 | 6,000,000.00 | 6,768,300.00 |
| ノルウェークローネ 小計 | | 37,000,000.00 | 40,675,700.00 (563,765,202) |
| デンマーククローネ | DENMARK - BULLET 1.5 | 5,000,000.00 | 5,382,500.00 |
| | DENMARK - BULLET 1.75 | 5,000,000.00 | 5,444,400.00 |
| | DENMARK - BULLET 3 | 10,000,000.00 | 11,643,600.00 |
| | DENMARK - BULLET 4 | 10,000,000.00 | 10,842,000.00 |
| | DENMARK - BULLET 4 | 8,000,000.00 | 9,281,600.00 |
| | DENMARK - BULLET 4.5 | 14,000,000.00 | 22,933,400.00 |
| | DENMARK - BULLET 7 | 3,080,000.00 | 4,802,952.00 |
| デンマーククローネ 小計 | | 55,080,000.00 | 70,330,452.00 (1,242,035,782) |
| ポーランドズロチ | POLAND GOVT BOND 2.5 | 5,000,000.00 | 5,090,000.00 |
| | POLAND GOVT BOND 3.25 | 2,000,000.00 | 2,048,000.00 |
| | POLAND GOVT BOND 4 | 2,000,000.00 | 2,158,000.00 |
| | POLAND GOVT BOND 5.25 | 5,000,000.00 | 5,309,500.00 |
| | POLAND GOVT BOND 5.25 | 2,000,000.00 | 2,263,000.00 |
| | POLAND GOVT BOND 5.5 | 4,000,000.00 | 4,500,000.00 |
| | POLAND GOVT BOND 5.75 | 4,000,000.00 | 4,716,000.00 |
| | POLAND GOVT BOND 5.75 | 4,200,000.00 | 4,998,000.00 |
| | POLAND GOVT BOND 5.75 | 2,000,000.00 | 2,533,460.00 |
| ポーランドズロチ 小計 | | 30,200,000.00 | 33,615,960.00 (1,037,052,366) |
| オーストラリアドル | AUSTRALIAN GOVT. 2.75 | 1,000,000.00 | 1,023,050.00 |
| | AUSTRALIAN GOVT. 2.75 | 3,000,000.00 | 3,011,076.00 |
| | AUSTRALIAN GOVT. 2.75 | 1,000,000.00 | 913,800.00 |
| | AUSTRALIAN GOVT. 3.25 | 2,000,000.00 | 2,065,300.00 |
| | AUSTRALIAN GOVT. 3.25 | 3,000,000.00 | 3,117,000.00 |
| | AUSTRALIAN GOVT. 3.25 | 1,500,000.00 | 1,531,050.00 |
| | AUSTRALIAN GOVT. 3.75 | 1,000,000.00 | 1,056,100.00 |
| | AUSTRALIAN GOVT. 4.25 | 2,000,000.00 | 2,068,600.00 |
| | AUSTRALIAN GOVT. 4.25 | 2,000,000.00 | 2,225,000.00 |
| | AUSTRALIAN GOVT. 4.5 | 3,000,000.00 | 3,289,719.00 |
| | AUSTRALIAN GOVT. 4.5 | 1,500,000.00 | 1,749,900.00 |
| | AUSTRALIAN GOVT. 4.75 | 1,200,000.00 | 1,412,280.00 |
| | AUSTRALIAN GOVT. 5.25 | 3,000,000.00 | 3,296,910.00 |
| | AUSTRALIAN GOVT. 5.5 | 2,000,000.00 | 2,140,000.00 |
| | AUSTRALIAN GOVT. 5.5 | 2,500,000.00 | 2,981,000.00 |
| | AUSTRALIAN GOVT. 5.75 | 3,000,000.00 | 3,525,150.00 |
| | AUSTRALIAN GOVT. 5.75 | 2,000,000.00 | 2,391,800.00 |
| | AUSTRALIAN GOVT. 6 | 1,800,000.00 | 1,879,938.00 |
| | オーストラリアドル 小計 | | 36,500,000.00 |

| | | | | |
|---------------|-----------------------|----------------|-----------------|-------------------|
| シンガポールドル | SINGAPORE GOV'T 2.25 | 500,000.00 | 505,500.00 | |
| | SINGAPORE GOV'T 2.75 | 400,000.00 | 393,464.00 | |
| | SINGAPORE GOV'T 2.875 | 400,000.00 | 406,316.00 | |
| | SINGAPORE GOV'T 3.125 | 1,000,000.00 | 1,058,500.00 | |
| | SINGAPORE GOV'T 3.25 | 1,000,000.00 | 1,064,000.00 | |
| | SINGAPORE GOV'T 3.375 | 500,000.00 | 541,980.00 | |
| | SINGAPORE GOV'T 3.5 | 1,500,000.00 | 1,638,750.00 | |
| | SINGAPORE GOV'T 4 | 2,100,000.00 | 2,258,550.00 | |
| シンガポールドル 小計 | | 7,400,000.00 | 7,867,060.00 | (675,544,442) |
| マレーシアリングット | MALAYSIA GOVT 3.418 | 8,000,000.00 | 7,652,640.00 | |
| | MALAYSIA GOVT 3.502 | 9,000,000.00 | 8,160,435.00 | |
| | MALAYSIA GOVT 3.814 | 2,000,000.00 | 2,032,628.00 | |
| | MALAYSIA GOVT 4.24 | 5,000,000.00 | 5,116,500.00 | |
| | MALAYSIA GOVT 4.262 | 3,000,000.00 | 3,038,688.00 | |
| | MALAYSIA GOVT 4.378 | 5,000,000.00 | 5,155,000.00 | |
| マレーシアリングット 小計 | | 32,000,000.00 | 31,155,891.00 | (878,596,126) |
| 南アフリカランド | REP SOUTH AFRICA 6.5 | 40,000,000.00 | 26,228,000.00 | |
| | REP SOUTH AFRICA 6.75 | 30,000,000.00 | 27,031,500.00 | |
| | REP SOUTH AFRICA 7 | 40,000,000.00 | 30,800,000.00 | |
| | REP SOUTH AFRICA 8 | 10,000,000.00 | 9,854,000.00 | |
| | REP SOUTH AFRICA 8.25 | 8,000,000.00 | 7,971,680.00 | |
| 南アフリカランド 小計 | | 128,000,000.00 | 101,885,180.00 | (819,156,847) |
| 合計 | | | 194,358,799,433 | (194,358,799,433) |

(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 |
|------------|------------|----------|------------|
| 米ドル | 国債証券 197銘柄 | 42.5% | 43.1% |
| カナダドル | 国債証券 26銘柄 | 1.9% | 2.0% |
| メキシコペソ | 国債証券 7銘柄 | 1.0% | 1.0% |
| ユーロ | 国債証券 246銘柄 | 39.7% | 40.3% |
| 英ポンド | 国債証券 37銘柄 | 8.3% | 8.4% |
| スイスフラン | 国債証券 6銘柄 | 0.3% | 0.3% |
| スウェーデンクローナ | 国債証券 7銘柄 | 0.5% | 0.5% |
| ノルウェークローネ | 国債証券 5銘柄 | 0.3% | 0.3% |
| デンマーククローネ | 国債証券 7銘柄 | 0.6% | 0.6% |
| ポーランドズロチ | 国債証券 9銘柄 | 0.5% | 0.5% |
| オーストラリアドル | 国債証券 18銘柄 | 1.7% | 1.8% |
| シンガポールドル | 国債証券 8銘柄 | 0.3% | 0.3% |

| | | | | |
|------------|------|-----|------|------|
| マレーシアリングット | 国債証券 | 6銘柄 | 0.4% | 0.5% |
| 南アフリカランド | 国債証券 | 5銘柄 | 0.4% | 0.4% |

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「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。

S M A M ・ マネーインカムファンド < 適格機関投資家限定 >

貸借対照表

| | （単位：円） | |
|----------------|--------------------|--------------------|
| | （平成26年12月19日現在） | （平成27年12月18日現在） |
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| 親投資信託受益証券 | 351,819,950 | 420,393,814 |
| 流動資産合計 | 351,819,950 | 420,393,814 |
| 資産合計 | 351,819,950 | 420,393,814 |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 未払受託者報酬 | 1,651 | 2,325 |
| 未払委託者報酬 | 14,508 | 21,073 |
| 流動負債合計 | 16,159 | 23,398 |
| 負債合計 | 16,159 | 23,398 |
| 純資産の部 | | |
| 元本等 | | |
| 元本 | 348,639,298 | 416,711,197 |
| 剰余金 | | |
| 剰余金又は欠損金（ ） | 3,164,493 | 3,659,219 |
| 元本等合計 | 351,803,791 | 420,370,416 |
| 純資産合計 | 351,803,791 | 420,370,416 |
| 負債純資産合計 | 351,819,950 | 420,393,814 |

注記表

（重要な会計方針の注記）

| | |
|-----|--------------------------------|
| 項 目 | 自 平成27年 4月14日 至 平成27年12月18日 |
|-----|--------------------------------|

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

(貸借対照表に関する注記)

| 項 目 | （平成26年12月19日現在） | （平成27年12月18日現在） |
|-----------------------|--|--|
| 1. 当計算期間の末日における受益権の総数 | 348,639,298口 | 416,711,197口 |
| 2. 1単位当たり純資産の額 | 1口当たり純資産額 1.0091円 (10,000口当たりの純資産額 10,091円) | 1口当たり純資産額 1.0088円 (10,000口当たりの純資産額 10,088円) |

(金融商品に関する注記)

. 金融商品の状況に関する事項

| 項 目 | 自 平成27年 4月14日 至 平成27年12月18日 |
|------------------------|--|
| 1. 金融商品に対する取組方針 | 当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。 |
| 2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク | <p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、親投資信託受益証券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいておりません。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク</p> |

| | |
|---------------------------|--|
| | <p>有価証券およびデリバティブ取引等</p> <p>当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p> |
| 3.金融商品に係るリスク管理体制 | <p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する委員会をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用グループに是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用グループは、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。その後、当該関連運用グループの対処の実施や対処方針の決定等に関し、必要に応じてリスク管理を行う部署が当該部署の担当役員、当該関連運用グループの担当役員およびリスク管理委員会へ報告を行う体制となっております。</p> <p>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する部会にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。</p> |
| 4.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | <p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない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認める評価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。</p> |

・金融商品の時価等に関する事項

| 項目 | (平成27年12月18日現在) |
|-------------------|--|
| 1.貸借対照表計上額、時価及び差額 | 金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 |
| 2.時価の算定方法 | <p>(1) 有価証券（親投資信託受益証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p> |

(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）

該当事項はありません。

（その他の注記）

| 項 目 | （平成26年12月19日現在） | （平成27年12月18日現在） |
|-----------|-----------------|-----------------|
| 期首元本額 | 297,590,675円 | 387,243,990円 |
| 期中追加設定元本額 | 54,736,624円 | 48,937,001円 |
| 期中一部解約元本額 | 3,688,001円 | 19,469,794円 |

附属明細表

有価証券明細表

(a) 株式

該当事項はありません。

(b) 株式以外の有価証券

（単位：円）

| 種類 | 銘 柄 | 券面総額 | 評価額 | 備考 |
|-----------|-----------------|-------------|-------------|----|
| 親投資信託受益証券 | マネーインカム・マザーファンド | 415,326,827 | 420,393,814 | |
| 合計 | | 415,326,827 | 420,393,814 | |

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

（参考）

S M A M・マネーインカムファンド<適格機関投資家限定>は、「マネーインカム・マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同マザーファンドの受益証券です。

なお、以下に記載した状況は、監査の対象外です。

マネーインカム・マザーファンド

貸借対照表

| | （単位：円） | |
|-------------|-----------------|-----------------|
| | （平成26年12月19日現在） | （平成27年12月18日現在） |
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| コール・ローン | 28,032,754 | 306,631,991 |
| 国債証券 | 1,298,018,470 | 849,726,100 |
| 特殊債券 | - | 203,257,000 |
| 未収利息 | 3,722,893 | 4,434,646 |
| 前払費用 | 1,692,396 | 1,262,191 |
| 流動資産合計 | 1,331,466,513 | 1,365,311,928 |
| 資産合計 | 1,331,466,513 | 1,365,311,928 |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 未払解約金 | 10,000 | - |
| 流動負債合計 | 10,000 | - |
| 負債合計 | 10,000 | - |
| 純資産の部 | | |
| 元本等 | | |
| 元本 | 1,315,372,664 | 1,348,876,502 |
| 剰余金 | | |
| 剰余金又は欠損金（ ） | 16,083,849 | 16,435,426 |
| 元本等合計 | 1,331,456,513 | 1,365,311,928 |
| 純資産合計 | 1,331,456,513 | 1,365,311,928 |
| 負債純資産合計 | 1,331,466,513 | 1,365,311,928 |

注記表

（重要な会計方針の注記）

| | |
|-----|--------------------------------|
| 項 目 | 自 平成27年 4月14日 至 平成27年12月18日 |
|-----|--------------------------------|

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

(貸借対照表に関する注記)

| 項目 | (平成26年12月19日現在) | (平成27年12月18日現在) |
|-----------------------|---|---|
| 1. 当計算期間の末日における受益権の総数 | 1,315,372,664口 | 1,348,876,502口 |
| 2. 1単位当たり純資産の額 | 1口当たり純資産額 1.0122円 (10,000口当たりの純資産額 10,122円) | 1口当たり純資産額 1.0122円 (10,000口当たりの純資産額 10,122円) |

(金融商品に関する注記)

. 金融商品の状況に関する事項

| 項目 | 自平成27年 4月14日 至平成27年12月18日 |
|------------------------|--|
| 1. 金融商品に対する取組方針 | 当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。 |
| 2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク | <p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、国債証券、特殊債券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいておりません。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク</p> |

| | |
|---------------------------|--|
| | <p>有価証券およびデリバティブ取引等</p> <p>当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p> |
| 3.金融商品に係るリスク管理体制 | <p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する委員会をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用グループに是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用グループは、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。その後、当該関連運用グループの対処の実施や対処方針の決定等に関し、必要に応じてリスク管理を行う部署が当該部署の担当役員、当該関連運用グループの担当役員およびリスク管理委員会へ報告を行う体制となっております。</p> <p>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する部会にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。</p> |
| 4.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | <p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない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認める評価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。</p> |

・金融商品の時価等に関する事項

| 項目 | (平成27年12月18日現在) |
|-------------------|--|
| 1.貸借対照表計上額、時価及び差額 | 金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 |
| 2.時価の算定方法 | <p>(1) 有価証券（国債証券、特殊債券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p> |

(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）

該当事項はありません。

（その他の注記）

| （平成26年12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 | 1,367,531,596円 |
| 同期中における追加設定元本額 | 212,230,306円 |
| 同期中における一部解約元本額 | 264,389,238円 |
| 平成26年12月19日現在における元本の内訳 | |
| スミセイ・DCバランスファンド（機動的資産配分型） | 30,042,233円 |
| スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2020 | 15,221,888円 |
| スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2025 | 2,097,358円 |
| スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2030 | 1,789,279円 |
| スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2035 | 2,186,760円 |
| スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2040 | 1,092,946円 |
| スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2045 | 2,165,529円 |
| 日興ニューバード・米国小型ハイクオリティファンド（毎月決算型） | 99,128円 |
| 日興ニューバード・米国小型ハイクオリティファンド（資産成長型） | 297,384円 |
| S M A M ・ マネーインカムファンド＜適格機関投資家限定＞ | 347,579,481円 |
| S M A M ・ バランス先物ファンドV A 2 0 ＜適格機関投資家限定＞ | 665,502,511円 |
| S M A M ・ F G マネーファンドV A ＜適格機関投資家限定＞ | 247,298,167円 |
| 合計 | 1,315,372,664円 |

| （平成27年12月18日現在） | |
|------------------------|----------------|
| 開示対象ファンドの | |
| 期首における当該親投資信託の元本額 | 1,480,579,600円 |
| 同期中における追加設定元本額 | 314,723,321円 |
| 同期中における一部解約元本額 | 446,426,419円 |
| 平成27年12月18日現在における元本の内訳 | |

| | |
|---|----------------|
| スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2020 | 26,405,832円 |
| スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2025 | 8,687,305円 |
| スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2030 | 8,735,195円 |
| スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2035 | 5,457,036円 |
| スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2040 | 3,157,819円 |
| スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2045 | 6,848,648円 |
| 米国小型ハイクオリティファンド（毎月決算型） | 99,128円 |
| 米国小型ハイクオリティファンド（資産成長型） | 297,384円 |
| S M A M ・ マネーインカムファンド＜適格機関投資家限定＞ | 415,326,827円 |
| S M A M ・ バランス先物ファンドV A 2 0 ＜適格機関投資家限定＞ | 653,649,487円 |
| S M A M ・ F G マネーファンドV A ＜適格機関投資家限定＞ | 220,211,841円 |
| 合計 | 1,348,876,502円 |

附属明細表

有価証券明細表

(a) 株式

該当事項はありません。

(b) 株式以外の有価証券

（単位：円）

| 種類 | 銘柄 | 券面総額 | 評価額 | 備考 |
|--------|---------------------------|-------------|---------------|----|
| 国債証券 | 第338回利付国債（2年） | 215,000,000 | 215,068,800 | |
| | 第98回利付国債（5年） | 40,000,000 | 40,067,200 | |
| | 第276回利付国債（10年） | 200,000,000 | 200,016,000 | |
| | 第280回利付国債（10年） | 190,000,000 | 191,822,100 | |
| | 第283回利付国債（10年） | 200,000,000 | 202,752,000 | |
| 国債証券合計 | | 845,000,000 | 849,726,100 | |
| 特殊債券 | 第23回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 100,000,000 | 101,648,000 | |
| | 第19回政府保証国民生活債券 | 100,000,000 | 101,609,000 | |
| 特殊債券合計 | | 200,000,000 | 203,257,000 | |
| 合計 | | | 1,052,983,100 | |

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。

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

三井住友・DC年金プラン・ファンド（ターゲット・イヤー型）2010

平成28年 1月29日現在

| | |
|----------------|--------------|
| 資産総額 | 524,346,962円 |
| 負債総額 | 538,548円 |
| 純資産総額（ - ） | 523,808,414円 |
| 発行済口数 | 426,934,209口 |
| 1口当たり純資産額（ / ） | 1.2269円 |
| （1万口当たり純資産額） | （12,269円） |

三井住友・DC年金プラン・ファンド（ターゲット・イヤー型）2020

平成28年 1月29日現在

| | |
|----------------|----------------|
| 資産総額 | 1,213,738,001円 |
| 負債総額 | 1,948,561円 |
| 純資産総額（ - ） | 1,211,789,440円 |
| 発行済口数 | 852,496,313口 |
| 1口当たり純資産額（ / ） | 1.4215円 |
| （1万口当たり純資産額） | （14,215円） |

三井住友・DC年金プラン・ファンド（ターゲット・イヤー型）2030

平成28年 1月29日現在

| | |
|----------------|----------------|
| 資産総額 | 1,174,319,117円 |
| 負債総額 | 1,403,392円 |
| 純資産総額（ - ） | 1,172,915,725円 |
| 発行済口数 | 798,576,348口 |
| 1口当たり純資産額（ / ） | 1.4688円 |
| （1万口当たり純資産額） | （14,688円） |

三井住友・DC年金プラン・ファンド（ターゲット・イヤー型）2040

平成28年 1月29日現在

| | |
|------|----------------|
| 資産総額 | 1,768,047,573円 |
| 負債総額 | 6,276,277円 |

| | |
|----------------|----------------|
| 純資産総額（ - ） | 1,761,771,296円 |
| 発行済口数 | 1,175,209,291口 |
| 1口当たり純資産額（ / ） | 1.4991円 |
| （1万口当たり純資産額） | （14,991円） |

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

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

イ 名義書換

該当事項はありません。

ロ 受益者名簿

作成しません。

ハ 受益者に対する特典

ありません。

ニ 受益権の譲渡および譲渡制限等

（イ）受益権の譲渡

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

（ロ）受益権の譲渡制限および譲渡の対抗要件

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

ホ 受益権の再分割

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

ヘ 償還金

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

ト 質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

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

第三部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

イ 資本金の額および株式数

| | |
|--------------|---------------|
| | 平成28年 1月29日現在 |
| 資本金の額 | 2,000百万円 |
| 会社が発行する株式の総数 | 60,000株 |
| 発行済株式総数 | 17,640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。

八 会社の機構

委託会社の取締役は7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。

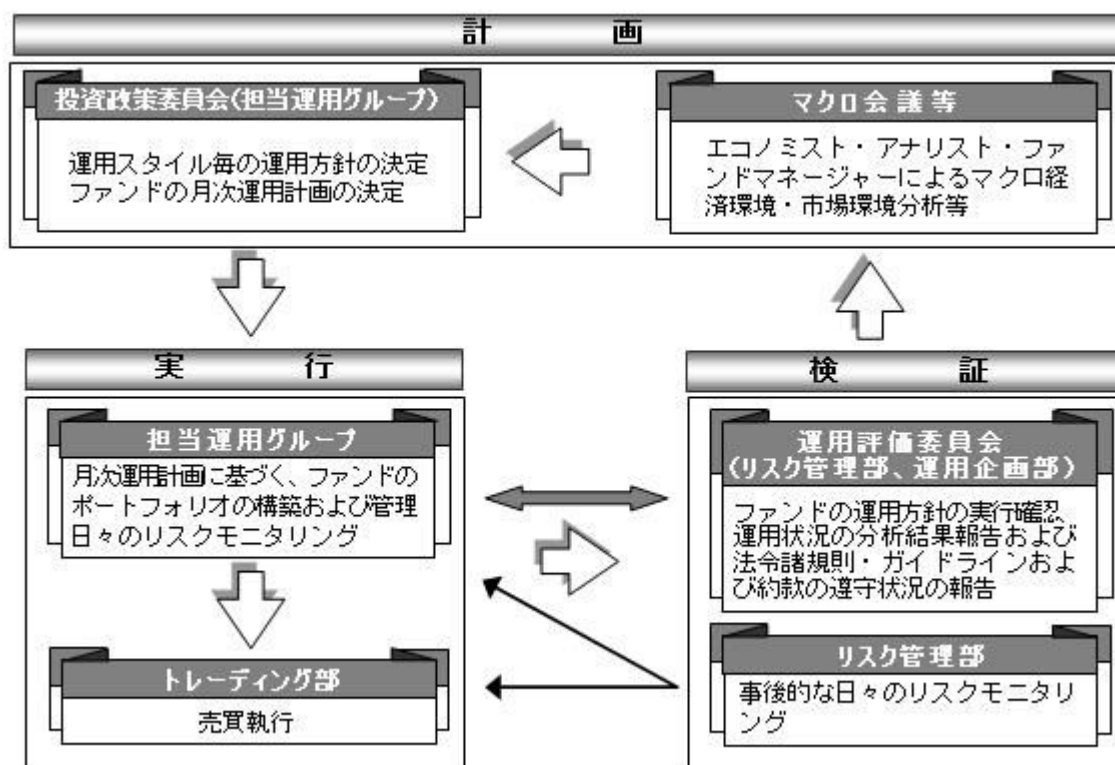
取締役の任期は、選任後1年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会の終結の時までとし、補欠または増員によって選任された取締役の任期は、他の現任取締役の任期の満了する時までとします。

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、代表取締役を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名のほか、取締役副社長、専務取締役、常務取締役を若干名選定することができます。

二 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その運用（投資運用業）を行っています。また「金融商品取引法」に定める投資助言業務を行っています。

平成28年1月29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。

（平成28年 1月29日現在）

| | | 本数(本) | 純資産総額(百万円) |
|---------|-----|----------------|----------------------------|
| 株式投資信託 | 単位型 | 51 (14) | 154,116 (56,306) |
| | 追加型 | 468 (188) | 5,031,754 (2,763,449) |
| | 計 | 519 (202) | 5,185,869 (2,819,755) |
| 公社債投資信託 | 単位型 | 48 (48) | 214,948 (214,948) |
| | 追加型 | 4 (1) | 224,496 (146,961) |
| | 計 | 52 (49) | 439,444 (361,909) |
| 合計 | | 571 (251) | 5,625,314 (3,181,664) |

()内は、私募投資信託分であり、内書き表記しております。

3【委託会社等の経理状況】

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

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

2 当社は、第30期（平成26年4月1日から平成27年3月31日まで）の財務諸表については、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、有限責任 あずさ監査法人の監査を受けており、第31期中間会計期間（平成27年4月1日から平成27年9月30日まで）の中間財務諸表については、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、有限責任 あずさ監査法人の中間監査を受けております。

(1)【貸借対照表】

(単位：千円)

| | | 前事業年度 (平成26年 3月31日) | 当事業年度 (平成27年 3月31日) |
|--------|---|------------------------|------------------------|
| 資産の部 | | | |
| 流動資産 | | | |
| 現金及び預金 | 2 | 20,615,467 | 25,021,336 |
| 有価証券 | | 4,999,802 | - |

| | | | |
|------------|---|------------|------------|
| 前払費用 | | 257,741 | 291,119 |
| 未収入金 | | 4,026 | 41,860 |
| 未収委託者報酬 | | 4,128,531 | 4,897,032 |
| 未収運用受託報酬 | | 934,710 | 1,000,744 |
| 未収投資助言報酬 | 2 | 453,941 | 455,390 |
| 未収収益 | | 11,700 | 13,030 |
| 繰延税金資産 | | 548,658 | 475,859 |
| その他の流動資産 | | 4,577 | 52,473 |
| 流動資産合計 | | 31,959,157 | 32,248,847 |
| 固定資産 | | | |
| 有形固定資産 | 1 | | |
| 建物 | | 124,723 | 120,234 |
| 器具備品 | | 204,970 | 230,712 |
| 有形固定資産合計 | | 329,694 | 350,947 |
| 無形固定資産 | | | |
| ソフトウェア | | 517,480 | 497,668 |
| ソフトウェア仮勘定 | | 4,595 | 77,155 |
| 電話加入権 | | 103 | 91 |
| 商標権 | | 468 | 222 |
| 無形固定資産合計 | | 522,646 | 575,137 |
| 投資その他の資産 | | | |
| 投資有価証券 | | 6,843,224 | 7,151,933 |
| 関係会社株式 | | 353,036 | 509,146 |
| 長期差入保証金 | | 541,904 | 600,480 |
| 長期前払費用 | | 41,193 | 36,031 |
| 会員権 | | 9,480 | 17,299 |
| 繰延税金資産 | | 463,476 | 665,425 |
| 投資その他の資産合計 | | 8,252,316 | 8,980,317 |
| 固定資産合計 | | 9,104,657 | 9,906,402 |
| 資産合計 | | 41,063,815 | 42,155,249 |

(単位：千円)

| | 前事業年度 (平成26年3月31日) | 当事業年度 (平成27年3月31日) |
|----------|-----------------------|-----------------------|
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 預り金 | 61,327 | 82,723 |
| 未払金 | | |
| 未払収益分配金 | 671 | 711 |
| 未払償還金 | 143,230 | 143,201 |
| 未払手数料 | 2,138,441 | 2,338,432 |
| その他未払金 | 203,170 | 1,075,587 |
| 未払費用 | 1,615,419 | 2,095,111 |
| 未払消費税等 | 215,390 | 478,421 |
| 未払法人税等 | 1,623,022 | 454,520 |
| 賞与引当金 | 926,263 | 906,623 |
| その他の流動負債 | 8 | 808 |
| 流動負債合計 | 6,926,944 | 7,576,142 |
| 固定負債 | | |
| 退職給付引当金 | 1,802,340 | 2,633,080 |
| 固定負債合計 | 1,802,340 | 2,633,080 |

| | | |
|------------|------------|------------|
| 負債合計 | 8,729,285 | 10,209,222 |
| 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 |
| 資本剰余金合計 | 8,628,984 | 8,628,984 |
| 利益剰余金 | | |
| 利益準備金 | 284,245 | 284,245 |
| その他利益剰余金 | | |
| 配当準備積立金 | 60,000 | 60,000 |
| 別途積立金 | 1,476,959 | 1,476,959 |
| 繰越利益剰余金 | 19,227,103 | 18,861,359 |
| 利益剰余金合計 | 21,048,308 | 20,682,564 |
| 株主資本計 | 31,677,292 | 31,311,548 |
| 評価・換算差額等 | | |
| その他有価証券 | | |
| 評価差額金 | 657,238 | 634,478 |
| 評価・換算差額等合計 | 657,238 | 634,478 |
| 純資産合計 | 32,334,530 | 31,946,027 |
| 負債・純資産合計 | 41,063,815 | 42,155,249 |

(2) 【損益計算書】

(単位：千円)

| | 前事業年度 | | 当事業年度 | |
|---------------------|-------------------------------|--|-------------------------------|--|
| | (自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日) | | (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日) | |
| 営業収益 | | | | |
| 委託者報酬 | 30,300,842 | | 30,094,858 | |
| 運用受託報酬 | 3,773,696 | | 3,862,895 | |
| 投資助言報酬 | 2,117,669 | | 2,106,161 | |
| その他営業収益 | | | | |
| 情報提供コンサルタント 業務報酬 | 5,000 | | 5,000 | |
| 投資法人運用受託報酬 | 26,625 | | 27,345 | |
| サービス支援手数料 | 24,883 | | 18,274 | |
| その他 | 56,406 | | 52,255 | |
| 営業収益計 | 36,305,122 | | 36,166,790 | |
| 営業費用 | | | | |
| 支払手数料 | 15,695,322 | | 15,123,724 | |
| 広告宣伝費 | 276,591 | | 407,991 | |
| 公告費 | 5,637 | | 4,737 | |
| 調査費 | | | | |
| 調査費 | 1,028,700 | | 1,319,743 | |
| 委託調査費 | 3,053,376 | | 3,550,675 | |
| 営業雑経費 | | | | |

| | | | |
|--------------------|---|------------|------------|
| 通信費 | | 38,776 | 38,911 |
| 印刷費 | | 262,934 | 294,002 |
| 協会費 | | 14,337 | 26,955 |
| 諸会費 | | 32,186 | 18,577 |
| 情報機器関連費 | | 2,277,699 | 2,403,857 |
| 販売促進費 | | 40,388 | 28,281 |
| その他 | | 117,451 | 144,250 |
| 営業費用合計 | | 22,843,403 | 23,361,707 |
| 一般管理費 | | | |
| 給料 | | | |
| 役員報酬 | | 140,440 | 190,241 |
| 給料・手当 | | 4,900,885 | 5,186,853 |
| 賞与 | | 786,372 | 569,685 |
| 賞与引当金繰入額 | | 926,263 | 906,623 |
| 交際費 | | 24,915 | 22,609 |
| 寄付金 | | 82 | - |
| 事務委託費 | | 303,945 | 366,661 |
| 旅費交通費 | | 196,933 | 226,254 |
| 租税公課 | | 100,575 | 108,953 |
| 不動産賃借料 | | 546,821 | 552,589 |
| 退職給付費用 | | 330,002 | 387,799 |
| 固定資産減価償却費 | | 227,090 | 287,833 |
| 諸経費 | | 258,736 | 283,156 |
| 一般管理費合計 | | 8,743,067 | 9,089,262 |
| 営業利益 | | 4,718,652 | 3,715,820 |
| 営業外収益 | | | |
| 受取配当金 | | 50,559 | 26,821 |
| 有価証券利息 | | 2,660 | 1,187 |
| 受取利息 | 1 | 5,190 | 6,113 |
| 時効成立分配金・償還金 | | 5,958 | 12 |
| 原稿・講演料 | | 2,456 | 1,899 |
| 還付加算金 | | 182 | - |
| 雑収入 | | 3,692 | 7,324 |
| 営業外収益合計 | | 70,701 | 43,357 |
| 営業外費用 | | | |
| 為替差損 | | 29,406 | 14,361 |
| 雑損失 | | 38 | - |
| 営業外費用合計 | | 29,444 | 14,361 |
| 経常利益 | | 4,759,909 | 3,744,816 |
| 特別利益 | | | |
| 投資有価証券償還益 | | 8,250 | 4,181 |
| 投資有価証券売却益 | | 310,894 | 893,251 |
| 負ののれん発生益 | | 186,047 | - |
| 企業結合に係る 特定勘定取崩益 | | 2,870 | - |
| 特別利益合計 | | 508,062 | 897,432 |
| 特別損失 | | | |
| 固定資産除却損 | 2 | 6,717 | 1,076 |
| 投資有価証券償還損 | | 2,337 | - |
| 投資有価証券評価損 | | 1,280 | - |
| 投資有価証券売却損 | | 454 | 1,091 |
| 合併関連費用 | | 17,767 | - |
| 事務所移転費用 | | 1,313 | - |
| その他の特別損失 | 3 | - | 973,862 |

| | | |
|--------------|-----------|-----------|
| 特別損失合計 | 29,870 | 976,030 |
| 税引前当期純利益 | 5,238,102 | 3,666,218 |
| 法人税、住民税及び事業税 | 2,147,762 | 1,574,213 |
| 法人税等調整額 | 282,886 | 166,505 |
| 法人税等合計 | 1,864,875 | 1,740,718 |
| 当期純利益 | 3,373,226 | 1,925,499 |

(3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日）

（単位：千円）

| | 株主資本 | | | | | | | | 株主資本 合計 |
|-----------------------------|-----------|-----------|-------------|---------|-------------|-----------|-------------|-------------|------------|
| | 資本金 | 資本剰余金 | | 利益準備金 | その他利益剰余金 | | | 利益剰余金 合計 | |
| | | 資本準備金 | 資本剰余金 合計 | | 配当準備 積立金 | 別途積立金 | 繰越利益 剰余金 | | |
| 当期首残高 | 2,000,000 | 8,628,984 | 8,628,984 | 284,245 | 60,000 | 1,476,959 | 16,718,237 | 18,539,441 | 29,168,425 |
| 当期変動額 | | | | | | | | | |
| 剰余金の配当 | | | | | | | 864,360 | 864,360 | 864,360 |
| 当期純利益 | | | | | | | 3,373,226 | 3,373,226 | 3,373,226 |
| 株主資本以外の 項目の当期変動 額（純額） | | | | | | | | | |
| 当期変動額合計 | - | - | - | - | - | - | 2,508,866 | 2,508,866 | 2,508,866 |
| 当期末残高 | 2,000,000 | 8,628,984 | 8,628,984 | 284,245 | 60,000 | 1,476,959 | 19,227,103 | 21,048,308 | 31,677,292 |

| | 評価・換算差額等 | | 純資産合計 |
|-----------------------------|------------------|----------------|------------|
| | その他有価証券 評価差額金 | 評価・換算 差額等合計 | |
| 当期首残高 | 529,488 | 529,488 | 29,697,914 |
| 当期変動額 | | | |
| 剰余金の配当 | | | 864,360 |
| 当期純利益 | | | 3,373,226 |
| 株主資本以外の項 目の当期変動額 （純額） | 127,749 | 127,749 | 127,749 |
| 当期変動額合計 | 127,749 | 127,749 | 2,636,616 |
| 当期末残高 | 657,238 | 657,238 | 32,334,530 |

当事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

（単位：千円）

| | 株主資本 | | | | | | | | 株主資本 合計 |
|--------------------------|-----------|-----------|-------------|---------|-------------|-----------|-------------|-------------|------------|
| | 資本金 | 資本剰余金 | | 利益準備金 | その他利益剰余金 | | | 利益剰余金 合計 | |
| | | 資本準備金 | 資本剰余金 合計 | | 配当準備 積立金 | 別途積立金 | 繰越利益 剰余金 | | |
| 当期首残高 | 2,000,000 | 8,628,984 | 8,628,984 | 284,245 | 60,000 | 1,476,959 | 19,227,103 | 21,048,308 | 31,677,292 |
| 会計方針の変更 による累積的影 響額 | | | | | | | 439,043 | 439,043 | 439,043 |
| 会計方針の変更を反映 した当期首残高 | 2,000,000 | 8,628,984 | 8,628,984 | 284,245 | 60,000 | 1,476,959 | 18,788,060 | 20,609,264 | 31,238,248 |

| | | | | | | | | | |
|---------------------|-----------|-----------|-----------|---------|--------|-----------|------------|------------|------------|
| 当期変動額 | | | | | | | | | |
| 剰余金の配当 | | | | | | | 1,852,200 | 1,852,200 | 1,852,200 |
| 当期純利益 | | | | | | | 1,925,499 | 1,925,499 | 1,925,499 |
| 株主資本以外の項目の当期変動額（純額） | | | | | | | | | |
| 当期変動額合計 | - | - | - | - | - | - | 73,299 | 73,299 | 73,299 |
| 当期末残高 | 2,000,000 | 8,628,984 | 8,628,984 | 284,245 | 60,000 | 1,476,959 | 18,861,359 | 20,682,564 | 31,311,548 |

| | 評価・換算差額等 | | 純資産合計 |
|---------------------|------------------|----------------|------------|
| | その他有価証券 評価差額金 | 評価・換算 差額等合計 | |
| 当期首残高 | 657,238 | 657,238 | 32,334,530 |
| 会計方針の変更による累積的影響額 | | | 439,043 |
| 会計方針の変更を反映した当期首残高 | 657,238 | 657,238 | 31,895,486 |
| 当期変動額 | | | |
| 剰余金の配当 | | | 1,852,200 |
| 当期純利益 | | | 1,925,499 |
| 株主資本以外の項目の当期変動額（純額） | 22,759 | 22,759 | 22,759 |
| 当期変動額合計 | 22,759 | 22,759 | 50,540 |
| 当期末残高 | 634,478 | 634,478 | 31,946,027 |

[注記事項]

(重要な会計方針)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法

(1) 満期保有目的の債券

償却原価法

(2) 子会社株式及び関連会社株式

移動平均法による原価法

(3) その他有価証券

時価のあるもの

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）

時価のないもの

移動平均法による原価法

2. 固定資産の減価償却の方法

(1) 有形固定資産

定率法によっております。但し、建物(建物附属設備を除く)については、定額法によっております。

なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。

建物 3～50年

器具備品 3～20年

(2) 無形固定資産

定額法によっております。

なお、ソフトウェア(自社利用分)については、社内における利用可能期間(5年)に基づく定額法によっております。

3. 引当金の計上基準

(1) 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。

(2) 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計上しております。

退職給付見込額の期間帰属方法

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

数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法

過去勤務費用については、その発生時において一時に費用処理しております。

数理計算上の差異については、その発生時において一時に費用処理しております。

4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

消費税等の会計処理

消費税等の会計処理は税抜方式によっております。

(会計方針の変更)

(退職給付に関する会計基準等の適用)

「退職給付に関する会計基準」(企業会計基準第26号 平成24年5月17日。以下「退職給付会計基準」という。)及び「退職給付に関する会計基準の適用指針」(企業会計基準適用指針第25号 平成27年3月26日。以下「退職給付適用指針」という。)を、退職給付会計基準第35項本文及び退職給付適用指針第67項本文に掲げられた定めについて当事業年度より適用し、退職給付債務及び勤務費用の計算方法を見直し、退職給付見込額の期間帰属方法を期間定額基準から給付算定式基準へ変更いたしました。

退職給付会計基準等の適用については、退職給付会計基準第37項に定める経過的な取扱いに従って、当事業年度の期首において、退職給付債務及び勤務費用の計算方法の変更に伴う影響額を繰越利益剰余金に加減しております。

この結果、当事業年度の期首の退職給付引当金が682,168千円、繰延税金資産が243,124千円増加し、繰越利益剰余金が439,043千円減少しております。また、当事業年度の営業利益、経常利益及び税引前当期純利益はそれぞれ28,067千円減少しております。

なお、1株当たり情報に与える影響は当該箇所に記載しております。

(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 (平成26年3月31日) | 当事業年度 (平成27年3月31日) |
|------|-----------------------|-----------------------|
| 建物 | 241,339千円 | 258,412千円 |
| 器具備品 | 704,790千円 | 783,602千円 |

2 関係会社に対する資産及び負債

| | 前事業年度 (平成26年3月31日) | 当事業年度 (平成27年3月31日) |
|----------|-----------------------|-----------------------|
| 現金及び預金 | 14,959,545千円 | 18,853,119千円 |
| 未収投資助言報酬 | 290,426千円 | 286,990千円 |
| 未払手数料 | 360,659千円 | 392,772千円 |

- 3 当社は、運転資金の効率的な調達を行うため取引銀行1行と当座借越契約を締結しております。当事業年度末における当座借越契約に係る借入金未実行残高等は次のとおりであります。

| | 前事業年度 (平成26年3月31日) | 当事業年度 (平成27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 |

4 保証債務

当社は、子会社であるSumitomo Mitsui Asset Management(New York) Inc.における賃貸借契約に係る賃借料に対し、前事業年度は平成27年6月まで、当事業年度は平成35年6月までの賃貸料総額の支払保証を行っております。

| | 前事業年度 (平成26年3月31日) | 当事業年度 (平成27年3月31日) |
|--|-----------------------|-----------------------|
| Sumitomo Mitsui Asset Management (New York) Inc. | 27,470千円 | 355,376千円 |

(損益計算書関係)

- 1 関係会社との取引に係るものが次のとおり含まれております。

| | 前事業年度 (自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日) | 当事業年度 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日) |
|------|--|--|
| 受取利息 | 2,104千円 | 2,463千円 |

2 固定資産除却損

| | 前事業年度 (自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日) | 当事業年度 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日) |
|--------|--|--|
| 器具備品 | 864千円 | 1,076千円 |
| ソフトウェア | 5,853千円 | - 千円 |
| 計 | 6,717千円 | 1,076千円 |

3 その他の特別損失

その他の特別損失は、中国において同国国家税務総局が平成26年11月17日付で公布した財税[2014]79号通達に基づき、当社が委託者として運用する証券投資信託に関し、適格国外機関投資家として課される平成21年11月17日から平成26年11月16日までに行われた中国A株投資のキャピタル・ゲインに対して遡及的に徴される源泉所得税等について納付すべきと見込まれる金額を計上したものであります。

(株主資本等変動計算書関係)

前事業年度(自 平成25年4月1日 至 平成26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 | 17,640株 | - | - | 17,640株 |

2. 剰余金の配当に関する事項

(1) 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 |
|----------------------|-------|----------------|-----------------|----------------|----------------|
| 平成25年6月24日 定時株主総会 | 普通株式 | 864,360 | 49,000 | 平成25年 3月31日 | 平成25年 6月25日 |

(2) 基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生が翌事業年度になるもの

平成26年6月26日開催の第29回定時株主総会において次の通り付議いたします。

| 決議 | 株式の種類 | 配当の原資 | 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 |
|----------------------|-------|-------|------------|-------------|----------------|----------------|
| 平成26年6月26日 定時株主総会 | 普通株式 | 利益剰余金 | 1,852,200 | 105,000 | 平成26年 3月31日 | 平成26年 6月27日 |

当事業年度(自 平成26年4月1日 至 平成27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 | 17,640株 | - | - | 17,640株 |

2.剰余金の配当に関する事項

(1)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 |
|----------------------|-------|------------|-------------|----------------|----------------|
| 平成26年6月26日 定時株主総会 | 普通株式 | 1,852,200 | 105,000 | 平成26年 3月31日 | 平成26年 6月27日 |

(2)基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生が翌事業年度になるもの

平成27年6月30日開催の第30回定時株主総会において次の通り付議いたします。

| 決議 | 株式の種類 | 配当の原資 | 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 |
|----------------------|-------|-------|------------|-------------|----------------|---------------|
| 平成27年6月30日 定時株主総会 | 普通株式 | 利益剰余金 | 952,560 | 54,000 | 平成27年 3月31日 | 平成27年 7月1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 (平成26年3月31日) | 当事業年度 (平成27年3月31日) |
|------|-----------------------|-----------------------|
| 1年以内 | 525,188 | 572,402 |
| 1年超 | 751,482 | 1,340,637 |
| 合計 | 1,276,671 | 1,913,040 |

(金融商品関係)

1.金融商品の状況に関する事項

(1)金融商品に対する取組方針

当社は、投資運用業及び投資助言業などの金融サービス事業を行っています。そのため、資金運用については、短期的で安全性の高い金融資産に限定し、財務体質の健全性、安全性、流動性の確保を第一とし、顧客利益に反しない運用を行っています。また、資金調達及びデリバティブ取引は行っていません。

(2)金融商品の内容及びそのリスク

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

有価証券及び投資有価証券については、主に満期保有目的の債券及び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、主に全額出資の海外子会社の株式及び50%出資した海外関連会社の株式であり、発行体の信用リスクに晒されています。また、長期差入保証金は、建物等の賃借

契約に関連する敷金等であり、差入先の信用リスクに晒されています。

営業債務である未払手数料は、すべて1年以内の支払期日であります。

(3)金融商品に係るリスク管理体制

信用リスクの管理

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

満期保有目的の債券は、余資運用規則に基づき、短期の国債のみを対象としているため、信用リスクは僅少であります。

有価証券、投資有価証券、子会社株式及び関連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。

長期差入保証金についても、差入先の信用リスクについて、資産の自己査定及び償却・引当規程に従い、定期的に管理を行い、その状況について取締役会に報告しています。

市場リスクの管理

有価証券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、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。

(4)金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

金融商品の時価には、市場価格及び業界団体が公表する売買参考統計値等に基づく価額のほか、これらの価額がない場合には合理的に算定された価額が含まれています。当該価額の算定においては一定の前提条件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があります。

2.金融商品の時価等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりです。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含まれていません（（注2）参照）。

前事業年度（平成26年3月31日）

（単位：千円）

| | 貸借対照表計上額 | 時価 | 差額 |
|-----------------|------------|------------|-----|
| (1)現金及び預金 | 20,615,467 | 20,615,467 | - |
| (2)未収委託者報酬 | 4,128,531 | 4,128,531 | - |
| (3)未収運用受託報酬 | 934,710 | 934,710 | - |
| (4)未収投資助言報酬 | 453,941 | 453,941 | - |
| (5)有価証券及び投資有価証券 | | | |
| 満期保有目的の債券 | 4,999,802 | 4,999,500 | 302 |
| その他有価証券 | 6,811,166 | 6,811,166 | - |
| (6)長期差入保証金 | 541,904 | 541,904 | - |
| 資産計 | 38,485,524 | 38,485,221 | 302 |
| (1)未払金 | | | |
| 未払手数料 | 2,138,441 | 2,138,441 | - |
| 負債計 | 2,138,441 | 2,138,441 | - |

当事業年度（平成27年3月31日）

（単位：千円）

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

| | | | |
|------------------------------|------------|------------|---|
| (1)現金及び預金 | 25,021,336 | 25,021,336 | - |
| (2)未収委託者報酬 | 4,897,032 | 4,897,032 | - |
| (3)未収運用受託報酬 | 1,000,744 | 1,000,744 | - |
| (4)未収投資助言報酬 | 455,390 | 455,390 | - |
| (5)有価証券及び投資有価証券 満期保有目的の債券 | - | - | - |
| その他有価証券 | 7,131,075 | 7,131,075 | - |
| (6)長期差入保証金 | 600,480 | 600,480 | - |
| 資産計 | 39,106,059 | 39,106,059 | - |
| (1)未払金 未払手数料 | 2,338,432 | 2,338,432 | - |
| 負債計 | 2,338,432 | 2,338,432 | - |

(注1)金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

資 産

(1)現金及び預金、(2)未収委託者報酬、(3)未収運用受託報酬、及び(4)未収投資助言報酬

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっています。

(5)有価証券及び投資有価証券

これらの時価について、債券については業界団体が公表する売買参考統計値等によって、投資信託等については取引所の価格、取引金融機関から提示された価格及び公表されている基準価格によっております。

また、保有目的ごとの有価証券に関する注記事項については、「有価証券関係」注記を参照ください。

(6)長期差入保証金

これらの時価については、敷金の性質及び賃貸借契約の期間から帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっています。

負 債

(1)未払金

未払手数料

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっています。

(注2)時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品の貸借対照表計上額

(単位：千円)

| | 前事業年度 (平成26年3月31日) | 当事業年度 (平成27年3月31日) |
|---------------|-----------------------|-----------------------|
| その他有価証券 | | |
| 非上場株式 | 298 | 298 |
| 投資証券 | 31,760 | 20,560 |
| 合計 | 32,058 | 20,858 |
| 子会社株式及び関連会社株式 | | |
| 非上場株式 | 353,036 | 509,146 |
| 合計 | 353,036 | 509,146 |

その他有価証券については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められるものであり、「(5) その他有価証券」には含めておりません。

子会社株式及び関連会社株式については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められるものであることから、時価開示の対象とはしておりません。

(注3)金銭債権及び満期がある有価証券の決算日後の償還予定額

前事業年度（平成26年3月31日）

(単位：千円)

| 区分 | 1年以内 | 1年超5年以内 | 5年超10年以内 | 10年超 |
|-----------------------|------------|---------|----------|------|
| 現金及び預金 | 20,615,467 | - | - | - |
| 未収委託者報酬 | 4,128,531 | - | - | - |
| 未収運用受託報酬 | 934,710 | - | - | - |
| 未収投資助言報酬 | 453,941 | - | - | - |
| 有価証券及び投資有価証券 | | | | |
| 満期保有目的の債券 | 5,000,000 | - | - | - |
| その他有価証券のうち 満期があるもの | - | - | - | - |
| 長期差入保証金 | 23,475 | 518,429 | - | - |
| 合計 | 31,156,125 | 518,429 | - | - |

当事業年度(平成27年3月31日)

(単位：千円)

| 区分 | 1年以内 | 1年超5年以内 | 5年超10年以内 | 10年超 |
|----------|------------|---------|----------|------|
| 現金及び預金 | 25,021,336 | - | - | - |
| 未収委託者報酬 | 4,897,032 | - | - | - |
| 未収運用受託報酬 | 1,000,744 | - | - | - |
| 未収投資助言報酬 | 455,390 | - | - | - |
| 長期差入保証金 | 4,148 | 596,332 | - | - |
| 合計 | 31,378,651 | 596,332 | - | - |

(有価証券関係)

1. 満期保有目的の債券

前事業年度(平成26年3月31日)

(単位：千円)

| 区分 | 貸借対照表計上額 | 時価 | 差額 |
|-----------------------------------|-----------|-----------|-----|
| (1) 貸借対照表日の時価が貸借対照 表計上額を超えるもの | | | |
| - | - | - | - |
| 小計 | - | - | - |
| (2) 貸借対照表日の時価が貸借対照 表計上額を超えないもの | | | |
| 国債 | 4,999,802 | 4,999,500 | 302 |
| 小計 | 4,999,802 | 4,999,500 | 302 |
| 合計 | 4,999,802 | 4,999,500 | 302 |

当事業年度(平成27年3月31日)

該当事項はありません。

2. 子会社株式及び関連会社株式

前事業年度(平成26年3月31日)

子会社株式及び関連会社株式(貸借対照表計上額 関係会社株式353,036千円)は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載しておりません。

当事業年度(平成27年3月31日)

子会社株式及び関連会社株式(貸借対照表計上額 関係会社株式509,146千円)は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載しておりません。

3. その他有価証券

前事業年度(平成26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 | 6,390,685 | 5,387,490 | 1,003,195 |
| 小計 | 6,390,685 | 5,387,490 | 1,003,195 |
| (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 | 420,480 | 424,165 | 3,684 |
| 小計 | 420,480 | 424,165 | 3,684 |
| 合計 | 6,811,166 | 5,811,655 | 999,510 |

(注)非上場株式等(貸借対照表計上額 32,058千円)については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載しておりません。また、上記「貸借対照表計上額」は、減損処理後の帳簿価額です。当事業年度における減損処理額は、1,280千円です。

当事業年度(平成27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 | 5,826,531 | 4,894,554 | 931,977 |
| 小計 | 5,826,531 | 4,894,554 | 931,977 |
| (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 | 1,304,543 | 1,312,300 | 7,756 |
| 小計 | 1,304,543 | 1,312,300 | 7,756 |
| 合計 | 7,131,075 | 6,206,854 | 924,220 |

(注)非上場株式等(貸借対照表計上額 20,858千円)については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載しておりません。

4.当事業年度中に売却したその他有価証券

前事業年度(自平成25年4月1日至平成26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 |
|-----------|---------|---------|
| 2,097,321 | 310,894 | 454 |

当事業年度(自平成26年4月1日至平成27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 |
|-----------|---------|---------|
| 3,892,685 | 893,251 | 1,091 |

(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 (自平成25年4月1日 至平成26年3月31日) | 当事業年度 (自平成26年4月1日 至平成27年3月31日) |
|----------------------|--------------------------------------|--------------------------------------|
| 退職給付債務の期首残高 | 1,605,470 | 1,802,340 |
| 会計方針の変更による 累積的影響額 | - | 682,168 |
| 会計方針の変更を反映した期首残高 | 1,605,470 | 2,484,508 |
| 勤務費用 | 184,549 | 217,881 |
| 利息費用 | 25,192 | 18,161 |

| | | |
|--------------|-----------|-----------|
| 数理計算上の差異の発生額 | 21,670 | 276 |
| 退職給付の支払額 | 93,535 | 87,196 |
| 過去勤務費用の発生額 | 27,157 | - |
| その他 | 75,176 | - |
| 退職給付債務の期末残高 | 1,802,340 | 2,633,080 |

(注) その他は、トヨタアセットマネジメント株式会社との合併により引き継いだ退職給付債務額になります。

(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 (平成26年3月31日) | 当事業年度 (平成27年3月31日) |
| 非積立型制度の退職給付債務 | 1,802,340 | 2,633,080 |
| 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 | 1,802,340 | 2,633,080 |

(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 (自平成25年4月1日 至平成26年3月31日) | 当事業年度 (自平成26年4月1日 至平成27年3月31日) |
| 勤務費用 | 184,549 | 217,881 |
| 利息費用 | 25,192 | 18,161 |
| 数理計算上の差異の費用処理額 | 21,670 | 276 |
| 過去勤務費用の費用処理額 | 27,157 | - |
| その他 | 114,773 | 152,031 |
| 確定給付制度に係る 退職給付費用 | 330,002 | 387,799 |

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

(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 (自平成25年4月1日 至平成26年3月31日) | 当事業年度 (自平成26年4月1日 至平成27年3月31日) |
|-----|--------------------------------------|--------------------------------------|
| 割引率 | 1.5% | 0.731% |

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43,539千円、当事業年度105,357千円でありませ

(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 (平成26年3月31日) | 当事業年度 (平成27年3月31日) |
| 流動の部 | | |
| 繰延税金資産 | | |
| 未払金 | - | 321,602 |

| | | |
|--------------|-----------|-----------|
| 賞与引当金 | 330,120 | 299,729 |
| 調査費 | 62,002 | 77,863 |
| 未払事業税 | 123,029 | 49,504 |
| その他 | 33,507 | 48,762 |
| 繰延税金資産小計 | 548,658 | 797,462 |
| 評価性引当額 | - | 321,602 |
| 繰延税金資産合計 | 548,658 | 475,859 |
| 固定の部 | | |
| 繰延税金資産 | | |
| 退職給付引当金 | 642,354 | 849,431 |
| 特定外国子会社留保金額 | 226,680 | 211,024 |
| ソフトウェア償却 | 105,651 | 62,560 |
| 投資有価証券評価損 | 50,143 | 43,051 |
| その他 | 6,970 | 6,291 |
| 繰延税金資産小計 | 1,031,799 | 1,172,360 |
| 評価性引当額 | 233,276 | 217,192 |
| 繰延税金資産合計 | 798,523 | 955,168 |
| 繰延税金負債 | | |
| その他有価証券評価差額金 | 334,588 | 289,742 |
| その他 | 457 | - |
| 繰延税金負債合計 | 335,046 | 289,742 |
| 繰延税金資産の純額 | 1,012,135 | 1,141,285 |

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 (平成26年3月31日) | 当事業年度 (平成27年3月31日) |
|----------------------|-----------------------|-----------------------|
| 法定実効税率 | 38.0% | 35.6% |
| (調整) | | |
| 評価性引当額の増減 | 0.5 | 9.6 |
| 交際費等永久に損金に算入されない項目 | 0.3 | 0.2 |
| 受取配当等永久に益金に算入されない項目 | - | 0.5 |
| 住民税均等割等 | 0.1 | 0.2 |
| 税率変更による期末繰延税金資産の減額修正 | 0.7 | 3.7 |
| 所得税額控除による税額控除 | - | 1.3 |
| 負ののれん発生益 | 1.3 | - |
| 企業結合に係る特定勘定取崩 | 1.5 | - |
| その他 | 0.1 | 0.1 |
| 税効果会計適用後の法人税等の負担率 | 35.6 | 47.5 |

3. 法人税等の税率の変更による繰延税金資産及び繰延税金負債の金額の修正

「所得税法等の一部を改正する法律」（平成27年法律第9号）及び「地方税法等の一部を改正する法律」（平成27年法律第2号）が平成27年3月31日に公布されたことに伴い、当事業年度の繰延税金資産及び繰延税金負債の計算（ただし、平成27年4月1日以降解消されるものに限る）に使用した法定実効税率は、前事業年度の35.6%から、回収又は支払が見込まれる期間が平成27年4月1日から平成28年3月31日までのものは33.1%、平成28年4月1日以降のものについては32.3%にそれぞれ変更されております。

その結果、繰延税金資産の金額（繰延税金負債の金額を控除した金額）が106,175千円減少し、当事業年度に計上された法人税等調整額が136,532千円、その他有価証券評価差額金が30,357千円それぞれ増加しております。

(セグメント情報等)

前事業年度(自 平成25年4月1日 至 平成26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 |
|-----------|------------|-----------|-----------|---------|------------|
| 外部顧客への売上高 | 30,300,842 | 3,773,696 | 2,117,669 | 112,914 | 36,305,122 |

(2) 地域ごとの情報

売上高

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

有形固定資産

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

(3) 主要な顧客ごとの情報

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

3. 報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

該当事項はありません。

4. 報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

該当事項はありません。

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

当社は単一セグメントのため、記載を省略しております。

当事業年度(自 平成26年4月1日 至 平成27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 |
|-----------|------------|-----------|-----------|---------|------------|
| 外部顧客への売上高 | 30,094,858 | 3,862,895 | 2,106,161 | 102,874 | 36,166,790 |

(2)地域ごとの情報

売上高

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

有形固定資産

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

(3)主要な顧客ごとの情報

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

3. 報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

該当事項はありません。

4. 報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

該当事項はありません。

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 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)

1. 親会社及び主要株主（会社等の場合に限る。）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 |
|----------|------------|-----------|---------------|-----------|-------------------|------------------|---------|-----------|----------|---------|
| その他の関係会社 | (株)三井住友銀行 | 東京都千代田区 | 1,770,996,505 | 銀行業 | (被所有) % 直接 40 | 投信の販売委託 役員の兼任 | 委託販売手数料 | 3,299,099 | 未払手数料 | 257,411 |
| その他の関係会社 | 住友生命保険(相) | 大阪府大阪市中央区 | 270,000,000 | 生命保険業 | (被所有) % 直接27.5 | 当社の主要顧客 | 投資助言報酬 | 1,127,963 | 未収投資助言報酬 | 290,426 |

(注) 1. 上記金額のうち、取引金額には消費税等は含まれておらず、期末残高には消費税等が含まれております。

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

(1) 投資助言契約の受託については、一般取引条件を勘案した個別契約に基づき決定しております。

(2) 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. 子会社及び関連会社等

(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 |
|------|-----------------------------------|-----------|-------------------------|-----------|----------------|------------------|-------|---------|----|------|
| 関連会社 | UOB-SM Asset Management Pte. Ltd. | Singapore | 3,000,000 (シンガポールドル) | 投資運用業 | (所有) % 直接50 | 投信の販売委託 役員の兼任 | 出資の引受 | 118,725 | - | - |

(注) 1. UOB-SM Asset Management Pte. Ltd.の出資の引受は、新規法人設立のため行ったものであります。

3. その他の関係会社の子会社等

(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 |
|--------------|--------------|---------|-------------|-----------|----------------|------------------|---------|-----------|-------|---------|
| その他の関係会社の子会社 | SMB C日興証券(株) | 東京都千代田区 | 10,000,000 | 証券業 | - % | 投信の販売委託 役員の兼任 | 委託販売手数料 | 4,037,816 | 未払手数料 | 403,591 |

- (注) 1. 上記金額のうち、取引金額には消費税等は含まれておらず、期末残高には消費税等が含まれております。
2. 取引条件及び取引条件の決定方針等
- (1) 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。

当事業年度(自 平成26年 4月 1日 至 平成27年 3月31日)

1. 親会社及び主要株主(会社等の場合に限る。)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 |
|----------|------------|-----------|---------------|-----------|-------------------|------------------|---------|-----------|----------|---------|
| その他の関係会社 | (株)三井住友銀行 | 東京都千代田区 | 1,770,996,505 | 銀行業 | (被所有) % 直接 40 | 投信の販売委託 役員の兼任 | 委託販売手数料 | 2,527,962 | 未払手数料 | 289,954 |
| その他の関係会社 | 住友生命保険(相) | 大阪府大阪市中央区 | 270,000,000 | 生命保険業 | (被所有) % 直接27.5 | 当社の主要顧客 | 投資助言報酬 | 1,072,459 | 未収投資助言報酬 | 286,990 |

- (注) 1. 上記金額のうち、取引金額には消費税等は含まれておらず、期末残高には消費税等が含まれております。
2. 取引条件及び取引条件の決定方針等
- (1) 投資助言契約の受託については、一般取引条件を勘案した個別契約に基づき決定しております。
- (2) 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. 子会社及び関連会社等

(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 |
|------|-----------------------------------|-----------|-------------------------|-----------|-----------------|-------------------|-------|---------|----|------|
| 子会社 | ソーラーエナジー投資合同会社 | 東京都港区 | 20,000 | 投資運用業 | (所有) % 直接100 | 投資事業有限責任組合の運営及び管理 | 出資の引受 | 20,000 | - | - |
| 関連会社 | UOB-SM Asset Management Pte. Ltd. | Singapore | 6,000,000 (シンガポールドル) | 投資運用業 | (所有) % 直接50 | 投信の販売委託 役員の兼任 | 増資の引受 | 136,110 | - | - |

- (注) 1. ソーラーエナジー投資合同会社の出資の引受は、新規法人設立のため行ったものであります。
2. UOB-SM Asset Management Pte. Ltd.の増資の引受については、当社とUOBアセットマネジメント社がそれぞれ1,500,000(シンガポールドル)出資しました。

3. その他の関係会社の子会社等

(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 |
|--------------|--------------|---------|-------------|-----------|----------------|------------------|---------|-----------|-------|---------|
| その他の関係会社の子会社 | SMB C日興証券(株) | 東京都千代田区 | 10,000,000 | 証券業 | - % | 投信の販売委託 役員の兼任 | 委託販売手数料 | 4,705,879 | 未払手数料 | 697,658 |

- (注) 1. 上記金額のうち、取引金額には消費税等は含まれておらず、期末残高には消費税等が含まれております。
2. 取引条件及び取引条件の決定方針等
- (1) 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。

(1株当たり情報)

| | 前事業年度 (自 平成25年 4月 1日 至 平成26年 3月31日) | 当事業年度 (自 平成26年 4月 1日 至 平成27年 3月31日) |
|--------------|---|---|
| 1株当たり純資産額 | 1,833,023.27円 | 1,810,999.27円 |
| 1株当たり当期純利益金額 | 191,226.00円 | 109,155.30円 |

- (注) 1. 潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額については、潜在株式が存在しないため記載していません。
2. 「会計方針の変更に関する注記」に記載のとおり、退職給付会計基準等を適用し、退職給付会計基準第37項に定める経過的な取扱いに従っております。この結果、当事業年度の期首の1

株当たり純資産額が、24,889円09銭減少し、1株当たり当期純利益金額は、1,591円10銭減少しております。

3. 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

| | 前事業年度 (自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日) | 当事業年度 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日) |
|------------------------|--|--|
| 1株当たり当期純利益金額 | | |
| 当期純利益(千円) | 3,373,226 | 1,925,499 |
| 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金額 (千円) | 3,373,226 | 1,925,499 |
| 期中平均株式数(株) | 17,640 | 17,640 |

(重要な後発事象)

1. 日興グローバルラップ株式会社の株式の取得(子会社化)について

当社は、平成26年12月26日開催の取締役会において、当社が日興グローバルラップ株式会社(以下「NGW」)の発行済株式の全部を取得し子会社化することを決議し、平成26年12月26日付にて株式譲渡契約を締結し、平成27年4月1日付にて発行済株式を取得いたしました。

(1) 株式取得の目的

NGWは、国内外資産の効率的な配分と、海外運用会社の評価・選定に特化した大変特徴ある運用会社であり、既に「日興・新経済成長国エクイティ・ファンド(EG5)」や「日興ワールド CBファンド」等の商品で当社と協働しております。本件子会社化は、外部委託運用機能の強化、アセットアロケーション機能の強化及びファンドラップビジネスへの参画の3つの分野において当社事業に対するプラスをもたらすと考えております。今後、当社はNGWと双方のリソースを活用した相乗効果の醸成を進め、更なるビジネスの拡大を目指していく考えです。

(2) 取得する会社の概要(平成26年3月末現在)

| | |
|-------|----------------|
| 名称 | 日興グローバルラップ株式会社 |
| 事業の内容 | 投資運用業等 |
| 資本金 | 1,499,000千円 |
| 純資産 | 7,620,283千円 |
| 総資産 | 8,134,920千円 |
| 営業利益 | 501,574千円 |
| 当期純利益 | 303,382千円 |

(3) 株式取得日

平成27年4月1日

(4) 取得する株式の数、取得価額及び取得後の持株比率

| | |
|----------|-------------|
| 取得株式数 | 59,960株 |
| 取得価額 | 9,877,717千円 |
| 取得後の持株比率 | 100% |

(5) 支払資金の調達方法

自己資金によります。

中間財務諸表

(1) 中間貸借対照表

(単位：千円)

第31期中間会計期間
(平成27年9月30日)

| | | |
|------------|---|------------|
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| 現金及び預金 | | 10,975,719 |
| 顧客分別金信託 | | 20,003 |
| 前払費用 | | 325,776 |
| 未収委託者報酬 | | 5,173,183 |
| 未収運用受託報酬 | | 1,458,560 |
| 未収投資助言報酬 | | 423,030 |
| 未収収益 | | 31,637 |
| 繰延税金資産 | | 519,032 |
| その他 | | 2,190 |
| 流動資産合計 | | 18,929,133 |
| 固定資産 | | |
| 有形固定資産 | 1 | 421,791 |
| 無形固定資産 | | 573,943 |
| 投資その他の資産 | | |
| 投資有価証券 | | 10,008,703 |
| 関係会社株式 | | 10,412,523 |
| その他 | | 1,298,972 |
| 投資その他の資産合計 | | 21,720,199 |
| 固定資産合計 | | 22,715,935 |
| 資産合計 | | 41,645,068 |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 顧客からの預り金 | | 29 |
| その他の預り金 | | 61,740 |
| 未払金 | | 2,614,352 |
| 未払費用 | | 1,987,591 |
| 未払法人税等 | | 406,231 |
| 賞与引当金 | | 1,066,694 |
| その他 | 2 | 169,290 |
| 流動負債合計 | | 6,305,931 |
| 固定負債 | | |
| 退職給付引当金 | | 2,705,437 |
| 固定負債合計 | | 2,705,437 |
| 負債合計 | | 9,011,368 |
| 純資産の部 | | |
| 株主資本 | | |
| 資本金 | | 2,000,000 |
| 資本剰余金 | | |
| 資本準備金 | | 8,628,984 |
| 資本剰余金合計 | | 8,628,984 |
| 利益剰余金 | | |
| 利益準備金 | | 284,245 |
| その他利益剰余金 | | |
| 配当準備積立金 | | 60,000 |

| | |
|--------------|------------|
| 別途積立金 | 1,476,959 |
| 繰越利益剰余金 | 19,580,326 |
| 利益剰余金合計 | 21,401,531 |
| 株主資本合計 | 32,030,515 |
| 評価・換算差額等 | |
| その他有価証券評価差額金 | 603,184 |
| 評価・換算差額等合計 | 603,184 |
| 純資産合計 | 32,633,699 |
| 負債純資産合計 | 41,645,068 |

(2)中間損益計算書

(単位：千円)

| | | 第31期中間会計期間 (自 平成27年4月1日 至 平成27年9月30日) | |
|--------------|---|---|------------|
| 営業収益 | | | |
| 委託者報酬 | | | 16,529,753 |
| 運用受託報酬 | | | 2,843,500 |
| 投資助言報酬 | | | 978,992 |
| その他の営業収益 | | | 64,711 |
| 営業収益計 | | | 20,416,958 |
| 営業費用 | | | 13,207,542 |
| 一般管理費 | 1 | | 5,203,152 |
| 営業利益 | | | 2,006,263 |
| 営業外収益 | 2 | | 41,105 |
| 営業外費用 | 3 | | 48,535 |
| 経常利益 | | | 1,998,832 |
| 特別利益 | 4 | | 34,739 |
| 特別損失 | | | 7,932 |
| 税引前中間純利益 | | | 2,025,639 |
| 法人税、住民税及び事業税 | | | 368,130 |
| 法人税等調整額 | | | 14,018 |
| 法人税等合計 | | | 354,112 |
| 中間純利益 | | | 1,671,526 |

(3)中間株主資本等変動計算書

第31期中間会計期間（自 平成27年4月1日 至 平成27年9月30日）

(単位：千円)

| | 株主資本 | | | | | | | | 株主資本 合計 |
|---------|-----------|-----------|-------------|---------|-------------|-----------|-------------|-------------|------------|
| | 資本金 | 資本剰余金 | | 利益準備金 | その他利益剰余金 | | | 利益剰余金 合計 | |
| | | 資本準備金 | 資本剰余金 合計 | | 配当準備 積立金 | 別途積立金 | 繰越利益 剰余金 | | |
| 当期首残高 | 2,000,000 | 8,628,984 | 8,628,984 | 284,245 | 60,000 | 1,476,959 | 18,861,359 | 20,682,564 | 31,311,548 |
| 当中間期変動額 | | | | | | | | | |
| 剰余金の配当 | | | | | | | 952,560 | 952,560 | 952,560 |
| 中間純利益 | | | | | | | 1,671,526 | 1,671,526 | 1,671,526 |

| | | | | | | | | | |
|-------------------------------|-----------|-----------|-----------|---------|--------|-----------|------------|------------|------------|
| 株主資本以外の 項目の当中間期 変動額（純額） | | | | | | | | | |
| 当中間期変動額 合計 | - | - | - | - | - | - | 718,966 | 718,966 | 718,966 |
| 当中間期末残高 | 2,000,000 | 8,628,984 | 8,628,984 | 284,245 | 60,000 | 1,476,959 | 19,580,326 | 21,401,531 | 32,030,515 |

| | 評価・換算差額等 | | 純資産合計 |
|-------------------------------|------------------|----------------|------------|
| | その他有価証券 評価差額金 | 評価・換算 差額等合計 | |
| 当期首残高 | 634,478 | 634,478 | 31,946,027 |
| 当中間期変動額 | | | |
| 剰余金の配当 | | | 952,560 |
| 中間純利益 | | | 1,671,526 |
| 株主資本以外の項 目の当中間期変動額 （純額） | 31,294 | 31,294 | 31,294 |
| 当中間期変動額合計 | 31,294 | 31,294 | 687,672 |
| 当中間期末残高 | 603,184 | 603,184 | 32,633,699 |

注記事項

（重要な会計方針）

1．資産の評価基準及び評価方法

(1)有価証券

満期保有目的の債券

償却原価法

子会社株式及び関連会社株式

移動平均法による原価法

その他有価証券

時価のあるもの

中間会計期間末日の市場価格等に基づく時価法

（評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定）

時価のないもの

移動平均法による原価法

2．固定資産の減価償却の方法

(1)有形固定資産

定率法によっております。但し、建物(建物附属設備を除く)については、定額法によっております。

なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。

建物 3～50年

器具備品 3～20年

(2)無形固定資産

定額法によっております。

なお、ソフトウェア（自社利用分）については、社内における利用可能期間（5年）に基づく定額法によっております。

3．引当金の計上基準

(1)賞与引当金

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

ます。

(2)退職給付引当金

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

退職給付見込額の期間帰属方法

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

数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法

過去勤務費用については、その発生時において一時に費用処理しております。

数理計算上の差異については、その発生時において一時に費用処理しております。

4. その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項

消費税等の会計処理

消費税等の会計処理は税抜方式によっております。

(中間貸借対照表関係)

| 第31期中間会計期間 (平成27年9月30日) | |
|--|--|
| 1.有形固定資産の減価償却累計額 | 973,461千円 |
| 2.消費税等の取扱い | 仮払消費税等及び仮受消費税等は、相殺のうえ、金額的重要性が乏しいため、流動負債のその他に含めて表示しております。 |
| 3.当社は、運転資金の効率的な調達を行うため取引銀行1行と当座借越契約を締結しております。当中間会計期間末における当座借越契約に係る借入金未実行残高等は次のとおりであります。 | |
| 当座借越極度額の総額 | 10,000,000千円 |
| 借入実行残高 | - |
| 差引額 | 10,000,000千円 |
| 4.当社は、子会社であるSumitomo Mitsui Asset Management(New York) Inc.における賃貸借契約に係る賃借料に対し、平成35年6月までの賃借料総額337,247千円の支払保証を行っております。 | |

(中間損益計算書関係)

| 第31期中間会計期間 (自平成27年4月1日至平成27年9月30日) | |
|---------------------------------------|----------|
| 1.減価償却実施額 | |
| 有形固定資産 | 65,954千円 |
| 無形固定資産 | 95,946千円 |
| 2.営業外収益のうち主要なもの | |
| 受取配当金 | 21,723千円 |
| 雑収入 | 17,209千円 |
| 3.営業外費用のうち主要なもの | |
| 為替差損 | 48,535千円 |
| 4.特別利益のうち主要なもの | |
| 投資有価証券清算益 | 24,751千円 |

(中間株主資本等変動計算書関係)

第31期中間会計期間(自平成27年4月1日至平成27年9月30日)

1.発行済株式数に関する事項

| | 当事業年度期首 株式数 | 当中間会計期間 増加株式数 | 当中間会計期間 減少株式数 | 当中間会計期間 末株式数 |
|--|----------------|------------------|------------------|-----------------|
| | | | | |

| | | | | |
|------|---------|---|---|---------|
| 普通株式 | 17,640株 | - | - | 17,640株 |
|------|---------|---|---|---------|

2. 剰余金の配当に関する事項

| 決議 | 株式の種類 | 配当金の総額 (千円) | 一株当たり 配当額(円) | 基準日 | 効力発生日 |
|----------------------|-------|----------------|-----------------|----------------|---------------|
| 平成27年6月30日 定時株主総会 | 普通株式 | 952,560 | 54,000 | 平成27年 3月31日 | 平成27年 7月1日 |

(リース取引関係)

| 第31期中間会計期間 (自 平成27年4月1日 至 平成27年9月30日) | |
|--|-------------|
| 1. オペレーティング・リース取引 (借主側) | |
| 未経過リース料(解約不能のもの) | |
| 1年以内 | 585,430千円 |
| 1年超 | 1,047,704千円 |
| 合計 | 1,633,134千円 |

(金融商品関係)

1. 金融商品の時価等に関する事項

第31期中間会計期間(平成27年9月30日)

平成27年9月30日における中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次の通りです。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含まれておりません(注2)参照)。

(単位:千円)

| 区分 | 中間貸借対照表計上額 | 時価 | 差額 |
|-------------|------------|------------|----|
| (1)現金及び預金 | 10,975,719 | 10,975,719 | - |
| (2)顧客分別金信託 | 20,003 | 20,003 | - |
| (3)未収委託者報酬 | 5,173,183 | 5,173,183 | - |
| (4)未収運用受託報酬 | 1,458,560 | 1,458,560 | - |
| (5)未収投資助言報酬 | 423,030 | 423,030 | - |
| (6)投資有価証券 | | | |
| その他有価証券 | 10,008,395 | 10,008,395 | - |
| (7)投資その他の資産 | | | |
| 長期差入保証金 | 600,466 | 600,466 | - |
| 資産計 | 28,659,358 | 28,659,358 | - |
| (1)顧客からの預り金 | 29 | 29 | - |
| (2)未払金 | | | |
| 未払手数料 | 2,360,638 | 2,360,638 | - |
| 負債計 | 2,360,667 | 2,360,667 | - |

(注1)金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

資 産

- (1)現金及び預金、(2)顧客分別金信託、(3)未収委託者報酬、(4)未収運用受託報酬、及び(5)未収投資助言報酬

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

- (6)投資有価証券

これらの時価について、債券については取引金融機関から提示された価格及び業界団体が公表する売買参考統計値等によって、投資信託等については取引所の価格、取引金融機関から提示された価格及び公表されている基準価格によっております。

また、保有目的ごとの有価証券に関する注記事項については、「有価証券関係」注記を参照ください。

(7) 投資その他の資産

長期差入保証金

これらの時価については、敷金の性質及び賃貸借契約の期間から帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

負債

(1) 顧客からの預り金、及び(2) 未払金 未払手数料

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

(注2) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

(単位：千円)

| | 中間貸借対照表計上額 |
|---------------|------------|
| その他有価証券 | |
| 非上場株式 | 298 |
| 投資証券 | 10 |
| 合計 | 308 |
| 子会社株式及び関連会社株式 | |
| 非上場株式 | 10,412,523 |
| 合計 | 10,412,523 |

その他有価証券については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められるものであり、「(6) その他有価証券」には含めておりません。

子会社株式及び関連会社株式については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められるものであることから、時価開示の対象とはしておりません。

(有価証券関係)

第31期中間会計期間(平成27年9月30日)

1. 満期保有目的の債券

該当事項はありません。

2. 子会社株式及び関連会社株式

子会社株式及び関連会社株式(中間貸借対照表計上額 10,412,523千円)は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載しておりません。

3. その他有価証券

(単位：千円)

| 区分 | 中間貸借対照表計上額 | 取得原価 | 差額 |
|----------------------------|------------|-----------|---------|
| (1) 中間貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの | | | |
| 投資信託等 | 6,450,671 | 5,524,611 | 926,060 |
| 小計 | 6,450,671 | 5,524,611 | 926,060 |
| (2) 中間貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの | | | |
| 投資信託等 | 3,557,723 | 3,605,760 | 48,037 |
| 小計 | 3,557,723 | 3,605,760 | 48,037 |
| 合計 | 10,008,395 | 9,130,371 | 878,023 |

(注) 非上場株式等(中間貸借対照表計上額 308千円)については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載しておりません。

（デリバティブ取引関係）

当社は、デリバティブ取引を全く行っておりませんので、該当事項はありません。

（資産除去債務等）

該当事項はありません。

（セグメント情報等）

第31期中間会計期間（自 平成27年4月1日 至 平成27年9月30日）

1. セグメント情報

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

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

2. 関連情報

(1) 製品及びサービスごとの情報

（単位：千円）

| | 委託者報酬 | 運用受託報酬 | 投資助言報酬 | その他 | 合計 |
|-----------|------------|-----------|---------|--------|------------|
| 外部顧客への売上高 | 16,529,753 | 2,843,500 | 978,992 | 64,711 | 20,416,958 |

(2) 地域ごとの情報

売上高

本邦の外部顧客への売上高に区分した金額が中間損益計算書の売上高の90%を超えるため、地域ごとの売上高の記載を省略しております。

有形固定資産

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

(3) 主要な顧客ごとの情報

外部顧客への売上高のうち、中間損益計算書の売上高の10%以上を占める相手先がないため、記載はありません。

3. 報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

該当事項はありません。

4. 報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

該当事項はありません。

5. 報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

該当事項はありません。

（1株当たり情報）

| |
|--|
| 第31期中間会計期間 （自 平成27年4月1日 至 平成27年9月30日） |
|--|

| | |
|------------|---------------|
| 1株当たり純資産額 | 1,849,982円98銭 |
| 1株当たり中間純利益 | 94,757円75銭 |

なお、潜在株式調整後1株当たり中間純利益については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。

(注) 1株当たり純資産額の算定上の基礎

| | |
|--------------------------|--------------|
| 中間貸借対照表の純資産の部の合計額 | 32,633,699千円 |
| 普通株式に係る純資産額 | 32,633,699千円 |
| 普通株式の発行済株式数 | 17,640株 |
| 1株当たり純資産額の算定に用いられた普通株式の数 | 17,640株 |

1株当たり中間純利益の算定上の基礎

| | |
|--------------------|-------------|
| 中間損益計算書上の中間純利益 | 1,671,526千円 |
| 普通株式に係る中間純利益 | 1,671,526千円 |
| 普通株主に帰属しない金額の主要な内訳 | 該当事項はありません。 |
| 普通株式の期中平均株式数 | 17,640株 |

(重要な後発事象)

該当事項はありません。

4【利害関係人との取引制限】

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

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

5【その他】

- イ 定款の変更、その他の重要事項
該当ありません。

- 訴訟事件その他会社に重要な影響を与えることが予想される事実
該当ありません。

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

イ 受託会社

- (イ) 名称 三井住友信託銀行株式会社
 (ロ) 資本金の額 342,037百万円（平成27年9月末現在）
 (ハ) 事業の内容 銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

〔参考情報：再信託受託会社の概要〕

- ・ 名称 日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社
- ・ 資本金の額 51,000百万円（平成27年9月末現在）
- ・ 事業の内容 銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

ロ 販売会社

| (イ) 名称 | (ロ) 資本金の額 | (ハ) 事業の内容 |
|--------------------|--------------|-------------------------------|
| 損保ジャパン日本興亜DC証券株式会社 | 3,000百万円 | 金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。 |
| 株式会社三井住友銀行 | 1,770,996百万円 | 銀行法に基づき、銀行業を営んでいます。 |

資本金の額は、平成27年9月末現在。

(注) 損保ジャパン日本興亜DC証券株式会社は、三井住友・DC年金プラン・ファンド（ターゲット・イヤー型）2010の取扱いを行いません。

2【関係業務の概要】

イ 受託会社

信託契約の受託会社であり、信託財産の保管・管理・計算等を行います。

ロ 販売会社

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

3【資本関係】

販売会社である株式会社三井住友銀行は、委託会社株式を7,056株（持株比率40.0%）保有していません。

第3【その他】

1. 目論見書の表紙にロゴ・マーク、図案およびキャッチコピーを採用すること、ファンドの形態および属性、申込みにかかる事項、ユニバーサルデザインフォントマーク、委託会社の金融商品取引業者登録番号、当該目論見書の使用開始日などを記載することがあります。
2. 目論見書は、目論見書の別称として「投資信託説明書（交付目論見書）」または「投資信託説明書

（請求目論見書）」と称して使用することがあります。

- 3．目論見書に当ファンドの信託約款を掲載すること、および投資信託の財産は受託会社において信託法に基づき分別管理されている旨を記載することがあります。
- 4．目論見書は、電子媒体等として使用されるほか、インターネット等に掲載されることがあります。
- 5．有価証券届出書の表紙記載情報を抜粋して、目論見書に記載することがあります。
- 6．目論見書の冒頭または巻末に届出書記載内容に関連する用語集を掲載することがあります。
- 7．評価機関等から当ファンドに対する評価を取得し、使用することがあります。
- 8．有価証券届出書を個別に提出している複数のファンドの実質的な投資対象資産に共通性がある場合には、当該複数のファンドを一つの投資信託説明書（交付目論見書）で説明することがあります。このため、有価証券届出書に他のファンドの情報を合わせて記載することがあります。
- 9．当ファンドとスイッチング対象ファンドにかかる投資信託説明書（交付目論見書）を一体のものとして使用することがあります。

独立監査人の監査報告書

平成27年 6月15日

三井住友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

指定有限責任社員

業務執行社員

公認会計士 鈴木 敏 夫 印

指定有限責任社員

業務執行社員

公認会計士 池ヶ谷 正 印

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アセットマネジメント株式会社の平成26年4月1日から平成27年3月31日までの第30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。

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。

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、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。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。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に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るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。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、当監査法人は、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、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、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見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。

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。

監査意見

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、三井住友アセットマネジメント株式会社の平成27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すべ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。

強調事項

重要な後発事象に記載されているとおり、会社は平成27年4月1日付にて日興グローバルラップ株式会社の発行済株式の全部を取得している。

当該事項は、当監査法人の意見に影響を及ぼすものではない。

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 . 上記は監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。 2 . X B R L データは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

平成28年2月9日

三井住友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

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士 小澤 陽一 印

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年金プラン・ファンド（ターゲット・イヤー型）2010の平成26年12月23日から平成27年12月21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。

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。

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、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。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。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に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るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。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、当監査法人は、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、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、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見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。

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。

監査意見

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年金プラン・ファンド（ターゲット・イヤー型）2010の平成27年12月21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すべ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。

利害関係

三井住友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. 上記は監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。2. XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

平成28年2月9日

三井住友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

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士

小澤 陽 一 印

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年金プラン・ファンド（ターゲット・イヤー型）2020の平成26年12月23日から平成27年12月21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。

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。

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、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。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。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に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るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。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、当監査法人は、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、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、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見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。

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。

監査意見

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年金プラン・ファンド（ターゲット・イヤー型）2020の平成27年12月21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すべ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。

利害関係

三井住友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. 上記は監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。2. X B R L データは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

平成28年2月9日

三井住友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

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士

小澤 陽一 印

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年金プラン・ファンド（ターゲット・イヤー型）2030の平成26年12月23日から平成27年12月21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。

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。

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、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。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。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に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るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。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、当監査法人は、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、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、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見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。

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。

監査意見

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年金プラン・ファンド（ターゲット・イヤー型）2030の平成27年12月21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すべ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。

利害関係

三井住友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. 上記は監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。2. XBR Lデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

平成28年2月9日

三井住友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

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士 小澤 陽一 印

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年金プラン・ファンド（ターゲット・イヤー型）2040の平成26年12月23日から平成27年12月21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。

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。

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、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。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。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に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るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。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、当監査法人は、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、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、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見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。

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。

監査意見

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年金プラン・ファンド（ターゲット・イヤー型）2040の平成27年12月21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すべ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。

利害関係

三井住友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. 上記は監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。2. XBR Lデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

平成27年11月25日

三井住友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

指定有限責任社員

業務執行社員

指定有限責任社員

業務執行社員

公認会計士 小澤陽一 印

公認会計士 池ヶ谷正 印

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アセットマネジメント株式会社の平成27年4月1日から平成28年3月31日までの第31期事業年度の中間会計期間（平成27年4月1日から平成27年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

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。

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した中間監査に基づいて、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。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。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には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るために、中間監査に係る監査計画を策定し、これに基づき中間監査を実施することを求めている。

中間監査においては、中間財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するために年度監査と比べて監査手続の一部を省略した中間監査手続が実施される。中間監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示の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、当監査法人は、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。また、中間監査には、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見積りの評価も含め中間財務諸表の表示を検討することが含まれる。

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。

中間監査意見

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、三井住友アセットマネジメント株式会社の平成27年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（平成27年4月1日から平成27年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

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. 上記は中間監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。2. X B R L データは中間監査の対象には含まれていません。