

【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29年9月14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 松下 隆史
【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】	土田 雅央
【電話番号】	03-5405-0740
【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29年9月15日から平成30年3月15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29年 9月15日から平成30年 3月15日まで

申込期間は、上記期間満了前に有価証券届出書を提出することにより更新されます。

（８）【申込取扱場所】

販売会社において申込みを取り扱います。

販売会社によっては一部のファンドのみの取扱いとなる場合があります。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

販売会社の詳細につきましては、前記「（４）発行（売出）価格」に記載の委託会社にお問い合わせください。

（９）【払込期日】

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

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

（１０）【払込取扱場所】

販売会社において払込みを取り扱います。（販売会社は前記「（４）発行（売出）価格」に記載の委託会社にお問い合わせください。）

（１１）【振替機関に関する事項】

当ファンドの振替機関は下記の通りです。

株式会社証券保管振替機構

（１２）【その他】

イ 申込証拠金
ありません。

ロ 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		
一般		(日本を含む)		
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	年12回(毎月)	アジア		
公債	日々	オセアニア		
社債	その他	中南米		
その他債券	()	アフリカ	ファンド・オブ・ファンズ	なし
クレジット属性 ()		中近東(中東)		
不動産投信		エマージング		
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))				
資産複合 ()				
資産配分固 定型				
資産配分変 更型				

（注）当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

属性区分の「為替ヘッジ」は、対円で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。

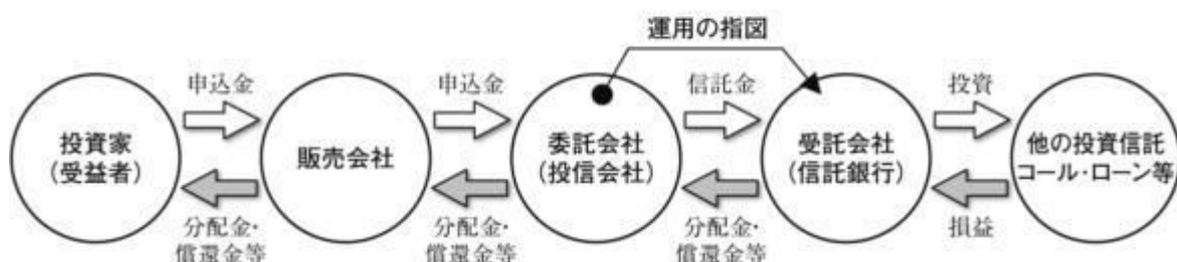
（ロ）受託会社 「三井住友信託銀行株式会社」

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29年 6月30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

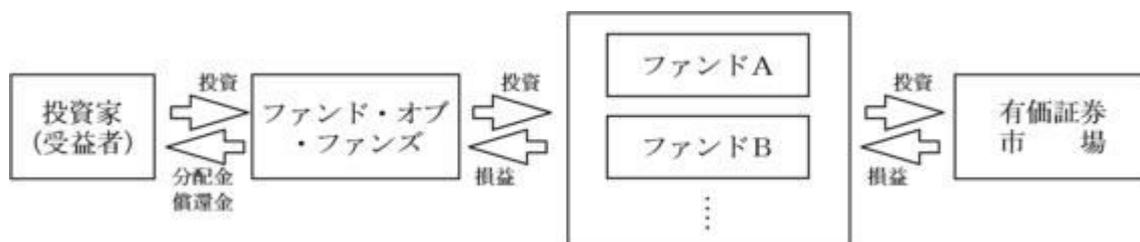
（平成29年 6月30日現在）

名称	住所	所有 株式数	比率 (%)
株式会社三井住友フィナンシャルグループ	東京都千代田区丸の内一丁目1番2号	10,584	60.0
住友生命保険相互会社	大阪府大阪市中央区城見一丁目4番35号	3,528	20.0
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	3,528	20.0

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。

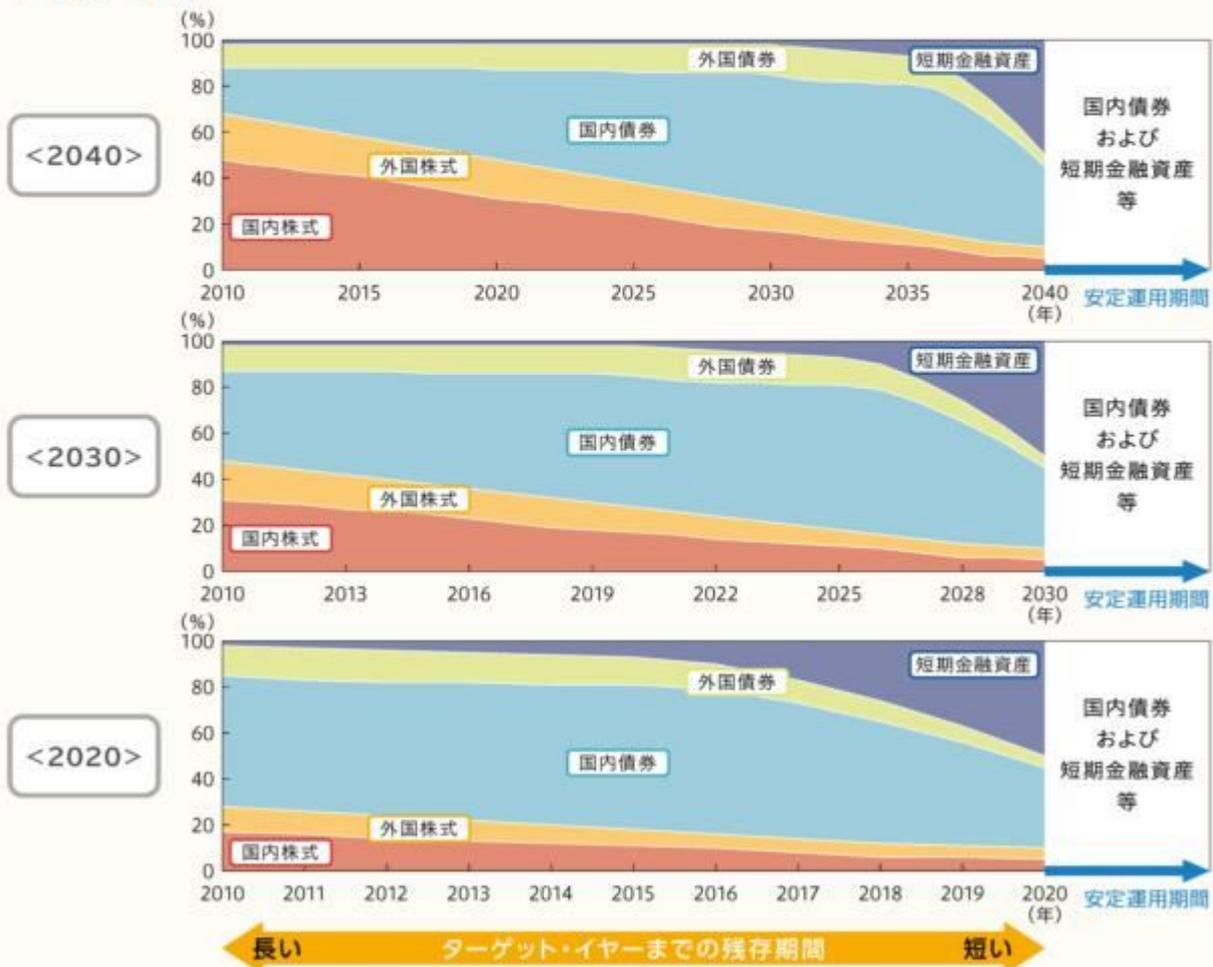
基本的な投資資産配分

▶基本アロケーション

■2017年6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	39%	23%	10%	5%
外国株式	17%	13%	6%	5%
国内債券	32%	50%	63%	35%
外国債券	10%	12%	11%	5%
短期金融資産	2%	2%	10%	50%

▶イメージ図



※上記は、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^{*2}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^{*3}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 トラッキングエラーとは

ポートフォリオとベンチマークのリターンのかい離のことをいいます。

*3 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。

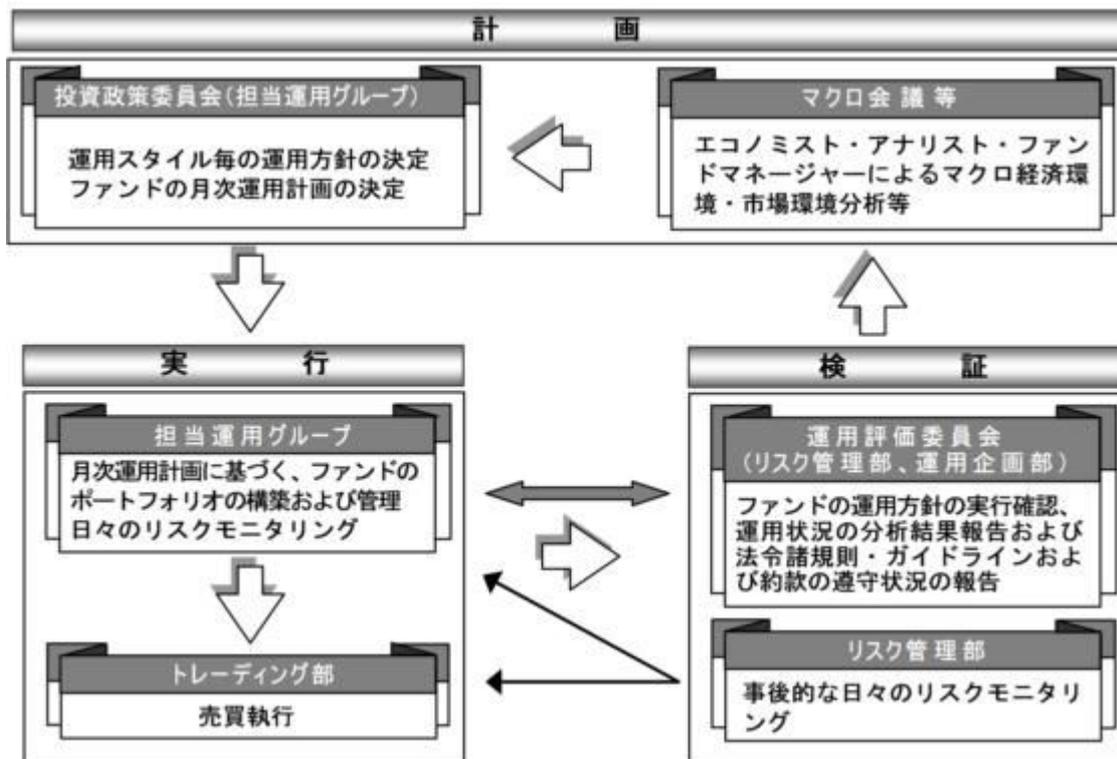
売買執行については、組織的に分離されたトレーディング部が、最良と思われる手法をもって売買を執行します。

(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11名程度、運用企画部は8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、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。

ニ 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解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は当該有価証券等の売却代金、解約代金および償還金の合計額を限度とします。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。

- 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
 □ 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。

□ 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

- | | |
|-----------|------------------------------------------|
| □ 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。 |
| 八 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) |

〔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>〕

(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・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(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、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。

□ 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、N O M U R A - B P I(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、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ます。

N O M U R A - B P I(総合)は、野村證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證券株式会社およびその許諾者に帰属します。なお、野村證券株式会社およびその許諾者は、N O M U R A - B P I(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、野村證券株式会社およびその許諾者は「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>」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 |
| □ 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。 |
| 八 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% |
| 二 決算日 | 毎年1回(原則として6月20日) |

〔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)〕

(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 ・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 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。

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 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。
 (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 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。

M S C I コクサイインデックス（配当込み、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、原則として対円での為替ヘッジを行いません。
- (ホ) 公社債の組入比率は原則として高位を保ちます。
- (ヘ) 資金動向、市況動向等の急変により上記の運用が困難となった場合、暫定的に上記と異なる運用を行う場合があります。

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「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>」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) |

[S M A M・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

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(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。

ハ 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

「ファンドの年間騰落率および 分配金再投資基準価額の推移」

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

<2010>



「ファンドと他の代表的な 資産クラスとの騰落率の比較」

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



<2020>



※年間騰落率、分配金再投資基準価額は、分配金（税引前）を分配時に再投資したものと仮定して計算したものです。

※分配実績がない場合は、分配金再投資基準価額は基準価額と同じです。

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

※すべての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。

【 ファンドの年間騰落率および 分配金再投資基準価額の推移 】

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

▶ <2030>



※年間騰落率、分配金再投資基準価額は、分配金(税引前)を分配時に再投資したものと仮定して計算したものです。

※分配実績がない場合は、分配金再投資基準価額は基準価額と同じです。

【 ファンドと他の代表的な 資産クラスとの騰落率の比較 】

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



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

※すべての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。

【 ファンドの年間騰落率および 分配金再投資基準価額の推移 】

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

▶ <2040>



※年間騰落率、分配金再投資基準価額は、分配金(税引前)を分配時に再投資したものと仮定して計算したものです。

※分配実績がない場合は、分配金再投資基準価額は基準価額と同じです。

【 ファンドと他の代表的な 資産クラスとの騰落率の比較 】

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



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

※すべての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。

日本株	TOPIX(配当込み) 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。
先進国株	MSCIコクサイインデックス(グロス配当込み、円ベース) MSCI Inc.が開発した指数で、日本を除く世界の主要先進国の株式を対象としています。
新興国株	MSCIエマージング・マーケット・インデックス(グロス配当込み、円ベース) MSCI Inc.が開発した指数で、新興国の株式を対象としています。
日本国債	NOMURA-BPI(国債) 野村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。
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) 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。
新興国債	JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ダイバーシファイド(円ベース) J.P. Morganが算出、公表する指数で、新興国が発行する現地通貨建て国債を対象としています。

※海外の指数は、為替ヘッジなしによる投資を想定して、円ベースとしています。

※上記各指数に関する知的所有権その他の一切の権利は、その発行者および許諾者に帰属します。また、上記各指数の発行者および許諾者は、当ファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。

4 【手数料等及び税金】

(1) 【申込手数料】

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29年6月末現在）に従った場合、以下の通りとなります。なお、SMAM・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0.602748%（税抜き0.5581%）程度
< 2 0 3 0 >	年0.597024%（税抜き0.5528%）程度
< 2 0 4 0 >	年0.602208%（税抜き0.5576%）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。

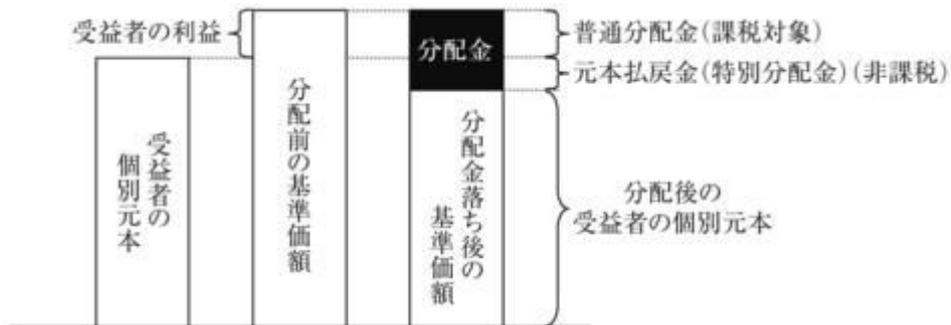
ハ 収益分配金の課税について

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）」、未成年者少額投資非課税制度「ジュニア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、ジュニアNISAでの取扱い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。

なお、当ファンドは、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、未成年者少額投資非課税制度「ジュニアNISA(ニーサ)」をご利用の場合、毎年、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年間非課税となります。NISA、ジュニアNISAのご利用には、販売会社での専用口座の開設等、一定の要件があります。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29年6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29年 6月30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	540,356,937	99.82
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		996,809	0.18
合計(純資産総額)		541,353,746	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29年 6月30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	1,337,520,315	99.91
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1,202,737	0.09
合計(純資産総額)		1,338,723,052	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29年 6月30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	1,468,817,863	99.94
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		879,179	0.06
合計(純資産総額)		1,469,697,042	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29年 6月30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	2,246,217,607	99.97
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		762,396	0.03
合計(純資産総額)		2,246,980,003	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29年 6月30日現在

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	投資 比率 (%)
日本	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>	268,080,174	1.0081	270,275,513	1.0078	270,171,199	49.91
日本	投資信託受益証券	SMAM・年金国内債券バッシブ ファンド<適格機関投資家限定>	147,200,667	1.2811	188,592,302	1.2826	188,799,575	34.88
日本	投資信託受益証券	SMAM・国内株式バッシブ・ファ ンド(適格機関投資家専用)	16,946,700	1.5116	25,616,970	1.6056	27,209,621	5.03
日本	投資信託受益証券	SMAM・年金外国債券バッシブ・ ファンド<適格機関投資家限定>	15,843,057	1.6917	26,803,219	1.7153	27,175,595	5.02
日本	投資信託受益証券	SMAM・外国株式バッシブ・ファ ンド(適格機関投資家専用)	11,144,982	2.2859	25,476,791	2.4227	27,000,947	4.99

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29年 6月30日現在

種類	投資比率(%)
投資信託受益証券	99.82
合計	99.82

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29年 6月30日現在

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	投資 比率 (%)
日本	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>	655,919,493	1.2812	840,405,159	1.2826	841,282,341	62.84
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>	86,151,820	1.6919	145,763,193	1.7153	147,776,216	11.04
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）	84,048,296	1.5109	126,995,126	1.6056	134,947,944	10.08
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>	132,049,027	1.0081	133,127,007	1.0078	133,079,009	9.94
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）	33,200,481	2.2856	75,886,007	2.4227	80,434,805	6.01

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29年 6月30日現在

種類	投資比率（%）
投資信託受益証券	99.91
合計	99.91

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29年 6月30日現在

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	投資 比率 (%)
日本	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>	569,293,806	1.2814	729,503,132	1.2826	730,176,235	49.68
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）	212,702,904	1.5131	321,850,973	1.6056	341,515,782	23.24
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）	78,859,428	2.2884	180,462,351	2.4227	191,052,736	13.00
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>	103,201,541	1.6913	174,550,766	1.7153	177,021,603	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>	28,826,660	1.0081	29,062,185	1.0078	29,051,507	1.98

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29年 6月30日現在

種類	投資比率（%）
投資信託受益証券	99.94
合計	99.94

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29年 6月30日現在

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	投資 比率 (%)
日本	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）	551,533,034	1.5123	834,119,332	1.6056	885,541,439	39.41
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＞	555,059,718	1.2813	711,218,099	1.2826	711,919,594	31.68
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）	157,062,504	2.2889	359,509,047	2.4227	380,515,328	16.93
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＞	130,789,759	1.6908	221,143,240	1.7153	224,343,673	9.98
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＞	43,557,822	1.0081	43,914,038	1.0078	43,897,573	1.95

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29年 6月30日現在

種類	投資比率（%）
投資信託受益証券	99.97
合計	99.97

【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
第16期 (平成28年12月20日)	553,177,646	553,177,646	12,457	12,457
平成28年 6月末日	537,264,037		12,333	
7月末日	539,569,221		12,384	
8月末日	544,193,341		12,317	
9月末日	551,132,032		12,305	
10月末日	554,760,330		12,317	
11月末日	559,626,807		12,404	
12月末日	551,298,066		12,451	
平成29年 1月末日	543,596,633		12,416	
2月末日	541,790,997		12,429	

3月末日	541,167,776		12,430	
4月末日	541,025,865		12,454	
5月末日	542,302,028		12,481	
6月末日	541,353,746		12,514	

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
第16期（平成28年12月20日）	1,350,077,224	1,350,077,224	14,620	14,620
平成28年 6月末日	1,260,795,633		14,300	
7月末日	1,285,586,314		14,409	
8月末日	1,283,179,723		14,270	
9月末日	1,304,833,598		14,256	
10月末日	1,324,294,680		14,292	
11月末日	1,341,910,853		14,486	
12月末日	1,352,876,995		14,610	
平成29年 1月末日	1,338,364,793		14,538	
2月末日	1,326,913,113		14,559	
3月末日	1,324,998,582		14,563	
4月末日	1,318,336,036		14,615	
5月末日	1,325,927,999		14,676	
6月末日	1,338,723,052		14,756	

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
第16期	(平成28年12月20日)	1,379,800,736	1,379,800,736	15,465	15,465
	平成28年 6月末日	1,196,592,500		14,387	
	7月末日	1,234,497,028		14,656	
	8月末日	1,229,855,193		14,552	
	9月末日	1,262,864,925		14,581	
	10月末日	1,300,124,207		14,718	
	11月末日	1,340,514,903		15,124	
	12月末日	1,376,118,484		15,404	
	平成29年 1月末日	1,376,394,020		15,365	
	2月末日	1,376,945,128		15,389	
	3月末日	1,379,068,076		15,414	
	4月末日	1,383,230,285		15,483	
	5月末日	1,422,010,610		15,618	
	6月末日	1,469,697,042		15,790	

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
第16期	(平成28年12月20日)	2,076,188,532	2,076,188,532	16,160	16,160
	平成28年 6月末日	1,765,539,767		14,300	
	7月末日	1,845,552,953		14,724	
	8月末日	1,859,329,642		14,670	
	9月末日	1,892,189,286		14,765	
	10月末日	1,941,079,852		15,013	

11月末日	2,008,470,216		15,620
12月末日	2,060,696,333		16,037
平成29年 1月末日	2,078,218,881		16,061
2月末日	2,103,735,107		16,077
3月末日	2,102,487,872		16,123
4月末日	2,116,566,592		16,204
5月末日	2,183,634,222		16,413
6月末日	2,246,980,003		16,690

【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
第16期	平成27年12月22日～平成28年12月20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
第16期	平成27年12月22日～平成28年12月20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
第16期	平成27年12月22日～平成28年12月20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
第16期	平成27年12月22日～平成28年12月20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
第16期	0.9
第17期（中間期）	0.4

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

三井住友・DC年金プラン・ファンド（ターゲット・イヤー型）2020

	収益率（％）
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
第16期	1.6
第17期（中間期）	0.8

（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
第16期	2.1
第17期（中間期）	1.8

（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
第16期	2.7
第17期（中間期）	2.8

（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
第16期	73,067,241	53,460,656
第17期（中間期）	12,291,239	23,846,109

（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
第16期	133,314,585	57,348,024
第17期(中間期)	32,061,712	49,282,198

(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
第16期	162,461,354	60,911,862
第17期(中間期)	73,124,751	34,239,010

(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
第16期	268,656,486	151,120,292
第17期(中間期)	131,444,946	70,993,847

(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）

平成29年 6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	24,860,631,369	100.01
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1,717,101	0.01
合計(純資産総額)		24,858,914,268	100.00

国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

平成29年 6月29日現在

資産の種類	国 / 地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
株式	日本	194,915,359,440	98.55
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		2,860,683,462	1.45
合計(純資産総額)		197,776,042,902	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	2,662,540,000	1.34
合計	買建		2,662,540,000	1.34

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>

平成29年 6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	32,314,247,279	100.00
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		451,878	0.00
合計(純資産総額)		32,313,795,401	100.00

国内債券（NOMURA - BPI）マザーファンド

平成29年 6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	日本	84,529,172,650	75.84
地方債証券	日本	8,925,268,880	8.01
特殊債券	日本	11,722,682,365	10.52
社債券	日本	4,455,483,000	4.00
	オランダ	300,987,000	0.27
	アメリカ	100,325,000	0.09
	オーストラリア	100,299,000	0.09
	小計	4,957,094,000	4.45
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1,316,821,436	1.18
合計(純資産総額)		111,451,039,331	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29年 6月30日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
親投資信託受益証券	日本	13,341,862,282	99.97
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		4,287,058	0.03
合計(純資産総額)		13,346,149,340	100.00

外国株式インデックス・マザーファンド

平成29年 6月30日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
株式	アメリカ	116,088,032,595	58.70
	イギリス	13,321,117,136	6.74
	フランス	7,587,659,528	3.84
	ドイツ	7,537,110,188	3.81
	カナダ	7,522,748,083	3.80
	スイス	7,343,059,325	3.71
	オーストラリア	4,918,247,247	2.49
	オランダ	3,757,866,508	1.90

	アイルランド	3,089,209,327	1.56
	スペイン	2,764,995,001	1.40
	スウェーデン	2,286,912,599	1.16
	香港	1,850,549,508	0.94
	イタリア	1,556,515,224	0.79
	シンガポール	1,492,966,391	0.75
	デンマーク	1,414,249,094	0.72
	ジャージー	1,102,903,153	0.56
	バミューダ	981,975,207	0.50
	ベルギー	902,962,261	0.46
	フィンランド	808,230,797	0.41
	キュラソー	521,842,238	0.26
	ケイマン諸島	484,775,356	0.25
	ノルウェー	481,806,610	0.24
	イスラエル	470,264,129	0.24
	ルクセンブルグ	254,324,687	0.13
	オーストリア	188,829,565	0.10
	ニュージーランド	138,050,738	0.07
	ポルトガル	117,478,944	0.06
	リベリア	106,558,356	0.05
	パプアニューギニア	41,715,920	0.02
	英ヴァージン諸島	38,940,418	0.02
	マン島	25,198,495	0.01
	モーリシャス	10,916,056	0.01
	小計	189,208,010,684	95.68
投資証券	アメリカ	3,411,607,352	1.73
	オーストラリア	675,589,716	0.34
	フランス	270,659,109	0.14
	イギリス	194,556,052	0.10
	香港	127,457,417	0.06
	シンガポール	103,804,157	0.05
	カナダ	43,549,061	0.02
	小計	4,827,222,864	2.44
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		3,716,001,432	1.88
合計(純資産総額)		197,751,234,980	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	2,371,600,000	1.19
	買建	ドイツ	655,498,171	0.33
	買建	イギリス	244,546,688	0.12
	買建	オーストラリア	186,698,197	0.09
合計	買建		3,458,343,056	1.73

種類	買建/ 売建	国/地域	時価合計(円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	売建		1,309,594,600	0.66

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29年 6月30日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
親投資信託受益証券	日本	3,313,463,230	100.00
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		59,639	0.00
合計(純資産総額)		3,313,403,591	100.00

外国債券パッシブ・マザーファンド

平成29年 6月30日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
国債証券	アメリカ	89,569,635,615	43.23
	フランス	20,280,205,096	9.79
	イタリア	19,879,322,848	9.60
	ドイツ	14,786,729,973	7.14
	イギリス	14,612,377,162	7.05
	スペイン	11,535,046,689	5.57
	ベルギー	5,287,263,550	2.55
	オランダ	4,638,576,449	2.24

	オーストラリア	4,407,076,545	2.13
	カナダ	4,362,615,716	2.11
	オーストリア	3,079,047,652	1.49
	メキシコ	1,945,470,663	0.94
	アイルランド	1,790,053,319	0.86
	フィンランド	1,345,010,129	0.65
	ポーランド	1,298,917,418	0.63
	デンマーク	1,296,825,130	0.63
	南アフリカ	1,123,363,059	0.54
	スウェーデン	953,016,559	0.46
	マレーシア	876,167,901	0.42
	シンガポール	818,330,113	0.39
	ノルウェー	582,215,527	0.28
	スイス	431,312,252	0.21
	小計	204,898,579,365	98.90
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		2,279,591,126	1.10
合計(純資産総額)		207,178,170,491	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		1,100,528	0.00
	売建		685,255,395	0.33

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29年 6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	500,107,521	100.00
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		974	0.00
合計(純資産総額)		500,108,495	100.00

マネーインカム・マザーファンド

平成29年 6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	日本	200,023,800	15.18
特殊債券	日本	1,006,031,000	76.35

現金・預金・その他の資産(負債控除後)		111,659,876	8.47
合計(純資産総額)		1,317,714,676	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29年 6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	国内株式インデックス・マザーファンド(B号)	10,156,731,368	2.1865	22,207,693,137	2.4477	24,860,631,369	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29年 6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

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29年 6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(%)
日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	1,000,600	6,657.77	6,661,764,662	5,910.00	5,913,546,000	2.99
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	6,155,000	672.94	4,141,945,700	755.20	4,648,256,000	2.35
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	652,100	4,649.69	3,032,062,849	5,404.00	3,523,948,400	1.78
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	365,700	6,810.26	2,490,512,082	9,252.00	3,383,456,400	1.71
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	650,000	4,221.96	2,744,274,000	4,366.00	2,837,900,000	1.43
日本	株式	ソニー	電気機器	581,400	3,297.82	1,917,352,548	4,365.00	2,537,811,000	1.28
日本	株式	KDDI	情報・通信業	793,400	3,002.19	2,381,937,546	2,989.00	2,371,472,600	1.20
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	740,400	3,336.82	2,470,581,528	3,084.00	2,283,393,600	1.15

日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	11,008,300	203.06	2,235,345,398	205.70	2,264,407,310	1.14
日本	株式	日本たばこ産業	食料品	511,300	3,938.50	2,013,755,050	4,010.00	2,050,313,000	1.04
日本	株式	任天堂	その他製品	50,700	27,540.61	1,396,308,927	38,780.00	1,966,146,000	0.99
日本	株式	キーエンス	電気機器	37,300	39,257.73	1,464,313,329	50,340.00	1,877,682,000	0.95
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	323,100	4,696.37	1,517,397,147	5,761.00	1,861,379,100	0.94
日本	株式	ファナック	電気機器	83,400	19,363.02	1,614,875,868	21,915.00	1,827,711,000	0.92
日本	株式	東日本旅客鉄道	陸運業	159,200	9,802.42	1,560,545,264	10,970.00	1,746,424,000	0.88
日本	株式	キヤノン	電気機器	442,800	3,262.91	1,444,816,548	3,828.00	1,695,038,400	0.86
日本	株式	NTTドコモ	情報・通信業	597,700	2,630.15	1,572,040,655	2,690.00	1,607,813,000	0.81
日本	株式	信越化学工業	化学	154,500	8,514.34	1,315,465,530	10,320.00	1,594,440,000	0.81
日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	339,800	4,445.09	1,510,441,582	4,676.00	1,588,904,800	0.80
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	327,000	4,889.20	1,598,768,400	4,685.00	1,531,995,000	0.77
日本	株式	村田製作所	電気機器	86,300	15,392.72	1,328,391,736	17,305.00	1,493,421,500	0.76
日本	株式	パナソニック	電気機器	944,500	1,164.70	1,100,059,150	1,551.50	1,465,391,750	0.74
日本	株式	花王	化学	215,100	5,276.37	1,134,947,187	6,746.00	1,451,064,600	0.73
日本	株式	三菱商事	卸売業	610,100	2,474.29	1,509,564,329	2,360.50	1,440,141,050	0.73
日本	株式	ブリヂストン	ゴム製品	291,000	4,353.81	1,266,958,710	4,836.00	1,407,276,000	0.71
日本	株式	三菱電機	電気機器	877,300	1,579.37	1,385,581,301	1,602.00	1,405,434,600	0.71
日本	株式	日立製作所	電気機器	1,976,000	611.74	1,208,798,240	689.80	1,363,044,800	0.69
日本	株式	ダイキン工業	機械	112,100	10,740.85	1,204,049,285	11,665.00	1,307,646,500	0.66
日本	株式	三菱地所	不動産業	604,400	2,305.43	1,393,401,892	2,100.50	1,269,542,200	0.64
日本	株式	東海旅客鉄道	陸運業	68,500	18,720.25	1,282,337,125	18,415.00	1,261,427,500	0.64

□ 種類別・業種別の投資比率

平成29年 6月29日現在

種類	国内 / 外国	業種	投資比率 (%)
株式	国内	水産・農林業	0.11
		鉱業	0.30
		建設業	3.13
		食料品	4.56
		繊維製品	0.67
		パルプ・紙	0.26
		化学	6.89
		医薬品	4.53

石油・石炭製品	0.48
ゴム製品	0.97
ガラス・土石製品	0.97
鉄鋼	1.17
非鉄金属	0.91
金属製品	0.70
機械	4.99
電気機器	13.03
輸送用機器	8.24
精密機器	1.59
その他製品	2.14
電気・ガス業	1.82
陸運業	4.16
海運業	0.21
空運業	0.56
倉庫・運輸関連業	0.19
情報・通信業	7.98
卸売業	4.29
小売業	4.63
銀行業	7.93
証券、商品先物取引業	1.10
保険業	2.48
その他金融業	1.28
不動産業	2.42
サービス業	3.85
合計	98.55

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29年 6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	国内債券(NOMURA-BPI) マザーファンド	23,348,444,566	1.3844	32,323,595,806	1.3840	32,314,247,279	100.00

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29年 6月29日現在

種類	投資比率（％）
親投資信託受益証券	100.00
合計	100.00

国内債券（NOMURA - B P I）マザーファンド

イ 主要投資銘柄（上位30銘柄）

平成29年 6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 (%)
日本	国債証券	第306回利付国債（10年）	1,310,000,000	104.12	1,364,037,500	104.09	1,363,618,300	1.400	2020/3/20	1.22
日本	国債証券	第130回利付国債（5年）	1,340,000,000	100.92	1,352,408,400	100.89	1,352,019,800	0.100	2021/12/20	1.21
日本	国債証券	第127回利付国債（5年）	1,335,000,000	100.75	1,345,025,850	100.74	1,344,945,750	0.100	2021/3/20	1.21
日本	国債証券	第310回利付国債（10年）	1,235,000,000	103.56	1,279,027,750	103.54	1,278,830,150	1.000	2020/9/20	1.15
日本	国債証券	第125回利付国債（5年）	1,230,000,000	100.63	1,237,810,500	100.64	1,237,933,500	0.100	2020/9/20	1.11
日本	国債証券	第315回利付国債（10年）	1,165,000,000	105.17	1,225,242,150	105.13	1,224,787,800	1.200	2021/6/20	1.10
日本	国債証券	第343回利付国債（10年）	1,192,000,000	100.71	1,200,463,200	100.71	1,200,522,800	0.100	2026/6/20	1.08
日本	国債証券	第128回利付国債（5年）	1,185,000,000	100.78	1,194,254,850	100.79	1,194,432,600	0.100	2021/6/20	1.07
日本	国債証券	第317回利付国債（10年）	1,100,000,000	105.05	1,155,550,000	105.05	1,155,638,000	1.100	2021/9/20	1.04
日本	国債証券	第344回利付国債（10年）	1,145,000,000	100.69	1,152,911,950	100.64	1,152,362,350	0.100	2026/9/20	1.03
日本	国債証券	第305回利付国債（10年）	1,105,000,000	103.51	1,143,840,750	103.47	1,143,376,650	1.300	2019/12/20	1.03
日本	国債証券	第339回利付国債（10年）	1,100,000,000	103.23	1,135,629,000	103.26	1,135,948,000	0.400	2025/6/20	1.02
日本	国債証券	第341回利付国債（10年）	1,060,000,000	102.46	1,086,076,000	102.49	1,086,457,600	0.300	2025/12/20	0.97
日本	国債証券	第313回利付国債（10年）	1,020,000,000	105.21	1,073,233,800	105.19	1,073,009,400	1.300	2021/3/20	0.96
日本	国債証券	第312回利付国債（10年）	985,000,000	104.52	1,029,551,550	104.50	1,029,344,700	1.200	2020/12/20	0.92
日本	国債証券	第346回利付国債（10年）	1,015,000,000	100.57	1,020,878,800	100.53	1,020,389,650	0.100	2027/3/20	0.92
日本	国債証券	第328回利付国債（10年）	970,000,000	103.77	1,006,598,100	103.81	1,006,976,400	0.600	2023/3/20	0.90
日本	国債証券	第342回利付国債（10年）	975,000,000	100.74	982,234,500	100.73	982,205,250	0.100	2026/3/20	0.88
日本	国債証券	第330回利付国債（10年）	920,000,000	105.32	968,999,200	105.36	969,367,200	0.800	2023/9/20	0.87
日本	国債証券	第131回利付国債（5年）	955,000,000	100.90	963,633,200	100.94	964,034,300	0.100	2022/3/20	0.86
日本	国債証券	第333回利付国債（10年）	910,000,000	104.39	950,012,700	104.41	950,149,200	0.600	2024/3/20	0.85
日本	国債証券	第340回利付国債（10年）	908,000,000	103.25	937,564,480	103.32	938,227,320	0.400	2025/9/20	0.84

日本	国債証券	第329回利付国債（10年）	835,000,000	105.14	877,935,700	105.17	878,244,650	0.800	2023/6/20	0.79
日本	国債証券	第345回利付国債（10年）	855,000,000	100.66	860,660,100	100.56	859,830,750	0.100	2026/12/20	0.77
日本	国債証券	第338回利付国債（10年）	817,000,000	103.21	843,274,720	103.24	843,503,480	0.400	2025/3/20	0.76
日本	国債証券	第334回利付国債（10年）	795,000,000	104.52	830,973,750	104.54	831,108,900	0.600	2024/6/20	0.75
日本	国債証券	第43回利付国債（20年）	710,000,000	106.76	758,038,600	106.67	757,392,500	2.900	2019/9/20	0.68
日本	国債証券	第147回利付国債（20年）	610,000,000	119.68	730,048,000	119.55	729,273,300	1.600	2033/12/20	0.65
日本	国債証券	第151回利付国債（20年）	645,000,000	112.98	728,741,100	112.87	728,043,750	1.200	2034/12/20	0.65
日本	国債証券	第332回利付国債（10年）	695,000,000	104.23	724,440,200	104.25	724,537,500	0.600	2023/12/20	0.65

□ 種類別の投資比率

平成29年 6月29日現在

種類	投資比率（％）
国債証券	75.84
地方債証券	8.01
特殊債券	10.52
社債券	4.45
合計	98.82

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29年 6月30日現在

国／地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価 （円）	帳簿価額 （円）	評価額 単価 （円）	評価額 （円）	投資 比率 （％）
日本	親投資信託受益証券	外国株式インデックス・マザーファンド	4,271,309,477	2.7559	11,771,301,788	3.1236	13,341,862,282	99.97

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29年 6月30日現在

種類	投資比率（％）
親投資信託受益証券	99.97
合計	99.97

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29年 6月30日現在

国/ 地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	投資 比率 (%)
アメリカ	株式	APPLE INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	269,946	12,686.23	3,424,599,743	16,092.15	4,344,014,223	2.20
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	377,558	6,879.03	2,597,236,584	7,670.87	2,896,202,111	1.46
アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	小売	20,887	86,571.51	1,808,219,338	109,304.16	2,283,035,990	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	139,731	12,647.03	1,767,183,546	14,855.67	2,075,799,022	1.05
アメリカ	株式	FACEBOOK INC-A	ソフトウェア・サービス	121,060	13,690.88	1,657,417,933	16,916.48	2,047,909,069	1.04
アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORPORATION	エネルギー	213,110	9,633.11	2,052,914,203	9,038.40	1,926,173,424	0.97
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	183,874	8,975.67	1,650,394,184	10,208.79	1,877,132,891	0.95
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	ソフトウェア・サービス	16,043	87,188.64	1,398,767,352	102,792.48	1,649,099,757	0.83
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	ソフトウェア・サービス	15,265	89,383.84	1,364,444,318	105,035.84	1,603,372,098	0.81
スイス	株式	NESTLE SA-REGISTERED	食品・飲料・タバコ	160,268	8,135.67	1,303,887,560	9,792.06	1,569,355,315	0.79
アメリカ	株式	WELLS FARGO & COMPANY	銀行	244,742	5,872.16	1,437,164,183	6,247.35	1,528,991,381	0.77
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	515,854	2,329.59	1,201,733,478	2,723.83	1,405,103,759	0.71
アメリカ	株式	GENERAL ELECTRIC CO	資本財	449,304	3,477.59	1,562,499,590	3,026.24	1,359,701,737	0.69
アメリカ	株式	AT&T INC	電気通信サービス	315,474	4,463.20	1,408,023,557	4,213.44	1,329,230,771	0.67
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	131,652	9,346.40	1,230,472,253	9,742.88	1,282,669,638	0.65
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	各種金融	63,620	17,735.20	1,128,313,424	18,961.60	1,206,336,992	0.61
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	306,506	3,579.51	1,097,144,357	3,766.55	1,154,473,239	0.58
アメリカ	株式	CHEVRON CORPORATION	エネルギー	97,158	12,410.72	1,205,800,734	11,661.44	1,133,002,188	0.57
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	114,996	8,245.70	948,223,253	9,417.47	1,082,972,185	0.55
アメリカ	株式	HOME DEPOT INC	小売	62,732	14,664.15	919,912,085	17,041.91	1,069,073,725	0.54
アメリカ	株式	CITIGROUP INC	銀行	142,142	6,274.23	891,833,022	7,501.76	1,066,315,170	0.54
イギリス	株式	HSBC HOLDINGS PLC	銀行	1,018,902	934.51	952,178,082	1,043.12	1,062,844,645	0.54

アメリカ	株式	COMCAST CORP-CLASS A	メディア	243,723	3,955.83	964,129,192	4,353.43	1,061,033,457	0.54
アメリカ	株式	COCA-COLA CO/THE	食品・飲料・タバコ	210,047	4,608.80	968,064,614	5,020.95	1,054,637,585	0.53
アメリカ	株式	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL INC.	食品・飲料・タバコ	79,892	10,196.47	814,617,180	13,112.95	1,047,620,600	0.53
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	36,150	26,721.28	965,974,496	28,902.11	1,044,811,421	0.53
アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS INC	電気通信サービス	209,941	5,748.96	1,206,942,412	4,973.92	1,044,229,739	0.53
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	49,576	17,715.03	878,240,823	20,750.23	1,028,713,898	0.52
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	141,986	6,961.91	988,495,173	7,206.08	1,023,162,475	0.52
アメリカ	株式	VISA INC	ソフトウェア・サービス	95,683	8,923.03	853,783,236	10,575.03	1,011,851,552	0.51

□ 種類別・業種別の投資比率

平成29年 6月30日現在

種類	国内 / 外国	業種	投資比率 (%)
株式	外国	エネルギー	6.38
		素材	4.69
		資本財	7.29
		商業・専門サービス	0.96
		運輸	1.90
		自動車・自動車部品	1.50
		耐久消費財・アパレル	1.77
		消費者サービス	1.82
		メディア	2.65
		小売	3.78
		食品・生活必需品小売り	1.78
		食品・飲料・タバコ	6.16
		家庭用品・パーソナル用品	1.72
		ヘルスケア機器・サービス	4.13
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	8.57
銀行	9.42		
各種金融	4.48		

	保険	4.25
	不動産	0.78
	ソフトウェア・サービス	9.27
	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	4.20
	電気通信サービス	2.75
	公益事業	3.28
	半導体・半導体製造装置	2.16
投資証券		2.44
合計		98.12

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29年 6月30日現在

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	投資 比率 (%)
日本	親投資信託受益証券	外国債券パッシブ・マザーファンド	1,914,964,590	1.7027	3,260,610,208	1.7303	3,313,463,230	100.00

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29年 6月30日現在

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	100.00
合計	100.00

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29年 6月30日現在

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.375	8,000,000	11,131.14	890,491,494	11,396.87	911,750,004	2.375	2024/8/15	0.44
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2	8,000,000	10,780.93	862,474,834	11,073.12	885,850,004	2.000	2025/2/15	0.43
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2	8,000,000	10,725.53	858,042,640	10,951.50	876,120,000	2.000	2026/11/15	0.42
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.25	7,500,000	10,954.25	821,569,280	11,230.62	842,296,879	2.250	2025/11/15	0.41

アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2	7,500,000	10,725.12	804,384,000	11,037.24	827,793,749	2.000	2025/8/15	0.40
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.75	7,000,000	11,494.94	804,645,873	11,677.75	817,442,500	2.750	2024/2/15	0.39
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 4.25	5,000,000	16,397.81	819,890,992	16,127.93	806,396,556	4.250	2023/10/25	0.39
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.5	7,000,000	11,259.95	788,196,640	11,498.37	804,886,254	2.500	2024/5/15	0.39
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.25	7,000,000	11,037.60	772,632,000	11,287.50	790,125,000	2.250	2024/11/15	0.38
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.25	7,000,000	11,102.46	777,172,480	11,179.87	782,591,254	2.250	2027/2/15	0.38
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.125	7,000,000	10,888.16	762,171,200	11,158.87	781,121,254	2.125	2025/5/15	0.38
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 3.625	6,000,000	12,153.75	729,225,000	12,936.87	776,212,503	3.625	2043/8/15	0.37
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 5.75	3,700,000	21,182.42	783,749,705	20,972.49	775,982,182	5.750	2032/10/25	0.37
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 1.625	7,000,000	10,360.00	725,200,000	10,671.50	747,005,000	1.625	2026/2/15	0.36
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 1.625	7,000,000	10,314.41	722,009,263	10,646.12	745,228,754	1.625	2026/5/15	0.36
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 3	5,000,000	14,916.38	745,819,398	14,716.29	735,814,703	3.000	2022/4/25	0.36
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 1.5	7,000,000	10,198.72	713,910,400	10,507.00	735,490,000	1.500	2026/8/15	0.36
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2	6,500,000	11,030.87	717,007,199	11,223.62	729,535,628	2.000	2023/2/15	0.35
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.75	6,200,000	11,439.75	709,264,500	11,683.87	724,400,253	2.750	2023/11/15	0.35
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 3.125	6,000,000	11,188.03	671,282,080	11,887.75	713,265,000	3.125	2044/8/15	0.34
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 3.625	6,000,000	11,882.50	712,950,000	11,818.62	709,117,503	3.625	2020/2/15	0.34
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 4.5	3,500,000	20,159.11	705,568,994	20,212.09	707,423,279	4.500	2041/4/25	0.34
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 3.25	4,800,000	14,954.78	717,829,543	14,706.05	705,890,710	3.250	2021/10/25	0.34
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 3.75	5,000,000	14,387.02	719,351,362	14,055.96	702,798,443	3.750	2019/10/25	0.34
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 3	6,000,000	10,889.67	653,380,282	11,591.12	695,467,503	3.000	2045/11/15	0.34
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 3.75	4,700,000	15,057.07	707,682,291	14,770.68	694,222,022	3.750	2021/4/25	0.34
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 5.5	3,500,000	19,612.17	686,425,961	19,318.99	676,164,687	5.500	2029/4/25	0.33
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 1.75	6,000,000	10,825.92	649,555,200	11,051.25	663,075,000	1.750	2023/5/15	0.32
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 3.625	5,000,000	12,336.26	616,813,400	12,962.25	648,112,500	3.625	2044/2/15	0.31
イタリア	国債証券	BTPS 6	3,600,000	18,551.81	667,865,193	17,992.96	647,746,773	6.000	2031/5/1	0.31

□ 種類別の投資比率

平成29年 6月30日現在

種類	投資比率（％）
国債証券	98.90
合計	98.90

イ 主要投資銘柄

平成29年 6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	マネーインカム・マザーファンド	494,519,452	1.0113	500,107,605	1.0113	500,107,521	100.00

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29年 6月29日現在

種類	投資比率 (%)
親投資信託受益証券	100.00
合計	100.00

マネーインカム・マザーファンド

イ 主要投資銘柄

平成29年 6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 (%)
日本	特殊債券	第40回政府保証 日本高速道路保 有・債務返済機構 債券	200,000,000	100.74	201,488,000	100.32	200,658,000	1.900	2017/8/31	15.23
日本	特殊債券	第195回政府保証 預金保険機構債	200,000,000	100.18	200,372,000	100.12	200,242,000	0.200	2018/1/23	15.20
日本	特殊債券	第60回政府保証 日本高速道路保 有・債務返済機構 債券	100,000,000	102.06	102,060,000	101.82	101,820,000	1.800	2018/6/29	7.73
日本	特殊債券	第56回政府保証 日本高速道路保 有・債務返済機構 債券	100,000,000	101.46	101,467,000	101.14	101,144,000	1.400	2018/4/20	7.68
日本	特殊債券	第21回政府保証 日本政策投資銀行 債券	100,000,000	101.40	101,401,000	101.03	101,038,000	1.600	2018/2/19	7.67
日本	特殊債券	第880回政府保証 証公営企業債券	100,000,000	100.71	100,715,000	100.66	100,661,000	1.700	2017/11/17	7.64
日本	特殊債券	第17回政府保証 中日本高速道路債 券	100,000,000	100.40	100,408,000	100.36	100,366,000	1.700	2017/9/15	7.62
日本	特殊債券	第1回政府保証地 方公共団体金融機 構債券（6年）	100,000,000	100.20	100,202,000	100.10	100,102,000	0.400	2017/9/27	7.60
日本	国債証券	第686回国庫短 期証券	100,000,000	100.02	100,021,600	100.01	100,015,100		2017/9/4	7.59
日本	国債証券	第662回国庫短 期証券	100,000,000	100.01	100,015,000	100.00	100,008,700		2017/8/10	7.59

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29年 6月29日現在

種類	投資比率（％）
国債証券	15.18
特殊債券	76.35
合計	91.53

投資不動産物件

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）

該当事項はありません。

国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

該当事項はありません。

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＞

該当事項はありません。

国内債券（NOMURA - B P I）マザーファンド

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）

該当事項はありません。

外国株式インデックス・マザーファンド

該当事項はありません。

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＞

該当事項はありません。

外国債券パッシブ・マザーファンド

該当事項はありません。

S M A M ・マネーインカムファンド＜適格機関投資家限定＞

該当事項はありません。

マネーインカム・マザーファンド

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

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）

該当事項はありません。

国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

平成29年 6月29日現在

種類	取引所等	名称	買建/ 売建	数量	通貨	簿価 （円）	時価 （円）	投資 比率 （%）
株価指数先物 取引	大阪取引所	東証株価指数先物	買建	164	日本円	2,628,122,320	2,662,540,000	1.34

（注）主たる取引所の発表する清算値段または最終相場で評価しております。

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>

該当事項はありません。

国内債券（NOMURA - B P I）マザーファンド

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）

該当事項はありません。

外国株式インデックス・マザーファンド

平成29年 6月30日現在

種類	地域	取引所等	名称	買建/ 売建	数量	通貨	帳簿価額	簿価 （円）	評価額	時価 （円）	投資 比率 （%）
株価指 数先物 取引	アメリカ	シカゴ商業 取引所	SPMINI 1709	買建	175	米ドル	21,298,550	2,385,437,600	21,175,000	2,371,600,000	1.19
	ドイツ	ユーレック ス・ドイツ 金融先物取 引所	DJ EUR 1709	買建	148	ユーロ	5,235,436	669,978,744	5,122,280	655,498,171	0.33
	オース トラリ ア	シドニー先 物取引所	SPI200 1709	買建	15	オースト ラリアドル	2,127,817.5	183,375,312	2,166,375	186,698,197	0.09
	イギリ ス	ロンドン国 際金融先物 オプション 取引所	FTSE 1709	買建	23	英ポンド	1,697,451	247,471,381	1,677,390	244,546,688	0.12

（注）主たる取引所の発表する清算値段または最終相場で評価しております。

平成29年 6月30日現在

種類	資産の名称	買建 / 売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	米ドル	売建	9,200,000.00	1,032,250,000	1,030,194,000	0.52
	カナダドル	売建	160,000.00	13,792,000	13,798,400	0.00
	ユーロ	売建	670,000.00	85,681,400	85,739,900	0.04
	英ポンド	売建	470,000.00	68,390,200	68,514,900	0.03
	スイスフラン	売建	420,000.00	49,163,000	49,165,200	0.02
	スウェーデンクローナ	売建	1,260,000.00	16,590,700	16,644,600	0.00
	ノルウェークローネ	売建	240,000.00	3,198,900	3,201,600	0.00
	デンマーククローネ	売建	610,000.00	10,488,900	10,498,100	0.00
	ニュージーランドドル	売建	20,000.00	1,640,000	1,639,700	0.00
	香港ドル	売建	1,350,000.00	19,408,000	19,359,000	0.00
	シンガポールドル	売建	90,000.00	7,311,300	7,310,400	0.00
	イスラエルシェケル	売建	110,000.00	3,526,100	3,528,800	0.00

(注) わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しております。

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>

該当事項はありません。

外国債券パッシブ・マザーファンド

平成29年 6月30日現在

種類	資産の名称	買建 / 売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	米ドル	買建	755.42	84,683	84,591	0.00
	ユーロ	買建	5,543.99	707,453	709,464	0.00
	英ポンド	買建	1,659.03	238,568	241,853	0.00
	オーストラリアドル	買建	750.00	63,825	64,620	0.00
	米ドル	売建	2,269,412.00	254,441,676	254,128,755	0.12
	ユーロ	売建	1,990,762.00	254,334,090	254,757,813	0.12
	英ポンド	売建	573,753.00	82,411,356	83,641,712	0.04
	オーストラリアドル	売建	1,076,220.00	91,698,679	92,727,115	0.04

(注) わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しております。

S M A M ・マネーインカムファンド<適格機関投資家限定>

該当事項はありません。

マネーインカム・マザーファンド

該当事項はありません。

参考情報

基準日:2017年6月30日

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

★ 基準価額・純資産の推移

▶ <2010>



★ 分配の推移

決算期	分配金
2016年12月	0円
2015年12月	0円
2014年12月	0円
2013年12月	0円
2012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
2016年12月	0円
2015年12月	0円
2014年12月	0円
2013年12月	0円
2012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
2016年12月	0円
2015年12月	0円
2014年12月	0円
2013年12月	0円
2012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。

※基準価額は、1万口当たり、信託報酬控除後です。

▶ <2040>



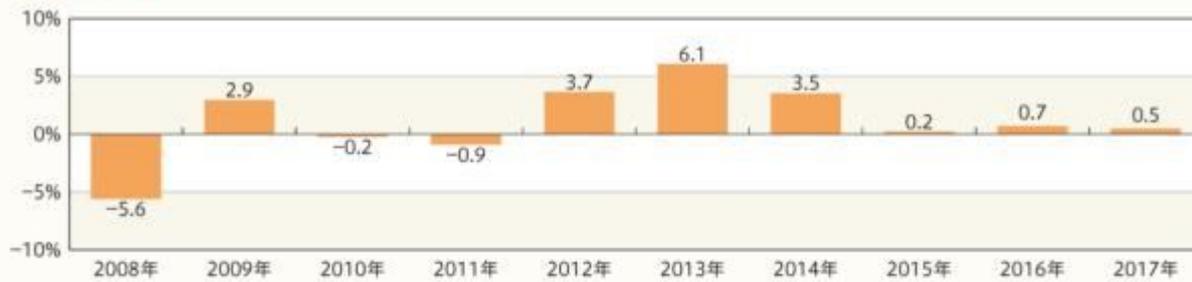
※基準価額は、1万口当たり、信託報酬控除後です。

決算期	分配金
2016年12月	0円
2015年12月	0円
2014年12月	0円
2013年12月	0円
2012年12月	0円
設定来累計	0円

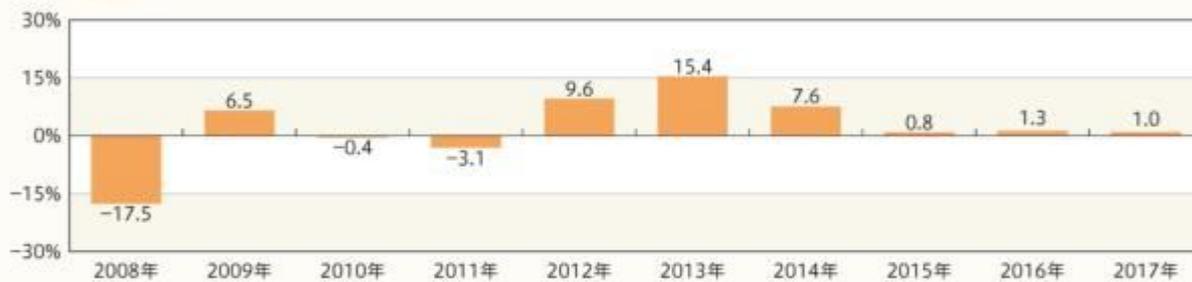
※分配金は1万口当たり、税引前です。
※直近5計算期間を記載しています。

★年間収益率の推移(暦年ベース)

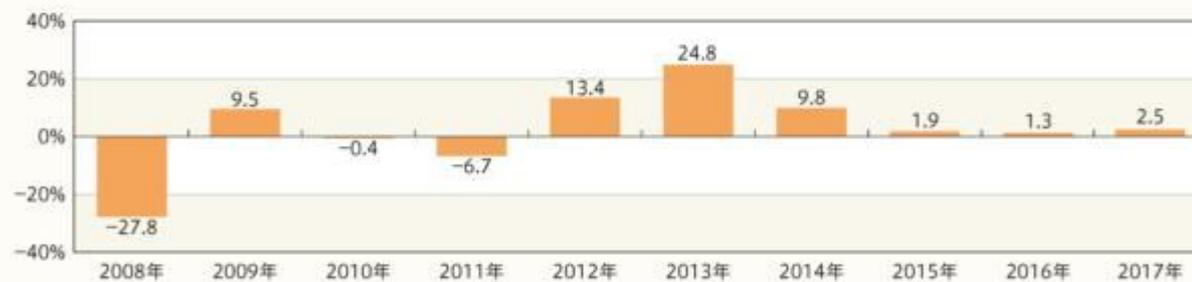
▶<2010>



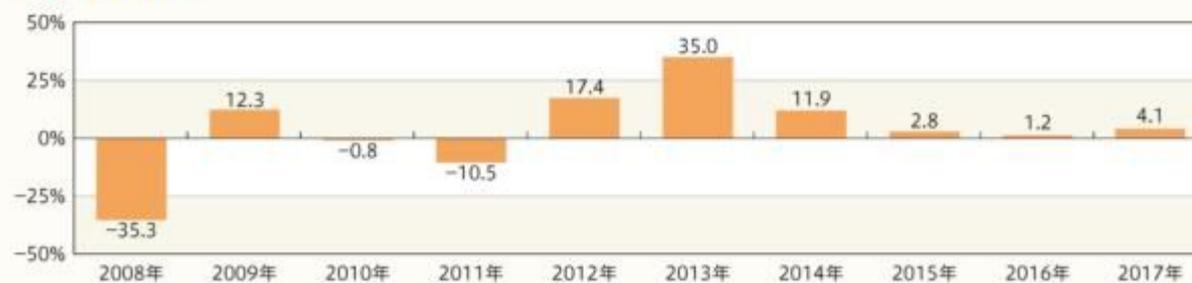
▶<2020>



▶<2030>



▶<2040>



※2017年のファンドの収益率は、年初から2017年6月30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。

ハ 申込手数料

無手数料です。

ニ 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。）。

ロ 基準価額の算出頻度・照会方法

基準価額は、委託会社の営業日において日々算出されます。

基準価額は、販売会社または委託会社にお問い合わせいただけるほか、原則として翌日付の日本経済新聞朝刊の証券欄「オープン基準価格」の紙面に、それぞれ「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、）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、）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。ただし、平成30年2月1日以降は、以下の通り変更される予定です。

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

<http://www.snam-jp.com>

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

チ 運用にかかる報告書の開示方法

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

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

4【受益者の権利等】

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

受益者の有する主な権利は次の通りです。

イ 分配金請求権

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

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

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

ハ 一部解約実行請求権

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

ニ 信託約款変更等に対する異議申立権および受益権の買取請求権

委託会社が、当ファンドの解約（監督官庁の命令による解約等の場合を除きます。）または重大な信託約款の変更を行おうとする場合において、当該解約または信託約款変更に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、受託会社に対し、自己に帰属する受益権を、信託財産をもって買い取るべき旨の請求ができます。

ホ 帳簿閲覧・謄写請求権

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

第3【ファンドの経理状況】

1. 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）ならびに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づいて作成しております。
なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
2. 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第16期（平成27年12月22日から平成28年12月20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15期 （平成27年12月21日現在）	第16期 （平成28年12月20日現在）
資産の部		
流動資産		
金銭信託	-	64,497
コール・ローン	7,051,630	3,042,319
投資信託受益証券	521,086,746	551,247,305
未収入金	-	270,000
未収利息	1	-
流動資産合計	528,138,377	554,624,121
資産合計	528,138,377	554,624,121
負債の部		
流動負債		
未払金	1,210,000	-
未払解約金	1,789,724	262,865
未払受託者報酬	109,491	117,486
未払委託者報酬	985,332	1,057,349
未払利息	-	7
その他未払費用	8,161	8,768
流動負債合計	4,102,708	1,446,475
負債合計	4,102,708	1,446,475
純資産の部		
元本等		
元本	424,461,776	444,068,361
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	99,573,893	109,109,285
元本等合計	524,035,669	553,177,646
純資産合計	524,035,669	553,177,646
負債純資産合計	528,138,377	554,624,121

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第15期		第16期	
	自	平成26年12月23日 至 平成27年12月21日	自	平成27年12月22日 至 平成28年12月20日
営業収益				
受取利息		434		40
有価証券売買等損益		3,867,632		7,450,559
営業収益合計		3,868,066		7,450,599
営業費用				
支払利息		-		1,630
受託者報酬		215,754		232,099
委託者報酬		1,941,689		2,088,807
その他費用		16,057		17,781
営業費用合計		2,173,500		2,340,317
営業利益又は営業損失()		1,694,566		5,110,282
経常利益又は経常損失()		1,694,566		5,110,282
当期純利益又は当期純損失()		1,694,566		5,110,282
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()		182,081		16,037
期首剰余金又は期首欠損金()		91,762,330		99,573,893
剰余金増加額又は欠損金減少額		19,181,175		16,967,844
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		19,181,175		16,967,844
剰余金減少額又は欠損金増加額		12,882,097		12,526,697
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		12,882,097		12,526,697
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()		99,573,893		109,109,285

（ 3 ）【注記表】

（ 重要な会計方針の注記 ）

項 目	第16期	
	自 平成27年12月22日 至 平成28年12月20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が休日のため、平成27年12月22日から平成28年12月20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15期		第16期	
	（平成27年12月21日現在）		（平成28年12月20日現在）	
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	424,461,776口		444,068,361口	
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額	1.2346円	1口当たり純資産額	1.2457円
	(10,000口当たりの純資産額)	12,346円	(10,000口当たりの純資産額)	12,457円

（ 損益及び剰余金計算書に関する注記 ）

項目	第15期	第16期
	自 平成26年12月23日 至 平成27年12月21日	自 平成27年12月22日 至 平成28年12月20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（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。	計算期間末における費用控除後の配当等収益（0円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（5,095,774円）、収益調整金（69,323,400円）、および分配準備積立金（34,690,111円）より、分配対象収益は109,109,285円（1万口当たり2,457.02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16期
	自 平成27年12月22日 至 平成28年12月20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16期 自 平成27年12月22日 至 平成28年12月20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16期 (平成28年12月20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

第16期（自 平成27年12月22日 至 平成28年12月20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	7,976,210円
合計	7,976,210円

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

第16期 自 平成27年12月22日 至 平成28年12月20日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。

（その他の注記）

項 目	第15期 （平成27年12月21日現在）	第16期 （平成28年12月20日現在）
期首元本額	398,408,082円	424,461,776円
期中追加設定元本額	81,915,864円	73,067,241円
期中一部解約元本額	55,862,170円	53,460,656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）	18,576,845	28,095,620	
	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）	12,247,581	27,991,846	
	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＞	16,266,696	27,531,382	
	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＞	149,756,337	191,867,818	
	S M A M ・ マネーインカムファンド＜適格機関投資家限定＞	273,517,794	275,760,639	
合計		470,365,253	551,247,305	

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15期 （平成27年12月21日現在）	第16期 （平成28年12月20日現在）
資産の部		
流動資産		
金銭信託	-	142,862
コール・ローン	13,465,243	6,738,784
投資信託受益証券	1,210,066,656	1,346,885,111
未収入金	-	360,000
未収利息	3	-
流動資産合計	1,223,531,902	1,354,126,757
資産合計	1,223,531,902	1,354,126,757
負債の部		
流動負債		
未払金	440,000	240,000
未払解約金	-	370,634
未払受託者報酬	253,189	279,024
未払委託者報酬	2,848,358	3,138,950
未払利息	-	16
その他未払費用	18,928	20,909
流動負債合計	3,560,475	4,049,533
負債合計	3,560,475	4,049,533
純資産の部		
元本等		
元本	847,471,022	923,437,583
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	372,500,405	426,639,641
元本等合計	1,219,971,427	1,350,077,224
純資産合計	1,219,971,427	1,350,077,224
負債純資産合計	1,223,531,902	1,354,126,757

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第15期		第16期	
	自	平成26年12月23日 至 平成27年12月21日	自	平成27年12月22日 至 平成28年12月20日
営業収益				
受取利息		699		103
有価証券売買等損益		18,360,298		28,128,455
営業収益合計		18,360,997		28,128,558
営業費用				
支払利息		-		3,770
受託者報酬		482,461		544,469
委託者報酬		5,427,663		6,125,189
その他費用		36,069		41,884
営業費用合計		5,946,193		6,715,312
営業利益又は営業損失（ ）		12,414,804		21,413,246
経常利益又は経常損失（ ）		12,414,804		21,413,246
当期純利益又は当期純損失（ ）		12,414,804		21,413,246
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（ ）		920,421		383,350
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		309,472,046		372,500,405
剰余金増加額又は欠損金減少額		76,640,258		57,514,298
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		76,640,258		57,514,298
剰余金減少額又は欠損金増加額		25,106,282		25,171,658
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		25,106,282		25,171,658
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（ ）		372,500,405		426,639,641

（ 3 ）【注記表】

（ 重要な会計方針の注記 ）

項 目	第16期	
	自 平成27年12月22日 至 平成28年12月20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が休日のため、平成27年12月22日から平成28年12月20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15期		第16期	
	（平成27年12月21日現在）		（平成28年12月20日現在）	
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	847,471,022口		923,437,583口	
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額	1.4395円	1口当たり純資産額	1.4620円
	(10,000口当たりの純資産額)	14,395円)	(10,000口当たりの純資産額)	14,620円)

（ 損益及び剰余金計算書に関する注記 ）

項目	第15期	第16期
	自 平成26年12月23日 至 平成27年12月21日	自 平成27年12月22日 至 平成28年12月20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(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。	計算期間末における費用控除後の配当等収益(0円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(21,800,184円)、収益調整金(314,501,669円)、および分配準備積立金(163,150,104円)より、分配対象収益は499,451,957円(1万口当たり5,408.60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16期
	自 平成27年12月22日 至 平成28年12月20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16期 自 平成27年12月22日 至 平成28年12月20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16期 (平成28年12月20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

第16期（自 平成27年12月22日 至 平成28年12月20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	29,608,679円
合計	29,608,679円

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

第16期 自 平成27年12月22日 至 平成28年12月20日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。

（その他の注記）

項 目	第15期 （平成27年12月21日現在）	第16期 （平成28年12月20日現在）
期首元本額	732,860,365円	847,471,022円
期中追加設定元本額	173,855,110円	133,314,585円
期中一部解約元本額	59,244,453円	57,348,024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）	104,966,722	158,751,670	
	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）	45,096,593	103,068,263	
	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＞	99,492,411	168,390,905	
	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＞	643,909,079	824,976,312	
	S M A M ・ マネーインカムファンド＜適格機関投資家限定＞	90,952,154	91,697,961	
合計		984,416,959	1,346,885,111	

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15期 （平成27年12月21日現在）	第16期 （平成28年12月20日現在）
資産の部		
流動資産		
金銭信託	-	145,892
コール・ローン	9,081,071	6,881,698
投資信託受益証券	1,192,242,951	1,377,100,635
未収入金	210,000	220,000
未収利息	2	-
流動資産合計	1,201,534,024	1,384,348,225
資産合計	1,201,534,024	1,384,348,225
負債の部		
流動負債		
未払金	10,000	-
未払解約金	1,314,125	1,207,106
未払受託者報酬	251,244	271,035
未払委託者報酬	2,826,490	3,049,011
未払利息	-	17
その他未払費用	18,781	20,320
流動負債合計	4,420,640	4,547,489
負債合計	4,420,640	4,547,489
純資産の部		
元本等		
元本	790,633,233	892,182,725
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	406,480,151	487,618,011
元本等合計	1,197,113,384	1,379,800,736
純資産合計	1,197,113,384	1,379,800,736
負債純資産合計	1,201,534,024	1,384,348,225

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第15期		第16期	
	自	平成26年12月23日 至 平成27年12月21日	自	平成27年12月22日 至 平成28年12月20日
営業収益				
受取利息		1,305		69
有価証券売買等損益		25,074,109		40,097,684
営業収益合計		25,075,414		40,097,753
営業費用				
支払利息		-		4,107
受託者報酬		463,876		528,453
委託者報酬		5,218,478		5,944,939
その他費用		34,666		40,739
営業費用合計		5,717,020		6,518,238
営業利益又は営業損失（ ）		19,358,394		33,579,515
経常利益又は経常損失（ ）		19,358,394		33,579,515
当期純利益又は当期純損失（ ）		19,358,394		33,579,515
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（ ）		2,163,088		2,979,618
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		251,223,750		406,480,151
剰余金増加額又は欠損金減少額		166,359,178		75,616,971
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		166,359,178		75,616,971
剰余金減少額又は欠損金増加額		28,298,083		31,038,244
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		28,298,083		31,038,244
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（ ）		406,480,151		487,618,011

(3) 【注記表】

(重要な会計方針の注記)

項 目	第16期	
	自 平成27年12月22日 至 平成28年12月20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が休日のため、平成27年12月22日から平成28年12月20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15期		第16期	
	(平成27年12月21日現在)		(平成28年12月20日現在)	
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	790,633,233口		892,182,725口	
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額	1.5141円	1口当たり純資産額	1.5465円
	(10,000口当たりの純資産額)	15,141円	(10,000口当たりの純資産額)	15,465円

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第15期	第16期
	自 平成26年12月23日 至 平成27年12月21日	自 平成27年12月22日 至 平成28年12月20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(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。	計算期間末における費用控除後の配当等収益(0円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(36,563,065円)、収益調整金(459,108,212円)、および分配準備積立金(147,382,783円)より、分配対象収益は643,054,060円(1万口当たり7,207.62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16期
	自 平成27年12月22日 至 平成28年12月20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16期 自 平成27年12月22日 至 平成28年12月20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16期 (平成28年12月20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

第16期（自 平成27年12月22日 至 平成28年12月20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	41,440,999円
合計	41,440,999円

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

第16期 自 平成27年12月22日 至 平成28年12月20日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。

（その他の注記）

項 目	第15期 （平成27年12月21日現在）	第16期 （平成28年12月20日現在）
期首元本額	521,905,300円	790,633,233円
期中追加設定元本額	326,685,857円	162,461,354円
期中一部解約元本額	57,957,924円	60,911,862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）	240,252,752	363,358,262	
	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）	85,390,606	195,160,230	
	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＞	97,731,620	165,410,766	
	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＞	490,149,229	627,979,192	
	S M A M ・ マネーインカムファンド＜適格機関投資家限定＞	24,987,290	25,192,185	
合計		938,511,497	1,377,100,635	

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15期 （平成27年12月21日現在）	第16期 （平成28年12月20日現在）
資産の部		
流動資産		
金銭信託	-	317,543
コール・ローン	24,350,124	14,978,413
投資信託受益証券	1,819,415,613	2,071,027,567
未収入金	1,720,000	9,250,000
未収利息	6	-
流動資産合計	1,845,485,743	2,095,573,523
資産合計	1,845,485,743	2,095,573,523
負債の部		
流動負債		
未払金	1,200,000	4,500,000
未払解約金	1,971,860	9,871,375
未払受託者報酬	388,663	406,782
未払委託者報酬	4,372,394	4,576,241
未払利息	-	37
その他未払費用	29,086	30,556
流動負債合計	7,962,003	19,384,991
負債合計	7,962,003	19,384,991
純資産の部		
元本等		
元本	1,167,240,058	1,284,776,252
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	670,283,682	791,412,280
元本等合計	1,837,523,740	2,076,188,532
純資産合計	1,837,523,740	2,076,188,532
負債純資産合計	1,845,485,743	2,095,573,523

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第15期		第16期	
	自	平成26年12月23日 至 平成27年12月21日	自	平成27年12月22日 至 平成28年12月20日
営業収益				
受取利息		2,987		202
有価証券売買等損益		37,215,959		75,251,954
営業収益合計		37,218,946		75,252,156
営業費用				
支払利息		-		6,958
受託者報酬		681,444		792,508
委託者報酬		7,666,107		8,915,601
その他費用		50,986		61,286
営業費用合計		8,398,537		9,776,353
営業利益又は営業損失（ ）		28,820,409		65,475,803
経常利益又は経常損失（ ）		28,820,409		65,475,803
当期純利益又は当期純損失（ ）		28,820,409		65,475,803
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（ ）		7,212,233		9,604,398
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		202,810,825		670,283,682
剰余金増加額又は欠損金減少額		533,728,533		131,283,960
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		533,728,533		131,283,960
剰余金減少額又は欠損金増加額		87,863,852		85,235,563
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		87,863,852		85,235,563
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（ ）		670,283,682		791,412,280

（ 3 ）【注記表】

（ 重要な会計方針の注記 ）

項 目	第16期	
	自 平成27年12月22日 至 平成28年12月20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 当計算期間は前期末が休日のため、平成27年12月22日から平成28年12月20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15期		第16期	
	（平成27年12月21日現在）		（平成28年12月20日現在）	
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	1,167,240,058口		1,284,776,252口	
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額	1.5742円	1口当たり純資産額	1.6160円
	(10,000口当たりの純資産額)	15,742円	(10,000口当たりの純資産額)	16,160円

（ 損益及び剰余金計算書に関する注記 ）

項目	第15期	第16期
	自 平成26年12月23日 至 平成27年12月21日	自 平成27年12月22日 至 平成28年12月20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(2,114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。	計算期間末における費用控除後の配当等収益(0円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(75,086,623円)、収益調整金(845,719,589円)、および分配準備積立金(128,028,002円)より、分配対象収益は1,048,834,214円(1万口当たり8,163.54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16期
	自 平成27年12月22日 至 平成28年12月20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16期 自 平成27年12月22日 至 平成28年12月20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16期 (平成28年12月20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

第16期（自 平成27年12月22日 至 平成28年12月20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	76,642,340円
合計	76,642,340円

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

第16期 自 平成27年12月22日 至 平成28年12月20日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。

（その他の注記）

項 目	第15期 （平成27年12月21日現在）	第16期 （平成28年12月20日現在）
期首元本額	385,837,486円	1,167,240,058円
期中追加設定元本額	941,205,290円	268,656,486円
期中一部解約元本額	159,802,718円	151,120,292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）	571,714,125	864,660,442	
	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）	161,296,717	368,643,646	
	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＞	122,171,764	206,775,710	
	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＞	464,028,734	594,513,614	
	S M A M ・ マネーインカムファンド＜適格機関投資家限定＞	36,137,825	36,434,155	
合計		1,355,349,165	2,071,027,567	

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、「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）」、「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＞」、「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）」、「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＞」および「S M A M ・ 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。

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）

貸借対照表

(単位：円)

	(平成27年12月18日現在)	(平成28年12月19日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	-	1,645
コール・ローン	-	2,324
親投資信託受益証券	34,761,858,085	32,529,989,996
未収入金	-	247,759,995
流動資産合計	34,761,858,085	32,777,753,960
資産合計	34,761,858,085	32,777,753,960

(平成27年12月18日現在)

(平成28年12月19日現在)

負債の部		
流動負債		
未払解約金	-	247,759,995
未払受託者報酬	753,626	726,752
未払委託者報酬	659,417	635,901
その他未払費用	30,672	33,858
流動負債合計	1,443,715	249,156,506
負債合計	1,443,715	249,156,506
純資産の部		
元本等		
元本	23,646,117,924	21,507,908,809
剰余金		
剰余金又は欠損金()	11,114,296,446	11,020,688,645
元本等合計	34,760,414,370	32,528,597,454
純資産合計	34,760,414,370	32,528,597,454
負債純資産合計	34,761,858,085	32,777,753,960

注記表

(重要な会計方針の注記)

項目	自平成28年12月1日
	至平成28年12月19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27年12月18日現在)	(平成28年12月19日現在)
	1. 当計算期間の末日における受益権の総数	23,646,117,924口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 (10,000口当たりの純資産額)	1口当たり純資産額 (10,000口当たりの純資産額)
	1.4700円 14,700円)	1.5124円 15,124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28年12月 1日 至 平成28年12月19日
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2.金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<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28年12月19日現在)
1.貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1) 有価証券（親投資信託受益証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

自 平成28年12月 1日 至 平成28年12月19日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。

（その他の注記）

項目	(平成27年12月18日現在)	(平成28年12月19日現在)
期首元本額	23,955,799,828円	22,284,529,854円

期中追加設定元本額	3,620,186円	207,178円
期中一部解約元本額	313,302,090円	776,828,223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）	14,114,630,970	32,529,989,996	
合計		14,114,630,970	32,529,989,996	

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27年12月18日現在） （平成28年12月19日現在）

資産の部

流動資産

金銭信託

-

1,087,396,908

	（平成27年12月18日現在）	（平成28年12月19日現在）
コール・ローン	2,797,289,336	1,535,898,591
株式	214,240,794,730	211,313,924,930
派生商品評価勘定	2,070,160	81,998,920
未収入金	851,360	35,545,560
未収配当金	19,364,700	21,019,390
未収利息	766	-
前払金	7,440,000	-
流動資産合計	217,067,811,052	214,075,784,299
資産合計	217,067,811,052	214,075,784,299
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	9,701,320	88,640
前受金	-	82,055,000
未払金	51,430,000	10,990,000
未払解約金	93,592,122	628,285,493
未払利息	-	4,055
その他未払費用	-	25,245
流動負債合計	154,723,442	721,448,433
負債合計	154,723,442	721,448,433
純資産の部		
元本等		
元本	96,905,986,483	92,573,739,391
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	120,007,101,127	120,780,596,475
元本等合計	216,913,087,610	213,354,335,866
純資産合計	216,913,087,610	213,354,335,866
負債純資産合計	217,067,811,052	214,075,784,299

注記表

（重要な会計方針の注記）

項目	自 平成28年12月 1日 至 平成28年12月19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27年12月18日現在)	(平成28年12月19日現在)
1. 担保資産	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。 株式 3,829,000,000円	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。 株式 3,572,000,000円
2. 当計算期間の末日における受益権の総数	96,905,986,483口	92,573,739,391口
3. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 2.2384円 (10,000口当たりの純資産額 22,384円)	1口当たり純資産額 2.3047円 (10,000口当たりの純資産額 23,047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28年12月1日 至平成28年12月19日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<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。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28年12月19日現在)
1.貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。
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

（平成28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	1,992,409,720	-	2,074,320,000	81,910,280
	東証株価指数先物	1,992,409,720	-	2,074,320,000	81,910,280
合計		1,992,409,720	-	2,074,320,000	81,910,280

（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）

自 平成28年12月 1日

至 平成28年12月19日

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

（その他の注記）

（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
SMAM・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(TOPIX)	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
SMAM・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
SMAM・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
SMAM・バランスファンドVA25 <適格機関投資家専用>	7,058,035,025円
SMAM・バランスファンドVA37.5 <適格機関投資家専用>	3,716,619,363円
SMAM・バランスファンドVA50 <適格機関投資家専用>	13,875,729,303円
SMAM・バランスファンドVL30 <適格機関投資家限定>	77,363,005円
SMAM・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
SMAM・バランスファンドVA75 <適格機関投資家専用>	1,524,494,427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>	78,999,123円
SMAM・インデックス・バランスVA25 <適格機関投資家専用>	524,915,239円
SMAM・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
SMAM・バランスファンドVA40 <適格機関投資家専用>	2,703,796,162円
SMAM・バランスファンドVA35 <適格機関投資家専用>	4,874,911,467円
SMAM・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

S M A M ・ 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
S M A M ・ 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
S M A M ・ 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
S M A M ・ 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
S M A M ・ 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
S M A M ・ F G新興国重視型バランス20VA <適格機関投資家限定>	305,920円
S M A M ・ F Gグローバルバランス25VA <適格機関投資家限定>	2,473,721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>	310,886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>	210,636円
合計	96,905,986,483円

(平成28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	93,628,160,347円
同期中における追加設定元本額	594,206,888円
同期中における一部解約元本額	1,648,627,844円
平成28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	10,016,881,973円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	565,897,048円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	2,747,468,301円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	1,968,281,614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)	113,859,207円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2020	8,827,446円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2025	23,024,768円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2030	60,888,460円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2035	56,096,815円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2040	29,990,761円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2045	74,957,122円
国内株式指数ファンド(T O P I X)	1,886,369,801円
三井住友・DC日本株式インデックスファンドS	1,439,329,105円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	2,024,372,550円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	2,137,282,032円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	2,499,300,547円
イオン・バランス戦略ファンド	19,623,114円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2050	3,762,845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)	14,114,630,970円
バランスファンドVA(安定運用型) <適格機関投資家限定>	69,839,748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>	10,583,112,934円
S M A M ・ バランスファンドVA25 <適格機関投資家専用>	5,882,038,609円
S M A M ・ バランスファンドVA37.5 <適格機関投資家専用>	3,492,466,402円
S M A M ・ バランスファンドVA50 <適格機関投資家専用>	12,937,715,486円
S M A M ・ バランスファンドVL30 <適格機関投資家限定>	71,943,091円
S M A M ・ バランスファンドVL50 <適格機関投資家限定>	316,816,514円

世界6資産バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	13,050,902円
SMAM・バランスファンドVA75<適格機関投資家専用>	1,359,747,939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>	79,014,405円
SMAM・インデックス・バランスVA25<適格機関投資家専用>	510,341,880円
SMAM・インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用>	1,556,018,951円
SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用>	2,610,821,920円
SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>	4,542,663,088円
SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定>	118,317,004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)	2,240,447,439円
SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	102,877,758円
SMAM・バランスファンドVA20<適格機関投資家専用>	155,705,340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)	2,506,631,767円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>	146,094,154円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>	66,126,438円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用>	32,274,637円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>	311,008,543円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	512,133,608円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T<適格機関投資家専用>	239,050,332円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A2<適格機関投資家専用>	158,652,472円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A2<適格機関投資家専用>	76,692,388円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A2<適格機関投資家専用>	12,767,533円
SMAM・アセットバランスファンドVA30L2<適格機関投資家専用>	103,334,777円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L2<適格機関投資家専用>	1,365,080,816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)	252,774,769円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T2<適格機関投資家専用>	28,000,161円
SMAM・FG新興国重視型バランス20VA<適格機関投資家限定>	24,037円
SMAM・FGグローバルバランス25VA<適格機関投資家限定>	496,588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>	337,317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>	281,782円
SMAM・マルチアセットストラテジーファンド2016-04<適格機関投資家限定>	155,445,892円
SMAM・マルチアセットストラテジーファンド2016-05<適格機関投資家限定>	74,476,332円
SMAM・マルチアセットストラテジー・オープン<適格機関投資家限定>	98,271,159円
合計	92,573,739,391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	4,500	2,715.00	12,217,500	

日本水産	136,100	548.00	74,582,800
マルハニチロ	19,900	3,055.00	60,794,500
カネコ種苗	4,700	1,545.00	7,261,500
サカタのタネ	15,100	3,255.00	49,150,500
ホクト	10,300	2,134.00	21,980,200
日鉄鉱業	3,000	5,680.00	17,040,000
三井松島産業	7,400	1,356.00	10,034,400
国際石油開発帝石	551,300	1,231.50	678,925,950
日本海洋掘削	4,100	2,568.00	10,528,800
石油資源開発	17,000	2,731.00	46,427,000
K&Oエナジーグループ	7,100	1,894.00	13,447,400
ショーボンドホールディングス	10,600	5,000.00	53,000,000
ミライト・ホールディングス	32,000	1,064.00	34,048,000
タマホーム	12,200	542.00	6,612,400
ダイセキ環境ソリューション	3,500	1,411.00	4,938,500
安藤・間	74,600	769.00	57,367,400
東急建設	36,800	928.00	34,150,400
コムシスホールディングス	40,700	2,119.00	86,243,300
ミサワホーム	13,500	1,030.00	13,905,000
高松コンストラクショングループ	7,300	2,478.00	18,089,400
東建コーポレーション	4,200	8,580.00	36,036,000
大成建設	530,000	840.00	445,200,000
大林組	312,600	1,127.00	352,300,200
清水建設	319,000	1,094.00	348,986,000
飛鳥建設	103,600	194.00	20,098,400
長谷工コーポレーション	122,000	1,193.00	145,546,000
松井建設	12,600	1,071.00	13,494,600
銭高組	18,000	515.00	9,270,000
鹿島建設	459,000	822.00	377,298,000
不動テトラ	88,700	210.00	18,627,000
鉄建建設	64,000	349.00	22,336,000
西松建設	122,000	574.00	70,028,000
三井住友建設	401,900	127.00	51,041,300
大豊建設	38,000	576.00	21,888,000
前田建設工業	65,000	1,057.00	68,705,000
ナカノフドー建設	10,300	620.00	6,386,000
奥村組	86,000	665.00	57,190,000
東鉄工業	12,200	2,933.00	35,782,600
イチケン	11,000	419.00	4,609,000
浅沼組	37,000	386.00	14,282,000
戸田建設	121,000	636.00	76,956,000
熊谷組	163,000	304.00	49,552,000

青木あすなる建設	8,700	779.00	6,777,300
北野建設	28,000	319.00	8,932,000
三井ホーム	17,000	488.00	8,296,000
矢作建設工業	14,800	1,054.00	15,599,200
日本ハウスホールディングス	25,800	498.00	12,848,400
大東建託	38,600	17,410.00	672,026,000
新日本建設	13,200	943.00	12,447,600
N I P P O	23,000	2,190.00	50,370,000
東亜道路工業	26,000	342.00	8,892,000
前田道路	33,000	1,932.00	63,756,000
日本道路	31,000	473.00	14,663,000
東亜建設工業	8,800	1,955.00	17,204,000
若築建設	73,000	156.00	11,388,000
東洋建設	33,800	413.00	13,959,400
五洋建設	117,400	574.00	67,387,600
大林道路	12,500	729.00	9,112,500
世紀東急工業	17,900	504.00	9,021,600
福田組	17,000	1,186.00	20,162,000
住友林業	72,000	1,587.00	114,264,000
日成ビルド工業	32,000	519.00	16,608,000
ヤマダ・エスバイエルホーム	83,000	80.00	6,640,000
巴コーポレーション	20,200	359.00	7,251,800
パナホーム	38,000	855.00	32,490,000
大和ハウス工業	309,000	3,292.00	1,017,228,000
ライト工業	20,100	1,236.00	24,843,600
積水ハウス	329,400	1,924.50	633,930,300
日特建設	12,500	474.00	5,925,000
北陸電気工事	6,100	869.00	5,300,900
ユアテック	17,000	818.00	13,906,000
中電工	12,400	2,553.00	31,657,200
関電工	41,000	1,059.00	43,419,000
きんでん	69,400	1,490.00	103,406,000
東京エネシス	12,000	1,035.00	12,420,000
トーエネック	17,000	580.00	9,860,000
住友電設	8,100	1,281.00	10,376,100
日本電設工業	16,700	1,922.00	32,097,400
協和エクシオ	41,500	1,702.00	70,633,000
新日本空調	9,100	1,268.00	11,538,800
N D S	2,600	2,851.00	7,412,600
九電工	20,300	3,030.00	61,509,000
三機工業	23,200	965.00	22,388,000
日揮	97,700	2,196.00	214,549,200

中外炉工業	40,000	220.00	8,800,000
ヤマト	12,400	581.00	7,204,400
太平電業	15,000	1,135.00	17,025,000
高砂熱学工業	28,200	1,545.00	43,569,000
朝日工業社	3,000	2,948.00	8,844,000
明星工業	20,800	570.00	11,856,000
大気社	13,700	2,850.00	39,045,000
ダイダン	15,000	971.00	14,565,000
日比谷総合設備	11,500	1,651.00	18,986,500
東芝プラントシステム	16,900	1,683.00	28,442,700
OSJBホールディングス	38,500	246.00	9,471,000
東洋エンジニアリング	63,000	307.00	19,341,000
千代田化工建設	76,000	857.00	65,132,000
新興プランテック	22,000	859.00	18,898,000
日本製粉	30,200	1,618.00	48,863,600
日清製粉グループ本社	114,100	1,734.00	197,849,400
日東富士製粉	1,400	3,780.00	5,292,000
昭和産業	42,000	604.00	25,368,000
鳥越製粉	11,900	836.00	9,948,400
中部飼料	12,400	1,003.00	12,437,200
フィード・ワン	77,600	150.00	11,640,000
日本甜菜製糖	6,200	2,389.00	14,811,800
三井製糖	7,300	2,502.00	18,264,600
日新製糖	5,300	1,644.00	8,713,200
森永製菓	20,500	4,765.00	97,682,500
中村屋	3,000	4,795.00	14,385,000
江崎グリコ	26,200	5,300.00	138,860,000
名糖産業	6,600	1,383.00	9,127,800
不二家	72,000	227.00	16,344,000
山崎製パン	76,800	2,293.00	176,102,400
モロゾフ	21,000	483.00	10,143,000
亀田製菓	5,800	5,200.00	30,160,000
寿スピリッツ	7,500	2,746.00	20,595,000
カルビー	42,800	3,710.00	158,788,000
森永乳業	95,000	792.00	75,240,000
六甲バター	4,900	2,483.00	12,166,700
ヤクルト本社	56,200	5,400.00	303,480,000
明治ホールディングス	61,800	9,040.00	558,672,000
雪印メグミルク	22,800	3,130.00	71,364,000
プリマハム	65,000	401.00	26,065,000
日本ハム	71,000	3,120.00	221,520,000
丸大食品	49,000	481.00	23,569,000

S Foods	5,500	2,889.00	15,889,500
伊藤ハム米久ホールディングス	57,500	1,026.00	58,995,000
サッポロホールディングス	34,400	3,010.00	103,544,000
アサヒグループホールディングス	196,500	3,515.00	690,697,500
キリンホールディングス	451,000	1,932.00	871,332,000
宝ホールディングス	76,200	1,038.00	79,095,600
オエノンホールディングス	36,000	272.00	9,792,000
養命酒製造	4,500	1,851.00	8,329,500
コカ・コーラウエスト	35,200	3,415.00	120,208,000
コカ・コーライーストジャパン	40,700	2,540.00	103,378,000
サントリー食品インターナショナル	71,500	4,900.00	350,350,000
ダイドードリンコ	4,700	5,770.00	27,119,000
伊藤園	31,200	3,710.00	115,752,000
キーコーヒー	8,800	2,159.00	18,999,200
日清オイリオグループ	59,000	523.00	30,857,000
不二製油グループ本社	28,300	2,250.00	63,675,000
J・オイルミルズ	4,800	3,760.00	18,048,000
キッコーマン	73,000	3,735.00	272,655,000
味の素	215,900	2,430.00	524,637,000
キューピー	53,500	2,730.00	146,055,000
ハウス食品グループ本社	38,600	2,384.00	92,022,400
カゴメ	37,800	2,875.00	108,675,000
焼津水産化学工業	7,100	1,080.00	7,668,000
アリアケジャパン	8,400	6,140.00	51,576,000
ニチレイ	51,500	2,371.00	122,106,500
東洋水産	51,300	4,155.00	213,151,500
日清食品ホールディングス	40,800	6,050.00	246,840,000
永谷園ホールディングス	11,000	1,339.00	14,729,000
一正蒲鉾	5,300	1,126.00	5,967,800
フジッコ	10,100	2,346.00	23,694,600
ロック・フィールド	10,900	1,534.00	16,720,600
日本たばこ産業	580,200	3,926.00	2,277,865,200
ケンコーマヨネーズ	4,000	3,225.00	12,900,000
わらべや日洋ホールディングス	6,300	2,461.00	15,504,300
なとり	6,500	1,827.00	11,875,500
ユーグレナ	33,700	1,283.00	43,237,100
ミヨシ油脂	51,000	149.00	7,599,000
理研ビタミン	3,200	4,685.00	14,992,000
片倉工業	13,300	1,417.00	18,846,100
ゲンゼ	72,000	377.00	27,144,000
東洋紡	395,000	176.00	69,520,000
ユニチカ	276,000	84.00	23,184,000

富士紡ホールディングス	5,100	3,240.00	16,524,000
倉敷紡績	100,000	231.00	23,100,000
シキボウ	71,000	138.00	9,798,000
日本毛織	27,900	858.00	23,938,200
帝国繊維	10,600	1,664.00	17,638,400
帝人	80,100	2,369.00	189,756,900
東レ	710,000	957.20	679,612,000
サカイオーベックス	3,700	1,787.00	6,611,900
住江織物	32,000	251.00	8,032,000
アツギ	102,000	126.00	12,852,000
ダイニック	35,000	178.00	6,230,000
セーレン	24,600	1,486.00	36,555,600
小松精練	16,600	740.00	12,284,000
ワコールホールディングス	59,000	1,382.00	81,538,000
ホギメディカル	6,200	7,000.00	43,400,000
レナウン	44,600	113.00	5,039,800
T S Iホールディングス	40,500	712.00	28,836,000
三陽商会	63,000	176.00	11,088,000
オンワードホールディングス	65,000	824.00	53,560,000
ルック	31,000	177.00	5,487,000
ゴールドウイン	4,300	5,370.00	23,091,000
デサント	22,600	1,367.00	30,894,200
特種東海製紙	5,600	3,960.00	22,176,000
王子ホールディングス	379,000	501.00	189,879,000
日本製紙	43,500	2,071.00	90,088,500
三菱製紙	16,200	773.00	12,522,600
北越紀州製紙	55,700	682.00	37,987,400
中越パルプ工業	43,000	243.00	10,449,000
巴川製紙所	19,000	229.00	4,351,000
大王製紙	38,100	1,288.00	49,072,800
レンゴー	95,100	659.00	62,670,900
トモク	35,000	330.00	11,550,000
ザ・パック	6,700	2,695.00	18,056,500
クラレ	163,800	1,766.00	289,270,800
旭化成	611,000	1,047.00	639,717,000
共和レザー	7,900	838.00	6,620,200
昭和電工	65,400	1,756.00	114,842,400
住友化学	718,000	587.00	421,466,000
住友精化	4,100	4,460.00	18,286,000
日産化学工業	53,400	3,970.00	211,998,000
ラサ工業	51,000	139.00	7,089,000
クレハ	7,400	4,590.00	33,966,000

テイカ	17,000	667.00	11,339,000
石原産業	18,300	983.00	17,988,900
日東エフシー	7,000	905.00	6,335,000
日本曹達	59,000	540.00	31,860,000
東ソー	283,000	855.00	241,965,000
トクヤマ	154,000	465.00	71,610,000
セントラル硝子	103,000	537.00	55,311,000
東亜合成	62,000	1,140.00	70,680,000
大阪ソーダ	42,000	480.00	20,160,000
関東電化工業	21,000	1,037.00	21,777,000
デンカ	203,000	530.00	107,590,000
信越化学工業	175,400	9,169.00	1,608,242,600
日本カーバイド工業	42,000	159.00	6,678,000
堺化学工業	36,000	389.00	14,004,000
エア・ウォーター	80,100	2,114.00	169,331,400
大陽日酸	75,200	1,391.00	104,603,200
日本化学工業	41,000	244.00	10,004,000
日本パーカライズン	49,800	1,420.00	70,716,000
高压ガス工業	15,700	759.00	11,916,300
四国化成工業	14,000	1,055.00	14,770,000
戸田工業	27,000	289.00	7,803,000
ステラ ケミファ	4,900	2,968.00	14,543,200
保土谷化学工業	3,800	2,710.00	10,298,000
日本触媒	15,400	7,370.00	113,498,000
大日精化工業	40,000	639.00	25,560,000
カネカ	132,000	988.00	130,416,000
三菱瓦斯化学	91,100	1,999.00	182,108,900
三井化学	444,000	548.00	243,312,000
J S R	98,300	1,816.00	178,512,800
東京応化工業	18,500	3,790.00	70,115,000
大阪有機化学工業	8,400	1,008.00	8,467,200
三菱ケミカルホールディングス	656,600	791.10	519,436,260
K Hネオケム	12,600	1,251.00	15,762,600
ダイセル	132,200	1,335.00	176,487,000
住友ベークライト	88,000	664.00	58,432,000
積水化学工業	221,100	1,815.00	401,296,500
日本ゼオン	83,000	1,130.00	93,790,000
アイカ工業	31,400	3,085.00	96,869,000
宇部興産	494,000	248.00	122,512,000
積水樹脂	14,800	1,868.00	27,646,400
タキロン	23,000	518.00	11,914,000
旭有機材	39,000	222.00	8,658,000

日立化成	54,200	2,906.00	157,505,200
ニチバン	11,000	823.00	9,053,000
リケンテクノス	22,400	546.00	12,230,400
大倉工業	26,000	493.00	12,818,000
積水化成成品工業	15,200	826.00	12,555,200
群栄化学工業	2,700	3,240.00	8,748,000
ダイキョーニシカワ	17,300	1,514.00	26,192,200
日本化薬	64,000	1,433.00	91,712,000
カーリットホールディングス	12,100	560.00	6,776,000
日本精化	10,800	897.00	9,687,600
扶桑化学工業	7,000	2,419.00	16,933,000
A D E K A	42,300	1,666.00	70,471,800
日油	79,000	1,090.00	86,110,000
花王	248,600	5,616.00	1,396,137,600
第一工業製薬	27,000	370.00	9,990,000
三洋化成工業	5,900	5,050.00	29,795,000
大日本塗料	61,000	225.00	13,725,000
日本ペイントホールディングス	75,300	3,190.00	240,207,000
関西ペイント	102,500	2,135.00	218,837,500
中国塗料	28,700	871.00	24,997,700
日本特殊塗料	7,600	1,689.00	12,836,400
藤倉化成	16,500	660.00	10,890,000
太陽ホールディングス	7,900	4,640.00	36,656,000
D I C	38,600	3,685.00	142,241,000
サカタインクス	19,500	1,466.00	28,587,000
東洋インキS Cホールディングス	93,000	540.00	50,220,000
T & K T O K A	8,200	1,007.00	8,257,400
富士フイルムホールディングス	193,900	4,477.00	868,090,300
資生堂	185,900	2,991.00	556,026,900
ライオン	121,000	1,869.00	226,149,000
高砂香料工業	6,500	3,085.00	20,052,500
マンダム	9,600	4,985.00	47,856,000
ミルボン	5,300	4,425.00	23,452,500
ファンケル	20,700	1,633.00	33,803,100
コーセー	15,800	9,920.00	156,736,000
シーズ・ホールディングス	12,700	3,345.00	42,481,500
ポーラ・オルビスホールディングス	10,000	9,520.00	95,200,000
ノエビアホールディングス	5,800	3,625.00	21,025,000
エステー	7,900	1,503.00	11,873,700
コニシ	15,200	1,267.00	19,258,400
長谷川香料	12,000	1,998.00	23,976,000
星光P M C	6,000	1,198.00	7,188,000

小林製薬	27,100	5,090.00	137,939,000
荒川化学工業	8,900	1,786.00	15,895,400
メック	8,600	923.00	7,937,800
日本高純度化学	3,700	2,454.00	9,079,800
タカラバイオ	20,900	1,460.00	30,514,000
JCU	3,100	5,330.00	16,523,000
新田ゼラチン	8,800	720.00	6,336,000
デクセリアルズ	25,700	1,046.00	26,882,200
アース製薬	6,800	4,850.00	32,980,000
イハラケミカル工業	13,900	1,166.00	16,207,400
北興化学工業	16,000	460.00	7,360,000
大成ラミック	3,700	3,085.00	11,414,500
クミアイ化学工業	21,200	730.00	15,476,000
日本農薬	23,200	661.00	15,335,200
アキレス	8,800	1,640.00	14,432,000
有沢製作所	18,500	658.00	12,173,000
日東電工	70,600	9,127.00	644,366,200
レック	3,400	3,560.00	12,104,000
きもと	21,700	253.00	5,490,100
藤森工業	7,200	2,996.00	21,571,200
前澤化成工業	7,700	1,172.00	9,024,400
JSP	4,700	2,787.00	13,098,900
エフピコ	8,500	5,350.00	45,475,000
天馬	6,700	2,019.00	13,527,300
信越ポリマー	19,000	867.00	16,473,000
東リ	27,100	376.00	10,189,600
ニフコ	17,200	6,200.00	106,640,000
日本バルカー工業	9,100	1,536.00	13,977,600
ユニ・チャーム	198,400	2,559.00	507,705,600
協和発酵キリン	116,600	1,627.00	189,708,200
武田薬品工業	366,600	4,820.00	1,767,012,000
アステラス製薬	999,600	1,630.50	1,629,847,800
大日本住友製薬	69,000	1,947.00	134,343,000
塩野義製薬	132,400	5,243.00	694,173,200
田辺三菱製薬	113,600	2,269.00	257,758,400
あすか製薬	10,900	1,650.00	17,985,000
日本新薬	22,500	5,660.00	127,350,000
中外製薬	96,900	3,315.00	321,223,500
科研製薬	18,400	6,240.00	114,816,000
エーザイ	120,500	6,764.00	815,062,000
ロート製薬	48,200	1,799.00	86,711,800
小野薬品工業	222,600	2,496.50	555,720,900

久光製薬	27,700	5,630.00	155,951,000
持田製薬	6,800	8,030.00	54,604,000
参天製薬	180,100	1,400.00	252,140,000
扶桑薬品工業	4,100	2,779.00	11,393,900
日本ケミファ	1,800	5,440.00	9,792,000
ツムラ	33,200	3,200.00	106,240,000
日医工	23,600	1,713.00	40,426,800
キッセイ薬品工業	17,600	2,837.00	49,931,200
生化学工業	18,400	1,685.00	31,004,000
栄研化学	8,400	2,950.00	24,780,000
鳥居薬品	6,600	2,550.00	16,830,000
JCRファーマ	7,700	2,658.00	20,466,600
東和薬品	4,600	4,515.00	20,769,000
富士製薬工業	3,800	2,656.00	10,092,800
沢井製薬	16,800	6,140.00	103,152,000
ゼリア新薬工業	20,200	1,838.00	37,127,600
第一三共	288,100	2,410.50	694,465,050
キョーリン製薬ホールディングス	24,000	2,482.00	59,568,000
大幸薬品	5,500	1,815.00	9,982,500
ダイト	6,300	2,199.00	13,853,700
大塚ホールディングス	210,300	5,008.00	1,053,182,400
大正製薬ホールディングス	20,800	9,750.00	202,800,000
ペプチドリーム	16,800	5,660.00	95,088,000
日本コークス工業	97,300	110.00	10,703,000
昭和シェル石油	87,800	1,147.00	100,706,600
ニチレキ	13,200	914.00	12,064,800
東燃ゼネラル石油	160,000	1,265.00	202,400,000
ユシロ化学工業	6,800	1,450.00	9,860,000
ビーピー・カストロール	5,300	1,519.00	8,050,700
MORESCO	4,700	1,606.00	7,548,200
出光興産	46,600	3,165.00	147,489,000
JXホールディングス	1,084,000	503.40	545,685,600
コスモエネルギーホールディングス	28,700	1,702.00	48,847,400
横浜ゴム	59,200	2,190.00	129,648,000
東洋ゴム工業	52,200	1,593.00	83,154,600
ブリヂストン	330,000	4,415.00	1,456,950,000
住友ゴム工業	91,500	1,943.00	177,784,500
藤倉ゴム工業	10,400	692.00	7,196,800
オカモト	30,000	1,047.00	31,410,000
ニッタ	8,900	3,200.00	28,480,000
住友理工	18,400	1,147.00	21,104,800
三ツ星ベルト	24,000	1,002.00	24,048,000

バンドー化学	18,200	1,050.00	19,110,000
日東紡績	80,000	473.00	37,840,000
旭硝子	481,000	842.00	405,002,000
日本板硝子	32,700	900.00	29,430,000
日本山村硝子	53,000	206.00	10,918,000
日本電気硝子	204,000	663.00	135,252,000
住友大阪セメント	184,000	423.00	77,832,000
太平洋セメント	592,000	368.00	217,856,000
日本ヒューム	12,000	720.00	8,640,000
日本コンクリート工業	26,400	356.00	9,398,400
三谷セキサン	5,500	2,980.00	16,390,000
アジアパイルホールディングス	15,600	544.00	8,486,400
東海カーボン	91,000	391.00	35,581,000
日本カーボン	53,000	246.00	13,038,000
東洋炭素	6,300	1,914.00	12,058,200
ノリタケカンパニーリミテド	5,800	2,742.00	15,903,600
TOTO	71,700	4,640.00	332,688,000
日本碍子	123,600	2,361.00	291,819,600
日本特殊陶業	84,400	2,762.00	233,112,800
MARUWA	3,900	3,975.00	15,502,500
品川リフラクトリーズ	33,000	249.00	8,217,000
黒崎播磨	26,000	317.00	8,242,000
ニッカトー	10,200	412.00	4,202,400
フジインコーポレーテッド	8,600	2,189.00	18,825,400
ニチアス	51,000	1,109.00	56,559,000
ニチハ	13,300	2,848.00	37,878,400
新日鐵住金	441,500	2,703.00	1,193,374,500
神戸製鋼所	168,800	1,215.00	205,092,000
中山製鋼所	12,400	761.00	9,436,400
合同製鐵	5,900	2,182.00	12,873,800
ジェイ エフ イー ホールディングス	267,500	1,872.00	500,760,000
日新製鋼	44,900	1,479.00	66,407,100
東京製鐵	49,600	881.00	43,697,600
共英製鋼	10,400	2,123.00	22,079,200
大和工業	19,700	3,300.00	65,010,000
東京鐵鋼	23,000	484.00	11,132,000
大阪製鐵	6,400	2,066.00	13,222,400
淀川製鋼所	13,100	3,145.00	41,199,500
東洋鋼鈹	25,900	392.00	10,152,800
丸一鋼管	32,500	3,715.00	120,737,500
モリ工業	3,900	2,001.00	7,803,900
大同特殊鋼	165,000	502.00	82,830,000

日本冶金工業	82,400	203.00	16,727,200
山陽特殊製鋼	59,000	566.00	33,394,000
愛知製鋼	5,700	5,200.00	29,640,000
日立金属	99,400	1,599.00	158,940,600
大太平洋金属	63,000	396.00	24,948,000
新日本電工	59,800	254.00	15,189,200
栗本鐵工所	5,300	2,407.00	12,757,100
虹技	21,000	261.00	5,481,000
三菱製鋼	69,000	235.00	16,215,000
日亜鋼業	21,700	293.00	6,358,100
シンニッタン	10,800	671.00	7,246,800
大紀アルミニウム工業所	20,000	528.00	10,560,000
日本軽金属ホールディングス	224,800	252.00	56,649,600
三井金属鉱業	272,000	314.00	85,408,000
東邦亜鉛	58,000	475.00	27,550,000
三菱マテリアル	61,000	3,710.00	226,310,000
住友金属鉱山	254,000	1,537.00	390,398,000
D O W Aホールディングス	109,000	916.00	99,844,000
古河機械金属	153,000	223.00	34,119,000
大阪チタニウムテクノロジーズ	11,300	1,666.00	18,825,800
東邦チタニウム	18,700	818.00	15,296,600
U A C J	125,000	312.00	39,000,000
古河電気工業	33,000	3,345.00	110,385,000
住友電気工業	369,200	1,689.00	623,578,800
フジクラ	130,200	636.00	82,807,200
タツタ電線	20,700	467.00	9,666,900
平河ヒューテック	5,900	1,249.00	7,369,100
リョービ	61,000	489.00	29,829,000
アーレスティ	12,500	1,248.00	15,600,000
アサヒホールディングス	14,900	2,075.00	30,917,500
稲葉製作所	6,600	1,325.00	8,745,000
宮地エンジニアリンググループ	37,000	191.00	7,067,000
トーカロ	7,000	2,630.00	18,410,000
S U M C O	102,700	1,560.00	160,212,000
川田テクノロジーズ	2,200	6,900.00	15,180,000
東洋製罐グループホールディングス	69,300	2,222.00	153,984,600
ホッカンホールディングス	31,000	434.00	13,454,000
コロナ	7,300	1,162.00	8,482,600
横河ブリッジホールディングス	17,700	1,352.00	23,930,400
駒井ハルテック	3,200	2,194.00	7,020,800
三和ホールディングス	97,200	1,118.00	108,669,600
文化シャッター	27,600	926.00	25,557,600

三協立山	13,000	1,681.00	21,853,000
アルインコ	8,900	1,038.00	9,238,200
LIXILグループ	136,200	2,686.00	365,833,200
日本フィルコン	9,600	595.00	5,712,000
ノーリツ	19,100	2,060.00	39,346,000
長府製作所	10,400	2,734.00	28,433,600
リンナイ	16,600	9,400.00	156,040,000
日東精工	20,000	427.00	8,540,000
岡部	21,000	1,004.00	21,084,000
ジーテクト	10,200	2,361.00	24,082,200
東プレ	18,600	2,962.00	55,093,200
高周波熱錬	19,000	900.00	17,100,000
東京製綱	7,400	2,043.00	15,118,200
パイオラックス	4,900	7,530.00	36,897,000
日本発條	93,000	1,085.00	100,905,000
三益半導体工業	8,500	1,620.00	13,770,000
日本製鋼所	32,800	2,092.00	68,617,600
三浦工業	40,500	1,784.00	72,252,000
タクマ	31,000	916.00	28,396,000
ツガミ	28,000	702.00	19,656,000
オークマ	64,000	1,147.00	73,408,000
東芝機械	58,000	475.00	27,550,000
アマダホールディングス	131,100	1,318.00	172,789,800
アイダエンジニアリング	27,700	1,090.00	30,193,000
滝澤鉄工所	43,000	165.00	7,095,000
富士機械製造	29,400	1,368.00	40,219,200
牧野フライス製作所	48,000	962.00	46,176,000
オーエスジー	44,800	2,357.00	105,593,600
旭ダイヤモンド工業	28,500	878.00	25,023,000
D M G 森精機	58,200	1,540.00	89,628,000
ソディック	25,300	982.00	24,844,600
ディスコ	11,400	13,420.00	152,988,000
日東工器	5,800	2,493.00	14,459,400
O K K	54,000	119.00	6,426,000
津田駒工業	32,000	169.00	5,408,000
島精機製作所	12,800	3,840.00	49,152,000
フリーー	2,400	3,310.00	7,944,000
日阪製作所	15,300	894.00	13,678,200
やまびこ	17,800	1,421.00	25,293,800
ペガサスミシン製造	11,300	710.00	8,023,000
ナブテスコ	50,900	2,788.00	141,909,200
三井海洋開発	10,000	1,927.00	19,270,000

レオン自動機	9,100	888.00	8,080,800
S M C	29,300	28,375.00	831,387,500
新川	10,100	769.00	7,766,900
ホソカワミクロン	19,000	774.00	14,706,000
ユニオンツール	4,200	2,982.00	12,524,400
オイレス工業	12,600	2,097.00	26,422,200
日精エー・エス・ビー機械	3,500	2,444.00	8,554,000
サトーホールディングス	12,300	2,475.00	30,442,500
日精樹脂工業	8,500	1,015.00	8,627,500
ワイエイシイ	4,500	1,204.00	5,418,000
小松製作所	451,400	2,649.50	1,195,984,300
住友重機械工業	285,000	756.00	215,460,000
日立建機	43,600	2,513.00	109,566,800
日工	4,000	2,092.00	8,368,000
巴工業	5,500	1,577.00	8,673,500
井関農機	102,000	233.00	23,766,000
T O W A	8,800	1,368.00	12,038,400
丸山製作所	34,000	191.00	6,494,000
北川鉄工所	5,200	2,348.00	12,209,600
ローツェ	3,700	1,679.00	6,212,300
クボタ	469,400	1,725.50	809,949,700
三菱化工機	38,000	223.00	8,474,000
月島機械	18,100	1,258.00	22,769,800
帝国電機製作所	9,000	972.00	8,748,000
新東工業	22,500	1,049.00	23,602,500
澁谷工業	8,300	2,412.00	20,019,600
アイチ コーポレーション	14,900	865.00	12,888,500
小森コーポレーション	23,300	1,541.00	35,905,300
鶴見製作所	7,800	1,745.00	13,611,000
住友精密工業	22,000	366.00	8,052,000
荏原製作所	40,700	3,205.00	130,443,500
西島製作所	11,000	1,117.00	12,287,000
北越工業	12,400	798.00	9,895,200
ダイキン工業	127,400	10,700.00	1,363,180,000
オルガノ	22,000	466.00	10,252,000
トーヨーカネツ	46,000	315.00	14,490,000
栗田工業	55,300	2,470.00	136,591,000
椿本チエイン	55,000	980.00	53,900,000
大同工業	28,000	250.00	7,000,000
アネスト岩田	17,300	1,142.00	19,756,600
ダイフク	46,700	2,341.00	109,324,700
加藤製作所	5,200	2,973.00	15,459,600

タダノ	49,500	1,573.00	77,863,500
フジテック	27,000	1,336.00	36,072,000
C K D	28,000	1,444.00	40,432,000
キトー	13,300	1,247.00	16,585,100
平和	28,200	2,640.00	74,448,000
理想科学工業	9,200	1,984.00	18,252,800
S A N K Y O	25,900	3,800.00	98,420,000
日本金銭機械	9,200	1,425.00	13,110,000
マースエンジニアリング	5,800	2,219.00	12,870,200
福島工業	5,700	3,220.00	18,354,000
ダイコク電機	4,500	1,789.00	8,050,500
竹内製作所	17,000	2,670.00	45,390,000
アマノ	28,500	2,049.00	58,396,500
J U K I	15,800	1,114.00	17,601,200
サンデンホールディングス	58,000	387.00	22,446,000
蛇の目マシン工業	10,600	849.00	8,999,400
マックス	14,000	1,450.00	20,300,000
グローリー	30,000	3,725.00	111,750,000
新晃工業	7,300	1,379.00	10,066,700
大和冷機工業	15,600	912.00	14,227,200
セガサミーホールディングス	92,900	1,785.00	165,826,500
日本ピストンリング	4,800	2,092.00	10,041,600
リケン	4,400	4,495.00	19,778,000
T P R	10,400	3,450.00	35,880,000
ツバキ・ナカシマ	10,900	1,743.00	18,998,700
ホシザキ	20,400	8,850.00	180,540,000
大豊工業	7,900	1,693.00	13,374,700
日本精工	191,600	1,410.00	270,156,000
N T N	217,000	511.00	110,887,000
ジェイテクト	99,300	1,942.00	192,840,600
不二越	97,000	519.00	50,343,000
日本トムソン	32,100	513.00	16,467,300
T H K	66,100	2,620.00	173,182,000
ユーシン精機	4,500	2,705.00	12,172,500
前澤給装工業	5,100	1,513.00	7,716,300
イーグル工業	10,200	1,601.00	16,330,200
日本ピラー工業	10,600	1,225.00	12,985,000
キッツ	44,800	674.00	30,195,200
日立工機	24,600	1,229.00	30,233,400
マキタ	60,800	7,740.00	470,592,000
日立造船	75,500	622.00	46,961,000
三菱重工業	1,566,000	550.80	862,552,800

I H I	719,000	324.00	232,956,000
スター精密	16,400	1,607.00	26,354,800
日清紡ホールディングス	52,200	1,163.00	60,708,600
イビデン	65,600	1,685.00	110,536,000
コニカミノルタ	218,100	1,161.00	253,214,100
ブラザー工業	120,900	2,129.00	257,396,100
ミネベア	151,100	1,198.00	181,017,800
日立製作所	2,243,000	651.20	1,460,641,600
東芝	2,090,000	463.10	967,879,000
三菱電機	996,100	1,656.00	1,649,541,600
富士電機	282,000	606.00	170,892,000
東洋電機製造	5,000	1,626.00	8,130,000
安川電機	108,100	1,837.00	198,579,700
シンフォニアテクノロジー	64,000	274.00	17,536,000
明電舎	87,000	399.00	34,713,000
オリジン電気	23,000	314.00	7,222,000
山洋電気	25,000	841.00	21,025,000
デンヨー	9,600	1,609.00	15,446,400
東芝テック	59,000	572.00	33,748,000
芝浦メカトロニクス	21,000	266.00	5,586,000
マブチモーター	26,300	6,330.00	166,479,000
日本電産	121,100	10,025.00	1,214,027,500
東光高岳	5,200	2,054.00	10,680,800
ダブル・スコープ	9,300	1,598.00	14,861,400
ダイヘン	51,000	736.00	37,536,000
田淵電機	15,800	416.00	6,572,800
ヤーマン	1,400	4,720.00	6,608,000
JVCケンウッド	70,400	321.00	22,598,400
ミマキエンジニアリング	10,100	711.00	7,181,100
第一精工	5,200	1,423.00	7,399,600
日新電機	19,100	1,229.00	23,473,900
大崎電気工業	19,000	1,203.00	22,857,000
オムロン	99,100	4,600.00	455,860,000
日東工業	13,600	1,657.00	22,535,200
I D E C	13,800	1,117.00	15,414,600
ジーエス・ユアサ コーポレーション	178,000	493.00	87,754,000
サクサホールディングス	30,000	220.00	6,600,000
メルコホールディングス	5,400	3,195.00	17,253,000
テクノメディカ	2,800	1,921.00	5,378,800
日本電気	1,284,000	321.00	412,164,000
富士通	900,000	688.90	620,010,000
沖電気工業	40,300	1,681.00	67,744,300

電気興業	27,000	579.00	15,633,000
サンケン電気	56,000	565.00	31,640,000
アイホン	6,000	1,927.00	11,562,000
ルネサスエレクトロニクス	47,900	1,005.00	48,139,500
セイコーエプソン	138,800	2,445.00	339,366,000
ワコム	74,400	310.00	23,064,000
アルバック	17,200	3,510.00	60,372,000
E I Z O	9,200	3,525.00	32,430,000
ジャパンディスプレイ	151,200	343.00	51,861,600
日本信号	26,200	959.00	25,125,800
京三製作所	28,000	390.00	10,920,000
能美防災	10,400	1,733.00	18,023,200
ホーチキ	7,700	1,360.00	10,472,000
エレコム	8,400	1,949.00	16,371,600
日本無線	6,200	1,354.00	8,394,800
パナソニック	1,067,400	1,281.00	1,367,339,400
アンリツ	69,000	637.00	43,953,000
富士通ゼネラル	32,000	2,298.00	73,536,000
日立国際電気	24,300	2,360.00	57,348,000
ソニー	659,700	3,381.00	2,230,445,700
T D K	52,600	8,350.00	439,210,000
ミツミ電機	36,300	703.00	25,518,900
タムラ製作所	37,000	451.00	16,687,000
アルプス電気	86,300	2,918.00	251,823,400
池上通信機	42,000	153.00	6,426,000
パイオニア	141,800	252.00	35,733,600
日本電波工業	12,100	901.00	10,902,100
日本トリム	2,500	4,380.00	10,950,000
ローランド ディー . ジー .	5,100	3,125.00	15,937,500
フォスター電機	11,100	2,245.00	24,919,500
クラリオン	50,000	420.00	21,000,000
S M K	26,000	444.00	11,544,000
ヨコオ	8,600	928.00	7,980,800
ホシデン	28,800	974.00	28,051,200
ヒロセ電機	15,100	14,390.00	217,289,000
日本航空電子工業	30,000	1,766.00	52,980,000
T O A	12,100	1,047.00	12,668,700
日立マクセル	13,900	2,079.00	28,898,100
古野電気	13,600	866.00	11,777,600
ユニデンホールディングス	40,000	174.00	6,960,000
アルパイン	22,600	1,558.00	35,210,800
スミダコーポレーション	9,200	983.00	9,043,600

アイコム	6,000	2,128.00	12,768,000
リオン	4,700	1,626.00	7,642,200
本多通信工業	3,700	1,299.00	4,806,300
船井電機	11,400	988.00	11,263,200
横河電機	101,300	1,690.00	171,197,000
新電元工業	37,000	456.00	16,872,000
アズビル	28,300	3,265.00	92,399,500
日本光電工業	39,200	2,576.00	100,979,200
チノー	6,000	1,107.00	6,642,000
共和電業	17,900	405.00	7,249,500
堀場製作所	18,400	5,430.00	99,912,000
アドバンテスト	63,800	1,640.00	104,632,000
エスベック	9,000	1,304.00	11,736,000
パナソニック デバイスSUNX	10,500	750.00	7,875,000
キーエンス	21,200	79,330.00	1,681,796,000
日置電機	5,800	2,158.00	12,516,400
シスメックス	72,400	6,500.00	470,600,000
日本マイクロニクス	17,800	1,105.00	19,669,000
メガチップス	8,900	2,499.00	22,241,100
OBARA GROUP	5,500	5,380.00	29,590,000
コーセル	13,500	1,313.00	17,725,500
イリソ電子工業	3,000	6,640.00	19,920,000
オブテックス	7,100	2,559.00	18,168,900
千代田インテグレ	5,300	2,481.00	13,149,300
アイ・オー・データ機器	3,600	1,190.00	4,284,000
レーザーテック	11,200	2,048.00	22,937,600
スタンレー電気	66,700	3,225.00	215,107,500
岩崎電気	44,000	184.00	8,096,000
ウシオ電機	57,100	1,486.00	84,850,600
ヘリオス テクノ ホールディング	12,400	480.00	5,952,000
日本セラミック	7,800	2,096.00	16,348,800
遠藤照明	7,400	866.00	6,408,400
古河電池	8,000	753.00	6,024,000
山一電機	9,700	1,121.00	10,873,700
図研	7,300	1,214.00	8,862,200
日本電子	35,000	528.00	18,480,000
カシオ計算機	78,400	1,706.00	133,750,400
ファナック	94,700	20,340.00	1,926,198,000
日本シイエムケイ	22,600	713.00	16,113,800
エンプラス	4,500	3,620.00	16,290,000
ローム	45,100	6,760.00	304,876,000
浜松ホトニクス	72,800	3,125.00	227,500,000

三井ハイテック	13,900	842.00	11,703,800	
新光電気工業	34,500	798.00	27,531,000	
京セラ	153,200	5,860.00	897,752,000	
太陽誘電	45,800	1,410.00	64,578,000	
村田製作所	98,000	15,985.00	1,566,530,000	
ユーシン	14,100	734.00	10,349,400	
双葉電子工業	15,300	1,956.00	29,926,800	
北陸電気工業	50,000	135.00	6,750,000	
ニチコン	29,000	1,028.00	29,812,000	
日本ケミコン	84,000	266.00	22,344,000	
K O A	14,100	1,137.00	16,031,700	
市光工業	23,000	379.00	8,717,000	
小糸製作所	55,800	6,160.00	343,728,000	
ミツバ	17,400	1,802.00	31,354,800	
S C R E E Nホールディングス	19,200	6,870.00	131,904,000	
キャノン電子	7,900	1,810.00	14,299,000	
キャノン	502,400	3,417.00	1,716,700,800	
リコー	280,100	1,014.00	284,021,400	
東京エレクトロン	62,300	10,700.00	666,610,000	
トヨタ紡織	32,800	2,716.00	89,084,800	
芦森工業	33,000	165.00	5,445,000	
ユニプレス	18,700	2,338.00	43,720,600	
豊田自動織機	84,600	5,750.00	486,450,000	
モリタホールディングス	16,800	1,621.00	27,232,800	
三櫻工業	15,000	791.00	11,865,000	
デンソー	230,600	5,175.00	1,193,355,000	
東海理化電機製作所	25,100	2,422.00	60,792,200	
三井造船	348,000	184.00	64,032,000	
川崎重工業	727,000	390.00	283,530,000	
名村造船所	28,700	830.00	23,821,000	
日本車輛製造	39,000	277.00	10,803,000	
ニチユ三菱フォークリフト	12,300	857.00	10,541,100	
日産自動車	1,119,400	1,169.00	1,308,578,600	
いすゞ自動車	271,500	1,516.50	411,729,750	
トヨタ自動車	1,162,400	7,144.00	8,304,185,600	代用有価証券 500,000株
日野自動車	133,100	1,200.00	159,720,000	
三菱自動車工業	343,000	659.00	226,037,000	
エフテック	6,600	1,363.00	8,995,800	
武蔵精密工業	11,100	3,075.00	34,132,500	
日産車体	41,600	1,148.00	47,756,800	
新明和工業	38,000	1,054.00	40,052,000	
極東開発工業	18,900	1,540.00	29,106,000	

日信工業	20,800	1,848.00	38,438,400
トピー工業	7,900	3,025.00	23,897,500
ティラド	45,000	315.00	14,175,000
タチエス	16,200	1,947.00	31,541,400
N O K	45,600	2,464.00	112,358,400
フタバ産業	29,700	716.00	21,265,200
K Y B	105,000	550.00	57,750,000
大同メタル工業	13,500	1,234.00	16,659,000
プレス工業	51,100	548.00	28,002,800
ミクニ	19,100	397.00	7,582,700
カルソニックカンセイ	63,000	1,762.00	111,006,000
太平洋工業	19,700	1,497.00	29,490,900
ケーヒン	21,600	2,035.00	43,956,000
河西工業	13,200	1,417.00	18,704,400
アイシン精機	85,200	5,210.00	443,892,000
富士機工	14,100	467.00	6,584,700
マツダ	296,500	2,041.50	605,304,750
今仙電機製作所	10,800	1,055.00	11,394,000
本田技研工業	841,200	3,533.00	2,971,959,600
スズキ	185,500	4,205.00	780,027,500
富士重工業	290,100	4,871.00	1,413,077,100
ヤマハ発動機	131,900	2,786.00	367,473,400
ショーワ	25,000	786.00	19,650,000
T B K	18,000	491.00	8,838,000
エクセディ	12,500	3,265.00	40,812,500
豊田合成	30,400	2,714.00	82,505,600
愛三工業	17,500	1,011.00	17,692,500
ヨロズ	9,500	1,733.00	16,463,500
エフ・シー・シー	15,600	2,176.00	33,945,600
シマノ	37,600	18,820.00	707,632,000
テイ・エス テック	21,900	3,115.00	68,218,500
ジャムコ	5,800	2,469.00	14,320,200
テルモ	142,900	4,215.00	602,323,500
日機装	32,300	1,077.00	34,787,100
島津製作所	120,000	1,801.00	216,120,000
J M S	27,000	303.00	8,181,000
ブイ・テクノロジー	1,900	11,780.00	22,382,000
東京計器	39,000	228.00	8,892,000
愛知時計電機	2,000	3,585.00	7,170,000
東京精密	17,900	3,295.00	58,980,500
マニー	12,600	2,803.00	35,317,800
ニコン	162,600	1,774.00	288,452,400

トプコン	47,100	1,792.00	84,403,200
オリンパス	148,900	4,300.00	640,270,000
理研計器	9,300	1,658.00	15,419,400
タムロン	8,700	2,028.00	17,643,600
H O Y A	192,400	4,844.00	931,985,600
ノーリツ鋼機	11,000	816.00	8,976,000
シチズン時計	105,900	743.00	78,683,700
リズム時計工業	51,000	181.00	9,231,000
大研医器	9,900	809.00	8,009,100
メニコン	6,500	3,090.00	20,085,000
松風	6,300	1,346.00	8,479,800
セイコーホールディングス	66,000	450.00	29,700,000
ニプロ	65,200	1,263.00	82,347,600
スノーピーク	1,700	3,070.00	5,219,000
パラマウントベッドホールディングス	9,000	4,535.00	40,815,000
トランザクション	2,200	1,562.00	3,436,400
ニホンフラッシュ	5,400	1,315.00	7,101,000
前田工織	10,000	1,241.00	12,410,000
永大産業	15,000	504.00	7,560,000
アートネイチャー	13,000	713.00	9,269,000
ダンロップスポーツ	7,600	1,034.00	7,858,400
バンダイナムコホールディングス	102,800	3,235.00	332,558,000
S H O E I	4,900	2,261.00	11,078,900
フランスベッドホールディングス	13,200	916.00	12,091,200
パイロットコーポレーション	16,400	4,855.00	79,622,000
萩原工業	3,400	2,392.00	8,132,800
トッパン・フォームズ	15,400	1,164.00	17,925,600
フジシールインターナショナル	10,400	4,755.00	49,452,000
タカラトミー	36,700	1,210.00	44,407,000
アーク	52,100	124.00	6,460,400
プロネクサス	10,200	1,068.00	10,893,600
大建工業	7,100	2,080.00	14,768,000
凸版印刷	263,000	1,131.00	297,453,000
大日本印刷	267,000	1,161.00	309,987,000
図書印刷	15,000	470.00	7,050,000
共同印刷	31,000	400.00	12,400,000
日本写真印刷	15,800	2,875.00	45,425,000
宝印刷	5,900	1,497.00	8,832,300
アシックス	92,500	2,450.00	226,625,000
ツツミ	3,700	1,974.00	7,303,800
小松ウオール工業	4,100	1,924.00	7,888,400
ヤマハ	62,700	3,615.00	226,660,500

河合楽器製作所	4,600	2,375.00	10,925,000
クリナップ	12,000	959.00	11,508,000
ピジョン	56,200	2,956.00	166,127,200
キングジム	11,000	850.00	9,350,000
リンテック	22,200	2,567.00	56,987,400
T A S A K I	3,300	1,680.00	5,544,000
イトーキ	20,000	842.00	16,840,000
任天堂	57,600	24,540.00	1,413,504,000
三菱鉛筆	7,500	6,440.00	48,300,000
タカラスタANDARD	18,800	1,960.00	36,848,000
コクヨ	48,600	1,354.00	65,804,400
ナカバヤシ	26,000	265.00	6,890,000
グローブライド	5,300	2,030.00	10,759,000
岡村製作所	32,100	1,035.00	33,223,500
美津濃	49,000	584.00	28,616,000
アデランス	18,700	628.00	11,743,600
東京電力ホールディングス	792,200	536.00	424,619,200
中部電力	308,000	1,750.00	539,000,000
関西電力	381,600	1,349.50	514,969,200
中国電力	127,800	1,470.00	187,866,000
北陸電力	91,300	1,405.00	128,276,500
東北電力	232,100	1,556.00	361,147,600
四国電力	84,300	1,252.00	105,543,600
九州電力	206,000	1,337.00	275,422,000
北海道電力	86,900	988.00	85,857,200
沖縄電力	13,700	2,679.00	36,702,300
電源開発	74,400	2,886.00	214,718,400
エフオン	4,900	917.00	4,493,300
イーレックス	4,100	2,844.00	11,660,400
東京瓦斯	1,003,000	542.70	544,328,100
大阪瓦斯	907,000	461.10	418,217,700
東邦瓦斯	234,000	963.00	225,342,000
北海道瓦斯	33,000	276.00	9,108,000
広島ガス	25,000	378.00	9,450,000
西部瓦斯	104,000	255.00	26,520,000
静岡ガス	29,100	851.00	24,764,100
メタウォーター	5,300	2,873.00	15,226,900
S B S ホールディングス	10,000	860.00	8,600,000
東武鉄道	495,000	576.00	285,120,000
相鉄ホールディングス	149,000	579.00	86,271,000
東京急行電鉄	507,000	882.00	447,174,000
京浜急行電鉄	256,000	1,324.00	338,944,000

小田急電鉄	148,800	2,328.00	346,406,400
京王電鉄	259,000	961.00	248,899,000
京成電鉄	69,900	2,852.00	199,354,800
富士急行	26,000	1,072.00	27,872,000
新京成電鉄	16,000	412.00	6,592,000
東日本旅客鉄道	180,600	10,235.00	1,848,441,000
西日本旅客鉄道	90,000	7,194.00	647,460,000
東海旅客鉄道	77,600	19,460.00	1,510,096,000
西武ホールディングス	128,800	2,173.00	279,882,400
鴻池運輸	13,000	1,583.00	20,579,000
西日本鉄道	114,000	542.00	61,788,000
ハマキョウレックス	6,900	2,096.00	14,462,400
サカイ引越センター	3,800	2,598.00	9,872,400
近鉄グループホールディングス	939,000	453.00	425,367,000
阪急阪神ホールディングス	117,900	3,770.00	444,483,000
南海電気鉄道	200,000	599.00	119,800,000
京阪ホールディングス	210,000	779.00	163,590,000
神戸電鉄	30,000	371.00	11,130,000
名古屋鉄道	339,000	572.00	193,908,000
山陽電気鉄道	35,000	596.00	20,860,000
日本通運	360,000	616.00	221,760,000
ヤマトホールディングス	167,200	2,371.50	396,514,800
山九	123,000	718.00	88,314,000
丸全昭和運輸	34,000	470.00	15,980,000
センコー	41,800	813.00	33,983,400
トナミホールディングス	24,000	344.00	8,256,000
ニッコンホールディングス	31,600	2,442.00	77,167,200
福山通運	58,000	686.00	39,788,000
セイノーホールディングス	66,300	1,328.00	88,046,400
神奈川中央交通	13,000	745.00	9,685,000
日立物流	19,000	2,401.00	45,619,000
丸和運輸機関	2,800	2,908.00	8,142,400
C & F ロジホールディングス	11,000	1,390.00	15,290,000
九州旅客鉄道	69,500	3,095.00	215,102,500
日本郵船	785,000	229.00	179,765,000
商船三井	492,000	335.00	164,820,000
川崎汽船	355,000	276.00	97,980,000
N S ユナイテッド海運	49,000	204.00	9,996,000
飯野海運	50,700	473.00	23,981,100
乾汽船	9,000	937.00	8,433,000
日本航空	168,700	3,511.00	592,305,700
A N A ホールディングス	1,743,000	322.80	562,640,400

トランコム	2,800	5,840.00	16,352,000
日新	42,000	376.00	15,792,000
三菱倉庫	61,000	1,660.00	101,260,000
三井倉庫ホールディングス	56,000	359.00	20,104,000
住友倉庫	70,000	618.00	43,260,000
澁澤倉庫	32,000	345.00	11,040,000
東陽倉庫	24,000	295.00	7,080,000
日本トランスシティ	27,000	426.00	11,502,000
安田倉庫	10,000	780.00	7,800,000
東洋埠頭	38,000	187.00	7,106,000
上組	112,000	1,110.00	124,320,000
キューソー流通システム	3,800	2,425.00	9,215,000
郵船ロジスティクス	9,500	1,247.00	11,846,500
近鉄エクスプレス	16,900	1,771.00	29,929,900
エーアイティー	7,400	1,064.00	7,873,600
NEC ネットエスアイ	10,200	2,136.00	21,787,200
システナ	8,200	1,621.00	13,292,200
デジタルアーツ	4,500	2,553.00	11,488,500
新日鉄住金ソリューションズ	15,300	2,068.00	31,640,400
コア	4,900	1,167.00	5,718,300
ソフトクリエイイトホールディングス	6,200	1,331.00	8,252,200
T I S	31,000	2,478.00	76,818,000
電算システム	4,100	1,896.00	7,773,600
グリー	56,900	621.00	35,334,900
コーエーテクモホールディングス	22,000	1,958.00	43,076,000
三菱総合研究所	4,000	3,210.00	12,840,000
ファインデックス	7,300	908.00	6,628,400
ヒト・コミュニケーションズ	3,000	1,511.00	4,533,000
K L a b	19,200	650.00	12,480,000
ポルトゥウィン・ピットクルーホールディングス	8,400	999.00	8,391,600
ネクソン	101,900	1,643.00	167,421,700
アイスタイル	15,300	784.00	11,995,200
エイチーム	5,500	2,170.00	11,935,000
テクノスジャパン	7,600	1,122.00	8,527,200
コロプラ	26,400	1,004.00	26,505,600
ブロードリーフ	24,400	663.00	16,177,200
ハーツユナイテッドグループ	5,200	1,573.00	8,179,600
メディアドゥ	2,700	1,337.00	3,609,900
VOYAGE GROUP	4,500	1,053.00	4,738,500
オブティム	1,100	4,895.00	5,384,500
ティーガイア	9,300	1,914.00	17,800,200
日本アジアグループ	15,000	448.00	6,720,000

豆蔵ホールディングス	8,100	921.00	7,460,100
テクマトリックス	3,500	1,951.00	6,828,500
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	193,600	248.00	48,012,800
GMOペイメントゲートウェイ	7,700	4,395.00	33,841,500
インターネットイニシアティブ	14,000	1,731.00	24,234,000
さくらインターネット	7,700	954.00	7,345,800
SRAホールディングス	5,500	2,434.00	13,387,000
フリービット	6,400	818.00	5,235,200
コムチュア	2,000	3,260.00	6,520,000
gumi	10,600	816.00	8,649,600
LINE	15,500	3,985.00	61,767,500
フェイス	4,600	1,228.00	5,648,800
野村総合研究所	62,600	3,975.00	248,835,000
サイバネットシステム	9,300	625.00	5,812,500
インテージホールディングス	6,300	1,979.00	12,467,700
クレスコ	2,800	2,246.00	6,288,800
フジ・メディア・ホールディングス	96,400	1,663.00	160,313,200
オービック	31,900	5,140.00	163,966,000
ジャストシステム	15,000	1,045.00	15,675,000
TDCソフトウェアエンジニアリング	5,000	1,160.00	5,800,000
ヤフー	660,700	443.00	292,690,100
トレンドマイクロ	49,000	4,340.00	212,660,000
日本オラクル	14,900	5,660.00	84,334,000
アルファシステムズ	4,400	1,946.00	8,562,400
フューチャー	14,700	731.00	10,745,700
CAC Holdings	9,700	934.00	9,059,800
ソフトバンク・テクノロジー	2,500	3,165.00	7,912,500
オービックビジネスコンサルタント	4,800	5,130.00	24,624,000
伊藤忠テクノソリューションズ	21,100	2,964.00	62,540,400
アイティフォー	14,900	627.00	9,342,300
大塚商会	24,800	5,550.00	137,640,000
サイボウズ	16,700	458.00	7,648,600
ソフトブレーン	14,000	384.00	5,376,000
電通国際情報サービス	6,200	1,850.00	11,470,000
デジタルガレージ	15,000	1,976.00	29,640,000
EMシステムズ	4,400	1,600.00	7,040,000
ウェザーニューズ	3,800	3,560.00	13,528,000
WOWOW	4,600	3,270.00	15,042,000
スカラ	6,800	996.00	6,772,800
イマジカ・ロボットホールディングス	9,100	656.00	5,969,600
ネットワンシステムズ	40,800	753.00	30,722,400
アルゴグラフィックス	5,300	2,236.00	11,850,800

マーベラス	16,800	762.00	12,801,600
エイベックス・グループ・ホールディングス	17,400	1,700.00	29,580,000
日本ユニシス	25,800	1,464.00	37,771,200
兼松エレクトロニクス	5,700	2,453.00	13,982,100
東京放送ホールディングス	61,100	1,870.00	114,257,000
日本テレビホールディングス	84,200	2,093.00	176,230,600
朝日放送	12,600	708.00	8,920,800
テレビ朝日ホールディングス	25,700	2,238.00	57,516,600
スカパーJ S A Tホールディングス	60,500	561.00	33,940,500
テレビ東京ホールディングス	7,700	2,321.00	17,871,700
ワイヤレスゲート	4,000	1,662.00	6,648,000
コネクシオ	8,700	1,480.00	12,876,000
日本電信電話	740,600	4,891.00	3,622,274,600
K D D I	912,800	3,059.00	2,792,255,200
光通信	11,100	10,900.00	120,990,000
N T T ドコモ	689,400	2,711.50	1,869,308,100
エムティーアイ	15,600	732.00	11,419,200
G M O インターネット	33,800	1,481.00	50,057,800
カドカワ	26,700	1,649.00	44,028,300
学研ホールディングス	35,000	316.00	11,060,000
ゼンリン	12,600	1,924.00	24,242,400
アイネット	7,100	1,057.00	7,504,700
松竹	63,000	1,251.00	78,813,000
東宝	60,300	3,245.00	195,673,500
東映	35,000	991.00	34,685,000
A O I P r o .	7,200	855.00	6,156,000
エヌ・ティ・ティ・データ	56,800	5,830.00	331,144,000
D T S	9,700	2,545.00	24,686,500
スクウェア・エニックス・ホールディングス	35,800	2,980.00	106,684,000
シーイーシー	6,000	1,667.00	10,002,000
カブコン	22,200	2,485.00	55,167,000
ジャステック	8,100	1,061.00	8,594,100
S C S K	25,200	4,000.00	100,800,000
日本システムウエア	3,900	1,402.00	5,467,800
アイネス	13,000	1,257.00	16,341,000
T K C	8,700	3,115.00	27,100,500
富士ソフト	13,800	2,775.00	38,295,000
N S D	19,100	1,815.00	34,666,500
コナミホールディングス	41,800	4,130.00	172,634,000
福井コンピュータホールディングス	3,000	2,407.00	7,221,000
J B C C ホールディングス	11,900	755.00	8,984,500
ミロク情報サービス	7,200	1,737.00	12,506,400

ソフトバンクグループ	415,300	7,822.00	3,248,476,600
伊藤忠食品	2,900	4,300.00	12,470,000
エレマテック	4,400	1,880.00	8,272,000
JALUX	3,900	1,905.00	7,429,500
あらた	4,800	2,525.00	12,120,000
東京エレクトロン デバイス	5,200	1,581.00	8,221,200
フィールズ	8,300	1,453.00	12,059,900
双日	545,800	296.00	161,556,800
アルフレッサ ホールディングス	108,900	1,976.00	215,186,400
横浜冷凍	23,200	1,028.00	23,849,600
アルコニックス	6,700	1,747.00	11,704,900
神戸物産	5,100	3,885.00	19,813,500
あい ホールディングス	16,400	2,283.00	37,441,200
ダイワボウホールディングス	79,000	293.00	23,147,000
マクニカ・富士エレホールディングス	16,600	1,483.00	24,617,800
バイタルケーエスケー・ホールディングス	17,300	988.00	17,092,400
UKCホールディングス	6,500	2,163.00	14,059,500
TOKAIホールディングス	41,700	774.00	32,275,800
三洋貿易	6,000	1,539.00	9,234,000
ウイン・パートナーズ	3,700	1,945.00	7,196,500
シップヘルスケアホールディングス	17,700	3,010.00	53,277,000
コメダホールディングス	12,800	1,796.00	22,988,800
小野建	9,400	1,365.00	12,831,000
佐島電機	11,200	741.00	8,299,200
伯東	8,400	1,031.00	8,660,400
コンドーテック	10,800	846.00	9,136,800
ナガイレーベン	13,400	2,504.00	33,553,600
三菱食品	9,700	3,430.00	33,271,000
松田産業	7,300	1,520.00	11,096,000
第一興商	15,300	4,540.00	69,462,000
メディバルホールディングス	92,100	1,816.00	167,253,600
萩原電気	4,100	2,114.00	8,667,400
アズワン	7,300	5,030.00	36,719,000
尾家産業	5,400	1,136.00	6,134,400
シモジマ	6,900	1,131.00	7,803,900
ドウシシャ	11,000	2,045.00	22,495,000
小津産業	3,300	2,105.00	6,946,500
高速	8,300	1,099.00	9,121,700
黒田電気	12,400	2,371.00	29,400,400
丸文	10,900	700.00	7,630,000
ハピネット	8,800	1,294.00	11,387,200
日本ライフライン	8,000	2,344.00	18,752,000

エクセル	5,100	1,500.00	7,650,000
マルカキカイ	4,800	1,548.00	7,430,400
I D O M	26,000	685.00	17,810,000
日本エム・ディ・エム	8,300	805.00	6,681,500
進和	7,200	1,707.00	12,290,400
シークス	6,600	3,935.00	25,971,000
オーハシテクニカ	6,600	1,399.00	9,233,400
伊藤忠商事	675,600	1,594.00	1,076,906,400
丸紅	909,800	674.50	613,660,100
長瀬産業	55,600	1,529.00	85,012,400
蝶理	6,700	1,760.00	11,792,000
豊田通商	101,900	3,060.00	311,814,000
三共生興	20,300	390.00	7,917,000
兼松	195,000	200.00	39,000,000
三井物産	834,400	1,681.00	1,402,626,400
日本紙パルプ商事	47,000	370.00	17,390,000
日立ハイテクノロジーズ	32,000	4,485.00	143,520,000
カメイ	13,200	1,205.00	15,906,000
スターゼン	4,000	4,800.00	19,200,000
山善	35,100	986.00	34,608,600
住友商事	581,200	1,397.00	811,936,400
内田洋行	27,000	484.00	13,068,000
三菱商事	692,100	2,563.00	1,773,852,300
第一実業	24,000	667.00	16,008,000
キャノンマーケティングジャパン	26,600	1,996.00	53,093,600
西華産業	35,000	347.00	12,145,000
佐藤商事	11,600	865.00	10,034,000
菱洋エレクトロ	9,600	1,463.00	14,044,800
東京産業	12,000	493.00	5,916,000
ユアサ商事	8,600	2,998.00	25,782,800
阪和興業	93,000	771.00	71,703,000
カナデン	10,800	1,040.00	11,232,000
菱電商事	16,000	737.00	11,792,000
フルサト工業	6,200	1,682.00	10,428,400
岩谷産業	105,000	637.00	66,885,000
すてきナイスグループ	56,000	154.00	8,624,000
三愛石油	25,000	880.00	22,000,000
稲畑産業	21,800	1,273.00	27,751,400
ワキタ	20,400	992.00	20,236,800
東邦ホールディングス	29,800	2,392.00	71,281,600
サンゲツ	32,300	2,055.00	66,376,500
ミツウロコグループホールディングス	16,700	719.00	12,007,300

シナネンホールディングス	5,100	2,094.00	10,679,400
伊藤忠エネクス	20,100	933.00	18,753,300
サンリオ	29,300	2,267.00	66,423,100
サンワテクノス	8,600	978.00	8,410,800
リョーサン	14,100	3,515.00	49,561,500
新光商事	11,200	1,232.00	13,798,400
トーホー	5,200	2,548.00	13,249,600
三信電気	11,500	1,144.00	13,156,000
東陽テクニカ	14,200	1,039.00	14,753,800
モスフードサービス	11,700	3,485.00	40,774,500
加賀電子	8,500	1,924.00	16,354,000
ソーダニッカ	14,500	519.00	7,525,500
立花エレテック	7,400	1,312.00	9,708,800
PALTA C	14,600	2,721.00	39,726,600
三谷産業	15,900	350.00	5,565,000
太平洋興発	47,000	104.00	4,888,000
ヤマタネ	6,000	1,637.00	9,822,000
日鉄住金物産	7,800	4,625.00	36,075,000
トラスコ中山	10,500	4,935.00	51,817,500
オートバックスセブン	34,800	1,778.00	61,874,400
加藤産業	14,100	2,679.00	37,773,900
イノテック	13,800	583.00	8,045,400
イエローハット	8,900	2,388.00	21,253,200
J Kホールディングス	13,400	601.00	8,053,400
日伝	4,400	3,195.00	14,058,000
杉本商事	6,700	1,548.00	10,371,600
因幡電機産業	12,700	4,045.00	51,371,500
バイテックホールディングス	5,600	1,254.00	7,022,400
ミスミグループ本社	103,800	1,941.00	201,475,800
タキヒヨー	20,000	452.00	9,040,000
スズケン	42,000	3,775.00	158,550,000
ジェコス	7,900	1,038.00	8,200,200
ローソン	32,000	8,160.00	261,120,000
サンエー	6,800	5,690.00	38,692,000
カワチ薬品	7,300	2,922.00	21,330,600
エービーシー・マート	16,800	6,470.00	108,696,000
ハードオフコーポレーション	6,200	1,182.00	7,328,400
アスクル	11,200	4,285.00	47,992,000
ゲオホールディングス	15,800	1,382.00	21,835,600
アダストリア	14,400	3,260.00	46,944,000
くらコーポレーション	6,000	4,765.00	28,590,000
キャンドウ	6,000	1,785.00	10,710,000

パルグループホールディングス	5,100	2,879.00	14,682,900
エディオン	35,200	1,136.00	39,987,200
サーラコーポレーション	15,100	653.00	9,860,300
ハローズ	3,400	2,368.00	8,051,200
あみやき亭	2,300	3,905.00	8,981,500
ひらまつ	16,800	683.00	11,474,400
ゲンキー	2,000	5,780.00	11,560,000
大黒天物産	2,500	5,070.00	12,675,000
ハニーズ	9,500	1,225.00	11,637,500
アルペン	8,200	2,274.00	18,646,800
クオール	10,900	1,467.00	15,990,300
ジェイアイエヌ	6,300	5,120.00	32,256,000
ビックカメラ	52,100	1,128.00	58,768,800
D C Mホールディングス	56,100	1,013.00	56,829,300
MonotaRO	32,800	2,393.00	78,490,400
アークランドサービスホールディングス	3,200	2,884.00	9,228,800
J . フロント リテイリング	116,600	1,774.00	206,848,400
ドトール・日レスホールディングス	16,100	2,153.00	34,663,300
マツモトキヨシホールディングス	17,500	5,940.00	103,950,000
ブロンコビリー	4,900	2,959.00	14,499,100
スタートトゥデイ	84,800	1,957.00	165,953,600
物語コーポレーション	2,800	4,190.00	11,732,000
ココカラファイン	9,500	4,410.00	41,895,000
三越伊勢丹ホールディングス	183,300	1,381.00	253,137,300
ウエルシアホールディングス	8,900	6,970.00	62,033,000
クリエイトSDホールディングス	13,400	2,530.00	33,902,000
チムニー	3,200	2,891.00	9,251,200
シュッピン	4,300	1,333.00	5,731,900
ネクステージ	2,300	1,998.00	4,595,400
ジョイフル本田	14,900	3,120.00	46,488,000
鳥貴族	2,800	2,377.00	6,655,600
ホットランド	5,800	1,236.00	7,168,800
すかいらーく	39,400	1,597.00	62,921,800
綿半ホールディングス	4,600	1,625.00	7,475,000
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホール	28,200	979.00	27,607,800
ブックオフコーポレーション	8,900	804.00	7,155,600
ゴルフダイジェスト・オンライン	4,600	878.00	4,038,800
あさひ	8,000	1,337.00	10,696,000
日本調剤	3,300	4,775.00	15,757,500
コスモス薬品	4,600	21,220.00	97,612,000
セブン&アイ・ホールディングス	385,700	4,595.00	1,772,291,500
薬王堂	4,800	2,178.00	10,454,400

クリエイト・レストランツ・ホールディング	24,100	1,027.00	24,750,700
ツルハホールディングス	21,200	11,380.00	241,256,000
サンマルクホールディングス	6,000	3,520.00	21,120,000
トリドールホールディングス	11,500	2,398.00	27,577,000
クスリのアオキホールディングス	8,200	5,190.00	42,558,000
メディカルシステムネットワーク	13,700	448.00	6,137,600
総合メディカル	4,700	4,390.00	20,633,000
ノジマ	11,200	1,286.00	14,403,200
カッパ・クリエイト	13,400	1,291.00	17,299,400
ライトオン	8,200	1,080.00	8,856,000
良品計画	12,200	22,520.00	274,744,000
三城ホールディングス	16,700	457.00	7,631,900
アドヴァン	10,600	1,202.00	12,741,200
アルビス	3,000	3,245.00	9,735,000
コナカ	15,600	596.00	9,297,600
G - 7ホールディングス	3,100	1,547.00	4,795,700
コーナン商事	13,300	2,255.00	29,991,500
エコス	5,400	1,207.00	6,517,800
ワタミ	12,600	1,090.00	13,734,000
ドンキホーテホールディングス	59,600	4,370.00	260,452,000
西松屋チェーン	16,300	1,466.00	23,895,800
ゼンショーホールディングス	48,100	1,910.00	91,871,000
幸楽苑ホールディングス	6,900	1,632.00	11,260,800
サイゼリヤ	15,100	2,682.00	40,498,200
V Tホールディングス	31,600	597.00	18,865,200
魚力	4,800	1,261.00	6,052,800
ユナイテッドアローズ	12,500	3,325.00	41,562,500
ハイデイ日高	8,300	2,684.00	22,277,200
京都きもの友禅	8,800	931.00	8,192,800
コロワイド	29,900	1,892.00	56,570,800
ピーシーデポコーポレーション	13,900	600.00	8,340,000
壱番屋	8,200	3,780.00	30,996,000
スギホールディングス	20,300	5,560.00	112,868,000
スクロール	19,700	359.00	7,072,300
ヨンドシーホールディングス	7,100	2,479.00	17,600,900
ユニー・ファミリーマートホールディングス	40,300	7,620.00	307,086,000
木曽路	11,300	2,348.00	26,532,400
サトレストランシステムズ	14,400	813.00	11,707,200
千趣会	18,700	746.00	13,950,200
ケーヨー	20,900	551.00	11,515,900
上新電機	22,000	1,000.00	22,000,000
日本瓦斯	17,100	3,465.00	59,251,500

ベスト電器	37,700	162.00	6,107,400
ロイヤルホールディングス	14,900	1,973.00	29,397,700
いなげや	10,100	1,473.00	14,877,300
鳥忠	24,100	3,095.00	74,589,500
チヨダ	10,800	2,777.00	29,991,600
ライフコーポレーション	7,000	3,425.00	23,975,000
リンガーハット	10,800	2,198.00	23,738,400
MrMax	16,200	431.00	6,982,200
AOKIホールディングス	18,200	1,474.00	26,826,800
オークワ	13,000	1,172.00	15,236,000
コメリ	14,900	2,746.00	40,915,400
青山商事	19,400	4,075.00	79,055,000
しまむら	10,700	14,070.00	150,549,000
高島屋	155,000	1,060.00	164,300,000
松屋	20,700	1,124.00	23,266,800
エイチ・ツー・オー リテイリング	47,600	1,902.00	90,535,200
近鉄百貨店	37,000	354.00	13,098,000
パルコ	9,400	1,039.00	9,766,600
丸井グループ	97,300	1,831.00	178,156,300
アクシアル リテイリング	7,100	3,995.00	28,364,500
イオン	379,800	1,716.50	651,926,700
イズミ	18,300	5,020.00	91,866,000
平和堂	18,500	2,555.00	47,267,500
フジ	10,300	2,399.00	24,709,700
ヤオコー	10,200	4,630.00	47,226,000
ゼビオホールディングス	12,600	1,855.00	23,373,000
ケーズホールディングス	42,800	2,099.00	89,837,200
Olympicグループ	9,100	618.00	5,623,800
日産東京販売ホールディングス	19,700	335.00	6,599,500
アインホールディングス	11,100	7,940.00	88,134,000
元気寿司	3,500	2,107.00	7,374,500
ヤマダ電機	308,200	625.00	192,625,000
アークランドサカモト	16,100	1,485.00	23,908,500
ニトリホールディングス	39,900	12,930.00	515,907,000
グルメ杵屋	9,000	999.00	8,991,000
愛眼	19,800	197.00	3,900,600
吉野家ホールディングス	33,500	1,575.00	52,762,500
松屋フーズ	4,500	3,875.00	17,437,500
サガミチェーン	12,600	1,285.00	16,191,000
関西スーパーマーケット	8,000	1,506.00	12,048,000
王将フードサービス	6,700	4,235.00	28,374,500
プレナス	10,200	2,276.00	23,215,200

ミニストップ	7,100	2,040.00	14,484,000
アークス	17,100	2,679.00	45,810,900
パローホールディングス	20,300	3,045.00	61,813,500
ベルク	4,100	4,595.00	18,839,500
大庄	6,600	1,581.00	10,434,600
ファーストリテイリング	15,400	43,130.00	664,202,000
サンドラッグ	17,600	8,130.00	143,088,000
サクスパー ホールディングス	9,600	1,200.00	11,520,000
ヤマザワ	3,100	1,772.00	5,493,200
やまや	2,000	1,683.00	3,366,000
ペルーナ	23,400	683.00	15,982,200
じもとホールディングス	71,900	208.00	14,955,200
めぶきフィナンシャルグループ	441,100	451.00	198,936,100
東京ＴＹフィナンシャルグループ	13,500	4,370.00	58,995,000
九州フィナンシャルグループ	149,900	836.00	125,316,400
ゆうちょ銀行	259,300	1,473.00	381,948,900
富山第一銀行	26,300	567.00	14,912,100
コンコルディア・フィナンシャルグループ	601,600	585.00	351,936,000
西日本フィナンシャルホールディングス	62,400	1,186.00	74,006,400
新生銀行	873,000	205.00	178,965,000
あおぞら銀行	581,000	427.00	248,087,000
三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	6,991,500	759.60	5,310,743,400
りそなホールディングス	1,074,900	634.00	681,486,600
三井住友トラスト・ホールディングス	192,000	4,581.00	879,552,000
三井住友フィナンシャルグループ	738,600	4,695.00	3,467,727,000
第四銀行	110,000	543.00	59,730,000
北越銀行	10,300	2,688.00	27,686,400
千葉銀行	352,000	753.00	265,056,000
群馬銀行	203,600	667.00	135,801,200
武蔵野銀行	14,700	3,430.00	50,421,000
千葉興業銀行	28,400	606.00	17,210,400
筑波銀行	42,300	367.00	15,524,100
七十七銀行	143,000	608.00	86,944,000
青森銀行	74,000	397.00	29,378,000
秋田銀行	62,000	391.00	24,242,000
山形銀行	53,000	501.00	26,553,000
岩手銀行	6,100	4,875.00	29,737,500
東邦銀行	81,000	448.00	36,288,000
東北銀行	50,000	155.00	7,750,000
みちのく銀行	50,000	223.00	11,150,000
ふくおかフィナンシャルグループ	372,000	555.00	206,460,000
静岡銀行	250,000	1,029.00	257,250,000

十六銀行	122,000	433.00	52,826,000	
スルガ銀行	93,800	2,739.00	256,918,200	
八十二銀行	173,700	712.00	123,674,400	
山梨中央銀行	58,000	582.00	33,756,000	
大垣共立銀行	121,000	470.00	56,870,000	
福井銀行	82,000	305.00	25,010,000	
北國銀行	97,000	416.00	40,352,000	
清水銀行	3,600	3,700.00	13,320,000	
富山銀行	2,100	4,350.00	9,135,000	
滋賀銀行	85,000	663.00	56,355,000	
南都銀行	8,900	4,540.00	40,406,000	
百五銀行	81,000	492.00	39,852,000	
京都銀行	164,000	927.00	152,028,000	
紀陽銀行	36,300	1,913.00	69,441,900	
三重銀行	4,500	2,453.00	11,038,500	
ほくほくフィナンシャルグループ	60,600	2,100.00	127,260,000	
広島銀行	269,000	581.00	156,289,000	
山陰合同銀行	55,500	995.00	55,222,500	
中国銀行	63,800	1,729.00	110,310,200	
鳥取銀行	3,100	1,903.00	5,899,300	
伊予銀行	97,500	859.00	83,752,500	
百十四銀行	102,000	408.00	41,616,000	
四国銀行	76,000	288.00	21,888,000	
阿波銀行	78,000	726.00	56,628,000	
大分銀行	55,000	444.00	24,420,000	
宮崎銀行	63,000	368.00	23,184,000	
佐賀銀行	62,000	303.00	18,786,000	
十八銀行	60,000	357.00	21,420,000	
沖縄銀行	9,100	4,395.00	39,994,500	
琉球銀行	19,600	1,591.00	31,183,600	
セブン銀行	345,700	357.00	123,414,900	
みずほフィナンシャルグループ	12,522,000	220.90	2,766,109,800	
高知銀行	40,000	137.00	5,480,000	
山口フィナンシャルグループ	85,000	1,310.00	111,350,000	
長野銀行	3,500	2,030.00	7,105,000	
名古屋銀行	7,800	4,320.00	33,696,000	
北洋銀行	149,000	505.00	75,245,000	
愛知銀行	3,200	7,030.00	22,496,000	
第三銀行	5,300	1,855.00	9,831,500	
中京銀行	4,500	2,374.00	10,683,000	
大光銀行	36,000	270.00	9,720,000	
愛媛銀行	12,100	1,400.00	16,940,000	

トマト銀行	3,700	1,668.00	6,171,600
みなと銀行	8,700	2,105.00	18,313,500
京葉銀行	75,000	539.00	40,425,000
関西アーバン銀行	13,600	1,519.00	20,658,400
栃木銀行	52,400	596.00	31,230,400
北日本銀行	3,000	3,145.00	9,435,000
東和銀行	187,000	112.00	20,944,000
福島銀行	111,000	98.00	10,878,000
大東銀行	57,000	170.00	9,690,000
トモニホールディングス	77,200	641.00	49,485,200
フィデアホールディングス	95,800	220.00	21,076,000
池田泉州ホールディングス	98,000	558.00	54,684,000
F P G	33,500	934.00	31,289,000
S B Iホールディングス	103,900	1,532.00	159,174,800
ジャフコ	15,600	3,905.00	60,918,000
大和証券グループ本社	863,000	759.10	655,103,300
野村ホールディングス	1,885,900	735.80	1,387,645,220
岡三証券グループ	79,000	748.00	59,092,000
丸三証券	31,200	1,028.00	32,073,600
東洋証券	36,000	283.00	10,188,000
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	106,600	653.00	69,609,800
水戸証券	30,800	353.00	10,872,400
いちよし証券	20,500	946.00	19,393,000
松井証券	52,900	1,015.00	53,693,500
マネックスグループ	102,300	339.00	34,679,700
カブドットコム証券	71,600	405.00	28,998,000
極東証券	12,700	1,799.00	22,847,300
岩井コスモホールディングス	9,800	1,147.00	11,240,600
藍澤證券	19,600	682.00	13,367,200
マネーパートナーズグループ	14,000	577.00	8,078,000
かんぽ生命保険	34,800	2,583.00	89,888,400
S O M P Oホールディングス	192,500	4,017.00	773,272,500
アニコム ホールディングス	7,000	2,313.00	16,191,000
M S & A Dインシュアランスグループホールディングス	275,800	3,702.00	1,021,011,600
ソニーフィナンシャルホールディングス	88,500	1,880.00	166,380,000
第一生命ホールディングス	555,800	2,052.00	1,140,501,600
東京海上ホールディングス	373,200	5,021.00	1,873,837,200
T & Dホールディングス	335,900	1,590.00	534,081,000
アドバンスクリエイト	3,500	1,800.00	6,300,000
全国保証	26,100	3,775.00	98,527,500
クレディセゾン	69,700	2,152.00	149,994,400
アクリーティブ	11,600	478.00	5,544,800

芙蓉総合リース	10,600	5,690.00	60,314,000
興銀リース	17,500	2,662.00	46,585,000
東京センチュリー	18,100	4,000.00	72,400,000
日本証券金融	43,200	655.00	28,296,000
アイフル	154,500	358.00	55,311,000
ポケットカード	9,800	558.00	5,468,400
リコーリース	7,400	3,695.00	27,343,000
イオンフィナンシャルサービス	58,900	2,109.00	124,220,100
アコム	184,400	525.00	96,810,000
ジャックス	53,000	545.00	28,885,000
オリエントコーポレーション	196,800	218.00	42,902,400
日立キャピタル	21,800	2,927.00	63,808,600
アプラスフィナンシャル	47,000	124.00	5,828,000
オリックス	652,000	1,866.00	1,216,632,000
三菱UFJリース	232,200	616.00	143,035,200
日本取引所グループ	286,100	1,755.00	502,105,500
イー・ギャランティ	3,300	2,399.00	7,916,700
NECキャピタルソリューション	4,500	1,858.00	8,361,000
いちご	87,300	444.00	38,761,200
日本駐車場開発	117,500	168.00	19,740,000
ヒューリック	192,200	1,067.00	205,077,400
三栄建築設計	4,300	1,665.00	7,159,500
野村不動産ホールディングス	61,400	2,003.00	122,984,200
三重交通グループホールディングス	21,100	392.00	8,271,200
サムティ	8,600	1,085.00	9,331,000
日本商業開発	5,800	1,989.00	11,536,200
プレサンスコーポレーション	14,500	1,500.00	21,750,000
ユニゾホールディングス	7,900	3,245.00	25,635,500
日本管理センター	7,700	1,338.00	10,302,600
フージャースホールディングス	16,300	620.00	10,106,000
オープンハウス	13,400	2,813.00	37,694,200
東急不動産ホールディングス	223,200	707.00	157,802,400
飯田グループホールディングス	76,300	2,264.00	172,743,200
パーク24	46,900	3,045.00	142,810,500
パラカ	3,400	1,954.00	6,643,600
三井不動産	489,000	2,747.00	1,343,283,000
三菱地所	686,000	2,336.00	1,602,496,000
平和不動産	18,100	1,618.00	29,285,800
東京建物	107,100	1,554.00	166,433,400
ダイビル	24,300	1,035.00	25,150,500
京阪神ビルディング	18,700	613.00	11,463,100
住友不動産	221,000	3,150.00	696,150,000

大京	170,000	245.00	41,650,000
テオーシー	36,100	920.00	33,212,000
東京楽天地	18,000	514.00	9,252,000
レオパレス21	117,900	616.00	72,626,400
スターツコーポレーション	9,200	1,975.00	18,170,000
フジ住宅	15,700	748.00	11,743,600
空港施設	15,400	577.00	8,885,800
住友不動産販売	8,300	2,881.00	23,912,300
ゴールドクレスト	8,600	2,139.00	18,395,400
日神不動産	15,400	551.00	8,485,400
日本エスコン	15,500	412.00	6,386,000
タカラレーベン	41,300	682.00	28,166,600
サンヨーハウジング名古屋	7,700	1,065.00	8,200,500
イオンモール	60,200	1,726.00	103,905,200
トーセイ	14,400	847.00	12,196,800
エヌ・ティ・ティ都市開発	58,800	1,093.00	64,268,400
サンフロンティア不動産	11,800	1,011.00	11,929,800
エフ・ジェー・ネクスト	9,700	735.00	7,129,500
日本空港ビルデング	29,600	4,525.00	133,940,000
日本工営	34,000	526.00	17,884,000
ネクスト	24,400	780.00	19,032,000
ジェイエシーリクルートメント	6,500	1,301.00	8,456,500
日本M&Aセンター	28,300	3,105.00	87,871,500
アコーディア・ゴルフ	30,600	1,203.00	36,811,800
タケエイ	10,500	910.00	9,555,000
トラスト・テック	4,500	1,586.00	7,137,000
パソナグループ	9,900	806.00	7,979,400
リンクアンドモチベーション	25,400	408.00	10,363,200
G C A	10,200	924.00	9,424,800
エス・エム・エス	13,400	2,542.00	34,062,800
テンプホールディングス	75,200	1,746.00	131,299,200
リニカル	6,300	1,265.00	7,969,500
クックパッド	22,300	1,120.00	24,976,000
学情	5,100	1,172.00	5,977,200
スタジオアリス	4,900	2,285.00	11,196,500
シミックホールディングス	6,000	1,486.00	8,916,000
総合警備保障	35,400	4,495.00	159,123,000
カカクコム	70,200	1,834.00	128,746,800
ルネサンス	6,400	1,432.00	9,164,800
ディップ	12,600	2,364.00	29,786,400
オプトホールディング	9,200	734.00	6,752,800
ツクイ	24,000	724.00	17,376,000

エムスリー	84,700	2,782.00	235,635,400
ツカダ・グローバルホールディング	9,900	725.00	7,177,500
アウトソーシング	5,600	3,565.00	19,964,000
ウェルネット	8,200	1,269.00	10,405,800
ワールドホールディングス	2,700	2,160.00	5,832,000
ディー・エヌ・エー	43,900	2,638.00	115,808,200
博報堂DYホールディングス	134,600	1,400.00	188,440,000
ぐるなび	14,200	2,284.00	32,432,800
エスアールジータカミヤ	12,400	615.00	7,626,000
ジャパンベストレスキューシステム	18,100	248.00	4,488,800
ファンコミュニケーションズ	25,100	733.00	18,398,300
ライク	2,800	1,858.00	5,202,400
WDBホールディングス	4,300	1,199.00	5,155,700
インフォマート	21,000	1,272.00	26,712,000
J Pホールディングス	34,300	261.00	8,952,300
E P Sホールディングス	12,500	1,343.00	16,787,500
プレステージ・インターナショナル	15,300	732.00	11,199,600
アミューズ	6,000	1,727.00	10,362,000
ドリームインキュベータ	3,400	2,031.00	6,905,400
クイック	6,100	1,011.00	6,167,100
ケネディクス	131,500	428.00	56,282,000
電通	108,600	5,710.00	620,106,000
テイクアンドギヴ・ニーズ	6,400	748.00	4,787,200
ぴあ	3,500	2,904.00	10,164,000
イオンファンタジー	3,200	3,020.00	9,664,000
ネクシィーズグループ	4,000	1,371.00	5,484,000
みらかホールディングス	25,100	5,190.00	130,269,000
アルプス技研	4,400	2,508.00	11,035,200
日本空調サービス	12,200	592.00	7,222,400
オリエンタルランド	105,600	6,683.00	705,724,800
ダスキン	25,400	2,324.00	59,029,600
明光ネットワークジャパン	13,600	1,066.00	14,497,600
ファルコホールディングス	6,300	1,454.00	9,160,200
ラウンドワン	31,600	790.00	24,964,000
リゾートトラスト	38,200	2,199.00	84,001,800
ビー・エム・エル	12,800	2,809.00	35,955,200
りらいあコミュニケーションズ	16,000	1,096.00	17,536,000
リソー教育	19,200	572.00	10,982,400
ユー・エス・エス	118,400	1,856.00	219,750,400
サイバーエージェント	51,700	2,713.00	140,262,100
楽天	499,500	1,147.50	573,176,250
テー・オー・ダブリュー	10,900	662.00	7,215,800

セントラルスポーツ	4,300	2,787.00	11,984,100
フルキャストホールディングス	10,900	919.00	10,017,100
テクノプロ・ホールディングス	16,000	3,635.00	58,160,000
イー・ガーディアン	4,000	1,268.00	5,072,000
リブセンス	10,000	438.00	4,380,000
ジャパンマテリアル	3,700	3,590.00	13,283,000
ベクトル	8,300	1,079.00	8,955,700
I B J	9,100	618.00	5,623,800
アサンテ	5,200	1,704.00	8,860,800
N・フィールド	5,200	1,399.00	7,274,800
M & A キャピタルパートナーズ	1,700	2,819.00	4,792,300
アビスト	2,100	3,195.00	6,709,500
リクルートホールディングス	212,900	4,545.00	967,630,500
日本郵政	253,000	1,545.00	390,885,000
ベルシステム24ホールディングス	15,400	961.00	14,799,400
ソラスト	5,400	1,189.00	6,420,600
リログループ	3,600	15,390.00	55,404,000
東祥	2,200	4,965.00	10,923,000
エイチ・アイ・エス	15,700	3,135.00	49,219,500
共立メンテナンス	7,900	6,930.00	54,747,000
イチネンホールディングス	12,100	1,156.00	13,987,600
建設技術研究所	8,100	1,081.00	8,756,100
スペース	6,400	1,293.00	8,275,200
東京テアトル	52,000	159.00	8,268,000
ナガワ	1,900	4,235.00	8,046,500
よみうりランド	24,000	495.00	11,880,000
東京都競馬	68,000	286.00	19,448,000
常磐興産	5,400	1,552.00	8,380,800
カナモト	13,700	3,105.00	42,538,500
東京ドーム	38,800	1,167.00	45,279,600
西尾レントオール	7,800	3,420.00	26,676,000
トランス・コスモス	11,100	2,724.00	30,236,400
乃村工藝社	20,500	1,668.00	34,194,000
藤田観光	37,000	359.00	13,283,000
KNT-CTホールディングス	61,000	143.00	8,723,000
日本管財	9,000	1,790.00	16,110,000
トーカイ	4,400	4,010.00	17,644,000
白洋舎	1,700	2,676.00	4,549,200
セコム	101,600	8,503.00	863,904,800
セントラル警備保障	5,000	1,978.00	9,890,000
丹青社	17,500	832.00	14,560,000
メイテック	12,100	4,285.00	51,848,500

アサツー ディ・ケイ	16,100	2,956.00	47,591,600	
応用地質	10,000	1,351.00	13,510,000	
船井総研ホールディングス	12,900	1,789.00	23,078,100	
オオバ	11,200	452.00	5,062,400	
ベネッセホールディングス	32,900	3,290.00	108,241,000	
イオンディライト	10,700	3,235.00	34,614,500	
ナック	8,600	977.00	8,402,200	
ニチイ学館	17,600	886.00	15,593,600	
ダイセキ	17,100	2,286.00	39,090,600	
合 計	140,117,300		211,313,924,930	

(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

(単位：円)

	(平成27年12月18日現在)	(平成28年12月19日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	-	1,723
コール・ローン	4,669	2,433
親投資信託受益証券	32,406,754,029	33,685,920,979
未収入金	4,999,999	-
流動資産合計	32,411,758,697	33,685,925,135
資産合計	32,411,758,697	33,685,925,135
負債の部		
流動負債		
未払解約金	4,999,999	-
未払受託者報酬	4,844,865	4,357,700
未払委託者報酬	4,844,803	4,357,643
その他未払費用	486,000	486,017
流動負債合計	15,175,667	9,201,360
負債合計	15,175,667	9,201,360
純資産の部		
元本等		
元本	25,989,414,850	26,284,958,851
剰余金		
剰余金又は欠損金()	6,407,168,180	7,391,764,924
元本等合計	32,396,583,030	33,676,723,775
純資産合計	32,396,583,030	33,676,723,775
負債純資産合計	32,411,758,697	33,685,925,135

注記表

（重要な会計方針の注記）

項目	自 平成28年 6月21日 至 平成28年12月19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27年12月18日現在）	（平成28年12月19日現在）
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	25,989,414,850口	26,284,958,851口
2. 1単位当たり純資産の額	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)	1口当たり純資産額 1.2812円 (10,000口当たりの純資産額 12,812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28年 6月21日 至 平成28年12月19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28年12月19日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。

2.時価の算定方法	<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）

自 平成28年 6月21日 至 平成28年12月19日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。

（その他の注記）

項 目	（平成27年12月18日現在）	（平成28年12月19日現在）
期首元本額	29,681,762,293円	25,082,572,318円
期中追加設定元本額	2,576,006,063円	1,976,421,861円
期中一部解約元本額	6,268,353,506円	774,035,328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	24,372,998,321	33,685,920,979	
合計		24,372,998,321	33,685,920,979	

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（NOMURA - 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（NOMURA - B P I）マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

	(平成27年12月18日現在)	(平成28年12月19日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	-	298,302,534
コール・ローン	714,443,673	421,338,739
国債証券	88,456,047,680	87,229,070,140
地方債証券	7,278,673,985	8,565,085,580
特殊債証券	11,306,492,229	12,397,365,037
社債証券	7,029,207,000	4,973,357,000
未収入金	47,099,100	-
未収利息	466,323,881	421,237,380
前払費用	13,901,507	10,392,333
流動資産合計	115,312,189,055	114,316,148,743
資産合計	115,312,189,055	114,316,148,743
負債の部		
流動負債		
未払解約金	263,685,026	28,071,898
未払利息	-	1,112
その他未払費用	-	12,758
流動負債合計	263,685,026	28,085,768
負債合計	263,685,026	28,085,768

（平成27年12月18日現在）

（平成28年12月19日現在）

純資産の部		
元本等		
元本	85,606,537,336	82,693,627,894
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	29,441,966,693	31,594,435,081
元本等合計	115,048,504,029	114,288,062,975
純資産合計	115,048,504,029	114,288,062,975
負債純資産合計	115,312,189,055	114,316,148,743

注記表

（重要な会計方針の注記）

項目	自 平成28年 6月21日 至 平成28年12月19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27年12月18日現在）	（平成28年12月19日現在）
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	85,606,537,336口	82,693,627,894口
2. 1単位当たり純資産の額	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)	1口当たり純資産額 1.3821円 (10,000口当たりの純資産額 13,821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28年 6月21日 至 平成28年12月19日

1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2.金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<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28年12月19日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券（国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

自 平成28年 6月21日 至 平成28年12月19日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。

(その他の注記)

(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

（平成28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	81,405,391,010円
同期中における追加設定元本額	6,773,728,396円
同期中における一部解約元本額	5,485,491,512円
平成28年12月19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	38,191,825,088円
S M A M ・国内債券インデックス・ファンド	19,843,556,672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>	285,247,813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>	24,372,998,321円
合計	82,693,627,894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120回利付国債（5年）	160,000,000	161,544,000	
	第122回利付国債（5年）	1,080,000,000	1,087,635,600	
	第123回利付国債（5年）	1,010,000,000	1,017,231,600	
	第124回利付国債（5年）	470,000,000	473,379,300	
	第125回利付国債（5年）	1,230,000,000	1,239,249,600	
	第126回利付国債（5年）	380,000,000	382,971,600	
	第127回利付国債（5年）	1,415,000,000	1,426,447,350	
	第128回利付国債（5年）	1,285,000,000	1,295,434,200	
	第129回利付国債（5年）	455,000,000	458,790,150	
	第1回利付国債（40年）	10,000,000	14,774,900	
	第2回利付国債（40年）	162,000,000	231,715,080	

第3回利付国債(40年)	170,000,000	244,369,900	
第4回利付国債(40年)	190,000,000	275,184,600	
第5回利付国債(40年)	207,000,000	288,371,700	
第6回利付国債(40年)	230,000,000	314,794,100	
第7回利付国債(40年)	210,000,000	274,879,500	
第8回利付国債(40年)	285,000,000	345,705,000	
第9回利付国債(40年)	285,000,000	250,201,500	
第299回利付国債(10年)	1,225,000,000	1,265,412,750	
第300回利付国債(10年)	1,420,000,000	1,473,235,800	
第301回利付国債(10年)	1,153,000,000	1,200,653,490	
第303回利付国債(10年)	685,000,000	714,194,700	
第305回利付国債(10年)	1,325,000,000	1,382,213,500	
第306回利付国債(10年)	1,310,000,000	1,374,609,200	
第308回利付国債(10年)	505,000,000	529,891,450	
第309回利付国債(10年)	640,000,000	667,059,200	
第310回利付国債(10年)	1,235,000,000	1,286,104,300	
第312回利付国債(10年)	985,000,000	1,035,973,750	
第313回利付国債(10年)	1,020,000,000	1,080,159,600	
第315回利付国債(10年)	1,165,000,000	1,231,999,150	
第317回利付国債(10年)	1,100,000,000	1,161,578,000	
第319回利付国債(10年)	590,000,000	624,456,000	
第320回利付国債(10年)	575,000,000	605,699,250	
第321回利付国債(10年)	480,000,000	506,630,400	
第322回利付国債(10年)	460,000,000	483,101,200	
第323回利付国債(10年)	295,000,000	310,443,250	
第324回利付国債(10年)	640,000,000	669,977,600	
第325回利付国債(10年)	375,000,000	393,258,750	
第326回利付国債(10年)	910,000,000	950,476,800	
第327回利付国債(10年)	570,000,000	598,779,300	
第328回利付国債(10年)	880,000,000	914,672,000	
第329回利付国債(10年)	920,000,000	969,376,400	
第330回利付国債(10年)	920,000,000	970,646,000	
第332回利付国債(10年)	755,000,000	786,966,700	
第333回利付国債(10年)	835,000,000	870,345,550	
第334回利付国債(10年)	730,000,000	761,404,600	
第335回利付国債(10年)	635,000,000	657,815,550	

第336回利付国債(10年)	520,000,000	539,281,600	
第337回利付国債(10年)	530,000,000	541,198,900	
第338回利付国債(10年)	885,000,000	911,178,300	
第339回利付国債(10年)	990,000,000	1,019,739,600	
第340回利付国債(10年)	970,000,000	999,565,600	
第341回利付国債(10年)	1,075,000,000	1,098,574,750	
第342回利付国債(10年)	875,000,000	878,211,250	
第343回利付国債(10年)	1,280,000,000	1,284,825,600	
第344回利付国債(10年)	1,430,000,000	1,434,147,000	
第2回利付国債(30年)	150,000,000	192,583,500	
第4回利付国債(30年)	160,000,000	217,747,200	
第5回利付国債(30年)	110,000,000	139,641,700	
第7回利付国債(30年)	180,000,000	232,855,200	
第10回利付国債(30年)	230,000,000	255,725,500	
第11回利付国債(30年)	150,000,000	181,297,500	
第12回利付国債(30年)	230,000,000	292,750,900	
第14回利付国債(30年)	250,000,000	331,190,000	
第15回利付国債(30年)	250,000,000	335,845,000	
第16回利付国債(30年)	195,000,000	262,425,150	
第18回利付国債(30年)	190,000,000	249,682,800	
第19回利付国債(30年)	160,000,000	210,361,600	
第21回利付国債(30年)	102,000,000	134,318,700	
第22回利付国債(30年)	149,000,000	201,844,340	
第23回利付国債(30年)	151,000,000	204,828,480	
第24回利付国債(30年)	135,000,000	183,362,400	
第25回利付国債(30年)	185,000,000	244,647,700	
第26回利付国債(30年)	209,000,000	280,707,900	
第27回利付国債(30年)	206,000,000	281,857,440	
第28回利付国債(30年)	271,000,000	372,578,930	
第29回利付国債(30年)	155,000,000	210,903,850	
第30回利付国債(30年)	255,000,000	343,102,500	
第31回利付国債(30年)	380,000,000	505,745,800	
第32回利付国債(30年)	390,000,000	529,565,400	
第33回利付国債(30年)	355,000,000	461,180,500	
第34回利付国債(30年)	375,000,000	506,276,250	
第35回利付国債(30年)	380,000,000	497,313,600	

第36回利付国債(30年)	320,000,000	420,057,600	
第37回利付国債(30年)	345,000,000	446,519,700	
第38回利付国債(30年)	250,000,000	318,380,000	
第39回利付国債(30年)	195,000,000	253,533,150	
第40回利付国債(30年)	195,000,000	248,933,100	
第41回利付国債(30年)	215,000,000	269,321,900	
第42回利付国債(30年)	265,000,000	332,476,950	
第43回利付国債(30年)	270,000,000	339,295,500	
第44回利付国債(30年)	265,000,000	333,544,900	
第45回利付国債(30年)	295,000,000	356,504,550	
第46回利付国債(30年)	305,000,000	369,065,250	
第47回利付国債(30年)	305,000,000	377,382,600	
第48回利付国債(30年)	340,000,000	403,719,400	
第49回利付国債(30年)	300,000,000	356,637,000	
第50回利付国債(30年)	325,000,000	334,919,000	
第51回利付国債(30年)	330,000,000	296,277,300	
第52回利付国債(30年)	395,000,000	375,546,250	
第42回利付国債(20年)	400,000,000	424,860,000	
第43回利付国債(20年)	710,000,000	769,640,000	
第46回利付国債(20年)	289,000,000	312,463,910	
第48回利付国債(20年)	368,000,000	406,180,000	
第50回利付国債(20年)	223,000,000	241,876,950	
第52回利付国債(20年)	210,000,000	231,720,300	
第54回利付国債(20年)	275,000,000	306,303,250	
第56回利付国債(20年)	320,000,000	356,249,600	
第58回利付国債(20年)	300,000,000	333,912,000	
第59回利付国債(20年)	280,000,000	309,380,400	
第61回利付国債(20年)	140,000,000	149,206,400	
第63回利付国債(20年)	156,000,000	174,579,600	
第64回利付国債(20年)	210,000,000	237,323,100	
第65回利付国債(20年)	370,000,000	419,335,800	
第69回利付国債(20年)	200,000,000	230,090,000	
第70回利付国債(20年)	380,000,000	447,355,000	
第72回利付国債(20年)	300,000,000	347,868,000	
第74回利付国債(20年)	388,000,000	451,895,840	
第75回利付国債(20年)	230,000,000	268,929,800	

第78回利付国債(20年)	340,000,000	393,376,600	
第82回利付国債(20年)	288,000,000	339,569,280	
第84回利付国債(20年)	424,000,000	498,055,840	
第85回利付国債(20年)	332,000,000	394,621,840	
第88回利付国債(20年)	329,000,000	398,771,030	
第90回利付国債(20年)	418,000,000	504,442,400	
第92回利付国債(20年)	295,000,000	354,274,350	
第93回利付国債(20年)	267,000,000	319,086,360	
第95回利付国債(20年)	196,000,000	241,036,880	
第97回利付国債(20年)	305,000,000	373,304,750	
第99回利付国債(20年)	339,000,000	412,525,710	
第100回利付国債(20年)	318,000,000	391,814,160	
第102回利付国債(20年)	355,000,000	446,778,150	
第105回利付国債(20年)	397,000,000	487,496,150	
第107回利付国債(20年)	403,000,000	496,197,780	
第109回利付国債(20年)	380,000,000	459,952,000	
第111回利付国債(20年)	393,000,000	490,915,950	
第113回利付国債(20年)	370,000,000	458,814,800	
第114回利付国債(20年)	528,000,000	656,330,400	
第116回利付国債(20年)	355,000,000	446,604,200	
第118回利付国債(20年)	320,000,000	394,912,000	
第119回利付国債(20年)	310,000,000	374,439,700	
第121回利付国債(20年)	260,000,000	318,073,600	
第122回利付国債(20年)	255,000,000	308,557,650	
第123回利付国債(20年)	205,000,000	256,809,650	
第124回利付国債(20年)	200,000,000	247,836,000	
第125回利付国債(20年)	135,000,000	171,324,450	
第126回利付国債(20年)	210,000,000	260,723,400	
第127回利付国債(20年)	195,000,000	239,253,300	
第128回利付国債(20年)	270,000,000	331,624,800	
第129回利付国債(20年)	120,000,000	145,713,600	
第130回利付国債(20年)	270,000,000	328,122,900	
第131回利付国債(20年)	245,000,000	294,271,950	
第132回利付国債(20年)	245,000,000	294,646,800	
第133回利付国債(20年)	315,000,000	383,358,150	
第134回利付国債(20年)	235,000,000	286,382,750	

	第135回利付国債(20年)	145,000,000	174,591,600	
	第136回利付国債(20年)	135,000,000	160,465,050	
	第137回利付国債(20年)	110,000,000	132,508,200	
	第138回利付国債(20年)	130,000,000	152,760,400	
	第139回利付国債(20年)	165,000,000	196,325,250	
	第140回利付国債(20年)	595,000,000	717,022,600	
	第141回利付国債(20年)	200,000,000	241,266,000	
	第142回利付国債(20年)	225,000,000	274,839,750	
	第143回利付国債(20年)	145,000,000	172,724,000	
	第144回利付国債(20年)	155,000,000	182,256,750	
	第145回利付国債(20年)	520,000,000	628,009,200	
	第146回利付国債(20年)	330,000,000	398,587,200	
	第147回利付国債(20年)	530,000,000	631,722,900	
	第148回利付国債(20年)	435,000,000	511,359,900	
	第149回利付国債(20年)	445,000,000	522,901,700	
	第150回利付国債(20年)	365,000,000	422,680,950	
	第151回利付国債(20年)	530,000,000	595,184,700	
	第152回利付国債(20年)	525,000,000	588,897,750	
	第153回利付国債(20年)	530,000,000	603,314,900	
	第154回利付国債(20年)	475,000,000	531,990,500	
	第155回利付国債(20年)	530,000,000	573,486,500	
	第156回利付国債(20年)	405,000,000	393,400,800	
	第157回利付国債(20年)	610,000,000	568,398,000	
	第158回利付国債(20年)	585,000,000	576,195,750	
国債証券合計		78,386,000,000	87,229,070,140	
地方債証券	第1回東京都公募公債(20年)	200,000,000	218,956,000	
	第7回東京都公募公債(20年)	100,000,000	117,462,000	
	第8回東京都公募公債(30年)	100,000,000	128,012,000	
	第13回東京都公募公債(30年)	200,000,000	248,970,000	
	第656回東京都公募公債	300,000,000	305,637,000	
	第660回東京都公募公債	200,000,000	204,744,000	
	第668回東京都公募公債	200,000,000	206,926,000	
	第681回東京都公募公債	200,000,000	209,022,000	
	平成20年度第7回北海道公募公債	200,000,000	206,064,000	
	第7回神奈川県公募公債(20年)	200,000,000	239,482,000	
	第56回神奈川県公募公債(5年)	100,000,000	100,355,000	

第59回神奈川県公募公債(5年)	100,000,000	100,478,000	
第147回神奈川県公募公債	100,000,000	100,991,000	
第192回神奈川県公募公債	100,000,000	104,241,000	
第89回大阪府公募公債(5年)	100,000,000	100,199,000	
第297回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	100,042,000	
第311回大阪府公募公債(10年)	250,000,000	255,005,000	
第361回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	104,676,000	
第5回兵庫県公募公債(15年)	100,000,000	110,796,000	
第9回兵庫県公募公債(20年)	100,000,000	123,046,000	
平成19年度第18回兵庫県公募公債	100,000,000	101,968,000	
平成21年度第3回兵庫県公募公債	100,000,000	103,958,000	
第7回静岡県公募公債(30年)	100,000,000	126,799,000	
平成20年度第1回静岡県公募公債	100,000,000	117,533,000	
平成21年度第10回静岡県公募公債	100,000,000	104,540,000	
平成21年度第2回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	103,803,000	
平成21年度第7回愛知県公募公債(10年)	200,000,000	208,268,000	
平成21年度第8回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	103,865,000	
平成26年度第14回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	103,052,000	
平成26年度第18回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	102,368,000	
平成26年度第1回広島県公募公債	100,000,000	103,938,000	
平成21年度第2回埼玉県公募公債	246,000,000	255,404,580	
平成26年度第4回埼玉県公募公債	100,000,000	103,857,000	
平成27年度第2回埼玉県公募公債(5年)	100,000,000	100,453,000	
平成24年度第10回福岡県公募公債	100,000,000	100,194,000	
平成25年度第11回福岡県公募公債	100,000,000	104,079,000	
平成26年度第5回福岡県公募公債	100,000,000	102,929,000	
平成20年度第8回千葉県公募公債	100,000,000	103,235,000	
平成21年度第1回千葉県公募公債	100,000,000	103,592,000	
平成26年度第3回千葉県公募公債	100,000,000	103,510,000	
第66回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,732,000	
第75回共同発行市場公募地方債	300,000,000	312,696,000	
第76回共同発行市場公募地方債	200,000,000	207,272,000	
第79回共同発行市場公募地方債	200,000,000	207,722,000	
第82回共同発行市場公募地方債	200,000,000	208,800,000	
第84回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,491,000	

	第9 1 回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,471,000	
	第1 1 5 回共同発行市場公募地方債	300,000,000	312,846,000	
	第1 3 7 回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,181,000	
	第1 4 0 回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,812,000	
	平成2 1 年度第4 回大阪市公募公債	200,000,000	208,660,000	
	第4 6 4 回名古屋市公募公債(1 0 年)	100,000,000	102,814,000	
	平成1 9 年度第2 回京都市公募公債	100,000,000	101,774,000	
	平成2 1 年度第1 回京都市公募公債	100,000,000	104,203,000	
	平成2 3 年度第4 回京都市公募公債	100,000,000	105,105,000	
	第1 6 回横浜市公募公債(2 0 年)	100,000,000	123,279,000	
	平成2 0 年度第3 回横浜市公募公債	300,000,000	308,019,000	
	平成2 7 年度第5 回福岡市公募公債	100,000,000	102,759,000	
地方債証券合計		8,096,000,000	8,565,085,580	
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	514,055,000	
	第1 5 回政府保証日本政策投資銀行債券	100,000,000	110,095,000	
	第1 5 回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	100,435,000	
	第2 2 回政府保証日本政策投資銀行債券	100,000,000	114,038,000	
	第3 9 回日本政策投資銀行債券	100,000,000	101,317,000	
	第4 回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	133,185,000	
	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	216,004,000	
	第2 2 回日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	284,070,000	
	第2 7 回道路債券	100,000,000	116,527,000	
	第3 2 回道路債券	100,000,000	117,599,000	
	第3 6 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	302,862,000	
	第3 7 回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	123,432,000	
	第3 8 回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,807,000	
	第4 2 回道路債券	100,000,000	116,777,000	
	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	101,915,000	
	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	307,398,000	
第7 7 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,942,000		
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	121,697,000		

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	122,259,000	
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	123,433,000	
第1 0 0 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,506,000	
第1 0 4 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	209,482,000	
第1 1 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	104,020,000	
第1 2 0 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,526,000	
第2 0 7 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	208,848,000	
第2 回政府保証地方公営企業等金融機構債券	100,000,000	103,071,000	
第3 回政府保証地方公共団体金融機構債券	700,000,000	728,084,000	
第4 回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,581,000	
第4 回公営企業債券(20年)	200,000,000	227,460,000	
第4 回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,884,000	
第5 回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,424,000	
第6 回政府保証地方公共団体金融機構債券(4年)	200,000,000	200,290,000	
第8 回政府保証地方公営企業等金融機構債券	100,000,000	103,665,000	
第9 回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	209,402,000	
第1 2 回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	104,727,000	
第1 4 回政府保証地方公共団体金融機構債券(6年)	200,000,000	201,460,000	
第1 6 回地方公共団体金融機構債券(5年)	100,000,000	100,500,000	
第1 8 回公営企業債券(20年)	100,000,000	122,470,000	
第2 2 回公営企業債券(20年)	200,000,000	241,846,000	
第6 1 回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	104,126,000	
第8 7 5 回政府保証公営企業債券	200,000,000	201,438,000	
第8 7 6 回政府保証公営企業債券	101,000,000	101,963,540	
第8 8 2 回政府保証公営企業債券	100,000,000	101,874,000	
第5 回政府保証日本政策金融公庫債券	100,000,000	103,596,000	
第3 4 回株式会社日本政策金融公庫社債	100,000,000	100,404,000	
第2 9 回国際協力銀行債券	100,000,000	101,337,000	
第3 0 回国際協力銀行債券	100,000,000	102,332,000	
第1 3 回関西国際空港株式会社社債	100,000,000	103,009,000	

第6回独立行政法人福祉医療機構債券	100,000,000	115,871,000	
第199回政府保証預金保険機構債	100,000,000	100,194,000	
第203回政府保証預金保険機構債	200,000,000	200,678,000	
第208回政府保証預金保険機構債	400,000,000	401,732,000	
第1回貸付債権担保住宅金融公庫債券	11,736,000	11,955,697	
第1回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	17,328,000	17,966,536	
第1回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	20,607,000	21,962,940	
第2回貸付債権担保住宅金融公庫債券	11,269,000	11,436,006	
第2回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	17,952,000	18,695,212	
第5回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	17,994,000	18,833,420	
第7回貸付債権担保住宅金融公庫債券	12,496,000	12,790,030	
第9回貸付債権担保住宅金融公庫債券	13,531,000	13,845,731	
第9回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	19,725,000	21,038,093	
第10回貸付債権担保住宅金融公庫債券	14,417,000	14,770,649	
第10回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	20,318,000	21,669,147	
第12回貸付債権担保住宅金融公庫債券	15,837,000	16,367,856	
第14回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	27,409,000	28,432,726	
第18回貸付債権担保住宅金融公庫債券	16,721,000	17,417,764	
第29回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	41,372,000	44,353,266	
第30回貸付債権担保住宅金融公庫債券	20,251,000	21,065,697	
第32回貸付債権担保住宅金融公庫債券	24,001,000	25,088,005	
第32回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	41,665,000	44,394,890	
第35回貸付債権担保住宅金融公庫債券	23,751,000	24,927,387	
第37回貸付債権担保住宅金融公庫債券	22,820,000	24,019,419	
第37回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	47,261,000	50,037,111	
第40回貸付債権担保住宅金融公庫債券	24,240,000	25,688,097	
第42回貸付債権担保住宅金融公庫債券	21,665,000	23,176,567	
第48回貸付債権担保住宅金融公庫債券	21,270,000	22,762,303	
第49回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	51,544,000	54,910,854	
第51回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	55,820,000	59,236,184	
第55回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	67,355,000	70,890,463	
第57回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	65,954,000	69,490,453	
第59回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	66,987,000	70,596,259	
第67回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	73,542,000	76,229,960	
第69回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	74,733,000	78,329,899	

	第70回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	68,904,000	72,149,378
	第73回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	74,373,000	78,206,184
	第88回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	79,347,000	81,710,747
	第113回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	99,366,000	98,752,911
	第130回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	118,270,000
	第2回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	23,648,000	25,206,639
	第3回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	21,590,000	23,073,017
	い第776号商工債	100,000,000	100,435,000
	い第746号農林債	300,000,000	300,615,000
	い第752号農林債	400,000,000	401,280,000
	い第753号農林債	100,000,000	100,285,000
	第281回信金中金債（5年）	100,000,000	100,327,000
	第298回信金中金債（5年）	200,000,000	200,996,000
	第304回信金中金債（5年）	200,000,000	201,276,000
	第174号商工債（3年）	200,000,000	200,168,000
	第177号商工債（3年）	100,000,000	100,119,000
	第184号商工債（3年）	100,000,000	100,205,000
	第195号商工債（3年）	200,000,000	200,070,000
	第16回政府保証東日本高速道路債券	200,000,000	205,934,000
	第46回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	100,260,000
特殊債券合計		11,749,799,000	12,397,365,037
社債券	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	100,485,000
	第11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	99,870,000
	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	100,591,000
	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	200,954,000
	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	100,503,000
	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	102,553,000
	第61回株式会社神戸製鋼所無担保社債	100,000,000	99,654,000
	第44回三菱電機株式会社無担保社債	100,000,000	100,292,000
	第12回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	100,489,000

第13回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	101,327,000	
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	100,562,000	
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	100,732,000	
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	100,310,000	
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	102,541,000	
第25回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	100,000,000	104,040,000	
第57回株式会社東京三菱銀行無担保社債	100,000,000	112,077,000	
株式会社三井住友フィナンシャル第1回無担保社債	100,000,000	101,652,000	
第4回株式会社りそな銀行無担保社債	100,000,000	106,239,000	
第9回三菱UFJ信託銀行株式会社無担保社債	100,000,000	105,924,000	
第6回株式会社セブン銀行無担保社債	100,000,000	100,189,000	
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	100,000,000	102,165,000	
第20回株式会社三井住友銀行無担保社債	100,000,000	105,158,000	
第8回株式会社みずほ銀行無担保社債	200,000,000	201,358,000	
第27回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	100,452,000	
第113回オリックス株式会社無担保社債	100,000,000	100,724,000	
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	101,740,000	
第65回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	117,829,000	
第24回東日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	108,773,000	
第32回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	114,589,000	
第69回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	103,944,000	
第10回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	112,335,000	
第7回東海旅客鉄道株式会社社債	100,000,000	110,898,000	
第13回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	112,565,000	
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	101,296,000	
第63回日本電信電話株式会社電信電話債券	100,000,000	102,581,000	
第19回KDDI株式会社無担保社債	100,000,000	103,091,000	
第457回東京電力株式会社社債	100,000,000	103,348,000	

第528回東京電力株式会社社債	100,000,000	103,890,000	
第536回東京電力株式会社社債	100,000,000	101,627,000	
第499回中部電力株式会社社債	100,000,000	105,843,000	
第448回関西電力株式会社社債	100,000,000	103,065,000	
第491回関西電力株式会社社債	100,000,000	100,000,000	
第253回四国電力株式会社社債	100,000,000	104,669,000	
第328回北海道電力株式会社社債	100,000,000	100,496,000	
第38回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	104,508,000	
第19回大阪瓦斯株式会社無担保社債	100,000,000	105,429,000	
社債券合計	4,800,000,000	4,973,357,000	
合計		113,164,877,757	

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

	（単位：円）	
	（平成27年12月21日現在）	（平成28年12月20日現在）
資産の部		
流動資産		
金銭信託	-	104
コール・ローン	-	4,886
親投資信託受益証券	22,256,550,178	18,048,564,518
未収入金	-	279,169,989
流動資産合計	22,256,550,178	18,327,739,497
資産合計	22,256,550,178	18,327,739,497
負債の部		
流動負債		
未払解約金	-	279,169,989
未払受託者報酬	787,237	589,000
未払委託者報酬	286,261	214,171
その他未払費用	37,611	37,460
流動負債合計	1,111,109	280,010,620
負債合計	1,111,109	280,010,620
純資産の部		
元本等		
元本	10,397,539,925	7,896,547,097
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	11,857,899,144	10,151,181,780
元本等合計	22,255,439,069	18,047,728,877

(平成27年12月21日現在) (平成28年12月20日現在)

純資産合計	22,255,439,069	18,047,728,877
負債純資産合計	22,256,550,178	18,327,739,497

注記表

(重要な会計方針の注記)

項目	自平成28年12月1日 至平成28年12月20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27年12月21日現在)	(平成28年12月20日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	10,397,539,925口	7,896,547,097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) 2.1405円 21,405円)	1口当たり純資産額 (10,000口当たりの純資産額) 2.2855円 22,855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28年12月1日 至平成28年12月20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28年12月20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)

自 平成28年12月 1日 至 平成28年12月20日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。

(その他の注記)

項 目	(平成27年12月21日現在)	(平成28年12月20日現在)
期首元本額	10,592,213,751円	8,355,446,305円
期中追加設定元本額	3,039,914円	-円
期中一部解約元本額	197,713,740円	458,899,208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	6,125,217,036	18,048,564,518	
合計		6,125,217,036	18,048,564,518	

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27年12月21日現在)	(平成28年12月20日現在)
資産の部		
流動資産		
預金	1,809,998,393	-
金銭信託	-	52,862,229
コール・ローン	462,437,299	2,493,500,168
株式	154,792,503,533	164,241,513,059
投資証券	3,986,261,428	4,139,703,818
派生商品評価勘定	10,917,916	14,709,818
未収入金	1,017,952,151	2,184,411,192
未収配当金	207,308,009	225,309,843
未収利息	126	-
前払金	11,641,537	-
差入委託証拠金	1,278,986,677	1,950,673,312
流動資産合計	163,578,007,069	175,302,683,439
資産合計	163,578,007,069	175,302,683,439
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	22,561,553	417,144
前受金	-	13,776,635
未払金	39,515,303	983,681,225
未払解約金	2,883,725	2,532,175,876

未払利息	-	6,255
その他未払費用	-	7,863
流動負債合計	64,960,581	3,530,064,998
負債合計	64,960,581	3,530,064,998
純資産の部		
元本等		
元本	59,300,511,881	58,294,769,147
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	104,212,534,607	113,477,849,294
元本等合計	163,513,046,488	171,772,618,441
純資産合計	163,513,046,488	171,772,618,441
負債純資産合計	163,578,007,069	175,302,683,439

注記表

(重要な会計方針の注記)

項目	自 平成28年12月 1日 至 平成28年12月20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27年12月21日現在）	（平成28年12月20日現在）
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	59,300,511,881口	58,294,769,147口
2. 1単位当たり純資産の額	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)	1口当たり純資産額 2.9466円 (10,000口当たりの純資産額 29,466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28年12月 1日 至 平成28年12月20日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	(1)金融商品の内容 1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、株式、投資証券を組み入れております。 2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。当計算期間については、先物取引、為替予約取引を行っております。 3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 (2)金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。

3.金融商品に係るリスク管理体制	<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28年12月20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、投資証券） 「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)

(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	うち1年超	時価	評価損益
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	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
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	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

（平成28年12月20日現在）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

（単位：円）

区分	種類	契約額等	うち1年超	時価	評価損益

市場取引	株価指数先物取引				
	買建	2,964,172,956	-	2,977,949,591	13,776,635
	SPMINI 1703	2,075,425,074	-	2,078,982,366	3,557,292
	DJ EUR 1703	515,929,048	-	522,328,118	6,399,070
	FTSE 1703	209,361,413	-	212,123,063	2,761,650
	SPI200 1703	163,457,421	-	164,516,044	1,058,623
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	514,965,739	-	514,449,700	516,039
	米ドル	399,854,180	-	399,521,600	332,580
	カナダドル	21,028,550	-	20,985,600	42,950
	ユーロ	12,198,000	-	12,198,000	-
	英ポンド	23,347,736	-	23,254,400	93,336
	スイスフラン	18,274,446	-	18,256,000	18,446
	スウェーデンクローナ	6,383,210	-	6,375,000	8,210
	ノルウェークローネ	1,351,500	-	1,349,000	2,500
	デンマーククローネ	3,449,932	-	3,446,100	3,832
	オーストラリアドル	15,307,200	-	15,301,800	5,400
	香港ドル	6,794,455	-	6,786,000	8,455
	シンガポールドル	2,429,100	-	2,428,200	900
	イスラエルシケル	4,547,430	-	4,548,000	570
	合計	3,479,138,695	-	3,492,399,291	14,292,674

(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）

自 平成28年12月 1日 至 平成28年12月20日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。

（その他の注記）

（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・DC外国株式インデックスファンドS	8,291,004,509円
三井住友・DC年金バランス30（債券重点型）	177,005,074円
三井住友・DC年金バランス50（標準型）	795,185,983円
三井住友・DC年金バランス70（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・DCターゲットイヤーファンド2020	2,642,623円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2025	6,224,551円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2030	26,153,071円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2035	22,791,101円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2040	13,925,777円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2045	32,008,852円
外国株式指数ファンド	412,620,099円
三井住友・DC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VA（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VA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VA25＜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VA37.5＜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 V A < 適格機関投資家限定 >	13,171,923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 >	1,391,751,327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 >	94,052,892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 >	279,764,936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 >	1,340,219,139円
S M A M ・ バランスファンド V A 4 0 < 適格機関投資家専用 >	2,162,096,036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 >	2,921,300,474円
S M A M ・ バランス V A 株 4 0 T < 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・ V A S (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・ V A S (適格機関投資家専用)	2,758,301,609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 >	240,740,755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 >	137,532,066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)	2,417,611,204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 >	38,232,319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 >	23,003,090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 >	11,369,463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 >	86,662,919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 >	199,455,929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 >	189,133,634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 >	243,873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 >	3,860,854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 >	129,237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 >	943,377,353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 >	137,744円
合計	59,300,511,881円

(平成28年12月20日現在)

開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	60,085,742,502円
同期中における追加設定元本額	799,955,565円
同期中における一部解約元本額	2,590,928,920円
平成28年12月20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	9,969,952,133円
三井住友・ D C 年金バランス 3 0 (債券重点型)	212,285,026円
三井住友・ D C 年金バランス 5 0 (標準型)	901,148,591円
三井住友・ D C 年金バランス 7 0 (株式重点型)	614,153,063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)	44,586,766円
スミセイ・ D C ターゲットイヤーファンド 2 0 2 0	3,182,251円
スミセイ・ D C ターゲットイヤーファンド 2 0 2 5	8,454,317円
スミセイ・ D C ターゲットイヤーファンド 2 0 3 0	26,099,614円

スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2035	30,548,801円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2040	17,228,998円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2045	44,423,187円
外国株式指数ファンド	430,691,277円
三井住友・DC全海外株式インデックスファンド	1,062,550,194円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	1,058,449,445円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	1,015,317,170円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	1,656,469,853円
イオン・バランス戦略ファンド	28,153,566円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2050	2,470,413円
SMAM・外国株式バッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	6,125,217,036円
バランスファンドVA(安定運用型) < 適格機関投資家限定 >	27,085,591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 >	4,122,040,996円
SMAM・バランスファンドVA25 < 適格機関投資家専用 >	2,965,585,735円
SMAM・バランスファンドVA37.5 < 適格機関投資家専用 >	2,318,165,631円
SMAM・バランスファンドVA50 < 適格機関投資家専用 >	9,871,293,087円
SMAM・バランスファンドVL30 < 適格機関投資家限定 >	27,103,084円
SMAM・バランスファンドVL50 < 適格機関投資家限定 >	160,314,491円
世界6資産バランスファンドVA < 適格機関投資家限定 >	7,646,100円
SMAM・バランスファンドVA75 < 適格機関投資家専用 >	1,216,500,418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 >	90,850,764円
SMAM・インデックス・バランスVA25 < 適格機関投資家専用 >	256,584,317円
SMAM・インデックス・バランスVA50 < 適格機関投資家専用 >	1,180,513,917円
SMAM・バランスファンドVA40 < 適格機関投資家専用 >	1,981,378,128円
SMAM・バランスファンドVA35 < 適格機関投資家専用 >	2,581,647,573円
SMAM・バランスVA株40T < 適格機関投資家限定 >	88,061,326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)	1,109,550,822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)	1,633,174,553円
SMAM・グローバルバランス40VA < 適格機関投資家限定 >	222,118,496円
SMAM・バランスファンドVA20 < 適格機関投資家専用 >	119,867,051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)	1,812,790,647円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A < 適格機関投資家専用 >	36,675,973円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A < 適格機関投資家専用 >	20,039,327円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A < 適格機関投資家専用 >	10,467,324円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L < 適格機関投資家専用 >	77,395,833円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L < 適格機関投資家専用 >	169,219,351円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T < 適格機関投資家専用 >	175,149,433円
SMAM・FG新興国重視型バランス20VA < 適格機関投資家限定 >	17,631円
SMAM・FGグローバルバランス25VA < 適格機関投資家限定 >	735,612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 >	850,735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 >	2,507,358,516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 >	197,586円
SMAM・マルチアセットストラテジーファンド2016-04 < 適格機関投資家限定 >	119,826,439円
SMAM・マルチアセットストラテジーファンド2016-05 < 適格機関投資家限定 >	57,423,936円
SMAM・マルチアセットストラテジー・オープン < 適格機関投資家限定 >	75,757,023円

合計

58,294,769,147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	26,293	71.37	1,876,531.41	
	ANTERO RESOURCES CORP	8,176	24.40	199,494.40	
	APACHE CORPORATION	17,581	66.70	1,172,652.70	
	BAKER HUGHES INC	18,963	65.73	1,246,437.99	
	CABOT OIL & GAS CORPORATION	22,720	21.84	496,204.80	
	CHENIERE ENERGY INC	9,802	41.62	407,959.24	
	CHEVRON CORPORATION	88,004	117.65	10,353,670.60	
	CIMAREX ENERGY CO	4,508	137.59	620,255.72	
	CONCHO RESOURCES INC	6,762	138.57	937,010.34	
	CONOCOPHILLIPS	57,775	51.98	3,003,144.50	
	CONTINENTAL RESOURCES, INC.	4,214	51.87	218,580.18	
	CORE LABORATORIES N.V.	2,101	120.00	252,120.00	
	DEVON ENERGY CORPORATION	21,983	47.04	1,034,080.32	
	DIAMONDBACK ENERGY INC	3,751	105.25	394,792.75	
	EOG RESOURCES INC	26,891	103.48	2,782,680.68	
	EQT CORPORATION	8,423	65.78	554,064.94	
	EXXON MOBIL CORPORATION	193,264	90.42	17,474,930.88	
	FMC TECHNOLOGIES INC	10,651	34.63	368,844.13	
	HALLIBURTON CO	40,169	53.72	2,157,878.68	
	HELMERICH & PAYNE INC	5,427	78.45	425,748.15	
	HESS CORPORATION	13,057	63.37	827,422.09	
	HOLLYFRONTIER CORP	8,311	31.19	259,220.09	
	KINDER MORGAN INC	90,116	21.01	1,893,337.16	
	MARATHON OIL CORP	39,442	18.51	730,071.42	
	MARATHON PETROLEUM CORPORATION	25,098	49.44	1,240,845.12	
	MURPHY OIL CORPORATION	7,419	32.87	243,862.53	
	NATIONAL-OILWELL VARCO INC.	17,446	38.49	671,496.54	
	NEWFIELD EXPLORATION CO	10,026	45.00	451,170.00	
	NOBLE ENERGY INC	19,748	40.25	794,857.00	
	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	35,230	72.47	2,553,118.10	
ONEOK INC	9,816	58.10	570,309.60		
PARSLEY ENERGY INC-CLASS A	7,339	36.72	269,488.08		
PHILLIPS 66	22,355	87.17	1,948,685.35		

PIONEER NATURAL RESOURCES CO	8,022	186.02	1,492,252.44
PLAINS GP HOLDINGS LP-CL A	4,306	33.57	144,552.42
RANGE RESOURCES CORPORATION	8,475	33.97	287,895.75
SCHLUMBERGER LTD	64,874	85.12	5,522,074.88
SOUTHWESTERN ENERGY COMPANY	22,258	10.69	237,938.02
SPECTRA ENERGY CORPORATION	31,996	41.45	1,326,234.20
TARGA RESOURCES CORP	8,011	54.95	440,204.45
TESORO CORPORATION	5,612	90.51	507,942.12
VALERO ENERGY CORP	21,521	67.45	1,451,591.45
WILLIAMS COS INC	33,266	30.76	1,023,262.16
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	9,574	147.72	1,414,271.28
ALBEMARLE CORPORATION	5,355	89.00	476,595.00
ARCONIC INC	19,698	20.02	394,353.96
ASHLAND GLOBAL HOLDINGS INC	2,695	110.17	296,908.15
AVERY DENNISON CORP	4,362	71.28	310,923.36
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	9,132	27.41	250,308.12
BALL CORPORATION	8,103	76.53	620,122.59
CELANESE CORPORATION	6,817	81.88	558,175.96
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	10,460	28.29	295,913.40
CROWN HOLDINGS INC	6,080	53.18	323,334.40
DOW CHEMICAL	52,066	58.78	3,060,439.48
DU PONT (E.I.) DE NEMOURS	40,455	75.03	3,035,338.65
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	7,159	76.21	545,587.39
ECOLAB INC	12,410	120.57	1,496,273.70
FMC CORPORATION	6,226	57.14	355,753.64
FREEMONT-MCMORAN INC	60,662	13.55	821,970.10
INTERNATIONAL PAPER CO	18,567	53.68	996,676.56
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	3,872	117.87	456,392.64
LYONDELLBASELL INDU-CL A	16,157	88.14	1,424,077.98
MARTIN MARIETTA MATERIALS	2,795	222.68	622,390.60
MONSANTO CO	20,136	105.58	2,125,958.88
MOSAIC CO/THE	14,768	27.77	410,107.36
NEWMONT MINING CORP	23,842	31.78	757,698.76
NUCOR CORP	15,086	60.53	913,155.58
PACKAGING CORP OF AMERICA	4,571	86.75	396,534.25
PPG INDUSTRIES INC	12,675	96.22	1,219,588.50
PRAXAIR INC	13,484	123.00	1,658,532.00
SEALED AIR CORP	9,368	47.12	441,420.16
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	3,615	268.88	972,001.20
VALSPAR CORP/THE	3,700	103.64	383,468.00
VULCAN MATERIALS CO	6,171	124.18	766,314.78
WESTROCK CO	11,172	52.31	584,407.32

WR GRACE & CO	3,500	66.90	234,150.00
3M COMPANY	28,031	178.16	4,994,002.96
ACUITY BRANDS INC	1,995	245.57	489,912.15
AERCAP HOLDINGS NV	7,588	42.47	322,262.36
AGCO CORP	3,447	58.14	200,408.58
AMETEK INC	10,549	49.14	518,377.86
BE AEROSPACE INC	4,292	60.00	257,520.00
BOEING CO	27,459	156.18	4,288,546.62
CATERPILLAR INC	27,447	92.71	2,544,611.37
CUMMINS INC	7,713	137.41	1,059,843.33
DANAHER CORP	29,137	78.61	2,290,459.57
DEERE & CO	12,403	102.25	1,268,206.75
DOVER CORP	7,500	75.67	567,525.00
EATON CORP PLC	20,785	67.82	1,409,638.70
EMERSON ELECTRIC CO	30,395	56.31	1,711,542.45
FASTENAL COMPANY	13,131	48.02	630,550.62
FLOWSERVE CORPORATION	6,212	48.49	301,219.88
FLUOR CORP	6,997	54.17	379,027.49
FORTIVE CORP	14,484	54.96	796,040.64
GENERAL DYNAMICS CORP	11,939	174.63	2,084,907.57
GENERAL ELECTRIC CO	417,116	31.92	13,314,342.72
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	33,472	117.29	3,925,930.88
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES	2,195	184.21	404,340.95
ILLINOIS TOOL WORKS	14,671	125.96	1,847,959.16
INGERSOLL-RAND PLC	12,263	76.96	943,760.48
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	5,610	58.74	329,531.40
JARDINE MATHESON HOLDINGS LIMITED	11,400	54.00	615,600.00
L-3 COMMUNICATIONS HLDGS INC	3,735	155.25	579,858.75
LOCKHEED MARTIN CORPORATION	12,204	252.18	3,077,604.72
MASCO CORP	15,275	32.40	494,910.00
MIDDLEBY CORP	2,766	133.91	370,395.06
NORTHROP GRUMMAN CORP	7,939	233.54	1,854,074.06
PACCAR INC	15,913	65.21	1,037,686.73
PARKER HANNIFIN CORPORATION	6,158	142.82	879,485.56
PENTAIR PLC-REGISTERED	8,019	57.15	458,285.85
RAYTHEON COMPANY	13,819	142.98	1,975,840.62
ROCKWELL AUTOMATION INC	6,156	134.83	830,013.48
ROCKWELL COLLINS INC.	6,171	93.99	580,012.29
ROPER TECHNOLOGIES INC	4,691	184.43	865,161.13
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	8,113	40.54	328,901.02
SNAP-ON INC	2,746	172.30	473,135.80
STANLEY BLACK & DECKER INC	7,063	117.44	829,478.72

TEXTRON INC	13,079	48.34	632,238.86
TRANSDIGM GROUP INC	2,545	251.09	639,024.05
UNITED RENTALS INC	4,142	106.27	440,170.34
UNITED TECHNOLOGIES CORP	36,826	110.82	4,081,057.32
WABTEC CORP	4,643	80.03	371,579.29
WW GRAINGER INC	2,690	236.93	637,341.70
XYLEM INC	8,801	50.76	446,738.76
CINTAS CORP	4,008	120.15	481,561.20
DUN & BRADSTREET CORP	1,471	120.45	177,181.95
EQUIFAX INC	5,318	116.02	616,994.36
IHS MARKIT LTD	16,894	34.58	584,194.52
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	44,242	42.31	1,871,879.02
MANPOWERGROUP	3,518	91.03	320,243.54
NIELSEN HOLDINGS PLC	16,300	43.29	705,627.00
REPUBLIC SERVICES INC	10,686	57.41	613,483.26
ROBERT HALF INTL INC	6,506	48.98	318,663.88
STERICYCLE, INC.	3,750	77.12	289,200.00
VERISK ANALYTICS INC	7,324	82.11	601,373.64
WASTE CONNECTIONS INC	8,311	77.92	647,593.12
WASTE MANAGEMENT INC	20,589	71.09	1,463,672.01
AMERCO	390	372.98	145,462.20
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	6,369	48.58	309,406.02
C.H.ROBINSON WORLDWIDE, INC.	6,364	74.62	474,881.68
CSX CORPORATION	43,340	36.23	1,570,208.20
DELTA AIR LINES INC	8,821	50.42	444,754.82
EXPEDITORS INTL WASH INC	8,693	54.41	472,986.13
FEDEX CORP	11,833	197.62	2,338,437.46
J.B. HUNT TRANSPORT SERVICES INC	4,585	97.86	448,688.10
KANSAS CITY SOUTHERN	5,231	86.46	452,272.26
MACQUARIE INFRASTRUCTURE CORP	3,723	81.99	305,248.77
NORFOLK SOUTHERN CORP	13,426	106.93	1,435,642.18
SOUTHWEST AIRLINES	7,984	50.35	401,994.40
UNION PACIFIC CORP	38,574	103.40	3,988,551.60
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS INC	3,971	74.48	295,760.08
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	32,001	116.98	3,743,476.98
AUTOLIV INC	3,884	108.74	422,346.16
BORGWARNER INC	10,148	39.85	404,397.80
DELPHI AUTOMOTIVE PLC	13,056	67.68	883,630.08
FORD MOTOR COMPANY	170,640	12.66	2,160,302.40
GENERAL MOTORS CO	65,564	36.40	2,386,529.60
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	12,804	32.03	410,112.12
HARLEY-DAVIDSON INC	8,019	59.23	474,965.37

LEAR CORP	3,122	135.69	423,624.18
MOBILEYE NV	8,784	34.89	306,473.76
TESLA MOTORS INC	6,187	202.73	1,254,290.51
WABCO HOLDINGS INC	2,607	108.42	282,650.94
COACH INC	12,806	35.28	451,795.68
D.R.HORTON INC	15,704	28.02	440,026.08
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY	7,453	55.15	411,032.95
GARMIN LTD	5,408	49.39	267,101.12
HANESBRANDS INC	17,612	21.66	381,475.92
HARMAN INTERNATIONAL	3,248	110.66	359,423.68
HASBRO INC	5,206	79.82	415,542.92
LEGGETT & PLATT INC	5,956	49.94	297,442.64
LENNAR CORP-CL A	8,789	43.40	381,442.60
LULULEMON ATHLETICA INC	5,461	66.70	364,248.70
MATTEL INC	15,850	28.36	449,506.00
MICHAEL KORS HOLDINGS LIMITED	7,614	44.85	341,487.90
MOHAWK INDUSTRIES INC	2,796	199.61	558,109.56
NEWELL BRANDS INC	19,972	45.70	912,720.40
NIKE INC -CL B	62,357	50.85	3,170,853.45
POLARIS INDUSTRIES INC	3,113	83.01	258,410.13
PULTE GROUP INC	16,248	18.91	307,249.68
PVH CORP	3,849	91.71	352,991.79
RALPH LAUREN CORPORATION	2,738	93.24	255,291.12
SMITH(A.O.) CORP	6,800	48.65	330,820.00
TOLL BROTHERS INC	7,285	31.74	231,225.90
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	8,351	30.11	251,448.61
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	8,410	25.37	213,361.70
VF CORP	15,651	53.67	839,989.17
WHIRLPOOL CORP	3,356	174.57	585,856.92
ARAMARK	11,861	36.15	428,775.15
CARNIVAL CORP	16,458	51.32	844,624.56
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	1,451	389.50	565,164.50
DARDEN RESTAURANTS INC	5,517	75.68	417,526.56
DOMINO'S PIZZA INC	2,400	161.23	386,952.00
H&R BLOCK INC	10,337	23.20	239,818.40
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS INC	28,550	27.70	790,835.00
LAS VEGAS SANDS CORP	20,658	54.70	1,129,992.60
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	15,083	84.86	1,279,943.38
MCDONALD'S CORPORATION	39,574	122.99	4,867,206.26
MELCO CROWN ENTERTAINME-ADR	8,207	15.49	127,126.43
MGM MIRAGE	20,139	28.59	575,774.01
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDINGS	7,708	43.06	331,906.48

ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	7,877	82.55	650,246.35
STARBUCKS CORP	67,925	57.65	3,915,876.25
WYNDHAM WORLDWIDE CORP	5,415	77.48	419,554.20
WYNN RESORTS LTD	3,642	90.12	328,217.04
YUM! BRANDS INC	17,806	64.04	1,140,296.24
CBS CORP-CL B	18,528	64.34	1,192,091.52
CHARTER COMMUNICATTIONS INC-A	10,011	288.91	2,892,278.01
COMCAST CORP-CL A	111,657	70.15	7,832,738.55
DISCOVERY COMMUNICATIONS INC-A	6,972	28.17	196,401.24
DISCOVERY COMMUNICATIONS INC-C	11,289	27.39	309,205.71
DISH NETWORK CORP.	10,483	58.07	608,747.81
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	18,385	23.87	438,849.95
LIBERTY BROADBAND-C	4,608	74.36	342,650.88
LIBERTY GLOBAL PLC-A	12,074	30.33	366,204.42
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	29,127	29.36	855,168.72
LIBERTY LILAC GROUP-C	5,259	21.39	112,516.30
LIBERTY SIRIUS GROUP-C	9,534	34.22	326,253.48
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-A	3,927	34.69	136,227.63
NEWS CORP-CLASS A	15,889	11.73	186,377.97
OMNICOM GROUP	11,397	85.88	978,774.36
SCRIPPS NETWORKS INTERACTIVE	3,392	70.75	239,984.00
SIRIUS XM HOLDINGS INC	82,075	4.53	371,799.75
TEGNA INC	10,189	22.05	224,667.45
THE WALT DISNEY CO.	70,944	105.30	7,470,403.20
TIME WARNER INC	36,631	95.08	3,482,875.48
TWENTY-FIRST CE CL-A	48,606	28.12	1,366,800.72
TWENTY-FIRST CE CL-B	20,085	27.63	554,948.55
VIACOM INC-CLASS B	16,362	34.49	564,325.38
ADVANCE AUTO PARTS	3,481	173.82	605,067.42
AMAZON.COM INC	18,760	766.00	14,370,160.00
AUTONATION INC	3,089	48.60	150,125.40
AUTOZONE INC	1,411	798.69	1,126,951.59
BED BATH & BEYOND INC	6,627	47.09	312,065.43
BEST BUY COMPANY INC	13,895	46.56	646,951.20
CARMAX INC	8,630	62.36	538,166.80
DICK'S SPORTING GOODS INC	4,201	57.36	240,969.36
DOLLAR GENERAL CORP	12,763	75.95	969,349.85
DOLLAR TREE INC	11,142	84.27	938,936.34
EXPEDIA INC	5,769	116.22	670,473.18
FOOT LOCKER INC	6,434	75.33	484,673.22
GAP INC/THE	11,563	23.93	276,702.59
GENUINE PARTS CO	7,329	98.56	722,346.24

HOME DEPOT INC	57,426	135.44	7,777,777.44
KOHL'S CORP	9,070	52.08	472,365.60
L BRANDS INC	11,410	69.20	789,572.00
LIBERTY INTERACTIVE CORP QVC GROUP-A	21,340	20.02	427,226.80
LKQ CORPORATION	13,914	31.99	445,108.86
LOWE'S COMPANIES INC	41,459	72.92	3,023,190.28
MACY'S INC	14,660	37.00	542,420.00
NETFLIX INC	20,129	125.45	2,525,183.05
NORDSTROM INC	6,499	50.84	330,409.16
O'REILLY AUTOMOTIVE INC NEW	4,406	283.11	1,247,382.66
PRICELINE GROUP INC/THE	2,328	1,488.83	3,465,996.24
ROSS STORES INC	19,002	68.41	1,299,926.82
SIGNET JEWELERS LTD	3,437	94.41	324,487.17
STAPLES INC	31,615	9.77	308,878.55
TARGET CORP	25,103	77.04	1,933,935.12
TIFFANY & CO	6,182	79.94	494,189.08
TJX COMPANIES INC	30,259	76.94	2,328,127.46
TRACTOR SUPPLY COMPANY	6,118	76.52	468,149.36
TRIPADVISOR INC-W/I	5,824	46.45	270,524.80
ULTA SALON COSMETICS & FRAGRANCE INC	2,699	259.97	701,659.03
COSTCO WHOLESALE CORP	20,254	163.46	3,310,718.84
CVS HEALTH CORPORATION	49,373	79.93	3,946,383.89
KROGER CO	42,019	35.88	1,507,641.72
RITE AID CORP	48,792	8.17	398,630.64
SYSCO CORP	24,082	56.61	1,363,282.02
WAL-MART STORES INC	71,745	71.58	5,135,507.10
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	43,349	86.06	3,730,614.94
WHOLE FOODS MARKET INC	15,915	32.44	516,282.60
ALTRIA GROUP INC	90,708	67.76	6,146,374.08
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	27,896	46.07	1,285,168.72
BROWN-FORMAN CORPORATION	9,214	45.45	418,776.30
BUNGE LIMITED	6,595	71.54	471,806.30
CAMPBELL SOUP CO	9,076	59.82	542,926.32
COCA-COLA CO/THE	190,572	41.67	7,941,135.24
CONAGRA BRANDS INC	20,309	38.36	779,053.24
CONSTELLATION BRANDS INC-A	8,079	156.77	1,266,544.83
DR.PEPPER SNAPPLE GROUP, INC	8,846	90.35	799,236.10
GENERAL MILLS INC	27,510	63.06	1,734,780.60
HORMEL FOODS CORPORATION	13,718	34.78	477,112.04
INGREDION INC	3,604	125.30	451,581.20
JM SMUCKER CO/THE-NEW COM	5,536	129.39	716,303.04
KELLOGG CO	12,445	72.92	907,489.40

KRAFT HEINZ COMPANY	28,059	86.60	2,429,909.40
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	5,445	92.63	504,370.35
MEAD JOHNSON NUTRITION COMPANY	9,062	72.29	655,091.98
MOLSON COORS BREWING COMPANY	9,009	97.59	879,188.31
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	73,181	44.59	3,263,140.79
MONSTER BEVERAGE CORPORATION	18,966	43.87	832,038.42
PEPSICO INC	66,859	105.41	7,047,607.19
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL INC.	72,050	91.46	6,589,693.00
REYNOLDS AMERICAN INC	40,147	55.97	2,247,027.59
THE HERSHEY COMPANY	6,673	101.46	677,042.58
TYSON FOODS INC-CL A	13,986	62.33	871,747.38
WHITEWAVE FOODS CO	8,917	55.46	494,536.82
CHURCH & DWIGHT CO INC	11,966	44.63	534,042.58
CLOROX COMPANY	6,144	118.96	730,890.24
COLGATE-PALMOLIVE COMPANY	39,071	66.06	2,581,030.26
COTY INC-CL A	23,008	18.76	431,630.08
EDGEWELL PERSONAL CARE CO	2,963	75.43	223,499.09
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	10,328	76.28	787,819.84
KIMBERLY-CLARK CORP	17,041	114.87	1,957,499.67
PROCTER & GAMBLE CO	118,934	84.71	10,074,899.14
SPECTRUM BRANDS HOLDINGS INC	1,045	120.65	126,079.25
ABBOTT LABORATORIES	67,831	38.34	2,600,640.54
AETNA INC	16,137	124.10	2,002,601.70
ALIGN TECHNOLOGY INC	3,237	100.25	324,509.25
AMERISOURCEBERGEN CORP	9,041	78.42	708,995.22
ANTHEM INC	12,488	144.88	1,809,261.44
BARD(C.R.) INC	3,414	220.33	752,206.62
BAXTER INTERNATIONAL INC	23,410	44.64	1,045,022.40
BECTON DICKINSON & CO	10,045	166.74	1,674,903.30
BOSTON SCIENTIFIC CORP	64,418	21.47	1,383,054.46
CARDINAL HEALTH INC	15,363	73.70	1,132,253.10
CENTENE CORP	8,130	56.20	456,906.00
CERNER CORP	14,446	48.69	703,375.74
CIGNA CORP	11,972	138.09	1,653,213.48
COOPER COMPANIES INC (THE)	2,282	175.07	399,509.74
DAVITA INC	7,918	65.19	516,174.42
DENTSPLY SIRONA INC	10,774	59.68	642,992.32
DEXCOM INC	4,033	63.51	256,135.83
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	10,124	91.48	926,143.52
ENVISION HEALTHCARE CORP	5,640	65.30	368,292.00
EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO	28,990	69.24	2,007,267.60
HCA HOLDINGS, INC.	14,562	73.50	1,070,307.00

HENRY SCHEIN INC	3,867	152.03	587,900.01
HOLOGIC INC	11,890	40.08	476,551.20
HUMANA INC.	7,085	200.41	1,419,904.85
IDEXX LABORATORIES INC	3,936	119.03	468,502.08
INTUITIVE SURGICAL INC	1,851	637.91	1,180,771.41
LABORATORY CRP OF AMR HLDGS	4,739	127.82	605,738.98
MALLINCKRODT PLC	5,503	53.38	293,750.14
MCKESSON CORP	10,683	141.56	1,512,285.48
MEDNAX INC	4,300	65.78	282,854.00
MEDTRONIC PLC	64,613	73.10	4,723,210.30
PATTERSON COS INC	4,102	40.30	165,310.60
QUEST DIAGNOSTICS	6,376	92.38	589,014.88
QUINTILES IMS HOLDINGS INC	6,511	76.68	499,263.48
RESMED INC	6,797	62.30	423,453.10
ST JUDE MEDICAL INC	13,313	79.79	1,062,244.27
STRYKER CORP	15,742	118.81	1,870,307.02
TELEFLEX INC	2,117	160.12	338,974.04
TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES-SP ADR	42,182	36.57	1,542,595.74
UNITEDHEALTH GROUP INC	44,248	161.54	7,147,821.92
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	4,394	106.64	468,576.16
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	4,743	91.11	432,134.73
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	9,056	102.86	931,500.16
ABBVIE INC	75,502	62.22	4,697,734.44
AGILENT TECHNOLOGIES INC	14,561	45.43	661,506.23
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	10,499	114.56	1,202,765.44
ALKERMES PLC	6,546	55.97	366,379.62
ALLERGAN PLC	18,321	192.55	3,527,708.55
AMGEN INC	34,716	147.74	5,128,941.84
BIOGEN INC	10,121	278.77	2,821,431.17
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	8,210	84.38	692,759.80
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	77,451	59.42	4,602,138.42
CELGENE CORP	35,909	115.73	4,155,748.57
ELI LILLY & CO	45,918	73.42	3,371,299.56
ENDO INTERNATIONAL PLC	10,390	16.03	166,551.70
GILEAD SCIENCES INC	61,180	74.40	4,551,792.00
ILLUMINA INC	6,609	129.65	856,856.85
INCYTE CORP	7,807	100.79	786,867.53
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	2,928	107.12	313,647.36
JOHNSON & JOHNSON	127,375	116.02	14,778,047.50
MERCK & CO. INC.	128,527	61.14	7,858,140.78
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL INC	1,322	421.25	556,892.50
MYLAN NV	21,654	37.49	811,808.46

PERRIGO CO PLC	6,780	84.55	573,249.00
PFIZER INC	282,078	32.83	9,260,620.74
REGENERON PHARMACEUTICALS	3,602	371.75	1,339,043.50
SEATTLE GENETICS INC	4,762	61.33	292,053.46
TARO PHARMACEUTICAL INDUSTRIES	891	105.88	94,339.08
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	18,519	141.25	2,615,808.75
UNITED THERAPEUTICS CORP	2,212	143.24	316,846.88
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	11,571	76.30	882,867.30
WATERS CORP	4,006	136.13	545,336.78
ZOETIS INC	22,514	52.39	1,179,508.46
BANK OF AMERICA CORP	474,771	22.48	10,672,852.08
BB & T CORPORATION	38,502	46.86	1,804,203.72
CIT GROUP INC	10,293	42.88	441,363.84
CITIGROUP INC	135,048	59.66	8,056,963.68
CITIZENS FINANCIAL GROUP	24,353	35.37	861,365.61
COMERICA INC	8,610	67.89	584,532.90
FIFTH THIRD BANCORP	36,500	27.23	993,895.00
FIRST REPUBLIC BANK/CA	6,664	90.11	600,493.04
HUNTINGTON BANCSHARES INC	49,334	13.09	645,782.06
JPMORGAN CHASE & CO	168,159	85.43	14,365,823.37
KEYCORP	49,798	18.17	904,829.66
M & T BANK CORP	6,393	154.18	985,672.74
NEW YORK COMMUNITY BANCORP	21,566	17.30	373,091.80
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL INC	15,218	19.27	293,250.86
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	23,080	115.80	2,672,664.00
REGIONS FINANCIAL CORPORATION	60,408	14.28	862,626.24
SIGNATURE BANK	2,567	146.67	376,501.89
SUNTRUST BANKS INC	23,766	55.32	1,314,735.12
US BANCORP	79,284	51.87	4,112,461.08
WELLS FARGO & COMPANY	223,074	55.22	12,318,146.28
AFFILIATED MANAGERS GROUP	2,457	146.25	359,336.25
ALLY FINANCIAL INC	20,464	19.67	402,526.88
AMERICAN EXPRESS COMPANY	36,240	74.55	2,701,692.00
AMERIPRISE FINANCIAL INC	7,275	111.41	810,507.75
BANK OF NEW YORK MELLON CORP(THE)	49,206	47.28	2,326,459.68
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	56,659	165.35	9,368,565.65
BLACKROCK INC	5,784	389.77	2,254,429.68
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	23,284	90.04	2,096,491.36
CME GROUP INC.	16,077	122.41	1,967,985.57
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	18,424	72.18	1,329,844.32
E*TRADE FINANCIAL CORPORATION	13,758	34.79	478,640.82
EATON VANCE CORP	5,530	41.57	229,882.10

FIRST DATA CORP-CLASS A	14,774	14.66	216,586.84
FRANKLIN RESOURCES INC	17,532	39.77	697,247.64
GOLDMAN SACHS GROUP INC	16,903	239.07	4,041,000.21
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	27,801	57.66	1,603,005.66
INVESCO LIMITED	18,577	31.40	583,317.80
LEUCADIA NATIONAL CORPORATION	15,223	23.38	355,913.74
MOODY'S CORP	7,778	95.92	746,065.76
MORGAN STANLEY	67,414	42.83	2,887,341.62
MSCI INC-A	4,421	80.25	354,785.25
NASDAQ INC	5,692	67.70	385,348.40
NAVIENT CORPORATION	15,911	16.69	265,554.59
NORTHERN TRUST CORP	9,716	88.67	861,517.72
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	5,579	71.52	399,010.08
S&P GLOBAL INC	12,498	112.60	1,407,274.80
SCHWAB (CHARLES) CORP	55,809	38.75	2,162,598.75
SEI INVESTMENTS COMPANY	7,092	48.65	345,025.80
STATE STREET CORP	18,158	78.32	1,422,134.56
SYNCHRONY FINANCIAL	38,100	36.90	1,405,890.00
T ROWE PRICE GROUP INC	11,704	76.63	896,877.52
TD AMERITRADE HOLDING CORPORATION	11,968	43.84	524,677.12
AFLAC INC	19,032	69.79	1,328,243.28
ALLEGHANY CORPORATION	770	613.31	472,248.70
ALLSTATE CORP	17,304	74.37	1,286,898.48
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	49,509	66.54	3,294,328.86
AON PLC	12,577	112.33	1,412,774.41
ARCH CAPITAL GROUP LTD.	5,875	87.10	511,712.50
ARTHUR J GALLAGHER & CO	8,087	51.67	417,855.29
ASSURANT INC	2,496	92.41	230,655.36
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	4,260	65.16	277,581.60
CHUBB LTD	21,867	133.24	2,913,559.08
CINCINNATI FINANCIAL CORP	7,722	76.46	590,424.12
EVEREST RE GROUP LTD	1,821	218.38	397,669.98
FNF GROUP	11,145	34.34	382,719.30
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	17,403	47.83	832,385.49
LINCOLN NATIONAL CORP	11,366	66.67	757,771.22
LOEWS CORPORATION	13,343	47.43	632,858.49
MARKEL CORP	630	896.34	564,694.20
MARSH & MCLENNAN COS	24,229	68.68	1,664,047.72
METLIFE INC	43,846	53.92	2,364,176.32
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	13,370	57.84	773,320.80
PROGRESSIVE CORP	27,420	35.69	978,619.80
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	20,108	105.91	2,129,638.28

REINSURANCE GROUP OF AMERICA	2,843	127.00	361,061.00
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	2,159	134.35	290,061.65
TORCHMARK CORPORATION	5,751	74.34	427,529.34
TRAVELERS COS INC(THE)	13,209	121.75	1,608,195.75
UNUM GROUP	11,114	43.74	486,126.36
VOYA FINANCIAL INC	10,075	39.97	402,697.75
W.R.BERKLEY CORPORATION	4,740	66.11	313,361.40
WILLIS TOWERS WATSON PLC	6,260	123.63	773,923.80
XL GROUP LTD	13,694	37.07	507,636.58
CBRE GROUP INC-A	14,256	31.80	453,340.80
CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP	15,977	87.26	1,394,153.02
EQUINIX INC	3,375	354.49	1,196,403.75
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	50,300	6.13	308,339.00
JONES LANG LASALLE INC	2,108	100.96	212,823.68
WEYERHAEUSER CO	35,468	30.47	1,080,709.96
ACCENTURE PLC-CL A	29,326	123.65	3,626,159.90
ACTIVISION BLIZZARD INC	27,157	36.63	994,760.91
ADOBE SYSTEMS INC	23,383	105.29	2,461,996.07
AKAMAI TECHNOLOGIES	8,580	67.76	581,380.80
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	2,793	230.96	645,071.28
ALPHABET INC-CL A	13,719	812.50	11,146,687.50
ALPHABET INC-CL C	14,390	794.20	11,428,538.00
ANSYS INC	4,110	95.31	391,724.10
AUTODESK INC	9,122	75.70	690,535.40
AUTOMATIC DATA PROCESSING	20,985	101.09	2,121,373.65
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS	5,598	65.89	368,852.22
CA INC	14,472	32.72	473,523.84
CADENCE DESIGN SYS INC	14,296	25.69	367,264.24
CDK GLOBAL INC	6,408	60.55	388,004.40
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES	5,890	85.38	502,888.20
CITRIX SYSTEMS INC	7,141	91.45	653,044.45
COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS CORPORATION	28,634	56.69	1,623,261.46
COMPUTER SCIENCES CORP	6,751	60.92	411,270.92
COSTAR GROUP INC	1,567	189.63	297,150.21
EBAY INC	49,068	29.38	1,441,617.84
ELECTRONIC ARTS INC	14,215	79.50	1,130,092.50
FACEBOOK INC-A	108,124	119.24	12,892,705.76
FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES	14,536	76.08	1,105,898.88
FISERV INC	10,486	107.35	1,125,672.10
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	4,363	142.96	623,734.48
FORTINET INC	6,500	29.79	193,635.00
GARTNER INC	4,207	104.39	439,168.73

GLOBAL PAYMENTS INC	7,270	70.78	514,570.60
INTL BUSINESS MACHINES CORP	42,189	166.68	7,032,062.52
INTUIT INC	11,493	118.15	1,357,897.95
MASTERCARD INC-CL A	44,957	103.54	4,654,847.78
MERCADOLIBRE INC	1,911	153.08	292,535.88
MICROSOFT CORP	344,876	63.62	21,941,011.12
NUANCE COMMUNICATIONS INC	11,121	15.06	167,482.26
ORACLE CORPORATION	143,536	38.90	5,583,550.40
PAYCHEX INC	15,132	61.55	931,374.60
PAYPAL HOLDINGS INC	50,849	39.44	2,005,484.56
RED HAT INC	8,084	80.47	650,519.48
SABRE CORP	9,700	25.50	247,350.00
SALESFORCE.COM, INC.	30,557	69.51	2,124,017.07
SERVICENOW INC	7,574	77.50	586,985.00
SPLUNK INC	5,933	54.77	324,950.41
SYMANTEC CORPORATION	30,261	24.22	732,921.42
SYNOPSYS INC	7,563	60.37	456,578.31
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	7,323	50.11	366,955.53
TWITTER INC	25,955	18.24	473,419.20
VANTIV INC-CL A	7,696	58.84	452,832.64
VERISIGN INC	4,574	78.09	357,183.66
VISA INC	87,636	78.10	6,844,371.60
VMWARE INC	3,826	81.38	311,359.88
WESTERN UNION COMPANY	21,415	21.62	462,992.30
WORKDAY INC-CLASS A	6,010	69.13	415,471.30
XEROX CORP	42,168	9.13	384,993.84
YAHOO! INC	42,942	38.42	1,649,831.64
ZILLOW GROUP INC-C	5,184	38.13	197,665.92
AMPHENOL CORPORATION -CL A	14,435	68.00	981,580.00
APPLE INC	251,114	116.64	29,289,936.96
ARROW ELECTRONICS INC	4,041	72.00	290,952.00
AVNET INC	6,544	48.37	316,533.28
CDW CORP/DE	6,500	52.88	343,720.00
CISCO SYSTEMS INC	233,684	30.75	7,185,783.00
CORNING INC	49,847	24.36	1,214,272.92
DELL TECHNOLOGIES INC-CL V	10,446	56.39	589,049.94
F5 NETWORKS INC	3,338	145.15	484,510.70
FLEX LTD	27,993	14.53	406,738.29
FLIR SYSTEMS INC	7,048	36.16	254,855.68
HARRIS CORP	5,694	104.35	594,168.90
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE C	76,313	23.73	1,810,907.49
HP INC	81,338	15.12	1,229,830.56

JUNIPER NETWORKS INC	15,583	28.54	444,738.82
MOTOROLA SOLUTIONS INC	7,104	83.93	596,238.72
NETAPP INC	13,593	36.74	499,406.82
PALO ALTO NETWORKS INC	4,174	128.44	536,108.56
QORVO INC	6,646	55.45	368,520.70
QUALCOMM INC	68,317	67.02	4,578,605.34
SEAGATE TECHNOLOGY	14,132	38.71	547,049.72
SKYWORKS SOLUTIONS INC	8,902	77.44	689,370.88
TE CONNECTIVITY LTD	16,178	70.44	1,139,578.32
TRIMBLE INC	11,191	30.58	342,220.78
WESTERN DIGITAL CORP	13,047	68.36	891,892.92
AT&T INC	286,801	42.12	12,080,058.12
CENTURYLINK INC	26,370	24.19	637,890.30
FRONTIER COMMUNICATIONS CORPORATION	55,620	3.57	198,563.40
LEVEL 3 COMMUNICATIONS INC	14,158	56.70	802,758.60
SBA COMMUNICATIONS CORP-CL A	6,014	104.73	629,846.22
SPRINT CORP	39,845	8.44	336,291.80
T-MOBILE US INC	12,923	57.80	746,949.40
VERIZON COMMUNICATIONS INC	189,597	52.91	10,031,577.27
ZAYO GROUP HOLDINGS INC	6,750	32.91	222,142.50
AES CORPORATION	29,997	11.84	355,164.48
ALLIANT ENERGY CORP	11,683	37.77	441,266.91
AMEREN CORPORATION	11,406	51.89	591,857.34
AMERICAN ELECTRIC POWER	22,471	62.94	1,414,324.74
AMERICAN WATER WORKS CO INC	8,493	73.31	622,621.83
ATMOS ENERGY CORP	4,610	74.11	341,647.10
CALPINE CORP	16,738	11.67	195,332.46
CENTERPOINT ENERGY INC	20,704	24.46	506,419.84
CMS ENERGY CORPORATION	12,571	41.89	526,599.19
CONSOLIDATED EDISON INC	13,796	73.04	1,007,659.84
DOMINION RESOURCES INC/VA	29,429	76.51	2,251,612.79
DTE ENERGY COMPANY	8,619	98.28	847,075.32
DUKE ENERGY CORP	31,760	77.13	2,449,648.80
EDISON INTERNATIONAL	15,621	71.61	1,118,619.81
ENTERGY CORP	8,476	73.18	620,273.68
EVERSOURCE ENERGY	15,201	55.07	837,119.07
EXELON CORP	42,230	35.75	1,509,722.50
FIRSTENERGY CORP	19,917	31.65	630,373.05
NEXTERA ENERGY INC	21,694	119.22	2,586,358.68
NISOURCE INC	15,500	22.33	346,115.00
OGE ENERGY CORP	9,238	33.77	311,967.26
P G & E CORPORATION	23,027	60.82	1,400,502.14

	PINNACLE WEST CAPITAL CORPORATION	4,942	77.10	381,028.20
	PPL CORPORATION	31,707	34.58	1,096,428.06
	PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	24,048	43.67	1,050,176.16
	SCANA CORP	6,092	74.25	452,331.00
	SEMPRA ENERGY	11,320	103.52	1,171,846.40
	SOUTHERN CO	45,061	49.09	2,212,044.49
	UGI CORPORATION	8,000	45.12	360,960.00
	WEC ENERGY GROUP INC	14,509	58.16	843,843.44
	WESTAR ENERGY INC	6,600	56.31	371,646.00
	XCEL ENERGY INC	23,389	40.76	953,335.64
	ANALOG DEVICES INC	14,416	72.81	1,049,628.96
	APPLIED MATERIALS INC	49,526	32.44	1,606,623.44
	BROADCOM LTD	18,288	180.46	3,300,252.48
	INTEL CORP	219,487	36.89	8,096,875.43
	KLA-TENCOR CORPORATION	7,639	79.37	606,307.43
	LAM RESEARCH CORP	7,797	106.99	834,201.03
	LINEAR TECHNOLOGY CORP	11,183	62.28	696,477.24
	MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	18,250	14.20	259,150.00
	MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	13,285	39.06	518,912.10
	MICROCHIP TECHNOLOGY INC	10,039	65.01	652,635.39
	MICRON TECHNOLOGY INC	47,001	20.35	956,470.35
	NVIDIA CORP	25,102	101.63	2,551,116.26
	NXP SEMICONDUCTORS NV	13,487	97.13	1,309,992.31
	TEXAS INSTRUMENTS INC	46,401	73.57	3,413,721.57
	XILINX INC	11,585	58.61	678,996.85
	米ドル 小計	14,523,887		934,048,065.55 (109,451,752,321)
カナダドル	ALTAGAS LTD	6,948	34.16	237,343.68
	ARC RESOURCES LTD	16,083	23.28	374,412.24
	CAMECO CORP	19,538	14.22	277,830.36
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	50,543	44.39	2,243,603.77
	CENOVUS ENERGY INC	39,619	21.26	842,299.94
	CRESCENT POINT ENERGY CORP	23,181	19.00	440,439.00
	ENBRIDGE INC	43,677	57.09	2,493,519.93
	ENCANA CORP	43,689	16.65	727,421.85
	HUSKY ENERGY INC	15,674	16.65	260,972.10
	IMPERIAL OIL LTD	13,562	47.71	647,043.02
	INTER PIPELINE LTD	17,300	29.71	513,983.00
	KEYERA CORP	9,876	40.75	402,447.00
	PEMBINA PIPELINE CORP	18,567	42.10	781,670.70
	PEYTO EXPLORATION & DEV CORP	8,811	34.06	300,102.66
	PRAIRIESKY ROYALTY LTD	10,923	31.96	349,099.08

SEVEN GENERATIONS ENERGY-A	10,493	29.98	314,580.14
SUNCOR ENERGY INC	76,788	43.82	3,364,850.16
TOURMALINE OIL CORP	9,911	35.56	352,435.16
TRANSCANADA CORP	40,153	61.68	2,476,637.04
VERESEN INC	13,299	12.36	164,375.64
VERMILION ENERGY INC	5,586	58.13	324,714.18
AGNICO EAGLE MINES LIMITED	11,020	51.18	564,003.60
AGRIUM INC	5,976	132.55	792,118.80
BARRICK GOLD CORP	52,415	19.10	1,001,126.50
CCL INDUSTRIES INC-CL B	1,385	226.82	314,145.70
ELDORADO GOLD CORPORATION	41,255	3.80	156,769.00
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	32,770	13.85	453,864.50
FRANCO-NEVADA CORPORATION	8,418	76.73	645,913.14
GOLDCORP INC	38,350	16.57	635,459.50
KINROSS GOLD CORP	51,579	4.04	208,379.16
METHANEX CORPORATION	3,622	60.95	220,760.90
POTASH CORP OF SASKATCHEWAN	37,612	23.94	900,431.28
SILVER WHEATON CORPORATION	21,986	23.50	516,671.00
TECK RESOURCES LIMITED-CL B	27,750	27.58	765,345.00
TURQUOISE HILL RESOURCES LTD	45,107	4.39	198,019.73
WEST FRASER TIMBER CO LTD	2,873	48.99	140,748.27
YAMANA GOLD INC	51,365	3.42	175,668.30
BOMBARDIER INC 'B'	80,493	2.19	176,279.67
CAE INC	13,932	18.81	262,060.92
FINNING INTERNATIONAL INC	7,972	26.39	210,381.08
SNC-LAVALIN GROUP INC	6,787	56.99	386,791.13
CANADIAN NATL RAILWAY CO	36,579	90.00	3,292,110.00
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	6,343	193.23	1,225,657.89
LINAMAR CORP	2,200	58.65	129,030.00
MAGNA INTERNATIONAL INC	18,569	59.98	1,113,768.62
GILDAN ACTIVEWEAR INC	9,440	35.35	333,704.00
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	10,229	64.41	658,849.89
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	18,516	27.04	500,672.64
THOMSON REUTERS CORP	16,217	59.24	960,695.08
CANADIAN TIRE CORP -CL A	3,288	140.27	461,207.76
DOLLARAMA INC	5,395	99.25	535,453.75
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC-B	18,984	62.53	1,187,069.52
EMPIRE CO LTD A	7,235	15.30	110,695.50
JEAN COUTU GROUP INC A	2,801	21.40	59,941.40
LOBLAW COMPANIES LTD	10,287	70.72	727,496.64
METRO INC	11,599	40.23	466,627.77
WESTON (GEORGE) LTD	2,473	113.73	281,254.29

	SAPUTO INC	12,976	46.75	606,628.00
	VALEANT PHARMACEUTICALS INTERN	15,376	19.48	299,524.48
	BANK OF MONTREAL	30,218	96.62	2,919,663.16
	BANK OF NOVA SCOTIA	55,626	76.04	4,229,801.04
	CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	18,419	111.19	2,048,008.61
	NATIONAL BANK OF CANADA	15,972	55.61	888,202.92
	ROYAL BANK OF CANADA	68,942	91.79	6,328,186.18
	TORONTO-DOMINION BANK	85,951	66.71	5,733,791.21
	CI FINANCIAL CORP	10,961	28.81	315,786.41
	ELEMENT FLEET MANAGEMENT CORP	19,611	12.75	250,040.25
	IGM FINANCIAL INC	5,296	39.20	207,603.20
	ONEX CORPORATION	4,217	91.43	385,560.31
	FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	1,144	605.00	692,120.00
	GREAT-WEST LIFECEO INC	14,253	35.70	508,832.10
	INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANCE AND FINANC	4,851	54.54	264,573.54
	INTACT FINANCIAL CORPORATION	5,933	94.21	558,947.93
	MANULIFE FINANCIAL CORP	91,877	24.46	2,247,311.42
	POWER CORP OF CANADA	17,850	30.35	541,747.50
	POWER FINANCIAL CORP	10,930	34.32	375,117.60
	SUN LIFE FINANCIAL INC	29,069	51.41	1,494,437.29
	BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT INC	39,402	44.74	1,762,845.48
	FIRST CAPITAL REALTY INC	6,546	20.51	134,258.46
	CGI GROUP INC - CL A	9,600	63.90	613,440.00
	CONSTELLATION SOFTWARE	897	617.53	553,924.41
	OPEN TEXT CORPORATION	5,489	82.21	451,250.69
	BLACKBERRY LIMITED	23,701	10.34	245,068.34
	BCE INC	6,388	57.40	366,671.20
	ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	17,418	51.73	901,033.14
	TELUS CORPORATION	9,642	42.78	412,484.76
	ATCO LTD-CLASS I	3,354	44.05	147,743.70
	CANADIAN UTILITIES LIMITED	5,884	36.06	212,177.04
	EMERA INC	2,409	45.07	108,573.63
	FORTIS INC	17,950	40.92	734,514.00
	HYDRO ONE LTD	9,317	23.51	219,042.67
	カナダドル 小計	1,894,512		76,417,863.25 (6,682,742,141)
ユーロ	ENI SPA	118,985	14.96	1,780,015.60
	GALP ENERGIA SGPS S.A	23,722	13.90	329,735.80
	NESTE OYJ	6,068	36.21	219,722.28
	OMV AG	6,380	33.53	213,921.40
	REPSOL SA	52,652	13.37	703,957.24
	REPSOL SA-RTS-NEW	52,652	0.35	18,480.85

SAIPEM	254,172	0.51	130,008.97
TECHNIP S.A.	5,720	66.13	378,263.60
TENARIS S.A.	22,139	16.38	362,636.82
TOTAL SA	104,593	47.89	5,009,481.73
VOPAK	3,334	44.05	146,879.37
AIR LIQUIDE	18,332	106.00	1,943,192.00
AKZO NOBEL	11,711	59.73	699,498.03
ARCELOR MITTAL	82,239	7.11	584,719.29
ARKEMA	2,963	93.57	277,247.91
BASF SE	42,531	87.68	3,729,118.08
COVESTRO AG	3,160	64.57	204,041.20
CRH PLC	39,627	32.09	1,271,828.56
EVONIK INDUSTRIES AG	8,227	28.54	234,839.71
FUCHS PETROLUB SE-PREF	3,370	39.56	133,334.05
HEIDELBERGCEMENT AG	7,027	87.37	613,948.99
IMERYS SA	2,030	71.31	144,759.30
K+S AG	9,644	21.56	207,924.64
KONINKLIJKE DSM NV	7,972	56.78	452,650.16
LANXESS	4,066	62.14	252,661.24
LINDE AG	8,547	163.55	1,397,861.85
SOLVAY SA	3,467	111.40	386,223.80
STORA ENSO OYJ-R SHS	25,257	9.87	249,412.87
SYMRISE AG	5,820	57.46	334,417.20
THYSSENKRUPP AG	18,511	23.02	426,123.22
UMICORE	4,922	52.83	260,029.26
UPM-KYMMENE OYJ	23,991	22.46	538,837.86
VOESTALPINE AG	5,898	37.45	220,909.59
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	8,339	30.18	251,671.02
AIRBUS GROUP SE	27,060	63.25	1,711,545.00
ALSTOM RGPT	6,119	26.11	159,797.68
ANDRITZ AG	3,301	47.31	156,170.31
BOSKALIS WESTMINSTER NV	4,975	32.74	162,881.50
BOUYGUES SA	10,038	34.10	342,295.80
BRENTAG AG	6,928	52.72	365,244.16
CNH INDUSTRIAL NV	44,939	8.29	372,544.31
COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	22,673	43.50	986,275.50
DASSAULT AVIATION SA	117	1,074.15	125,675.55
EIFFAGE SA	2,496	65.70	163,987.20
FERROVIAL SA	23,863	17.31	413,187.84
GEA GROUP AG	8,548	37.25	318,413.00
HOCHTIEF AG	784	133.30	104,507.20
KONE OYJ-B	15,733	41.91	659,370.03

KONINKLIJKE PHILIPS NV	44,245	28.36	1,254,788.20
LEGRAND SA	12,536	53.16	666,413.76
LEONARDO-FINMECCANICA SPA	18,294	13.40	245,139.60
MAN SE	1,882	94.43	177,717.26
METSO OYJ	4,950	27.14	134,343.00
OSRAM LICHT AG	4,588	48.87	224,215.56
PRYSMIAN SPA	9,328	24.10	224,804.80
REXEL SA	13,762	15.58	214,411.96
SAFRAN SA	14,674	67.81	995,043.94
SCHNEIDER ELECTRIC SE	26,279	65.45	1,719,960.55
SIEMENS AG-REG	35,686	115.10	4,107,458.60
THALES SA	5,075	91.22	462,941.50
VINCI S.A.	23,616	64.56	1,524,648.96
WARTSILA OYJ-B SHARES	6,712	42.15	282,910.80
ZARDOYA OTIS SA	6,856	8.08	55,396.48
ZODIAC AEROSPACE	10,335	22.16	229,075.27
BIC	1,337	126.85	169,598.45
BUREAU VERITAS SA	13,923	18.17	253,050.52
EDENRED	8,942	18.89	168,914.38
PADDY POWER BETFAIR PLC	3,791	102.85	389,904.35
RANDSTAD HOLDING NV	5,110	51.84	264,902.40
ABERTIS INFRASTRUCTURAS SA	29,537	13.55	400,226.35
AENA SA	3,179	132.35	420,740.65
AEROPORTS DE PARIS (ADP)	1,346	99.17	133,482.82
ATLANTIA SPA	19,813	22.50	445,792.50
BOLLORE	39,433	3.32	130,917.56
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	12,281	12.83	157,565.23
DEUTSCHE POST AG-REG	45,259	31.15	1,409,817.85
FRAPORT AG	1,856	56.97	105,736.32
GROUPE EUROTUNNEL SE	23,484	9.05	212,647.62
INTERNATIONAL CONSOLIDATED AIRLINES GROUP	41,090	5.40	221,927.09
RYANAIR HOLDINGS PLC	1,614	14.62	23,604.75
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	15,725	90.11	1,416,979.75
BAYERISCHE MOTOREN WERKE(BMW)AG-PFD	2,879	73.78	212,412.62
CONTINENTAL AG	5,224	185.00	966,440.00
DAIMLER AG	44,524	70.98	3,160,313.52
FERRARI NV	6,007	56.30	338,194.10
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	41,200	8.54	351,848.00
MICHELIN (CGDE)-B	8,245	104.70	863,251.50
NOKIAN RENKAAT OYJ	5,578	35.30	196,903.40
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE PREF	7,484	51.79	387,596.36
PSA PEUGEOT CITROEN	23,663	15.67	370,799.21

RENAULT SA	8,641	85.06	735,003.46
SCHAEFFLER AG	9,576	13.74	131,622.12
VALEO SA	11,544	54.82	632,842.08
VOLKSWAGEN AG	1,615	139.70	225,615.50
VOLKSWAGEN AG PFD	7,364	133.65	984,198.60
ADIDAS AG	8,614	145.00	1,249,030.00
CHRISTIAN DIOR SE	2,471	197.70	488,516.70
HERMES INTERNATIONAL	1,283	389.45	499,664.35
HUGO BOSS AG	3,209	57.62	184,902.58
KERING	3,490	212.90	743,021.00
LUXOTTICA GROUP SPA	7,897	50.65	399,983.05
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	13,108	179.20	2,348,953.60
SEB SA	1,032	126.70	130,754.40
ACCOR SA	7,340	36.88	270,699.20
SODEXO	4,408	107.20	472,537.60
ALTICE NV -A W/I	19,316	18.67	360,726.30
ALTICE NV -B W/I	4,439	18.59	82,543.20
AXEL SPRINGER SE	2,125	45.08	95,795.00
EUTELSAT COMMUNICATIONS	8,726	18.68	163,045.31
JC DECAUX SA	2,828	26.85	75,931.80
LAGARDERE S.C.A.	6,108	25.69	156,945.06
PROSIEBEN SAT.1 MEDIA SE-REG	12,057	36.78	443,456.46
PUBLICIS GROUPE	9,036	64.07	578,936.52
RELX NV	46,138	15.91	734,055.58
RTL GROUP	1,967	67.01	131,808.67
SES	17,737	20.47	363,076.39
SFR GROUP SA	3,097	26.02	80,583.94
TELENET GROUP HOLDINGS NV	2,096	52.02	109,033.92
WOLTERS KLUWER-CVA	14,127	34.03	480,741.81
INDITEX	51,293	32.07	1,644,966.51
CARREFOUR SA	25,669	22.86	586,793.34
CASINO GUICHARD PERRACHON	2,725	45.55	124,137.37
COLRUYT NV	3,273	46.35	151,719.91
DISTRIBUIDORA INTERNACIONAL	29,663	4.58	135,945.52
JERONIMO MARTINS SGPS S.A.	11,930	14.46	172,567.45
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	59,388	19.70	1,170,240.54
METRO AG	8,566	31.26	267,773.16
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	35,349	98.80	3,492,481.20
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	10,170	31.15	316,795.50
DANONE	27,098	60.40	1,636,719.20
HEINEKEN HOLDING NV	4,695	66.49	312,170.55
HEINEKEN NV	11,423	71.24	813,774.52

KERRY GROUP PLC-A	7,513	67.75	509,005.75
PERNOD-RICARD SA	10,038	103.00	1,033,914.00
REMY COINTREAU	1,273	80.71	102,743.83
UNILEVER NV-CVA	75,282	38.93	2,931,104.67
BEIERSDORF AG	4,749	80.62	382,864.38
HENKEL AG & CO KGAA	4,649	98.70	458,856.30
HENKEL AG & CO KGAA	8,458	112.60	952,370.80
L'OREAL	11,800	170.00	2,006,000.00
ESSILOR INTERNATIONAL	9,594	105.05	1,007,849.70
FRESENIUS MEDICAL CARE AG AND CO.KGAA	10,291	79.46	817,722.86
FRESENIUS SE & CO KGAA	18,769	72.39	1,358,687.91
BAYER AG	38,576	98.35	3,793,949.60
EUROFINS SCIENTIFIC	590	406.75	239,982.50
GRIFOLS S.A.	14,594	18.45	269,259.30
MERCK KGAA	6,176	97.84	604,259.84
ORION OYJ	4,468	42.58	190,247.44
QIAGEN N.V.	9,901	26.75	264,851.75
SANOFI	53,759	74.86	4,024,398.74
UCB SA	6,014	58.67	352,841.38
ZALANDO SE	4,200	35.88	150,717.00
ABN AMRO GROUP NV-CVA	13,747	21.13	290,474.11
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	302,636	6.47	1,959,265.46
BANCO DE SABADELL SA	254,608	1.37	350,340.60
BANCO ESPIRITO SANTO,S.A(BES)	187,906	0.01	1,879.06
BANCO POPULAR ESPANOL	155,616	1.01	158,105.85
BANCO SANTANDER SA	687,627	4.91	3,380,374.33
BANK OF IRELAND	1,306,054	0.23	308,228.74
BANKIA SA	203,996	0.97	199,712.08
BANKINTER,S.A.	34,025	7.49	255,017.37
BNP PARIBAS	48,963	60.50	2,962,261.50
CAIXABANK	147,398	3.18	469,904.82
COMMERZBANK AG	52,468	7.46	391,621.15
CREDIT AGRICOLE SA	52,224	11.73	612,848.64
ERSTE GROUP BANK AG	13,235	28.46	376,734.27
INTESA SANPAOLO	580,434	2.39	1,390,719.86
INTESA SANPAOLO-RSP	50,545	2.18	110,592.46
KBC GROUPE SA	11,249	59.53	669,652.97
NATIXIS	41,035	5.29	217,444.46
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG	6,210	17.79	110,475.90
SOCIETE GENERALE	35,892	46.43	1,666,465.56
UNICREDIT SPA	247,342	2.74	678,211.76
DEUTSCHE BANK AG -REG	63,947	17.50	1,119,392.23

DEUTSCHE BOERSE AG-TENDER	8,800	79.21	697,048.00
EURAZEO	1,926	54.43	104,832.18
EXOR NV	4,723	41.03	193,784.69
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	3,943	79.51	313,507.93
ING GROEP NV-CVA	179,983	13.48	2,426,170.84
MEDIOBANCA SPA	26,522	7.80	206,871.60
WENDEL	1,532	113.25	173,499.00
AEGON NV	83,989	5.21	438,338.59
AGEAS	9,255	37.20	344,332.27
ALLIANZ SE-REG	21,318	156.30	3,332,003.40
ASSICURAZIONI GENERALI	57,775	14.20	820,405.00
AXA SA	90,997	23.75	2,161,178.75
CNP ASSURANCES	10,007	17.46	174,772.25
HANNOVER RUECKVERSICHERUNG SE	3,033	102.25	310,124.25
MAPFRE SA	43,669	2.96	129,303.90
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	7,515	176.65	1,327,524.75
NN GROUP NV	14,095	31.24	440,398.27
POSTE ITALIANE SPA	22,087	6.23	137,602.01
SAMPO OYJ-A SHS	20,982	42.67	895,301.94
SCOR SE	7,073	32.19	227,679.87
UNIPOLSAI SPA	49,963	2.03	101,424.89
DEUTSCHE WOHNEN AG-BR	16,186	29.07	470,527.02
VONOVIA SE	21,210	30.07	637,890.75
AMADEUS IT GROUP SA	20,381	43.01	876,586.81
ATOS SE	4,317	97.87	422,504.79
CAP GEMINI SA	7,755	79.22	614,351.10
DASSAULT SYSTEMES SA	5,613	70.35	394,874.55
GEMALTO	3,838	55.20	211,857.60
SAP SE	45,759	82.19	3,760,932.21
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	5,981	36.86	220,459.66
INGENICO S.A.	2,687	73.49	197,467.63
NOKIA OYJ	272,222	4.68	1,273,998.96
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	152,625	16.07	2,453,446.87
ELISA OYJ	7,025	30.70	215,667.50
ILIAD SA	1,212	177.75	215,433.00
KONINKLIJKE KPN NV	163,421	2.79	457,088.53
ORANGE S.A.	93,233	14.21	1,324,840.93
PROXIMUS SA	7,541	26.93	203,079.13
TELECOM ITALIA SPA	489,656	0.82	404,700.68
TELECOM ITALIA-RNC	281,876	0.67	190,266.30
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	28,533	4.08	116,585.83
TELEFONICA S.A.	224,831	8.76	1,969,969.22

	VIVENDI SA	46,520	18.24	848,757.40
	E.ON SE	89,157	6.56	585,315.70
	EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	99,663	2.88	287,029.44
	ELECTRICITE DE FRANCE(EDF)	13,019	9.76	127,065.44
	ENAGAS	11,219	24.82	278,455.58
	ENDESA S.A.	14,812	20.27	300,313.30
	ENEL SPA	365,554	4.05	1,482,687.02
	ENGIE	69,213	12.24	847,513.18
	FORTUM OYJ	22,045	14.61	322,077.45
	GAS NATURAL SDG SA	15,578	17.53	273,082.34
	IBERDROLA SA	250,115	6.03	1,508,693.68
	INNOGY SE	6,589	31.92	210,320.88
	RED ELECTRICA CORPORATION SA	21,060	17.54	369,497.70
	RWE AG	22,761	11.40	259,589.20
	SNAM SPA	109,009	3.81	415,324.29
	SUEZ	14,573	13.38	194,986.74
	TERNA SPA	65,136	4.30	280,084.80
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	22,998	15.74	361,988.52
	ASML HOLDING NV	17,297	105.35	1,822,238.95
	INFINEON TECHNOLOGIES AG	54,446	16.61	904,348.06
	STMICROELECTRONICS NV	28,920	10.47	302,937.00
	ユーロ 小計	11,032,239		162,725,486.13 (19,849,254,798)
英債券	BP PLC	876,242	4.90	4,300,595.73
	PETROFAC LIMITED	12,177	8.56	104,296.00
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	201,798	22.00	4,439,556.00
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	174,122	23.04	4,012,641.49
	ANGLO AMERICAN PLC	64,785	11.24	728,507.32
	ANTOFAGASTA PLC	19,439	6.61	128,588.98
	BHP BILLITON PLC	98,610	12.82	1,264,180.20
	CRODA INTERNATIONAL PLC	6,223	32.08	199,633.84
	FRESNILLO PLC	11,248	11.14	125,302.72
	GLENCORE PLC	562,660	2.68	1,510,179.44
	JOHNSON MATTHEY PLC	9,122	31.02	282,964.44
	MONDI PLC	17,394	15.80	274,825.20
	RANDGOLD RESOURCES LTD	4,386	57.05	250,221.30
	RIO TINTO PLC	56,994	30.50	1,738,317.00
	ASHTREAD GROUP PLC	23,485	15.34	360,259.90
	BAE SYSTEMS PLC	150,632	5.96	898,519.88
	BUNZL PLC	15,459	20.79	321,392.61
	COBHAM PLC	73,920	1.71	126,698.88
	DCC PLC	4,417	59.05	260,823.85

IMI PLC	11,445	10.13	115,937.85
MEGGITT PLC	36,073	4.73	170,697.43
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	82,390	6.73	554,484.70
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC-C	4,146,532	0.00	4,146.53
SMITHS GROUP PLC	19,422	14.12	274,238.64
TRAVIS PERKINS PLC	12,496	14.45	180,567.20
WEIR GROUP PLC/THE	10,014	18.62	186,460.68
WOLSELEY PLC	11,749	49.20	578,050.80
BABCOCK INTERNATIONAL GROUP PLC	11,442	9.48	108,527.37
CAPITA PLC	31,057	5.01	155,595.57
EXPERIAN PLC	43,930	15.17	666,418.10
G4S PLC	71,027	2.34	166,629.34
INTERTEK GROUP PLC	7,790	33.52	261,120.80
MERLIN ENTERTAINMENTS PLC	33,608	4.43	148,917.04
EASYJET PLC	7,630	10.34	78,894.20
ROYAL MAIL PLC	42,103	4.55	191,568.65
GKN PLC	72,867	3.29	239,732.43
BURBERRY GROUP PLC	19,981	14.74	294,519.94
PERSIMMON PLC	14,611	17.20	251,309.20
TAYLOR WIMPEY PLC	151,898	1.53	233,467.22
THE BERKELEY GROUP HOLDINGS	6,152	28.19	173,424.88
CARNIVAL PLC	9,170	40.23	368,909.10
COMPASS GROUP PLC	75,913	14.31	1,086,315.03
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	8,610	35.24	303,416.40
TUI AG-DI	22,447	11.23	252,079.81
WHITBREAD PLC	8,382	36.16	303,093.12
WILLIAM HILL PLC	41,877	2.97	124,500.32
ITV PLC	177,733	2.00	355,466.00
PEARSON PLC	38,947	8.22	320,339.07
RELX PLC	51,757	14.14	731,843.98
SKY PLC	48,018	9.95	477,779.10
WPP PLC	58,603	17.82	1,044,305.46
DIXONS CARPHONE PLC	49,868	3.44	171,944.86
KINGFISHER PLC	105,594	3.42	361,976.23
MARKS & SPENCER GROUP PLC	80,284	3.52	283,161.66
NEXT PLC	6,615	49.15	325,127.25
SAINSBURY (J) PLC	86,804	2.47	215,187.11
TESCO PLC	382,885	2.02	774,576.35
WILLIAM MORRISON SUPERMARKETS PLC	92,301	2.27	209,984.77
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	17,085	27.04	461,978.40
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	86,461	45.51	3,935,272.41
COCA-COLA HBC AG-CDI	8,704	16.68	145,182.72

DIAGEO PLC	118,427	20.75	2,457,952.38
IMPERIAL BRANDS PLC	44,964	35.53	1,597,570.92
TATE & LYLE PLC	24,535	6.94	170,272.90
UNILEVER PLC	59,157	32.18	1,903,968.04
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	47,273	4.61	218,023.07
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	29,157	67.94	1,980,926.58
MEDICLINIC INTERNATIONAL PLC	15,126	7.38	111,705.51
SMITH & NEPHEW PLC	42,313	11.89	503,101.57
ASTRAZENECA PLC	58,466	43.03	2,516,084.31
GLAXOSMITHKLINE PLC	225,881	15.33	3,462,755.73
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	7,449	18.61	138,625.89
SHIRE PLC	42,660	46.02	1,963,213.20
BARCLAYS PLC	793,497	2.22	1,761,960.08
HSBC HOLDINGS PLC	924,504	6.58	6,083,236.32
LLOYDS BANKING GROUP PLC	2,960,412	0.62	1,851,737.70
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	157,044	2.23	350,365.16
STANDARD CHARTERED PLC	149,834	6.65	997,444.93
3I GROUP PLC	42,898	6.86	294,280.28
ABERDEEN ASSET MGMT PLC	37,169	2.54	94,409.26
HARGREAVES LANSDOWN PLC	11,178	12.36	138,160.08
INVESTEC PLC	33,008	5.30	174,942.40
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP PLC	14,510	27.89	404,683.90
NEX GROUP PLC	27,845	4.81	133,934.45
PROVIDENT FINANCIAL PLC	7,000	27.50	192,500.00
SCHRODERS PLC	5,835	29.65	173,007.75
ADMIRAL GROUP PLC	10,760	17.94	193,034.40
AVIVA PLC	191,080	4.75	908,394.32
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	63,880	3.57	228,243.24
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	292,141	2.40	702,891.24
OLD MUTUAL PLC	248,728	1.97	490,242.88
PRUDENTIAL PLC	118,863	15.60	1,854,262.80
RSA INSURANCE GROUP PLC	49,032	5.66	277,521.12
ST JAMES'S PLACE PLC	26,198	9.90	259,491.19
STANDARD LIFE PLC	98,946	3.61	357,788.73
AUTO TRADER GROUP PLC	41,071	3.89	159,807.26
SAGE GROUP PLC/THE	50,639	6.53	330,925.86
WORLDPAY GROUP PLC	94,891	2.66	253,074.29
BT GROUP PLC	387,408	3.71	1,438,833.31
INMARSAT PLC	20,829	7.37	153,613.87
VODAFONE GROUP PLC	1,262,353	2.02	2,554,371.29
CENTRICA PLC	260,900	2.30	600,591.80
NATIONAL GRID PLC	173,157	9.39	1,626,290.54

	SEVERN TRENT PLC	10,991	22.14	243,340.74
	SSE PLC	47,906	15.21	728,650.26
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	31,939	8.93	285,215.27
	英ポンド 小計	18,047,242		81,936,099.32 (11,909,412,036)
スイスフラン	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	421	514.50	216,604.50
	GIVAUDAN-REG	440	1,832.00	806,080.00
	LAFARGEHOLCIM LTD	21,286	53.15	1,131,350.90
	SIKA AG	94	4,849.00	455,806.00
	SYNGENTA AG	4,290	410.30	1,760,187.00
	ABB LTD	87,247	21.55	1,880,172.85
	GEBERIT AG-REG	1,786	401.10	716,364.60
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	1,025	174.10	178,452.50
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	1,820	174.70	317,954.00
	ADECCO GROUP AG-REG	7,984	66.40	530,137.60
	SGS SA	252	2,068.00	521,136.00
	KUEHNE&NAGEL INTL AG-REG	2,501	135.40	338,635.40
	CIE FINANCIERE RICHEMONT SA-REGD A	24,042	67.15	1,614,420.30
	THE SWATCH GROUP AG-B	1,449	307.80	446,002.20
	THE SWATCH GROUP AG-REG	2,516	60.70	152,721.20
	DUFREY AG-REG	2,088	126.00	263,088.00
	ARYZTA AG	4,011	45.17	181,176.87
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	109	1,213.00	132,217.00
	LINDT & SPRUENGLI AG	45	5,140.00	231,300.00
	LINDT & SPRUENGLI AG-REG	5	60,500.00	302,500.00
	NESTLE SA-REGISTERED	144,776	72.95	10,561,409.20
	SONOVA HOLDING AG	2,594	120.30	312,058.20
	ACTELION LTD	4,635	214.00	991,890.00
	GALENICA AG-REG	170	1,140.00	193,800.00
	LONZA GROUP AG-REG	2,430	171.40	416,502.00
	NOVARTIS AG-REG SHS	104,169	73.75	7,682,463.75
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	32,774	233.70	7,659,283.80
	CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	92,766	15.45	1,433,234.70
	JULIUS BAER GROUP LTD	9,998	45.86	458,508.28
	PARGESA HOLDING SA-BR	1,867	65.60	122,475.20
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	813	477.00	387,801.00
	UBS GROUP AG	168,874	16.48	2,783,043.52
	BALOISE HOLDING AG	2,242	128.80	288,769.60
	SWISS LIFE HOLDING AG	1,572	286.60	450,535.20
	SWISS RE AG	15,218	96.40	1,467,015.20
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	7,022	279.20	1,960,542.40
	SWISS PRIME SITE-REG	3,473	81.75	283,917.75

	SWISSCOM AG-REG	1,198	452.40	541,975.20	
	スイスフラン 小計	760,002		50,171,531.92 (5,724,571,792)	
スウェーデンク ローナ	LUNDIN PETROLEUM AB	9,278	192.20	1,783,231.60	
	BOLIDEN AB	12,521	242.90	3,041,350.90	
	ALFA LAVAL AB	13,757	148.10	2,037,411.70	
	ASSA ABLOY AB-B	47,479	172.30	8,180,631.70	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	30,809	283.90	8,746,675.10	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	18,623	254.00	4,730,242.00	
	SANDVIK AB	52,526	114.10	5,993,216.60	
	SKANSKA AB-B SHS	15,044	218.40	3,285,609.60	
	SKF AB-B SHARES	18,017	169.00	3,044,873.00	
	VOLVO AB-B SHS	70,738	108.20	7,653,851.60	
	SECURITAS AB-B SHS	16,445	140.80	2,315,456.00	
	ELECTROLUX AB-SER B	11,157	226.50	2,527,060.50	
	HUSQVARNA AB-B SHS	18,593	69.85	1,298,721.05	
	HENNES & MAURITZ AB-B SHS	45,336	258.90	11,737,490.40	
	ICA GRUPPEN AB	3,550	272.70	968,085.00	
	SWEDISH MATCH AB	8,874	290.10	2,574,347.40	
	SVENSKA CELLULOSA AB-B SHS	27,871	259.40	7,229,737.40	
	GETINGE AB-B SHS	9,231	145.80	1,345,879.80	
	NORDEA BANK AB	139,268	103.00	14,344,604.00	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN AB-A	74,009	97.15	7,189,974.35	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	70,549	129.60	9,143,150.40	
	SWEDBANK AB - A SHARES	41,810	224.00	9,365,440.00	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	9,247	169.70	1,569,215.90	
	INVESTOR AB-B SHS	20,466	343.80	7,036,210.80	
	KINNEVIK AB-B SHS	11,257	227.70	2,563,218.90	
	LUNDBERGS AB-B SHS	1,567	548.50	859,499.50	
ERICSSON LM-B SHS	143,702	56.25	8,083,237.50		
HEXAGON AB-B SHS	11,518	330.40	3,805,547.20		
MILLICOM INTL CELLULAR-SDR	3,357	394.00	1,322,658.00		
TELE2 AB-B SHS	13,516	73.00	986,668.00		
TELIA CO AB	125,223	37.17	4,654,538.91		
	スウェーデンクローナ 小計	1,095,338		149,417,834.81 (1,867,722,935)	
ノルウェーク ローネ	STATOIL ASA	51,794	156.80	8,121,299.20	
	NORSK HYDRO ASA	60,696	41.32	2,507,958.72	
	YARA INTERNATIONAL ASA	8,259	331.10	2,734,554.90	
	SCHIBSTED ASA	3,623	194.50	704,673.50	
	SCIBSTED ASA-B SHS	4,063	181.50	737,434.50	
	MARINE HARVEST ASA	16,979	155.50	2,640,234.50	

	ORKLA ASA	41,997	76.70	3,221,169.90	
	DNB ASA	45,573	128.90	5,874,359.70	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	9,626	133.50	1,285,071.00	
	TELENOR ASA	35,231	129.70	4,569,460.70	
	ノルウェークローネ 小計	277,841		32,396,216.62 (437,348,924)	
デンマーククローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	4,400	388.00	1,707,200.00	
	NOVOZYMES A/S-B SHARES	11,427	240.00	2,742,480.00	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	10,326	427.50	4,414,365.00	
	ISS A/S	8,394	238.50	2,001,969.00	
	A P MOLLER-MAERSK A/S-A	178	10,760.00	1,915,280.00	
	A P MOLLER-MAERSK A/S-B	297	11,300.00	3,356,100.00	
	DSV A/S	8,645	311.50	2,692,917.50	
	PANDORA A/S	5,055	902.00	4,559,610.00	
	CARLSBERG AS-B	5,061	597.50	3,023,947.50	
	COLOPLAST-B	5,574	470.30	2,621,452.20	
	WILLIAM DEMANT HOLDING	6,645	122.80	816,006.00	
	GENMAB A/S	2,708	1,150.00	3,114,200.00	
	NOVO NORDISK A/S-B	88,402	254.50	22,498,309.00	
	DANSKE BANK A/S	32,814	212.70	6,979,537.80	
	TRYG A/S	5,005	125.80	629,629.00	
TDC A/S	39,176	35.58	1,393,882.08		
DONG ENERGY A/S	3,418	244.30	835,017.40		
	デンマーククローネ 小計	237,525		65,301,902.48 (1,071,604,219)	
オーストラリアドル	CALTEX AUSTRALIA LIMITED	12,366	29.91	369,867.06	
	OIL SEARCH LTD	63,906	6.90	440,951.40	
	ORIGIN ENERGY LIMITED	78,717	6.48	510,086.16	
	SANTOS LTD	77,838	3.98	309,795.24	
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	35,212	31.10	1,095,093.20	
	ALUMINA LTD	106,977	1.75	187,209.75	
	AMCOR LIMITED	54,679	14.81	809,795.99	
	BHP BILLITON LTD	148,690	25.09	3,730,632.10	
	BORAL LIMITED	51,850	5.35	277,397.50	
	FORTESCUE METALS GROUP LIMITED	66,575	6.00	399,450.00	
	INCITEC PIVOT LTD	85,406	3.57	304,899.42	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	21,875	21.52	470,750.00	
	NEWCREST MINING LIMITED	36,185	16.77	606,822.45	
	ORICA LIMITED	17,233	17.06	293,994.98	
	RIO TINTO LIMITED	20,256	59.55	1,206,244.80	
SOUTH32 LTD	251,285	2.66	668,418.10		
CIMIC GROUP LTD	4,188	33.33	139,586.04		

BRAMBLES LIMITED	73,679	12.23	901,094.17
SEEK LIMITED	16,538	14.75	243,935.50
AURIZON HOLDINGS LTD	89,118	4.91	437,569.38
QANTAS AIRWAYS LIMITED	24,631	3.36	82,760.16
ARISTOCRAT LEISURE LTD	23,366	15.12	353,293.92
CROWN RESORTS LTD	16,142	11.13	179,660.46
DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES LIMITED	3,373	62.86	212,026.78
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD	2,650	31.20	82,680.00
TABCORP HOLDINGS LIMITED	36,322	4.72	171,439.84
TATTS GROUP LTD	66,783	4.50	300,523.50
REA GROUP LTD	2,708	52.99	143,496.92
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	23,253	4.93	114,637.29
WESFARMERS LIMITED	51,654	41.82	2,160,170.28
WOOLWORTHS LIMITED	61,930	23.24	1,439,253.20
COCA-COLA AMATIL LIMITED	26,498	9.71	257,295.58
TREASURY WINE ESTATES LTD	33,467	10.41	348,391.47
COCHLEAR LIMITED	2,717	115.83	314,710.11
HEALTHSCOPE LTD	88,691	2.27	201,328.57
RAMSAY HEALTH CARE LTD	6,579	66.70	438,819.30
SONIC HEALTHCARE LTD	18,440	21.67	399,594.80
CSL LIMITED	21,029	97.30	2,046,121.70
AUST AND NZ BANKING GROUP LT	136,556	29.93	4,087,121.08
BANK OF QUEENSLAND LIMITED	17,851	11.63	207,607.13
BENDIGO AND ADELAIDE BANK	18,753	12.50	234,412.50
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	79,875	81.43	6,504,221.25
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	123,941	30.08	3,728,145.28
WESTPAC BANKING CORPORATION	154,910	32.33	5,008,240.30
ASX LTD	9,096	48.70	442,975.20
CHALLENGER FINANCIAL SERVICE	30,000	11.06	331,800.00
MACQUARIE GROUP LTD	14,076	87.90	1,237,280.40
AMP LIMITED	139,602	4.98	695,217.96
INSURANCE AUSTRALIA GROUP LT	117,694	5.88	692,040.72
MEDIBANK PRIVATE LTD	133,887	2.80	374,883.60
QBE INSURANCE GROUP LIMITED	64,545	12.59	812,621.55
SUNCORP GROUP LTD	59,068	13.42	792,692.56
COMPUTERSHARE LIMITED	21,847	12.30	268,718.10
VOCUS COMMUNICATIONS LTD	20,917	3.76	78,647.92
TELSTRA CORPORATION LIMITED	202,039	4.96	1,002,113.44
TPG TELECOM LTD	17,758	6.69	118,801.02
AGL ENERGY LIMITED	31,834	21.31	678,382.54
AUSNET SERVICES	85,220	1.50	128,256.10
	3,302,275		50,073,975.77

オーストラリアドル 小計				(4,257,790,159)
ニュージーランド ドル	FLETCHER BUILDING LTD	34,160	10.35	353,556.00
	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	45,835	6.38	292,427.30
	RYMAN HEALTHCARE LIMITED	15,453	8.20	126,714.60
	SPARK NEW ZEALAND LIMITED	82,677	3.42	282,755.34
	CONTACT ENERGY LIMITED	35,357	4.73	167,238.61
	MERCURY NZ LTD	26,696	2.99	79,954.52
	MERIDIAN ENERGY LTD	65,995	2.53	166,967.35
ニュージーランドドル 小計		306,173		1,469,613.72 (119,317,937)
香港ドル	NWS HOLDINGS LTD	67,500	12.62	851,850.00
	CATHAY PACIFIC AIRWAYS	57,000	10.16	579,120.00
	MTR CORPORATION	68,000	37.50	2,550,000.00
	LI & FUNG LTD	267,200	3.62	967,264.00
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	64,500	28.15	1,815,675.00
	YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	31,000	28.95	897,450.00
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LIMITED	115,000	33.60	3,864,000.00
	MGM CHINA HOLDINGS LTD	44,000	14.88	654,720.00
	SANDS CHINA LTD	112,000	32.80	3,673,600.00
	SHANGRI-LA ASIA LTD.	64,000	8.30	531,200.00
	SJM HOLDINGS LIMITED	92,000	5.95	547,400.00
	WYNN MACAU LTD	78,000	12.24	954,720.00
	WH GROUP LIMITED	359,000	6.33	2,272,470.00
	BANK OF EAST ASIA	53,020	30.25	1,603,855.00
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	178,000	27.35	4,868,300.00
	HANG SENG BANK LTD	34,800	145.60	5,066,880.00
	CHEUNG KONG PROPERTY HOLDING	125,924	49.70	6,258,422.80
	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	127,924	88.80	11,359,651.20
	FIRST PACIFIC COMPANY	86,000	5.65	485,900.00
	HONG KONG EXCHANGES & CLEARING LIMITED	56,100	182.60	10,243,860.00
	AIA GROUP LTD	557,000	43.85	24,424,450.00
	HANG LUNG GROUP LTD	42,000	28.30	1,188,600.00
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	105,000	16.56	1,738,800.00
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	48,655	41.00	1,994,855.00
	HYSAN DEVELOPMENT CO	29,000	32.70	948,300.00
	KERRY PROPERTIES LTD	27,500	21.20	583,000.00
	NEW WORLD DEVELOPMENT	259,333	8.25	2,139,497.25
SINO LAND CO	160,200	11.46	1,835,892.00	
SUN HUNG KAI PROPERTIES	69,000	98.75	6,813,750.00	
SWIRE PACIFIC LTD 'A'	28,500	73.45	2,093,325.00	
SWIRE PROPERTIES LIMITED	51,400	21.70	1,115,380.00	
WHARF HOLDINGS LTD	65,000	51.70	3,360,500.00	

	WHELOCK&COMPANY LTD	39,000	43.85	1,710,150.00	
	PCCW LIMITED	194,000	4.24	822,560.00	
	CHEUNG KONG INFRASTRUCTURE	32,000	62.00	1,984,000.00	
	CLP HOLDINGS LTD	74,100	72.00	5,335,200.00	
	HK ELECTRIC INVESTMENTS-SS	110,500	6.49	717,145.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	350,981	13.74	4,822,478.94	
	POWER ASSETS HOLDINGS LIMITED	66,500	68.35	4,545,275.00	
	ASM PACIFIC TECHNOLOGY	12,200	76.60	934,520.00	
	香港ドル 小計	4,402,837		129,154,016.19 (1,948,934,104)	
シンガポールドル	KEPPEL CORP LTD	65,600	6.00	393,600.00	
	SEMBCORP INDUSTRIES LTD	42,020	2.92	122,698.40	
	SINGAPORE TECHNOLOGIES ENG	76,700	3.31	253,877.00	
	YANGZIJANG SHIPBUILDING HOLDINGS LTD	90,000	0.83	75,150.00	
	COMFORTDELGRO CORP LTD	107,000	2.58	276,060.00	
	SATS LTD	27,700	4.94	136,838.00	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	24,266	9.77	237,078.82	
	GENTING SINGAPORE PLC	258,200	0.93	240,126.00	
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	78,350	3.59	281,276.50	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	4,700	40.70	191,290.00	
	GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	353,600	0.43	152,048.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	85,700	3.68	315,376.00	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	81,600	17.70	1,444,320.00	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	148,000	9.12	1,349,760.00	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	61,100	20.80	1,270,880.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	38,700	7.24	280,188.00	
	CAPITALAND LTD	122,300	3.00	366,900.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	21,000	8.04	168,840.00	
	GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES LIMITED	128,000	2.25	288,000.00	
	UOL GROUP LIMITED	19,200	6.12	117,504.00	
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	370,515	3.67	1,359,790.05		
STARHUB LIMITED	24,500	2.76	67,620.00		
	シンガポールドル 小計	2,228,751		9,389,220.77 (760,151,313)	
イスラエルシュケル	FRUTAROM INDUSTRIES LTD	1,842	201.20	370,610.40	
	ISRAEL CHEMICALS LIMITED	20,822	15.42	321,075.24	
	ELBIT SYSTEMS LTD	1,178	391.60	461,304.80	
	BANK HAPUALIM BM	53,450	22.25	1,189,262.50	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	64,754	15.73	1,018,580.42	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	5,662	54.89	310,787.18	
	AZRIELI GROUP	1,863	167.80	312,611.40	
	NICE LTD	2,554	263.10	671,957.40	

BEZEQ ISRAELI TELECOMMUNICATION CORP LTD	96,068	6.75	649,131.47
イスラエルシュケル 小計	248,193		5,305,320.81 (160,910,380)
合 計	58,356,815		164,241,513,059 (164,241,513,059)

(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 604銘柄	63.7%	66.6%
カナダドル	株式 91銘柄	3.9%	4.1%
ユーロ	株式 237銘柄	11.6%	12.1%
英ポンド	株式 106銘柄	6.9%	7.3%
スイスフラン	株式 38銘柄	3.3%	3.5%
スウェーデンクローナ	株式 31銘柄	1.1%	1.1%
ノルウェークローネ	株式 10銘柄	0.3%	0.3%
デンマーククローネ	株式 17銘柄	0.6%	0.7%
オーストラリアドル	株式 58銘柄	2.5%	2.6%
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 40銘柄	1.1%	1.2%
シンガポールドル	株式 22銘柄	0.4%	0.5%
イスラエルシュケル	株式 9銘柄	0.1%	0.1%

(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	AGNC INVESTMENT CORPORATION	15,293	279,097.25	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITIES, INC.	3,368	369,301.20	
		AMERICAN TOWER CORP	19,578	2,093,867.10	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	45,539	473,605.60	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	6,571	1,148,545.09	
		BOSTON PROPERTIES INC	7,225	911,433.75	
		BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	12,992	320,642.56	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	4,186	344,633.38	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	7,128	688,564.80	
		DUKE REALTY CORP	16,643	435,214.45	
		EQUITY RESIDENTIAL	16,896	1,083,709.44	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	3,103	710,524.94	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	5,847	438,174.18	
		FEDERAL REALTY INVESTMENT TRUST	3,548	504,135.32	
		GENERAL GROWTH PROPERTIES	25,713	672,394.95	

	HCP, INC.	21,687	657,116.10
	HOST HOTELS AND RESORTS INC	34,373	659,274.14
	HUTCHISON PORT HOLDINGS TRUST	283,000	125,935.00
	IRON MOUNTAIN INC	11,847	378,867.06
	KIMCO REALTY CORPORATION	19,336	496,741.84
	LIBERTY PROPERTY TRUST	7,065	279,067.50
	MACERICH COMPANY/THE	5,279	368,896.52
	MID-AMERICA APARTMENT COMMUNITIES	5,513	534,154.57
	NATIONAL RETAIL PROPERTIES	7,073	305,907.25
	PROLOGIS INC	24,471	1,284,482.79
	PUBLIC STORAGE	7,013	1,545,454.81
	REALTY INCOME CORPORATION	11,999	687,902.67
	REGENCY CENTERS CORP	4,993	340,672.39
	SIMON PROPERTY GROUP INC	14,768	2,697,079.84
	SL GREEN REALTY CORP	4,650	512,011.50
	UDR INC	12,366	439,487.64
	VENTAS INC	16,218	1,002,110.22
	VEREIT INC	45,247	385,504.44
	VORNADO REALTY TRUST	7,967	827,850.97
	WELLTOWER INC	16,250	1,078,675.00
	米ドル 小計	754,745	25,081,036.26 (2,938,995,828)
カナダドル	H&R REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	8,036	174,541.92
	RIOCAN REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	6,847	179,254.46
	SMART REAL ESTATE INVESTMENT	2,057	65,433.17
	カナダドル 小計	16,940	419,229.55 (36,661,624)
ユーロ	FONCIERE DES REGIONS	1,550	124,899.00
	GECINA SA	1,937	245,224.20
	ICADE	1,873	123,505.62
	KLEPIERRE	9,900	361,251.00
	UNIBAIL-RODAMCO SE	4,571	1,007,905.50
	ユーロ 小計	19,831	1,862,785.32 (227,222,553)
英ポンド	BRITISH LAND CO PLC	48,472	307,070.12
	HAMMERSON PLC	37,833	211,108.14
	INTU PROPERTIES PLC	38,514	105,220.24
	LAND SECURITIES GROUP PLC	37,251	384,430.32
	SEGRO PLC	36,381	161,276.97
	英ポンド 小計	198,451	1,169,105.79 (169,929,526)

オーストラリアドル	APA GROUP	53,427	449,855.34	
	DEXUS PROPERTY GROUP	42,722	396,032.94	
	DUET GROUP	117,678	329,498.40	
	GOODMAN GROUP	83,175	580,561.50	
	GPT GROUP	90,527	442,677.03	
	LENLEASE GROUP	27,382	386,086.20	
	MIRVAC GROUP	186,000	392,460.00	
	SCENTRE GROUP	241,614	1,058,269.32	
	STOCKLAND	109,052	486,371.92	
	SYDNEY AIRPORT	54,983	359,588.82	
	TRANSURBAN GROUP	96,148	1,007,631.04	
	VICINITY CENTRES	149,882	439,154.26	
WESTFIELD CORP	90,539	816,661.78		
オーストラリアドル 小計		1,343,129	7,144,848.55	(607,526,472)
香港ドル	HKT TRUST AND HKT LTD	121,000	1,147,080.00	
	LINK REIT	103,000	5,165,450.00	
香港ドル 小計		224,000	6,312,530.00	(95,256,077)
シンガポールドル	ASCENDAS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	109,000	251,790.00	
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	82,600	122,248.00	
	CAPITALAND MALL TRUST	132,400	251,560.00	
	SUNTEC REIT	101,400	166,296.00	
シンガポールドル 小計		425,400	791,894.00	(64,111,738)
合計			4,139,703,818	(4,139,703,818)

(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 35銘柄	1.7%	71.0%
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	0.1%	5.5%
英ポンド	投資証券 5銘柄	0.1%	4.1%
オーストラリアドル	投資証券 13銘柄	0.4%	14.7%
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27年12月21日現在）	（平成28年12月20日現在）
資産の部		
流動資産		
金銭信託	-	209
コール・ローン	65	9,835
親投資信託受益証券	3,220,109,528	2,605,037,268
流動資産合計	3,220,109,593	2,605,047,312
資産合計	3,220,109,593	2,605,047,312
負債の部		
流動負債		
未払受託者報酬	15,291	3,092
未払委託者報酬	7,644	1,546
その他未払費用	1,910	386
流動負債合計	24,845	5,024
負債合計	24,845	5,024
純資産の部		
元本等		
元本	1,807,023,919	1,539,170,048
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	1,413,060,829	1,065,872,240
元本等合計	3,220,084,748	2,605,042,288
純資産合計	3,220,084,748	2,605,042,288
負債純資産合計	3,220,109,593	2,605,047,312

注記表

（重要な会計方針の注記）

項 目	自 平成28年12月20日 至 平成28年12月20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27年12月21日現在）	（平成28年12月20日現在）
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	1,807,023,919口	1,539,170,048口
2. 1単位当たり純資産の額	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)	1口当たり純資産額 1.6925円 (10,000口当たりの純資産額 16,925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28年12月20日 至 平成28年12月20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28年12月20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）

自 平成28年12月20日 至 平成28年12月20日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。

（その他の注記）

項 目	（平成27年12月21日現在）	（平成28年12月20日現在）
期首元本額	1,807,023,919円	1,539,170,048円
期中追加設定元本額	-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	1,526,359,213	2,605,037,268	
合計		1,526,359,213	2,605,037,268	

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27年12月21日現在）	（平成28年12月20日現在）
資産の部		
流動資産		
預金	708,110,197	1,273,061,387
金銭信託	-	9,352,570
コール・ローン	508,221,461	441,158,759
国債証券	194,358,799,433	176,728,680,500
派生商品評価勘定	-	2,518,000
未収利息	1,699,971,647	1,434,187,906
前払費用	22,613,579	22,195,549
流動資産合計	197,297,716,317	179,911,154,671
資産合計	197,297,716,317	179,911,154,671
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	180,000	41,850
未払解約金	100,620,818	632,657,000
未払利息	-	1,106
その他未払費用	-	7,794
流動負債合計	100,800,818	632,707,750
負債合計	100,800,818	632,707,750
純資産の部		
元本等		
元本	109,818,225,660	105,043,968,082
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	87,378,689,839	74,234,478,839
元本等合計	197,196,915,499	179,278,446,921
純資産合計	197,196,915,499	179,278,446,921
負債純資産合計	197,297,716,317	179,911,154,671

注記表

（重要な会計方針の注記）

項 目	自 平成28年12月20日 至 平成28年12月20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</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。</p>
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建資産等の会計処理</p> <p>「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

項目	(平成27年12月21日現在)	(平成28年12月20日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	109,818,225,660口	105,043,968,082口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.7957円 (10,000口当たりの純資産額 17,957円)	1口当たり純資産額 1.7067円 (10,000口当たりの純資産額 17,067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28年12月20日 至平成28年12月20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

<p>2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク</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>
<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28年12月20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
	英ポンド	180,650,000	-	180,830,000	180,000
	合計	180,650,000	-	180,830,000	180,000

（平成28年12月20日現在）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

（単位：円）

区 分	種 類	契 約 額 等		時 価	評 価 損 益
			うち1年超		
市場取引以外の 取引	為替予約取引 売建	413,936,150	-	411,460,000	2,476,150
	米ドル	117,560,000	-	117,170,000	390,000
	カナダドル	88,167,000	-	87,440,000	727,000
	メキシコペソ	51,708,150	-	51,750,000	41,850
	ユーロ	122,967,000	-	121,980,000	987,000
	南アフリカランド	33,534,000	-	33,120,000	414,000
	合計	413,936,150	-	411,460,000	2,476,150

（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)

自 平成28年12月20日 至 平成28年12月20日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。

(その他の注記)

(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・DC外国債券インデックスファンドS	7,021,371,084円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	275,009,252円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	812,242,498円
三井住友・DC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・DCターゲットイヤーファンド2020	7,569,069円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2025	20,169,875円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2030	55,517,142円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2035	34,004,666円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2040	19,416,310円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2045	41,446,177円
三井住友・DC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

(平成28年12月20日現在)

開示対象ファンドの 期首における当該親投資信託の元本額	105,284,855,497円
--------------------------------	------------------

同期中における追加設定元本額	22,543,848円
同期中における一部解約元本額	263,431,263円
平成28年12月20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	8,189,684,105円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	359,532,658円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	1,002,767,123円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	519,625,799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)	15,869,660円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2020	9,425,916円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2025	28,404,195円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2030	68,668,482円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2035	52,353,200円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2040	26,048,571円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2045	60,840,968円
三井住友・DC年金バランスゼロ(債券型)	8,460,141円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	768,678,148円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	832,529,971円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	832,448,865円
イオン・バランス戦略ファンド	9,270,380円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2050	1,624,594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>	1,526,359,213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>	3,377,004,481円
S M A M・バランスファンドVA25<適格機関投資家専用>	17,643,484,733円
S M A M・バランスファンドVA37.5<適格機関投資家専用>	7,371,088,826円
S M A M・バランスファンドVA50<適格機関投資家専用>	16,466,642,012円
S M A M・バランスファンドVL30<適格機関投資家限定>	45,061,279円
S M A M・バランスファンドVL50<適格機関投資家限定>	134,526,850円
世界6資産バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	8,655,039円
S M A M・バランスファンドVA75<適格機関投資家専用>	1,002,314,233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>	152,420,385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>	1,528,345,391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>	1,989,588,910円
S M A M・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用>	5,074,689,743円
S M A M・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>	8,893,095,939円
S M A M・バランスVA株40T<適格機関投資家限定>	152,226,438円
S M A M・外国債券パッシブファンドVA<適格機関投資家限定>	14,373,754,636円
三井住友・外国債券インデックスファンド・VAS(適格機関投資家専用)	1,271,322,511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)	2,794,203,626円
S M A M・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	254,769,722円
S M A M・バランスファンドVA20<適格機関投資家専用>	818,837,893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)	3,118,164,522円
S M A M・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>	185,752,703円
S M A M・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>	51,000,429円
S M A M・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用>	17,250,752円
S M A M・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>	195,054,217円
S M A M・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	668,398,959円
S M A M・アセットバランスファンドVA20T<適格機関投資家専用>	221,675,054円
S M A M・アセットバランスファンドVA20A2<適格機関投資家専用>	204,316,370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 >	57,239,716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 >	7,011,810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 >	1,748,852,664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 >	26,356,319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 >	171,310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 >	4,647,684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 >	565,346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 >	218,167,322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 >	479,601円
S M A M ・ マルチアセットストラテジーファンド2 0 1 6 - 0 4 < 適格機関投資家限定 >	309,855,468円
S M A M ・ マルチアセットストラテジーファンド2 0 1 6 - 0 5 < 適格機関投資家限定 >	148,488,043円
S M A M ・ マルチアセットストラテジー ・ オープン < 適格機関投資家限定 >	195,895,157円
合計	105,043,968,082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 0.625	5,000,000.00	4,987,109.40	
		US TREASURY N/B 0.625	3,000,000.00	2,980,078.14	
		US TREASURY N/B 0.625	2,000,000.00	1,984,843.76	
		US TREASURY N/B 0.75	2,000,000.00	1,995,937.50	
		US TREASURY N/B 0.75	5,000,000.00	4,983,593.75	
		US TREASURY N/B 0.75	3,000,000.00	2,988,515.64	
		US TREASURY N/B 0.75	4,000,000.00	3,982,812.52	
		US TREASURY N/B 0.75	2,000,000.00	1,990,468.76	
		US TREASURY N/B 0.75	3,000,000.00	2,979,375.00	
		US TREASURY N/B 0.75	3,500,000.00	3,473,476.58	
		US TREASURY N/B 0.75	3,000,000.00	2,974,687.50	
		US TREASURY N/B 0.75	2,000,000.00	1,981,875.00	
		US TREASURY N/B 0.75	2,000,000.00	1,976,250.00	
		US TREASURY N/B 0.75	2,000,000.00	1,965,000.00	
		US TREASURY N/B 0.875	4,000,000.00	3,995,312.52	
		US TREASURY N/B 0.875	2,000,000.00	1,997,500.00	

US TREASURY N/B 0.875	3,000,000.00	2,989,687.50	
US TREASURY N/B 0.875	3,000,000.00	2,985,937.50	
US TREASURY N/B 0.875	2,000,000.00	1,987,031.26	
US TREASURY N/B 0.875	4,000,000.00	3,955,625.00	
US TREASURY N/B 0.875	3,000,000.00	2,963,671.89	
US TREASURY N/B 0.875	3,000,000.00	2,959,921.89	
US TREASURY N/B 0.875	3,000,000.00	2,951,015.64	
US TREASURY N/B 1	2,000,000.00	2,001,250.00	
US TREASURY N/B 1	4,000,000.00	3,998,437.52	
US TREASURY N/B 1	2,000,000.00	1,998,750.00	
US TREASURY N/B 1	2,000,000.00	1,996,250.00	
US TREASURY N/B 1	3,000,000.00	2,989,218.75	
US TREASURY N/B 1	3,000,000.00	2,968,828.14	
US TREASURY N/B 1	4,000,000.00	3,951,562.52	
US TREASURY N/B 1	2,000,000.00	1,973,593.76	
US TREASURY N/B 1	2,000,000.00	1,972,500.00	
US TREASURY N/B 1	2,000,000.00	1,969,687.50	
US TREASURY N/B 1	6,000,000.00	5,911,406.28	
US TREASURY N/B 1.125	2,000,000.00	1,999,375.00	
US TREASURY N/B 1.125	2,000,000.00	1,987,343.76	
US TREASURY N/B 1.125	4,000,000.00	3,949,062.52	
US TREASURY N/B 1.125	2,800,000.00	2,753,843.76	
US TREASURY N/B 1.125	3,000,000.00	2,945,859.39	
US TREASURY N/B 1.125	1,800,000.00	1,742,203.13	
US TREASURY N/B 1.125	3,000,000.00	2,886,796.89	
US TREASURY N/B 1.125	3,000,000.00	2,882,578.14	
US TREASURY N/B 1.125	2,000,000.00	1,920,312.50	
US TREASURY N/B 1.125	3,000,000.00	2,876,484.39	
US TREASURY N/B 1.25	3,000,000.00	3,000,937.50	
US TREASURY N/B 1.25	3,000,000.00	3,000,703.14	
US TREASURY N/B 1.25	3,000,000.00	2,998,359.39	
US TREASURY N/B 1.25	4,000,000.00	3,995,000.00	
US TREASURY N/B 1.25	2,000,000.00	1,994,687.50	
US TREASURY N/B 1.25	2,000,000.00	1,985,937.50	
US TREASURY N/B 1.25	3,000,000.00	2,965,312.50	
US TREASURY N/B 1.25	2,000,000.00	1,942,968.76	
US TREASURY N/B 1.25	3,000,000.00	2,891,250.00	
US TREASURY N/B 1.25	3,000,000.00	2,800,546.89	
US TREASURY N/B 1.375	4,000,000.00	4,013,437.52	
US TREASURY N/B 1.375	4,500,000.00	4,511,250.00	
US TREASURY N/B 1.375	5,000,000.00	5,012,109.40	
US TREASURY N/B 1.375	2,000,000.00	2,004,375.00	

US TREASURY N/B 1.375	5,000,000.00	5,004,296.90
US TREASURY N/B 1.375	4,000,000.00	3,974,062.52
US TREASURY N/B 1.375	2,000,000.00	1,983,437.50
US TREASURY N/B 1.375	4,000,000.00	3,964,375.00
US TREASURY N/B 1.375	4,000,000.00	3,960,000.00
US TREASURY N/B 1.375	3,000,000.00	2,968,125.00
US TREASURY N/B 1.375	2,000,000.00	1,970,312.50
US TREASURY N/B 1.375	3,000,000.00	2,952,656.25
US TREASURY N/B 1.375	3,000,000.00	2,949,140.64
US TREASURY N/B 1.375	3,000,000.00	2,936,718.75
US TREASURY N/B 1.375	2,000,000.00	1,950,781.26
US TREASURY N/B 1.375	2,000,000.00	1,949,062.50
US TREASURY N/B 1.375	3,000,000.00	2,826,328.14
US TREASURY N/B 1.375	2,000,000.00	1,878,906.26
US TREASURY N/B 1.375	3,000,000.00	2,816,484.39
US TREASURY N/B 1.5	5,000,000.00	5,024,609.40
US TREASURY N/B 1.5	4,700,000.00	4,720,929.71
US TREASURY N/B 1.5	2,000,000.00	2,007,656.26
US TREASURY N/B 1.5	3,000,000.00	3,007,500.00
US TREASURY N/B 1.5	3,000,000.00	2,997,656.25
US TREASURY N/B 1.5	3,000,000.00	2,977,968.75
US TREASURY N/B 1.5	3,000,000.00	2,913,281.25
US TREASURY N/B 1.5	2,000,000.00	1,909,531.26
US TREASURY N/B 1.5	3,000,000.00	2,860,312.50
US TREASURY N/B 1.5	5,000,000.00	4,550,390.65
US TREASURY N/B 1.625	5,000,000.00	5,031,250.00
US TREASURY N/B 1.625	4,000,000.00	4,021,875.00
US TREASURY N/B 1.625	3,000,000.00	3,014,765.64
US TREASURY N/B 1.625	2,000,000.00	2,008,750.00
US TREASURY N/B 1.625	3,000,000.00	3,012,656.25
US TREASURY N/B 1.625	2,000,000.00	2,003,750.00
US TREASURY N/B 1.625	2,000,000.00	1,992,343.76
US TREASURY N/B 1.625	3,000,000.00	2,985,000.00
US TREASURY N/B 1.625	3,000,000.00	2,973,046.89
US TREASURY N/B 1.625	3,000,000.00	2,908,828.14
US TREASURY N/B 1.625	3,500,000.00	3,382,968.75
US TREASURY N/B 1.625	3,000,000.00	2,878,593.75
US TREASURY N/B 1.625	3,000,000.00	2,875,078.14
US TREASURY N/B 1.625	3,000,000.00	2,861,953.14
US TREASURY N/B 1.625	6,000,000.00	5,549,531.28
US TREASURY N/B 1.625	6,000,000.00	5,538,281.28
US TREASURY N/B 1.75	1,000,000.00	1,009,765.63
US TREASURY N/B 1.75	2,000,000.00	2,014,062.50

US TREASURY N/B 1.75	2,300,000.00	2,294,429.69
US TREASURY N/B 1.75	2,000,000.00	1,989,531.26
US TREASURY N/B 1.75	3,000,000.00	2,945,390.64
US TREASURY N/B 1.75	2,500,000.00	2,451,953.12
US TREASURY N/B 1.75	3,000,000.00	2,938,593.75
US TREASURY N/B 1.75	3,000,000.00	2,937,656.25
US TREASURY N/B 1.75	3,000,000.00	2,923,593.75
US TREASURY N/B 1.75	3,000,000.00	2,911,640.64
US TREASURY N/B 1.75	5,000,000.00	4,831,250.00
US TREASURY N/B 1.875	3,000,000.00	3,017,812.50
US TREASURY N/B 1.875	3,000,000.00	2,973,984.39
US TREASURY N/B 1.875	3,000,000.00	2,956,640.64
US TREASURY N/B 1.875	2,000,000.00	1,964,218.76
US TREASURY N/B 1.875	3,000,000.00	2,941,640.64
US TREASURY N/B 2	3,000,000.00	3,027,187.50
US TREASURY N/B 2	2,300,000.00	2,316,710.94
US TREASURY N/B 2	4,000,000.00	4,022,187.52
US TREASURY N/B 2	3,000,000.00	3,009,609.39
US TREASURY N/B 2	5,000,000.00	5,004,687.50
US TREASURY N/B 2	3,000,000.00	2,994,609.39
US TREASURY N/B 2	3,000,000.00	2,990,625.00
US TREASURY N/B 2	3,000,000.00	2,991,562.50
US TREASURY N/B 2	3,100,000.00	3,084,500.00
US TREASURY N/B 2	3,000,000.00	2,970,234.39
US TREASURY N/B 2	5,000,000.00	4,933,593.75
US TREASURY N/B 2	5,500,000.00	5,414,492.21
US TREASURY N/B 2	7,000,000.00	6,748,984.41
US TREASURY N/B 2	7,000,000.00	6,716,718.75
US TREASURY N/B 2	3,000,000.00	2,857,968.75
US TREASURY N/B 2.125	3,500,000.00	3,542,109.37
US TREASURY N/B 2.125	4,000,000.00	4,034,062.52
US TREASURY N/B 2.125	2,000,000.00	2,010,625.00
US TREASURY N/B 2.125	5,000,000.00	5,021,093.75
US TREASURY N/B 2.125	3,000,000.00	3,010,078.14
US TREASURY N/B 2.125	4,000,000.00	4,009,375.00
US TREASURY N/B 2.125	3,000,000.00	2,991,562.50
US TREASURY N/B 2.125	7,000,000.00	6,800,390.66
US TREASURY N/B 2.25	2,000,000.00	2,034,843.76
US TREASURY N/B 2.25	4,000,000.00	4,052,812.52
US TREASURY N/B 2.25	2,000,000.00	2,024,375.00
US TREASURY N/B 2.25	2,000,000.00	2,019,843.76
US TREASURY N/B 2.25	6,000,000.00	5,910,468.78

US TREASURY N/B 2.25	6,500,000.00	6,353,242.22
US TREASURY N/B 2.25	3,000,000.00	2,486,718.75
US TREASURY N/B 2.375	2,000,000.00	2,036,562.50
US TREASURY N/B 2.375	2,000,000.00	2,039,687.50
US TREASURY N/B 2.375	7,000,000.00	6,971,562.50
US TREASURY N/B 2.5	4,000,000.00	4,038,437.52
US TREASURY N/B 2.5	7,000,000.00	7,044,843.75
US TREASURY N/B 2.5	3,500,000.00	3,077,265.62
US TREASURY N/B 2.5	3,300,000.00	2,893,687.50
US TREASURY N/B 2.5	3,000,000.00	2,629,453.14
US TREASURY N/B 2.625	4,000,000.00	4,071,250.00
US TREASURY N/B 2.625	2,000,000.00	2,040,781.26
US TREASURY N/B 2.625	4,000,000.00	4,119,375.00
US TREASURY N/B 2.625	5,500,000.00	5,663,281.25
US TREASURY N/B 2.75	4,000,000.00	4,072,812.52
US TREASURY N/B 2.75	3,000,000.00	3,090,468.75
US TREASURY N/B 2.75	6,200,000.00	6,353,546.90
US TREASURY N/B 2.75	5,000,000.00	5,121,875.00
US TREASURY N/B 2.75	2,000,000.00	1,868,906.26
US TREASURY N/B 2.75	11,000,000.00	10,270,390.68
US TREASURY N/B 2.875	3,000,000.00	3,067,500.00
US TREASURY N/B 2.875	4,000,000.00	3,798,125.00
US TREASURY N/B 2.875	1,500,000.00	1,428,515.62
US TREASURY N/B 3	2,800,000.00	2,747,062.50
US TREASURY N/B 3	4,000,000.00	3,904,375.00
US TREASURY N/B 3	4,000,000.00	3,896,875.00
US TREASURY N/B 3	4,000,000.00	3,894,375.00
US TREASURY N/B 3.125	2,000,000.00	2,081,406.26
US TREASURY N/B 3.125	5,000,000.00	5,244,531.25
US TREASURY N/B 3.125	2,000,000.00	2,008,437.50
US TREASURY N/B 3.125	2,500,000.00	2,510,742.20
US TREASURY N/B 3.125	4,000,000.00	4,001,562.52
US TREASURY N/B 3.375	5,000,000.00	5,258,593.75
US TREASURY N/B 3.375	4,000,000.00	4,191,875.00
US TREASURY N/B 3.5	2,500,000.00	2,570,312.50
US TREASURY N/B 3.5	2,500,000.00	2,647,851.57
US TREASURY N/B 3.5	2,000,000.00	2,163,750.00
US TREASURY N/B 3.625	5,000,000.00	5,281,250.00
US TREASURY N/B 3.625	6,000,000.00	6,370,312.50
US TREASURY N/B 3.625	5,000,000.00	5,345,312.50
US TREASURY N/B 3.625	6,000,000.00	6,578,437.50
US TREASURY N/B 3.625	3,000,000.00	3,288,281.25
US TREASURY N/B 3.75	3,000,000.00	3,142,031.25

	US TREASURY N/B 3.75	2,000,000.00	2,230,468.76	
	US TREASURY N/B 3.75	3,000,000.00	3,363,281.25	
	US TREASURY N/B 3.875	6,000,000.00	6,231,562.50	
	US TREASURY N/B 3.875	2,000,000.00	2,272,656.26	
	US TREASURY N/B 4	2,500,000.00	2,617,382.82	
	US TREASURY N/B 4.25	2,000,000.00	2,403,437.50	
	US TREASURY N/B 4.375	1,200,000.00	1,476,375.00	
	US TREASURY N/B 4.375	1,500,000.00	1,832,578.12	
	US TREASURY N/B 4.375	1,500,000.00	1,833,398.44	
	US TREASURY N/B 4.375	2,000,000.00	2,449,218.76	
	US TREASURY N/B 4.5	1,500,000.00	1,879,101.57	
	US TREASURY N/B 4.5	1,000,000.00	1,250,703.13	
	US TREASURY N/B 4.5	1,000,000.00	1,242,343.75	
	US TREASURY N/B 4.625	3,000,000.00	3,794,765.64	
	US TREASURY N/B 4.75	1,500,000.00	1,934,765.62	
	US TREASURY N/B 5.25	1,000,000.00	1,262,031.25	
	US TREASURY N/B 5.25	500,000.00	633,203.12	
	US TREASURY N/B 5.375	1,320,000.00	1,739,512.50	
	US TREASURY N/B 5.5	500,000.00	641,757.81	
	US TREASURY N/B 6	1,000,000.00	1,284,296.88	
	US TREASURY N/B 6.125	1,000,000.00	1,331,640.63	
	US TREASURY N/B 6.25	800,000.00	995,250.00	
	US TREASURY N/B 6.25	1,000,000.00	1,401,093.75	
	US TREASURY N/B 6.5	500,000.00	672,695.31	
	US TREASURY N/B 8	1,300,000.00	1,659,226.56	
	US TREASURY N/B 8.75	1,000,000.00	1,247,421.88	
	US TREASURY N/B 8.875	1,100,000.00	1,279,781.25	
	米ドル 小計	668,520,000.00	671,188,232.73 (78,649,837,111)	
カナダドル	CANADA-GOV'T 0.25	1,000,000.00	996,716.00	
	CANADA-GOV'T 0.75	1,000,000.00	988,400.00	
	CANADA-GOV'T 0.75	1,000,000.00	983,900.00	
	CANADA-GOV'T 0.75	2,000,000.00	1,959,600.00	
	CANADA-GOV'T 1.25	2,000,000.00	2,007,720.00	
	CANADA-GOV'T 1.25	1,000,000.00	1,006,370.00	
	CANADA-GOV'T 1.25	2,000,000.00	2,012,980.00	
	CANADA-GOV'T 1.25	1,000,000.00	1,007,560.00	
	CANADA-GOV'T 1.5	1,000,000.00	1,006,020.00	
	CANADA-GOV'T 1.5	2,000,000.00	2,002,580.00	
	CANADA-GOV'T 1.5	2,000,000.00	1,946,600.00	
	CANADA-GOV'T 1.75	1,000,000.00	1,019,950.00	
	CANADA-GOV'T 1.75	1,000,000.00	1,022,340.00	

	CANADA-GOV'T 2.25	1,000,000.00	1,042,320.00
	CANADA-GOV'T 2.5	2,000,000.00	2,126,180.00
	CANADA-GOV'T 2.75	1,000,000.00	1,074,400.00
	CANADA-GOV'T 3.25	1,000,000.00	1,090,280.00
	CANADA-GOV'T 3.5	2,000,000.00	2,166,340.00
	CANADA-GOV'T 3.5	1,500,000.00	1,833,195.00
	CANADA-GOV'T 3.75	2,500,000.00	2,674,500.00
	CANADA-GOV'T 4	3,000,000.00	3,861,510.00
	CANADA-GOV'T 4.25	1,500,000.00	1,574,850.00
	CANADA-GOV'T 5	1,500,000.00	2,129,835.00
	CANADA-GOV'T 5.75	1,500,000.00	2,100,855.00
	CANADA-GOV'T 5.75	1,500,000.00	2,210,580.00
	CANADA-GOV'T 8	500,000.00	788,050.00
	カナダドル 小計	38,500,000.00	42,633,631.00 (3,728,311,030)
メキシコペソ	MEXICAN BONOS 10	20,000,000.00	23,348,660.00
	MEXICAN BONOS 6.5	30,000,000.00	29,366,190.00
	MEXICAN BONOS 7.75	20,000,000.00	20,298,880.00
	MEXICAN BONOS 8	50,000,000.00	51,968,350.00
	MEXICAN BONOS 8	20,000,000.00	20,939,900.00
	MEXICAN BONOS 8.5	50,000,000.00	54,052,550.00
	MEXICAN BONOS 8.5	40,000,000.00	43,672,400.00
	メキシコペソ 小計	230,000,000.00	243,646,930.00 (1,403,406,316)
ユーロ	BELGIAN 0326 4	1,000,000.00	1,427,590.00
	BELGIAN 0.8	2,000,000.00	2,072,040.00
	BELGIAN 0291 5.5	2,000,000.00	3,058,480.00
	BELGIAN 0304 5	1,500,000.00	2,478,465.00
	BELGIAN 0308 4	1,500,000.00	1,845,135.00
	BELGIAN 0312 4	1,000,000.00	1,060,160.00
	BELGIAN 0315 4	1,500,000.00	1,659,600.00
	BELGIAN 0318 3.75	2,000,000.00	2,326,300.00
	BELGIAN 0320 4.25	1,500,000.00	2,414,460.00
	BELGIAN 0321 4.25	1,700,000.00	2,078,845.00
	BELGIAN 0324 4.5	1,000,000.00	1,372,480.00
	BELGIAN 0325 4.25	2,000,000.00	2,520,440.00
	BELGIAN 0327 3	1,000,000.00	1,100,720.00
	BELGIAN 0328 2.25	1,000,000.00	1,153,180.00
	BELGIAN 0329 1.25	1,000,000.00	1,029,340.00
	BELGIAN 0332 2.6	2,000,000.00	2,364,840.00
	BELGIAN 0333 3	500,000.00	651,550.00
	BELGIAN 1	1,000,000.00	1,042,140.00
	BELGIAN 1	1,000,000.00	999,020.00

BELGIAN 1.9	1,000,000.00	1,121,390.00
BELGIAN 2.15	500,000.00	546,845.00
BELGIAN 3.75	1,000,000.00	1,533,210.00
BTPS 0.1	1,000,000.00	1,002,750.00
BTPS 0.3	1,000,000.00	1,007,380.00
BTPS 0.45	2,000,000.00	1,997,200.00
BTPS 0.95	2,000,000.00	1,991,700.00
BTPS 1.05	1,000,000.00	1,028,270.00
BTPS 1.25	1,000,000.00	949,400.00
BTPS 1.35	2,000,000.00	2,057,400.00
BTPS 1.45	1,000,000.00	1,031,950.00
BTPS 1.5	1,000,000.00	1,037,900.00
BTPS 1.5	2,000,000.00	1,991,600.00
BTPS 1.6	2,000,000.00	1,976,900.00
BTPS 1.65	1,000,000.00	938,100.00
BTPS 2	2,000,000.00	2,054,900.00
BTPS 2.15	2,000,000.00	2,148,260.00
BTPS 2.25	1,000,000.00	976,700.00
BTPS 2.5	1,000,000.00	1,058,850.00
BTPS 2.5	2,000,000.00	2,157,100.00
BTPS 2.7	1,000,000.00	966,180.00
BTPS 3.25	1,500,000.00	1,616,400.00
BTPS 3.5	3,400,000.00	3,578,670.00
BTPS 3.5	2,000,000.00	2,141,060.00
BTPS 3.5	1,000,000.00	1,158,750.00
BTPS 3.75	3,000,000.00	3,417,600.00
BTPS 3.75	2,000,000.00	2,280,360.00
BTPS 3.75	3,300,000.00	3,783,780.00
BTPS 3.75	2,000,000.00	2,340,300.00
BTPS 4	3,500,000.00	3,980,445.00
BTPS 4	3,000,000.00	3,695,010.00
BTPS 4.25	2,400,000.00	2,619,120.00
BTPS 4.25	3,500,000.00	3,895,325.00
BTPS 4.25	3,300,000.00	3,728,604.00
BTPS 4.5	4,000,000.00	4,207,600.00
BTPS 4.5	3,000,000.00	3,225,150.00
BTPS 4.5	2,700,000.00	2,968,785.00
BTPS 4.5	2,700,000.00	3,064,176.00
BTPS 4.5	1,800,000.00	2,181,420.00
BTPS 4.5	2,000,000.00	2,440,600.00
BTPS 4.5	2,000,000.00	2,468,900.00
BTPS 4.75	2,600,000.00	3,103,698.00
BTPS 4.75	2,500,000.00	3,088,500.00

BTPS 4.75	2,000,000.00	2,570,300.00	
BTPS 4.75	2,000,000.00	2,723,260.00	
BTPS 5	2,000,000.00	2,433,100.00	
BTPS 5	3,000,000.00	3,810,450.00	
BTPS 5	2,470,000.00	3,382,368.60	
BTPS 5	2,000,000.00	2,783,800.00	
BTPS 5	2,500,000.00	3,469,375.00	
BTPS 5.25	3,700,000.00	5,009,430.00	
BTPS 5.5	2,500,000.00	3,143,700.00	
BTPS 5.5	2,500,000.00	3,150,500.00	
BTPS 5.75	2,200,000.00	3,206,016.00	
BTPS 6	3,100,000.00	4,550,800.00	
BTPS 6.5	2,960,000.00	4,291,644.80	
BTPS 7.25	1,000,000.00	1,500,980.00	
BTPS 9	1,000,000.00	1,516,700.00	
BUNDESUBL-165 0.5	2,000,000.00	2,031,480.00	
BUNDESUBL-166 0.25	2,000,000.00	2,028,560.00	
BUNDESUBL-167 1	2,000,000.00	2,066,260.00	
BUNDESUBL-168 1	1,000,000.00	1,039,710.00	
BUNDESUBL-169 0.5	1,000,000.00	1,030,510.00	
BUNDESUBL-170 0.25	1,000,000.00	1,029,510.00	
BUNDESUBL-171 0	1,000,000.00	1,024,500.00	
BUNDESUBL-172 0.25	2,000,000.00	2,071,160.00	
BUNDESUBL-173 0	1,000,000.00	1,026,300.00	
BUNDESUBL-174 0	1,000,000.00	1,025,490.00	
BUNDESSCHATZANW 0	1,000,000.00	1,014,140.00	
DEUTSCHLAND REP 0	1,000,000.00	976,780.00	
DEUTSCHLAND REP 0.5	2,000,000.00	2,083,940.00	
DEUTSCHLAND REP 0.5	3,000,000.00	3,095,520.00	
DEUTSCHLAND REP 1	2,000,000.00	2,167,100.00	
DEUTSCHLAND REP 1	2,000,000.00	2,163,320.00	
DEUTSCHLAND REP 1.5	2,500,000.00	2,771,100.00	
DEUTSCHLAND REP 1.5	1,500,000.00	1,669,095.00	
DEUTSCHLAND REP 1.5	2,000,000.00	2,231,200.00	
DEUTSCHLAND REP 1.5	2,000,000.00	2,242,040.00	
DEUTSCHLAND REP 1.75	2,500,000.00	2,802,100.00	
DEUTSCHLAND REP 1.75	2,000,000.00	2,275,780.00	
DEUTSCHLAND REP 2	2,000,000.00	2,253,260.00	
DEUTSCHLAND REP 2	1,500,000.00	1,726,890.00	
DEUTSCHLAND REP 2.25	1,500,000.00	1,666,740.00	
DEUTSCHLAND REP 2.25	2,000,000.00	2,268,460.00	
DEUTSCHLAND REP 2.5	2,000,000.00	2,259,260.00	

DEUTSCHLAND REP 2.5	2,200,000.00	3,039,938.00
DEUTSCHLAND REP 2.5	2,000,000.00	2,793,740.00
DEUTSCHLAND REP 3	3,000,000.00	3,399,270.00
DEUTSCHLAND REP 3.25	3,000,000.00	3,371,370.00
DEUTSCHLAND REP 3.25	2,000,000.00	2,355,320.00
DEUTSCHLAND REP 3.25	1,500,000.00	2,306,655.00
DEUTSCHLAND REP 3.5	4,000,000.00	4,442,280.00
DEUTSCHLAND REP 3.75	3,500,000.00	3,830,680.00
DEUTSCHLAND REP 4	3,000,000.00	3,152,940.00
DEUTSCHLAND REP 4	2,200,000.00	3,533,640.00
DEUTSCHLAND REP 4.25	3,200,000.00	3,450,880.00
DEUTSCHLAND REP 4.25	1,500,000.00	2,563,545.00
DEUTSCHLAND REP 4.75	1,300,000.00	1,943,279.00
DEUTSCHLAND REP 4.75	2,100,000.00	3,530,436.00
DEUTSCHLAND REP 4.75	1,400,000.00	2,573,634.00
DEUTSCHLAND REP 5.5	1,800,000.00	3,020,904.00
DEUTSCHLAND REP 5.625	1,580,000.00	2,488,500.00
DEUTSCHLAND REP 6.25	1,200,000.00	1,747,272.00
DEUTSCHLAND REP 6.25	1,000,000.00	1,737,700.00
DEUTSCHLAND REP 6.5	1,000,000.00	1,645,320.00
FINNISH GOV'T 1.625	1,000,000.00	1,108,680.00
FINNISH GOV'T 2	1,000,000.00	1,141,890.00
FINNISH GOV'T 2.625	500,000.00	678,055.00
FINNISH GOV'T 2.75	600,000.00	748,506.00
FINNISH GOV'T 3.375	1,200,000.00	1,359,372.00
FINNISH GOV'T 3.5	1,000,000.00	1,172,360.00
FINNISH GOV'T 4	1,000,000.00	1,322,340.00
FRANCE O.A.T. 0	2,000,000.00	2,032,700.00
FRANCE O.A.T. 0	2,000,000.00	2,026,420.00
FRANCE O.A.T. 0.25	2,000,000.00	2,051,580.00
FRANCE O.A.T. 0.25	1,000,000.00	956,500.00
FRANCE O.A.T. 0.5	2,000,000.00	2,063,800.00
FRANCE O.A.T. 0.5	3,000,000.00	3,020,790.00
FRANCE O.A.T. 0.5	3,000,000.00	2,963,430.00
FRANCE O.A.T. 1	3,000,000.00	3,073,140.00
FRANCE O.A.T. 1	1,000,000.00	1,032,750.00
FRANCE O.A.T. 1	2,000,000.00	2,081,600.00
FRANCE O.A.T. 1	3,000,000.00	3,121,620.00
FRANCE O.A.T. 1.25	1,000,000.00	986,930.00
FRANCE O.A.T. 1.5	2,000,000.00	2,116,080.00
FRANCE O.A.T. 1.75	4,000,000.00	4,444,680.00
FRANCE O.A.T. 1.75	3,000,000.00	3,344,400.00
FRANCE O.A.T. 2.25	2,800,000.00	3,182,648.00

FRANCE O.A.T. 2.25	3,000,000.00	3,455,970.00	
FRANCE O.A.T. 2.5	4,500,000.00	5,011,110.00	
FRANCE O.A.T. 2.5	3,000,000.00	3,572,160.00	
FRANCE O.A.T. 2.75	3,000,000.00	3,612,300.00	
FRANCE O.A.T. 3	4,000,000.00	4,683,360.00	
FRANCE O.A.T. 3.25	3,800,000.00	4,450,674.00	
FRANCE O.A.T. 3.25	2,200,000.00	3,037,232.00	
FRANCE O.A.T. 3.5	4,000,000.00	4,540,600.00	
FRANCE O.A.T. 3.5	4,000,000.00	5,062,040.00	
FRANCE O.A.T. 3.75	5,000,000.00	5,623,650.00	
FRANCE O.A.T. 3.75	3,700,000.00	4,362,337.00	
FRANCE O.A.T. 4	4,000,000.00	4,255,520.00	
FRANCE O.A.T. 4	2,700,000.00	4,050,297.00	
FRANCE O.A.T. 4	1,370,000.00	2,278,419.60	
FRANCE O.A.T. 4	1,500,000.00	2,558,715.00	
FRANCE O.A.T. 4.25	4,000,000.00	4,368,120.00	
FRANCE O.A.T. 4.25	4,400,000.00	4,910,576.00	
FRANCE O.A.T. 4.25	4,000,000.00	5,144,920.00	
FRANCE O.A.T. 4.5	3,200,000.00	5,190,528.00	
FRANCE O.A.T. 4.75	3,100,000.00	4,905,068.00	
FRANCE O.A.T. 5.5	3,500,000.00	5,402,390.00	
FRANCE O.A.T. 5.75	3,200,000.00	5,371,744.00	
FRANCE O.A.T. 6	2,500,000.00	3,713,225.00	
FRANCE O.A.T. 8.5	850,000.00	1,072,547.00	
FRANCE O.A.T. 8.5	1,200,000.00	1,848,516.00	
IRISH GOVT 2	1,000,000.00	1,063,280.00	
IRISH GOVT 2.4	1,000,000.00	1,151,950.00	
IRISH GOVT 3.4	1,000,000.00	1,213,580.00	
IRISH GOVT 3.9	1,000,000.00	1,235,630.00	
IRISH GOVT 4.4	1,000,000.00	1,124,300.00	
IRISH GOVT 4.5	1,000,000.00	1,092,950.00	
IRISH GOVT 4.5	490,000.00	570,889.20	
IRISH GOVT 5	1,000,000.00	1,208,480.00	
IRISH GOVT 5.4	1,500,000.00	2,077,050.00	
IRISH GOVT 5.9	800,000.00	946,400.00	
NETHERLANDS GOVT 0	1,000,000.00	1,009,450.00	
NETHERLANDS GOVT 0.25	1,000,000.00	1,028,980.00	
NETHERLANDS GOVT 0.25	1,000,000.00	1,000,930.00	
NETHERLANDS GOVT 0.5	1,500,000.00	1,516,080.00	
NETHERLANDS GOVT 1.25	1,500,000.00	1,531,875.00	
NETHERLANDS GOVT 1.25	2,000,000.00	2,082,320.00	
NETHERLANDS GOVT 1.75	2,200,000.00	2,474,340.00	

NETHERLANDS GOVT 2	2,000,000.00	2,292,980.00
NETHERLANDS GOVT 2.25	2,000,000.00	2,289,640.00
NETHERLANDS GOVT 2.5	1,100,000.00	1,398,782.00
NETHERLANDS GOVT 2.75	1,000,000.00	1,439,580.00
NETHERLANDS GOVT 3.25	1,500,000.00	1,761,060.00
NETHERLANDS GOVT 3.5	2,000,000.00	2,299,540.00
NETHERLANDS GOVT 3.75	1,000,000.00	1,246,420.00
NETHERLANDS GOVT 3.75	2,000,000.00	3,260,220.00
NETHERLANDS GOVT 4	1,500,000.00	1,612,320.00
NETHERLANDS GOVT 4	1,500,000.00	1,684,020.00
NETHERLANDS GOVT 4	1,200,000.00	1,909,224.00
NETHERLANDS GOVT 5.5	1,500,000.00	2,315,580.00
REP OF AUSTRIA 0.75	1,000,000.00	1,025,000.00
REP OF AUSTRIA 1.15	1,000,000.00	1,033,530.00
REP OF AUSTRIA 1.2	500,000.00	539,045.00
REP OF AUSTRIA 1.65	1,000,000.00	1,118,380.00
REP OF AUSTRIA 1.75	1,000,000.00	1,125,280.00
REP OF AUSTRIA 1.95	1,000,000.00	1,064,320.00
REP OF AUSTRIA 3.15	500,000.00	726,255.00
REP OF AUSTRIA 3.4	1,000,000.00	1,212,760.00
REP OF AUSTRIA 3.5	2,000,000.00	2,369,400.00
REP OF AUSTRIA 3.65	1,000,000.00	1,209,960.00
REP OF AUSTRIA 3.8	500,000.00	899,545.00
REP OF AUSTRIA 3.9	2,000,000.00	2,316,020.00
REP OF AUSTRIA 4.15	1,300,000.00	2,041,897.00
REP OF AUSTRIA 4.35	1,200,000.00	1,334,220.00
REP OF AUSTRIA 4.65	1,000,000.00	1,057,240.00
REP OF AUSTRIA 4.85	1,000,000.00	1,414,190.00
REP OF AUSTRIA 6.25	1,000,000.00	1,601,230.00
SPANISH GOV'T 0.25	1,000,000.00	1,006,950.00
SPANISH GOV'T 0.25	1,000,000.00	1,008,780.00
SPANISH GOV'T 0.75	2,000,000.00	2,046,200.00
SPANISH GOV'T 1.3	1,000,000.00	994,480.00
SPANISH GOV'T 1.4	2,000,000.00	2,087,600.00
SPANISH GOV'T 1.6	2,000,000.00	2,073,900.00
SPANISH GOV'T 1.95	1,500,000.00	1,584,345.00
SPANISH GOV'T 1.95	1,000,000.00	1,016,950.00
SPANISH GOV'T 2.15	2,000,000.00	2,151,760.00
SPANISH GOV'T 2.75	2,000,000.00	2,136,900.00
SPANISH GOV'T 2.75	3,000,000.00	3,383,400.00
SPANISH GOV'T 2.9	1,000,000.00	1,059,930.00
SPANISH GOV'T 3.45	500,000.00	551,310.00
SPANISH GOV'T 3.75	2,200,000.00	2,365,286.00

	SPANISH GOV'T 3.8	2,000,000.00	2,406,160.00	
	SPANISH GOV'T 4	3,000,000.00	3,399,000.00	
	SPANISH GOV'T 4.1	3,000,000.00	3,209,190.00	
	SPANISH GOV'T 4.2	2,050,000.00	2,703,089.00	
	SPANISH GOV'T 4.3	3,000,000.00	3,371,040.00	
	SPANISH GOV'T 4.4	1,000,000.00	1,241,280.00	
	SPANISH GOV'T 4.5	2,500,000.00	2,632,125.00	
	SPANISH GOV'T 4.6	2,500,000.00	2,804,700.00	
	SPANISH GOV'T 4.65	2,000,000.00	2,564,360.00	
	SPANISH GOV'T 4.7	1,500,000.00	2,126,100.00	
	SPANISH GOV'T 4.8	3,000,000.00	3,819,840.00	
	SPANISH GOV'T 4.85	2,000,000.00	2,364,860.00	
	SPANISH GOV'T 4.9	1,500,000.00	2,174,250.00	
	SPANISH GOV'T 5.15	1,500,000.00	2,071,425.00	
	SPANISH GOV'T 5.15	1,000,000.00	1,512,480.00	
	SPANISH GOV'T 5.4	2,000,000.00	2,574,800.00	
	SPANISH GOV'T 5.5	2,000,000.00	2,459,640.00	
	SPANISH GOV'T 5.75	2,200,000.00	3,333,550.00	
	SPANISH GOV'T 5.85	2,500,000.00	3,192,250.00	
	SPANISH GOV'T 5.9	1,500,000.00	2,115,150.00	
	SPANISH GOV'T 6	2,400,000.00	3,550,680.00	
	ユーロ 小計	481,270,000.00	577,255,127.20 (70,413,580,415)	
英債券	UK TSY GILT 1.25	1,500,000.00	1,527,300.00	
	UK TSY GILT 1.5	1,000,000.00	1,038,750.00	
	UK TSY GILT 1.5	1,000,000.00	1,008,180.00	
	UK TSY GILT 1.75	1,000,000.00	1,040,180.00	
	UK TSY GILT 1.75	3,000,000.00	3,154,650.00	
	UK TSY GILT 2	1,000,000.00	1,050,800.00	
	UK TSY GILT 2	1,500,000.00	1,588,170.00	
	UK TSY GILT 2.25	2,700,000.00	2,903,850.00	
	UK TSY GILT 2.75	2,000,000.00	2,240,200.00	
	UK TSY GILT 3.25	2,500,000.00	3,113,925.00	
	UK TSY GILT 3.5	2,500,000.00	3,261,250.00	
	UK TSY GILT 3.5	1,500,000.00	2,306,475.00	
	UK TSY GILT 3.75	3,000,000.00	3,289,710.00	
	UK TSY GILT 3.75	2,800,000.00	3,145,940.00	
	UK TSY GILT 3.75	2,400,000.00	2,750,232.00	
	UK TSY GILT 3.75	2,300,000.00	3,353,515.00	
	UK TSY GILT 4	1,500,000.00	1,754,262.00	
	UK TSY GILT 4	2,000,000.00	3,256,200.00	
	UK TSY GILT 4.25	1,300,000.00	1,657,012.50	

	UK TSY GILT 4.25	2,000,000.00	2,655,620.00
	UK TSY GILT 4.25	2,000,000.00	2,734,200.00
	UK TSY GILT 4.25	1,500,000.00	2,101,425.00
	UK TSY GILT 4.25	2,000,000.00	2,831,200.00
	UK TSY GILT 4.25	1,900,000.00	2,833,698.00
	UK TSY GILT 4.25	1,900,000.00	2,939,015.00
	UK TSY GILT 4.25	2,100,000.00	3,466,365.00
	UK TSY GILT 4.5	2,700,000.00	2,961,144.00
	UK TSY GILT 4.5	1,500,000.00	2,082,345.00
	UK TSY GILT 4.5	2,000,000.00	2,984,000.00
	UK TSY GILT 4.75	2,700,000.00	3,080,424.60
	UK TSY GILT 4.75	1,300,000.00	1,790,438.00
	UK TSY GILT 4.75	1,500,000.00	2,229,975.00
	UK TSY GILT 5	2,500,000.00	2,636,500.00
	UK TSY GILT 5	2,500,000.00	3,250,875.00
	UK TSY GILT 6	1,200,000.00	1,780,344.00
	UK TSY GILT 8	1,620,000.00	2,150,671.50
	英債券 小計	69,420,000.00	87,948,841.60 (12,783,364,126)
スイスフラン	SWISS (GOVT) 2.25	900,000.00	996,930.00
	SWISS (GOVT) 3	500,000.00	521,000.00
	SWISS (GOVT) 3	1,000,000.00	1,094,900.00
	SWISS (GOVT) 4	500,000.00	638,150.00
	SWISS (GOVT) 4	700,000.00	1,015,000.00
	スイスフラン 小計	3,600,000.00	4,265,980.00 (486,748,318)
スウェーデンクローナ	SWEDISH GOVRNMNT 1	8,000,000.00	8,275,200.00
	SWEDISH GOVRNMNT 1.5	8,000,000.00	8,720,000.00
	SWEDISH GOVRNMNT 2.5	5,000,000.00	5,864,750.00
	SWEDISH GOVRNMNT 3.5	11,000,000.00	13,146,870.00
	SWEDISH GOVRNMNT 3.5	6,000,000.00	8,054,700.00
	SWEDISH GOVRNMNT 4.25	12,000,000.00	13,334,400.00
	SWEDISH GOVRNMNT 5	5,000,000.00	6,073,000.00
	スウェーデンクローナ 小計	55,000,000.00	63,468,920.00 (793,361,500)
ノルウェークローネ	NORWEGIAN GOV'T 2	10,000,000.00	10,365,000.00
	NORWEGIAN GOV'T 3	4,000,000.00	4,405,600.00
	NORWEGIAN GOV'T 3.75	11,000,000.00	12,256,200.00
	NORWEGIAN GOV'T 4.5	6,000,000.00	6,536,100.00
	ノルウェークローネ 小計	31,000,000.00	33,562,900.00 (453,099,150)
デンマーククローネ	DENMARK - BULLET 1.5	5,000,000.00	5,495,000.00
	DENMARK - BULLET 1.75	10,000,000.00	11,175,000.00

	DENMARK - BULLET 3	10,000,000.00	11,608,400.00
	DENMARK - BULLET 4	5,000,000.00	5,211,500.00
	DENMARK - BULLET 4	8,000,000.00	9,076,800.00
	DENMARK - BULLET 4.5	14,000,000.00	23,952,600.00
	DENMARK - BULLET 7	3,080,000.00	4,754,596.00
	デンマーククローネ 小計	55,080,000.00	71,273,896.00 (1,169,604,633)
ポーランドズロチ	POLAND GOVT BOND 2.5	5,000,000.00	5,060,000.00
	POLAND GOVT BOND 2.5	4,000,000.00	3,700,800.00
	POLAND GOVT BOND 3.25	2,000,000.00	1,990,000.00
	POLAND GOVT BOND 4	2,000,000.00	2,110,000.00
	POLAND GOVT BOND 5.25	5,000,000.00	5,155,500.00
	POLAND GOVT BOND 5.25	2,000,000.00	2,192,000.00
	POLAND GOVT BOND 5.5	4,000,000.00	4,348,000.00
	POLAND GOVT BOND 5.75	4,000,000.00	4,600,000.00
	POLAND GOVT BOND 5.75	4,200,000.00	4,823,616.00
	POLAND GOVT BOND 5.75	2,000,000.00	2,438,060.00
	ポーランドズロチ 小計	34,200,000.00	36,417,976.00 (1,004,771,957)
オーストラリアドル	AUSTRALIAN GOVT. 1.75	2,000,000.00	1,971,500.00
	AUSTRALIAN GOVT. 2.25	1,000,000.00	932,800.00
	AUSTRALIAN GOVT. 2.75	1,000,000.00	1,020,500.00
	AUSTRALIAN GOVT. 2.75	3,000,000.00	3,019,827.00
	AUSTRALIAN GOVT. 2.75	2,000,000.00	1,971,600.00
	AUSTRALIAN GOVT. 2.75	1,000,000.00	896,100.00
	AUSTRALIAN GOVT. 3	1,000,000.00	839,351.00
	AUSTRALIAN GOVT. 3.25	2,000,000.00	2,049,720.00
	AUSTRALIAN GOVT. 3.25	2,000,000.00	2,077,800.00
	AUSTRALIAN GOVT. 3.25	1,500,000.00	1,530,750.00
	AUSTRALIAN GOVT. 3.75	1,000,000.00	1,018,800.00
	AUSTRALIAN GOVT. 4.25	3,000,000.00	3,360,600.00
	AUSTRALIAN GOVT. 4.5	3,000,000.00	3,235,194.00
	AUSTRALIAN GOVT. 4.5	1,500,000.00	1,718,850.00
	AUSTRALIAN GOVT. 4.75	2,200,000.00	2,569,380.00
	AUSTRALIAN GOVT. 5.25	3,000,000.00	3,216,948.00
	AUSTRALIAN GOVT. 5.5	2,000,000.00	2,080,000.00
	AUSTRALIAN GOVT. 5.5	2,500,000.00	2,941,500.00
	AUSTRALIAN GOVT. 5.75	3,000,000.00	3,448,950.00
	AUSTRALIAN GOVT. 5.75	2,000,000.00	2,350,800.00
	オーストラリアドル 小計	39,700,000.00	42,250,970.00 (3,592,599,979)
シンガポールドル	SINGAPORE GOV'T 2.25	500,000.00	506,650.00
	SINGAPORE GOV'T 2.75	400,000.00	396,000.00

		SINGAPORE GOV'T 2.875	400,000.00	404,182.00	
		SINGAPORE GOV'T 3.125	1,000,000.00	1,051,000.00	
		SINGAPORE GOV'T 3.25	1,000,000.00	1,052,500.00	
		SINGAPORE GOV'T 3.375	500,000.00	536,900.00	
		SINGAPORE GOV'T 3.5	1,500,000.00	1,626,750.00	
		SINGAPORE GOV'T 4	2,100,000.00	2,192,526.00	
	シンガポールドル 小計		7,400,000.00	7,766,508.00	(628,776,487)
	マレーシアリングット	MALAYSIA GOVT 3.418	8,000,000.00	7,701,672.00	
		MALAYSIA GOVT 3.502	9,000,000.00	8,275,698.00	
		MALAYSIA GOVT 4.24	5,000,000.00	5,028,785.00	
		MALAYSIA GOVT 4.378	5,000,000.00	5,089,690.00	
	マレーシアリングット 小計		27,000,000.00	26,095,845.00	(682,928,263)
	南アフリカランド	REP SOUTH AFRICA 6.5	60,000,000.00	42,402,000.00	
		REP SOUTH AFRICA 6.75	30,000,000.00	28,260,000.00	
		REP SOUTH AFRICA 7	40,000,000.00	32,520,000.00	
		REP SOUTH AFRICA 8	10,000,000.00	10,001,500.00	
	南アフリカランド 小計		140,000,000.00	113,183,500.00	(938,291,215)
	合計			176,728,680,500	(176,728,680,500)

(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 213銘柄	43.9%	44.5%
カナダドル	国債証券 26銘柄	2.1%	2.1%
メキシコペソ	国債証券 7銘柄	0.8%	0.8%
ユーロ	国債証券 253銘柄	39.3%	39.8%
英ポンド	国債証券 36銘柄	7.1%	7.2%
スイスフラン	国債証券 5銘柄	0.3%	0.3%
スウェーデンクローナ	国債証券 7銘柄	0.4%	0.4%
ノルウェークローネ	国債証券 4銘柄	0.3%	0.3%
デンマーククローネ	国債証券 7銘柄	0.7%	0.7%
ポーランドズロチ	国債証券 10銘柄	0.6%	0.6%
オーストラリアドル	国債証券 20銘柄	2.0%	2.0%
シンガポールドル	国債証券 8銘柄	0.4%	0.4%
マレーシアリングット	国債証券 4銘柄	0.4%	0.4%
南アフリカランド	国債証券 4銘柄	0.5%	0.5%

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 ・ 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27年12月18日現在）	（平成28年12月19日現在）
資産の部			
流動資産			
金銭信託	-	-	409
コール・ローン	-	-	578
親投資信託受益証券	420,393,814	420,393,814	460,263,512
流動資産合計	420,393,814	420,393,814	460,264,499
資産合計	420,393,814	420,393,814	460,264,499
負債の部			
流動負債			
未払受託者報酬	2,325	-	-
未払委託者報酬	21,073	-	-
流動負債合計	23,398	-	-
負債合計	23,398	-	-
純資産の部			
元本等			
元本	416,711,197	-	456,510,471
剰余金	-	-	-
剰余金又は欠損金（ ）	3,659,219	-	3,754,028
元本等合計	420,370,416	-	460,264,499
純資産合計	420,370,416	-	460,264,499
負債純資産合計	420,393,814	-	460,264,499

注記表

（重要な会計方針の注記）

項 目	自 平成28年 4月14日 至 平成28年12月19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27年12月18日現在）	（平成28年12月19日現在）
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	416,711,197口	456,510,471口
2. 1単位当たり純資産の額	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)	1口当たり純資産額 1.0082円 (10,000口当たりの純資産額 10,082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28年 4月14日 至 平成28年12月19日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<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28年12月19日現在)
1.貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	<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）

自 平成28年 4月14日 至 平成28年12月19日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。

（その他の注記）

項 目	（平成27年12月18日現在）	（平成28年12月19日現在）
期首元本額	387,243,990円	433,581,490円
期中追加設定元本額	48,937,001円	33,815,417円
期中一部解約元本額	19,469,794円	10,886,436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	454,940,706	460,263,512	
合計		454,940,706	460,263,512	

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27年12月18日現在）	（平成28年12月19日現在）
資産の部		
流動資産		
金銭信託	-	141,829,685
コール・ローン	306,631,991	200,327,968
国債証券	849,726,100	-
特殊債券	203,257,000	1,005,832,000
未収利息	4,434,646	3,613,655
前払費用	1,262,191	579,178
流動資産合計	1,365,311,928	1,352,182,486
資産合計	1,365,311,928	1,352,182,486
負債の部		
流動負債		
未払解約金	-	41,680,000
未払利息	-	528
その他未払費用	-	3,041
流動負債合計	-	41,683,569
負債合計	-	41,683,569
純資産の部		
元本等		
元本	1,348,876,502	1,295,396,140
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	16,435,426	15,102,777
元本等合計	1,365,311,928	1,310,498,917
純資産合計	1,365,311,928	1,310,498,917
負債純資産合計	1,365,311,928	1,352,182,486

注記表

（重要な会計方針の注記）

項 目	自 平成28年 4月14日 至 平成28年12月19日
-----	--------------------------------

有価証券の評価基準及び評価方法	<p>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27年12月18日現在)	(平成28年12月19日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	1,348,876,502口	1,295,396,140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 1.0117円 (10,000口当たりの純資産額 10,117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28年 4月14日 至 平成28年12月19日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<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、特殊債券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク</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28年12月19日現在)
1.貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	<p>(1) 有価証券（特殊債券）</p> <p>「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引）</p> <p>デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

(デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

自 平成28年 4月14日 至 平成28年12月19日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。

(その他の注記)

(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

(平成28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	1,290,985,957円
同期中における追加設定元本額	365,086,217円

同期中における一部解約元本額	360,676,034円
平成28年12月19日現在における元本の内訳	
S M A M ・ グローバルバランスファンド（機動的資産配分型）	7,959,973円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2020	40,828,422円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2025	20,057,866円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2030	9,683,673円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2035	7,294,636円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2040	3,632,028円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2045	8,547,932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＞	454,940,706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＞	500,547,456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＞	241,506,936円
合計	1,295,396,140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
特殊債券	第16回政府保証日本政策投資銀行債券	200,000,000	200,698,000	
	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	100,043,000	
	第40回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	202,658,000	
	第1回政府保証地方公共団体金融機構債券（6年）	100,000,000	100,312,000	
	第875回政府保証公営企業債券	100,000,000	100,719,000	
	第876回政府保証公営企業債券	100,000,000	100,954,000	
	第195回政府保証預金保険機構債	200,000,000	200,448,000	
合計		1,000,000,000	1,005,832,000	

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

【中間財務諸表】

1. 当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和52年大蔵省令第38号)ならびに同規則第38条の3、第57条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)に基づいて作成しております。
なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
2. 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第17期中間計算期間（平成28年12月21日から平成29年6月20日まで）の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。

【三井住友・DC年金プラン・ファンド（ターゲット・イヤー型）2010】

（1）【中間貸借対照表】

（単位：円）

第17期中間計算期間 （平成29年 6月20日現在）	
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	2,978,892
投資信託受益証券	539,774,769
未収入金	420,000
流動資産合計	543,173,661
資産合計	
543,173,661	
負債の部	
流動負債	
未払金	620,000
未払解約金	414,802
未払受託者報酬	116,968
未払委託者報酬	1,052,684
未払利息	7
その他未払費用	8,727
流動負債合計	2,213,188
負債合計	
2,213,188	
純資産の部	
元本等	
元本	432,513,491
剰余金	
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	108,446,982
元本等合計	540,960,473
純資産合計	
540,960,473	
負債純資産合計	
543,173,661	

（２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第17期中間計算期間 自 平成28年12月21日 至 平成29年 6月20日
営業収益	
有価証券売買等損益	3,347,464
営業収益合計	3,347,464
営業費用	
支払利息	848
受託者報酬	116,968
委託者報酬	1,052,684
その他費用	8,791
営業費用合計	1,179,291
営業利益又は営業損失（ ）	2,168,173
経常利益又は経常損失（ ）	2,168,173
中間純利益又は中間純損失（ ）	2,168,173
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（ ）	24,875
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	109,109,285
剰余金増加額又は欠損金減少額	3,003,283
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	3,003,283
剰余金減少額又は欠損金増加額	5,858,634
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	5,858,634
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-
分配金	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	108,446,982

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針の注記)

項 目	第17期中間計算期間 自 平成28年12月21日 至 平成29年 6月20日
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>

(中間貸借対照表に関する注記)

項 目	第17期中間計算期間 (平成29年 6月20日現在)	
1. 当中間計算期間の末日における受益権の総数		432,513,491口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額	1.2507円
	(10,000口当たりの純資産額)	12,507円)

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項目	第17期中間計算期間 (平成29年 6月20日現在)
1. 中間貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券(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。

(その他の注記)

項目	第17期中間計算期間 (平成29年 6月20日現在)
期首元本額	444,068,361円
期中追加設定元本額	12,291,239円
期中一部解約元本額	23,846,109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】

（1）【中間貸借対照表】

（単位：円）

第17期中間計算期間 （平成29年 6月20日現在）	
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	6,911,924
投資信託受益証券	1,333,964,429
未収入金	2,570,000
流動資産合計	1,343,446,353
資産合計	1,343,446,353
負債の部	
流動負債	
未払金	2,270,000
未払解約金	2,557,222
未払受託者報酬	286,604
未払委託者報酬	3,224,217
未払利息	16
その他未払費用	21,440
流動負債合計	8,359,499
負債合計	8,359,499
純資産の部	
元本等	
元本	906,217,097
剰余金	
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	428,869,757
元本等合計	1,335,086,854
純資産合計	1,335,086,854
負債純資産合計	1,343,446,353

（２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第17期中間計算期間 自 平成28年12月21日 至 平成29年 6月20日
営業収益	
有価証券売買等損益	13,419,318
営業収益合計	13,419,318
営業費用	
支払利息	2,258
受託者報酬	286,604
委託者報酬	3,224,217
その他費用	21,627
営業費用合計	3,534,706
営業利益又は営業損失（ ）	9,884,612
経常利益又は経常損失（ ）	9,884,612
中間純利益又は中間純損失（ ）	9,884,612
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（ ）	316,080
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	426,639,641
剰余金増加額又は欠損金減少額	14,795,893
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	14,795,893
剰余金減少額又は欠損金増加額	22,766,469
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	22,766,469
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-
分配金	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	428,869,757

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針の注記)

項 目	第17期中間計算期間 自 平成28年12月21日 至 平成29年 6月20日
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>

(中間貸借対照表に関する注記)

項 目	第17期中間計算期間 (平成29年 6月20日現在)	
1. 当中間計算期間の末日における受益権の総数		906,217,097口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額	1.4733円
	(10,000口当たりの純資産額	14,733円)

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項 目	第17期中間計算期間 (平成29年 6月20日現在)
1. 中間貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券（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。

（その他の注記）

項 目	第17期中間計算期間 (平成29年 6月20日現在)
期首元本額	923,437,583円
期中追加設定元本額	32,061,712円
期中一部解約元本額	49,282,198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】

（1）【中間貸借対照表】

（単位：円）

第17期中間計算期間 （平成29年 6月20日現在）	
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	7,407,292
投資信託受益証券	1,463,216,447
未収入金	1,780,000
流動資産合計	1,472,403,739
資産合計	1,472,403,739
負債の部	
流動負債	
未払金	970,000
未払解約金	1,770,347
未払受託者報酬	299,292
未払委託者報酬	3,367,021
未払利息	17
その他未払費用	22,392
流動負債合計	6,429,069
負債合計	6,429,069
純資産の部	
元本等	
元本	931,068,466
剰余金	
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	534,906,204
元本等合計	1,465,974,670
純資産合計	1,465,974,670
負債純資産合計	1,472,403,739

（２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第17期中間計算期間 自 平成28年12月21日 至 平成29年 6月20日
営業収益	
有価証券売買等損益	29,115,812
営業収益合計	29,115,812
営業費用	
支払利息	2,504
受託者報酬	299,292
委託者報酬	3,367,021
その他費用	22,595
営業費用合計	3,691,412
営業利益又は営業損失（ ）	25,424,400
経常利益又は経常損失（ ）	25,424,400
中間純利益又は中間純損失（ ）	25,424,400
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（ ）	96,428
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	487,618,011
剰余金増加額又は欠損金減少額	40,478,481
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	40,478,481
剰余金減少額又は欠損金増加額	18,711,116
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	18,711,116
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-
分配金	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	534,906,204

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針の注記)

項 目	第17期中間計算期間 自 平成28年12月21日 至 平成29年 6月20日
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>

(中間貸借対照表に関する注記)

項 目	第17期中間計算期間 (平成29年 6月20日現在)	
1. 当中間計算期間の末日における受益権の総数		931,068,466口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額	1.5745円
	(10,000口当たりの純資産額	15,745円)

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項 目	第17期中間計算期間 (平成29年 6月20日現在)
1. 中間貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券（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。

（その他の注記）

項 目	第17期中間計算期間 (平成29年 6月20日現在)
期首元本額	892,182,725円
期中追加設定元本額	73,124,751円
期中一部解約元本額	34,239,010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】

（1）【中間貸借対照表】

（単位：円）

		第17期中間計算期間 （平成29年 6月20日現在）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン		17,094,815
投資信託受益証券		2,225,481,330
未収入金		3,340,000
流動資産合計		2,245,916,145
資産合計		2,245,916,145
負債の部		
流動負債		
未払金		1,170,000
未払解約金		3,802,063
未払受託者報酬		455,406
未払委託者報酬		5,123,231
未払利息		40
その他未払費用		34,098
流動負債合計		10,584,838
負債合計		10,584,838
純資産の部		
元本等		
元本		1,345,227,351
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）		890,103,956
元本等合計		2,235,331,307
純資産合計		2,235,331,307
負債純資産合計		2,245,916,145

（２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第17期中間計算期間 自 平成28年12月21日 至 平成29年 6月20日
営業収益	
有価証券売買等損益	66,623,763
営業収益合計	66,623,763
営業費用	
支払利息	4,226
受託者報酬	455,406
委託者報酬	5,123,231
その他費用	34,410
営業費用合計	5,617,273
営業利益又は営業損失（ ）	61,006,490
経常利益又は経常損失（ ）	61,006,490
中間純利益又は中間純損失（ ）	61,006,490
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（ ）	271,822
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	791,412,280
剰余金増加額又は欠損金減少額	81,673,483
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	81,673,483
剰余金減少額又は欠損金増加額	43,716,475
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	43,716,475
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-
分配金	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	890,103,956

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針の注記)

項 目	第17期中間計算期間 自 平成28年12月21日 至 平成29年 6月20日
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>

(中間貸借対照表に関する注記)

項 目	第17期中間計算期間 (平成29年 6月20日現在)
1. 当中間計算期間の末日における受益権の総数	1,345,227,351口
2. 1単位当たり純資産の額	1.6617円
	(10,000口当たりの純資産額 16,617円)

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項目	第17期中間計算期間 (平成29年 6月20日現在)
1. 中間貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券（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。

（その他の注記）

項目	第17期中間計算期間 (平成29年 6月20日現在)
期首元本額	1,284,776,252円
期中追加設定元本額	131,444,946円
期中一部解約元本額	70,993,847円

（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、中間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29年 6月19日現在）

資産の部

（平成29年 6月19日現在）

流動資産	
コール・ローン	19,953
親投資信託受益証券	25,128,625,894
未収入金	69,829,997
流動資産合計	25,198,475,844
資産合計	
25,198,475,844	
負債の部	
流動負債	
未払解約金	69,829,997
未払受託者報酬	601,812
未払委託者報酬	526,579
その他未払費用	35,640
流動負債合計	70,994,028
負債合計	70,994,028
純資産の部	
元本等	
元本	15,844,096,803
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	9,283,385,013
元本等合計	25,127,481,816
純資産合計	25,127,481,816
負債純資産合計	25,198,475,844

注記表

（重要な会計方針の注記）

項目	自 平成28年12月 1日 至 平成29年 6月19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29年 6月19日現在）
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	15,844,096,803口

2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額	1,5859円
	(10,000口当たりの純資産額)	15,859円)

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

項 目	（平成29年 6月19日現在）
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。
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。

（その他の注記）

項 目	（平成29年 6月19日現在）
期首元本額	22,284,529,854円
期中追加設定元本額	184,062,946円
期中一部解約元本額	6,624,495,997円

（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29年 6月19日現在）	
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	1,344,309,017
株式	194,205,995,430
派生商品評価勘定	14,335,120
未収入金	287,840
未収配当金	1,374,832,560
差入委託証拠金	11,420,000
流動資産合計	196,951,179,967
資産合計	196,951,179,967
負債の部	
流動負債	
前受金	14,455,000
未払解約金	210,171,021
未払利息	3,359
その他未払費用	3,476
流動負債合計	224,632,856
負債合計	224,632,856
純資産の部	
元本等	
元本	81,370,359,520
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	115,356,187,591
元本等合計	196,726,547,111
純資産合計	196,726,547,111
負債純資産合計	196,951,179,967

注記表

（重要な会計方針の注記）

項 目	自 平成28年12月 1日 至 平成29年 6月19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	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。
3.収益及び費用の計上基準	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。

(貸借対照表に関する注記)

項目	(平成29年 6月19日現在)	
1. 担保資産	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。	
	株式	2,893,500,000円
2. 当計算期間の末日における受益権の総数		81,370,359,520口
3. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額	2.4177円
	(10,000口当たりの純資産額)	24,177円)

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項目	(平成29年 6月19日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券(株式) 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定(デリバティブ取引) デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(デリバティブ取引に関する注記)

(平成29年 6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	2,455,824,880	-	2,470,160,000	14,335,120
	東証株価指数先物	2,455,824,880	-	2,470,160,000	14,335,120
	合計	2,455,824,880	-	2,470,160,000	14,335,120

(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。

(その他の注記)

(平成29年 6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	93,628,160,347円
同期中における追加設定元本額	12,376,345,963円
同期中における一部解約元本額	24,634,146,790円
平成29年 6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	9,759,557,121円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	595,289,059円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	2,868,310,196円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	2,051,852,813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)	88,795,301円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2020(4資産タイプ)	7,675,516円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2025(4資産タイプ)	22,512,113円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2030(4資産タイプ)	56,934,936円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2035(4資産タイプ)	59,618,635円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2040(4資産タイプ)	32,665,292円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2045(4資産タイプ)	85,307,003円
国内株式指数ファンド(T O P I X)	1,445,207,595円
三井住友・DC日本株式インデックスファンドS	2,250,819,501円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	704,384,522円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	1,114,415,376円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	1,170,367,378円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2050	3,736,244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)	10,393,607,931円
バランスファンドVA(安定運用型) < 適格機関投資家限定 >	48,854,093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 >	6,029,114,711円
S M A M・バランスファンドVA25 < 適格機関投資家専用 >	4,996,001,514円
S M A M・バランスファンドVA37.5 < 適格機関投資家専用 >	3,104,639,274円
S M A M・バランスファンドVA50 < 適格機関投資家専用 >	11,382,032,169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 >	65,465,081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 >	271,374,710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 >	6,339,875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 >	1,230,042,341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 >	73,726,217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 >	453,481,076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 >	1,322,487,740円
S M A M ・ バランスファンド V A 4 0 < 適格機関投資家専用 >	2,306,790,785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 >	3,992,840,128円
S M A M ・ バランス V A 株 4 0 T < 適格機関投資家限定 >	101,808,771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)	1,849,469,117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 >	86,603,913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 >	134,711,915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)	2,079,080,157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 >	131,749,461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 >	61,131,991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 >	28,229,627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 >	279,854,048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 >	479,591,700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 >	204,620,017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 >	143,657,872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 >	68,122,320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 >	11,960,676円
S M A M ・ アセットバランスファンド V A 3 0 L 2 < 適格機関投資家専用 >	90,729,276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 >	1,210,009,258円
S M A M ・ 国内株式インデックスファンド・ V A (適格機関投資家専用)	228,481,871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 >	23,603,385円
S M A M ・ グローバルバランスファンド (標準型) V A < 適格機関投資家限定 >	2,266,324,926円
S M A M ・ グローバルバランスファンド (債券重視型) V A < 適格機関投資家限定 >	364,919,548円
S M A M ・ 世界バランスファンド V A < 適格機関投資家限定 >	2,187,532,846円
S M A M ・ 世界バランスファンド V A 2 < 適格機関投資家限定 >	981,608,798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 >	21,880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 >	24,630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 >	322,676円
S M A M ・ マルチアセットストラテジーファンド 2 0 1 6 - 0 4 < 適格機関投資家限定 >	171,424,425円
S M A M ・ マルチアセットストラテジーファンド 2 0 1 6 - 0 5 < 適格機関投資家限定 >	82,103,099円
S M A M ・ マルチアセットストラテジー・オープン < 適格機関投資家限定 >	108,415,071円
合計	81,370,359,520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 >

貸借対照表

(単位 : 円)

(平成 29 年 6 月 19 日 現在)

資産の部

（平成29年 6月19日現在）

流動資産	
コール・ローン	42,805
親投資信託受益証券	32,301,721,372
未収入金	4,020,000
流動資産合計	32,305,784,177
資産合計	
32,305,784,177	
負債の部	
流動負債	
未払解約金	4,050,000
未払受託者報酬	4,401,808
未払委託者報酬	4,401,740
その他未払費用	486,000
流動負債合計	13,339,548
負債合計	
13,339,548	
純資産の部	
元本等	
元本	25,177,045,619
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	7,115,399,010
元本等合計	32,292,444,629
純資産合計	
32,292,444,629	
負債純資産合計	
32,305,784,177	

注記表

（重要な会計方針の注記）

項目	自 平成28年 6月21日 至 平成29年 6月19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29年 6月19日現在）
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	25,177,045,619口

2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額	1,2826円
	(10,000口当たりの純資産額)	12,826円)

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

項目	（平成29年 6月19日現在）
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。
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。

（その他の注記）

項目	（平成29年 6月19日現在）
期首元本額	25,082,572,318円
期中追加設定元本額	2,799,142,838円
期中一部解約元本額	2,704,669,537円

（参考）

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 - 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（NOMURA - B P I）マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）	
（平成29年 6月19日現在）	
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	463,895,421
国債証券	84,351,604,020
地方債証券	9,027,619,360
特殊債証券	12,127,374,761
社債証券	5,057,384,000
未収入金	38,651,450
未収利息	400,441,135
前払費用	5,457,962
流動資産合計	111,472,428,109
資産合計	111,472,428,109
負債の部	
流動負債	
未払金	42,913,850
未払解約金	118,539,999
未払利息	1,159
その他未払費用	1,198
流動負債合計	161,456,206
負債合計	161,456,206
純資産の部	
元本等	
元本	80,426,235,806
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	30,884,736,097
元本等合計	111,310,971,903
純資産合計	111,310,971,903
負債純資産合計	111,472,428,109

注記表

（重要な会計方針の注記）

項 目	自 平成28年 6月21日 至 平成29年 6月19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29年 6月19日現在)	
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	80,426,235,806口	
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額	1.3840円
	(10,000口当たりの純資産額)	13,840円)

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項目	(平成29年 6月19日現在)	
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	
2. 時価の算定方法	<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。

(その他の注記)

(平成29年 6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	81,405,391,010円
同期中における追加設定元本額	11,011,825,340円
同期中における一部解約元本額	11,990,980,544円
平成29年 6月19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	40,600,503,962円
S M A M ・国内債券インデックス・ファンド	16,214,186,980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>	272,150,809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>	23,339,394,055円
合計	80,426,235,806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）

貸借対照表

(単位：円)

(平成29年 6月20日現在)

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	5,290,595
親投資信託受益証券	13,833,328,062
未収入金	55,309,994
流動資産合計	13,893,928,651
資産合計	13,893,928,651
負債の部	
流動負債	
未払解約金	55,309,994
未払受託者報酬	472,630
未払委託者報酬	171,855
未払利息	12
その他未払費用	39,341
流動負債合計	55,993,832
負債合計	55,993,832
純資産の部	
元本等	
元本	5,677,011,358
剰余金	
剰余金又は欠損金()	8,160,923,461
元本等合計	13,837,934,819
純資産合計	13,837,934,819
負債純資産合計	13,893,928,651

注記表

（重要な会計方針の注記）

項目	自 平成28年12月 1日 至 平成29年 6月20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29年 6月20日現在）	
1. 当計算期間の末日における受益権の総数		5,677,011,358口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額	2.4375円
	(10,000口当たりの純資産額)	24,375円)

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

項目	（平成29年 6月20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。

（その他の注記）

項 目	（平成29年 6月20日現在）
期首元本額	8,355,446,305円
期中追加設定元本額	29,854,237円
期中一部解約元本額	2,708,289,184円

（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29年 6月20日現在）

資産の部	
流動資産	
預金	494,231,607
コール・ローン	262,703,954
株式	193,420,872,438
投資証券	4,971,802,448
派生商品評価勘定	21,168,880
未収入金	162,690,955
未収配当金	370,592,764
差入委託証拠金	1,852,040,104
流動資産合計	201,556,103,150
資産合計	201,556,103,150
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	2,550
前受金	21,160,980
未払解約金	176,726,008

（平成29年 6月20日現在）

未払利息	629
その他未払費用	693
流動負債合計	197,890,860
負債合計	197,890,860
純資産の部	
元本等	
元本	64,070,822,568
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	137,287,389,722
元本等合計	201,358,212,290
純資産合計	201,358,212,290
負債純資産合計	201,556,103,150

注記表

（重要な会計方針の注記）

項目	自 平成28年12月 1日 至 平成29年 6月20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29年 6月20日現在）	
1. 当計算期間の末日における受益権の総数		64,070,822,568口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額	3.1427円
	(10,000口当たりの純資産額)	31,427円)

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

項目	（平成29年 6月20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ぬ。
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29年 6月20日現在）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

（単位：円）

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	2,667,385,045	-	2,688,546,025	21,160,980
	SPMINI 1709	1,830,666,859	-	1,846,510,256	15,843,397
	DJ EUR 1709	512,586,902	-	516,777,772	4,190,870
	FTSE 1709	190,490,738	-	191,220,685	729,947
	SPI200 1709	133,640,546	-	134,037,312	396,766
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	91,756,475	-	91,751,125	5,350

米ドル	78,232,000	-	78,225,000	7,000
カナダドル	3,379,600	-	3,380,400	800
ユーロ	3,737,400	-	3,737,400	-
英ポンド	2,133,600	-	2,134,200	600
スイスフラン	1,144,900	-	1,145,200	300
スウェーデンク ローナ	510,800	-	511,200	400
ノルウェークロー ネ	262,800	-	262,600	200
デンマーククロー ネ	334,800	-	335,000	200
オーストラリアドル	212,075	-	212,125	50
香港ドル	1,003,100	-	1,002,400	700
シンガポールドル	805,400	-	805,600	200
合計	2,759,141,520	-	2,780,297,150	21,166,330

(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。

(その他の注記)

(平成29年 6月20日現在)

開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	60,085,742,502円
同期中における追加設定元本額	21,335,554,173円
同期中における一部解約元本額	17,350,474,107円
平成29年 6月20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	10,680,908,722円
三井住友・DC年金バランス30（債券重点型）	231,935,552円
三井住友・DC年金バランス50（標準型）	957,002,120円
三井住友・DC年金バランス70（株式重点型）	638,641,758円
S M A M ・ グローバルバランスファンド（機動的資産配分型）	48,286,443円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2020（4資産タイプ）	2,917,674円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2025（4資産タイプ）	8,240,711円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2030（4資産タイプ）	23,534,045円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2035（4資産タイプ）	30,661,818円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2040（4資産タイプ）	18,068,932円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2045（4資産タイプ）	49,543,918円
外国株式指数ファンド	415,520,443円
三井住友・DC全海外株式インデックスファンド	1,316,143,035円
アセットアロケーション・ファンド（安定型）	595,475,044円
アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）	646,357,110円
アセットアロケーション・ファンド（成長型）	607,431,519円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2050	2,416,442円
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）	4,401,733,561円
バランスファンドVA（安定運用型）＜適格機関投資家限定＞	18,490,592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＞	2,362,694,880円
S M A M ・ バランスファンドVA25＜適格機関投資家専用＞	2,583,684,794円
S M A M ・ バランスファンドVA37.5＜適格機関投資家専用＞	2,110,517,041円
S M A M ・ バランスファンドVA50＜適格機関投資家専用＞	8,856,715,253円
S M A M ・ バランスファンドVL30＜適格機関投資家限定＞	24,861,191円
S M A M ・ バランスファンドVL50＜適格機関投資家限定＞	140,683,685円
世界6資産バランスファンドVA＜適格機関投資家限定＞	3,684,751円
S M A M ・ バランスファンドVA75＜適格機関投資家専用＞	1,091,586,604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＞	85,672,753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＞	229,289,295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＞	1,032,482,426円
S M A M ・ バランスファンドVA40＜適格機関投資家専用＞	1,796,073,871円
S M A M ・ バランスファンドVA35＜適格機関投資家専用＞	2,325,041,971円
S M A M ・ バランスVA株40T＜適格機関投資家限定＞	77,945,283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）	1,034,573,402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）	1,448,766,479円
S M A M ・ グローバルバランス40VA＜適格機関投資家限定＞	200,403,905円
S M A M ・ バランスファンドVA20＜適格機関投資家専用＞	105,079,111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）	1,621,028,250円
S M A M ・ アセットバランスファンドVA20A＜適格機関投資家専用＞	33,208,479円
S M A M ・ アセットバランスファンドVA35A＜適格機関投資家専用＞	18,607,129円
S M A M ・ アセットバランスファンドVA50A＜適格機関投資家専用＞	9,334,115円
S M A M ・ アセットバランスファンドVA20L＜適格機関投資家専用＞	71,184,368円
S M A M ・ アセットバランスファンドVA25L＜適格機関投資家専用＞	160,129,372円

S M A M ・ アセットバランスファンドVA20T < 適格機関投資家専用 >	158,603,314円
S M A M ・ グローバルバランスファンド(標準型)VA < 適格機関投資家限定 >	1,726,879,450円
S M A M ・ グローバルバランスファンド(債券重視型)VA < 適格機関投資家限定 >	277,643,938円
S M A M ・ 世界バランスファンドVA < 適格機関投資家限定 >	9,112,457,762円
S M A M ・ 世界バランスファンドVA2 < 適格機関投資家限定 >	2,522,814,707円
S M A M ・ F G 新興国重視型バランス20VA < 適格機関投資家限定 >	17,298円
S M A M ・ F G グローバルバランス25VA < 適格機関投資家限定 >	31,661円
S M A M ・ 外国株式インデックスファンドSA < 適格機関投資家限定 >	1,976,875,352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 >	140,632円
S M A M ・ マルチアセットストラテジーファンド2016-04 < 適格機関投資家限定 >	84,699,911円
S M A M ・ マルチアセットストラテジーファンド2016-05 < 適格機関投資家限定 >	40,547,174円
S M A M ・ マルチアセットストラテジー・オープン < 適格機関投資家限定 >	53,553,522円
合計	64,070,822,568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 >

貸借対照表

(単位:円)

(平成29年 6月20日現在)

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	10,012
親投資信託受益証券	3,287,980,007
流動資産合計	3,287,990,019
資産合計	3,287,990,019
負債の部	
流動負債	
未払受託者報酬	3,876
未払委託者報酬	1,938
その他未払費用	484
流動負債合計	6,298
負債合計	6,298
純資産の部	
元本等	
元本	1,931,790,444
剰余金	
剰余金又は欠損金()	1,356,193,277
元本等合計	3,287,983,721
純資産合計	3,287,983,721
負債純資産合計	3,287,990,019

注記表

(重要な会計方針の注記)

項目	自 平成28年12月20日 至 平成29年 6月20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29年 6月20日現在)	
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	1,931,790,444口	
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額	1.7020円
	(10,000口当たりの純資産額)	17,020円)

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項目	(平成29年 6月20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。

（その他の注記）

項目	（平成29年 6月20日現在）
期首元本額	1,539,170,048円
期中追加設定元本額	422,506,959円
期中一部解約元本額	29,886,563円

（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29年 6月20日現在）	
資産の部	
流動資産	
預金	700,196,788
コール・ローン	394,701,377
国債証券	205,595,790,159
未収利息	1,542,596,983
前払費用	71,626,558
流動資産合計	208,304,911,865
資産合計	208,304,911,865
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	168,052
未払金	184,500,900
未払解約金	84,581,027
未払利息	946
その他未払費用	1,108
流動負債合計	269,252,033
負債合計	269,252,033
純資産の部	
元本等	
元本	121,172,766,782
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	86,862,893,050
元本等合計	208,035,659,832
純資産合計	208,035,659,832

(平成29年 6月20日現在)

負債純資産合計

208,304,911,865

注記表

(重要な会計方針の注記)

項目	自平成28年12月20日 至平成29年 6月20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</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。</p>
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建資産等の会計処理</p> <p>「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

項目	(平成29年 6月20日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	121,172,766,782口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.7169円 (10,000口当たりの純資産額 17,169円)

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項目	(平成29年 6月20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ぬ。

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

（デリバティブ取引に関する注記）

（平成29年 6月20日現在）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

（単位：円）

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	328,009,733	-	328,177,785	168,052
	米ドル	226,479,772	-	226,594,134	114,362
	英ポンド	101,529,961	-	101,583,651	53,690
	合計	328,009,733	-	328,177,785	168,052

（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。

（その他の注記）

（平成29年 6月20日現在）	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	105,284,855,497円
同期中における追加設定元本額	30,798,683,226円
同期中における一部解約元本額	14,910,771,941円
平成29年 6月20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	8,706,137,882円
三井住友・DC年金バランス30（債券重点型）	421,362,182円
三井住友・DC年金バランス50（標準型）	1,154,822,126円
三井住友・DC年金バランス70（株式重点型）	579,465,698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）	94,027,214円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2020（4資産タイプ）	9,255,802円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2025（4資産タイプ）	28,215,666円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2030（4資産タイプ）	71,922,178円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2035（4資産タイプ）	60,168,580円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2040（4資産タイプ）	29,691,930円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2045（4資産タイプ）	74,794,174円
三井住友・DC年金バランスゼロ（債券型）	9,973,831円
アセットアロケーション・ファンド（安定型）	124,048,354円
アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）	680,983,735円
アセットアロケーション・ファンド（成長型）	769,317,452円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2050	1,755,766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＞	1,915,067,859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＞	2,154,549,596円
S M A M ・ バランスファンドVA25＜適格機関投資家専用＞	16,536,334,907円
S M A M ・ バランスファンドVA37.5＜適格機関投資家専用＞	7,125,701,448円
S M A M ・ バランスファンドVA50＜適格機関投資家専用＞	16,108,742,856円
S M A M ・ バランスファンドVL30＜適格機関投資家限定＞	44,306,770円
S M A M ・ バランスファンドVL50＜適格機関投資家限定＞	127,774,767円
世界6資産バランスファンドVA＜適格機関投資家限定＞	4,414,667円
S M A M ・ バランスファンドVA75＜適格機関投資家専用＞	986,907,163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＞	154,508,654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＞	1,469,703,846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＞	1,876,756,899円
S M A M ・ バランスファンドVA40＜適格機関投資家専用＞	4,892,481,770円
S M A M ・ バランスファンドVA35＜適格機関投資家専用＞	8,471,665,233円
S M A M ・ バランスVA株40T＜適格機関投資家限定＞	140,814,283円
S M A M ・ 外国債券パッシブファンドVA＜適格機関投資家限定＞	13,537,259,034円
三井住友・外国債券インデックスファンド・VAS（適格機関投資家専用）	1,195,506,226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）	2,628,180,526円
S M A M ・ グローバルバランス40VA＜適格機関投資家限定＞	239,817,579円
S M A M ・ バランスファンドVA20＜適格機関投資家専用＞	764,815,272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）	2,945,167,899円
S M A M ・ アセットバランスファンドVA20A＜適格機関投資家専用＞	183,622,867円
S M A M ・ アセットバランスファンドVA35A＜適格機関投資家専用＞	50,913,809円
S M A M ・ アセットバランスファンドVA50A＜適格機関投資家専用＞	16,758,843円

S M A M ・ アセットバランスファンドVA20L < 適格機関投資家専用 >	192,147,018円
S M A M ・ アセットバランスファンドVA25L < 適格機関投資家専用 >	664,082,038円
S M A M ・ アセットバランスファンドVA20T < 適格機関投資家専用 >	217,409,697円
S M A M ・ アセットバランスファンドVA20A2 < 適格機関投資家専用 >	200,754,871円
S M A M ・ アセットバランスファンドVA35A2 < 適格機関投資家専用 >	57,825,244円
S M A M ・ アセットバランスファンドVA50A2 < 適格機関投資家専用 >	7,027,104円
S M A M ・ アセットバランスファンドVA25L2 < 適格機関投資家専用 >	1,697,376,026円
S M A M ・ アセットバランスファンドVA20T2 < 適格機関投資家専用 >	25,080,455円
S M A M ・ グローバルバランスファンド（標準型）VA < 適格機関投資家限定 >	5,133,891,057円
S M A M ・ グローバルバランスファンド（債券重視型）VA < 適格機関投資家限定 >	2,579,957,360円
S M A M ・ 世界バランスファンドVA < 適格機関投資家限定 >	7,986,289,284円
S M A M ・ 世界バランスファンドVA2 < 適格機関投資家限定 >	5,380,967,203円
S M A M ・ F G 新興国重視型バランス20VA < 適格機関投資家限定 >	177,313円
S M A M ・ F G グローバルバランス25VA < 適格機関投資家限定 >	235,574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 >	505,769円
S M A M ・ マルチアセットストラテジーファンド2016-04 < 適格機関投資家限定 >	303,734,502円
S M A M ・ マルチアセットストラテジーファンド2016-05 < 適格機関投資家限定 >	145,484,539円
S M A M ・ マルチアセットストラテジー・オープン < 適格機関投資家限定 >	192,106,385円
合計	121,172,766,782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 >

貸借対照表

（単位：円）

（平成29年 6月19日現在）

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	974
親投資信託受益証券	498,756,917
未収入金	390,000
流動資産合計	499,147,891
資産合計	499,147,891
負債の部	
流動負債	
未払解約金	390,000
流動負債合計	390,000
負債合計	390,000
純資産の部	
元本等	
元本	494,835,298
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	3,922,593
元本等合計	498,757,891
純資産合計	498,757,891
負債純資産合計	499,147,891

注記表

（重要な会計方針の注記）

項 目	自 平成29年 4月14日 至 平成29年 6月19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29年 6月19日現在）	
1. 当計算期間の末日における受益権の総数		494,835,298口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額	1.0079円
	(10,000口当たりの純資産額)	10,079円)

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項 目	（平成29年 6月19日現在）
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<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。

（その他の注記）

項目	（平成29年 6月19日現在）
期首元本額	490,073,343円
期中追加設定元本額	7,570,046円
期中一部解約元本額	2,808,091円

（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29年 6月19日現在）	
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	119,028,509
国債証券	200,033,800
特殊債券	1,005,314,000
未収利息	3,613,187
前払費用	815,340
流動資産合計	1,328,804,836
資産合計	1,328,804,836
負債の部	
流動負債	
未払解約金	390,000
未払利息	297
その他未払費用	649
流動負債合計	390,946
負債合計	390,946
純資産の部	
元本等	
元本	1,313,492,021
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	14,921,869

（平成29年 6月19日現在）

元本等合計	1,328,413,890
純資産合計	1,328,413,890
負債純資産合計	1,328,804,836

注記表

（重要な会計方針の注記）

項目	自 平成29年 4月14日 至 平成29年 6月19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29年 6月19日現在）
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	1,313,492,021口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.0114円 (10,000口当たりの純資産額 10,114円)

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

項目	（平成29年 6月19日現在）
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。

2.時価の算定方法	<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。

(その他の注記)

(平成29年 6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	1,308,650,457円
同期中における追加設定元本額	118,264,320円
同期中における一部解約元本額	113,422,756円
平成29年 6月19日現在における元本の内訳	
S M A M ・ グローバルバランスファンド(機動的資産配分型)	9,363,259円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2020(4資産タイプ)	57,160,440円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2025(4資産タイプ)	33,295,608円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2030(4資産タイプ)	11,700,517円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2035(4資産タイプ)	9,696,917円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2040(4資産タイプ)	4,571,165円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2045(4資産タイプ)	11,325,843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>	493,135,176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>	495,604,302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>	187,242,282円
合計	1,313,492,021円

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29年 6月30日現在

資産総額	541,648,241円
負債総額	294,495円
純資産総額（ - ）	541,353,746円
発行済口数	432,597,731口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2514円
（1万口当たり純資産額）	（12,514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29年 6月30日現在

資産総額	1,340,254,677円
負債総額	1,531,625円
純資産総額（ - ）	1,338,723,052円
発行済口数	907,259,267口
1口当たり純資産額（ / ）	1.4756円
（1万口当たり純資産額）	（14,756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29年 6月30日現在

資産総額	1,471,222,625円
負債総額	1,525,583円
純資産総額（ - ）	1,469,697,042円
発行済口数	930,777,696口
1口当たり純資産額（ / ）	1.5790円
（1万口当たり純資産額）	（15,790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29年 6月30日現在

資産総額	2,249,757,151円
負債総額	2,777,148円

純資産総額（ - ）	2,246,980,003円
発行済口数	1,346,272,743口
1口当たり純資産額（ / ）	1.6690円
（1万口当たり純資産額）	（16,690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29年 6月30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。

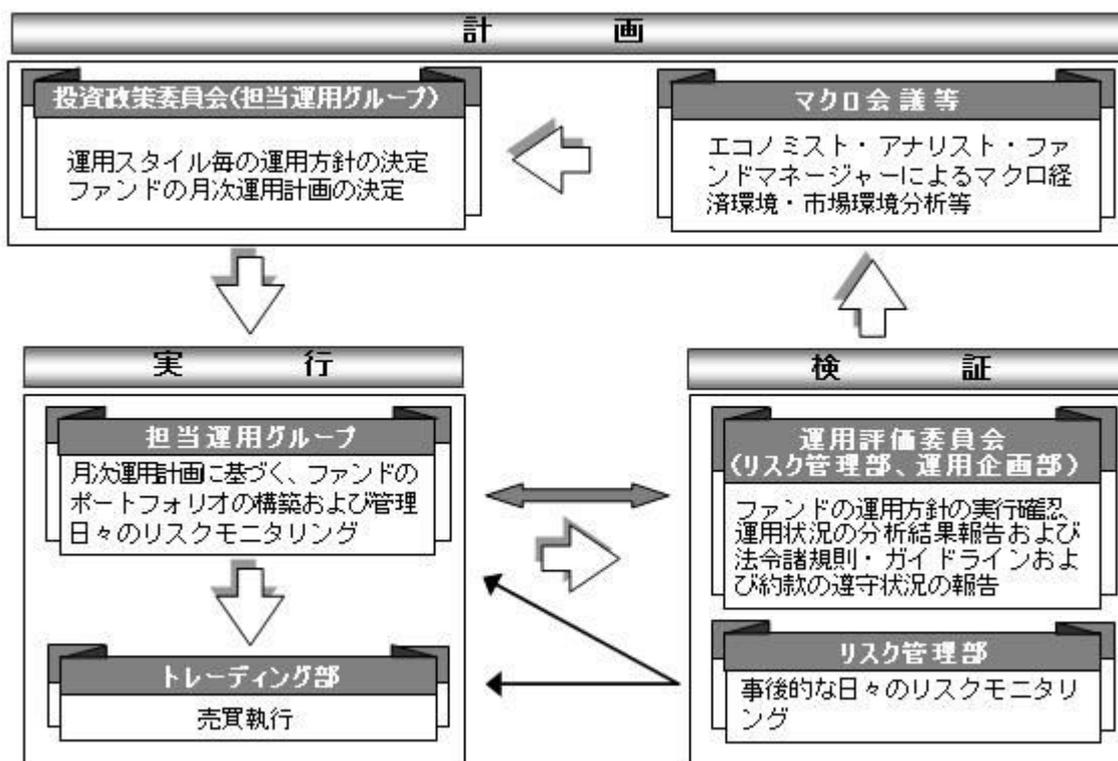
取締役の任期は、選任後1年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会の終結の時までとし、補欠または増員によって選任された取締役の任期は、他の現任取締役の任期の満了する時までとします。

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投資運用業および投資助言業務を行っています。また、「金融商品取引法」に定める第二種金融商品取引業にかかる業務を行っています。

平成29年6月30日現在、委託会社が運用を行っている投資信託（親投資信託は除きます）は、以下の通りです。

（平成29年 6月30日現在）

		本 数(本)	純資産総額(百万円)
株式投資信託	単位型	72 (24)	195,690 (92,434)
	追加型	451 (193)	5,225,532 (2,809,419)
	計	523 (217)	5,421,223 (2,901,853)
公社債投資信託	単位型	100 (100)	410,608 (410,608)
	追加型	1 (0)	29,556 (0)
	計	101 (100)	440,164 (410,608)
合 計		624 (317)	5,861,387 (3,312,461)

（ ）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。

2 当社は、当事業年度（平成28年4月1日から平成29年3月31日まで）の財務諸表については、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、有限責任 あずさ監査法人の監査を受けております。

(1)【貸借対照表】

（単位：千円）

		前事業年度 (平成28年3月31日)	当事業年度 (平成29年3月31日)
資産の部			
流動資産			
現金及び預金	2	10,857,507	13,279,384
顧客分別金信託		20,006	20,008
前払費用		324,934	351,526
未収入金		81,347	40,544
未収委託者報酬		5,418,116	5,511,715
未収運用受託報酬		1,635,461	1,297,104
未収投資助言報酬		382,911	343,523
未収収益		28,813	20,789

繰延税金資産		494,032	482,535
その他の流動資産		6,226	5,560
流動資産合計		19,249,357	21,352,691
固定資産			
有形固定資産	1		
建物		154,246	198,767
器具備品		240,748	261,096
有形固定資産合計		394,995	459,864
無形固定資産			
ソフトウェア		449,034	493,806
ソフトウェア仮勘定		146,452	141,025
電話加入権		79	68
商標権		60	3
無形固定資産合計		595,627	634,903
投資その他の資産			
投資有価証券		13,115,106	12,098,372
関係会社株式		10,412,523	10,412,523
長期差入保証金		603,625	677,681
長期前払費用		32,533	61,282
会員権		17,299	7,819
繰延税金資産		750,481	871,577
投資その他の資産合計		24,931,569	24,129,257
固定資産合計		25,922,192	25,224,025
資産合計		45,171,549	46,576,717

(単位：千円)

	前事業年度 (平成28年3月31日)	当事業年度 (平成29年3月31日)
負債の部		
流動負債		
顧客からの預り金	0	304
その他の預り金	73,103	80,380
未払金		
未払収益分配金	154	655
未払償還金	141,808	140,124
未払手数料	2,479,778	2,424,318
その他未払金	58,453	52,903
未払費用	2,092,669	2,564,625
未払消費税等	317,444	160,571
未払法人税等	992,491	661,467
賞与引当金	982,654	1,001,068
その他の流動負債	-	445
流動負債合計	7,138,557	7,086,864
固定負債		
退職給付引当金	3,028,212	3,177,131
賞与引当金	51,310	40,167
その他の固定負債	693	2,174
固定負債合計	3,080,216	3,219,473
負債合計	10,218,774	10,306,337

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	21,984,811	23,493,074
利益剰余金合計	23,806,015	25,314,279
株主資本計	34,434,999	35,943,263
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	517,775	327,116
評価・換算差額等合計	517,775	327,116
純資産合計	34,952,774	36,270,379
負債・純資産合計	45,171,549	46,576,717

(2) 【損益計算書】

(単位：千円)

	前事業年度 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)	当事業年度 (自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	32,339,255	31,628,014
運用受託報酬	7,401,835	5,649,190
投資助言報酬	1,909,892	1,726,511
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	8,546	-
サービス支援手数料	74,038	61,268
その他	55,319	54,261
営業収益計	41,793,887	39,124,246
営業費用		
支払手数料	16,006,652	14,908,517
広告宣伝費	615,596	366,227
公告費	4,507	1,140
調査費		
調査費	1,624,477	1,325,978
委託調査費	4,106,366	4,343,104
営業雑経費		
通信費	43,662	46,030
印刷費	399,236	338,254
協会費	23,328	21,669
諸会費	22,650	20,054
情報機器関連費	2,557,200	2,516,497
販売促進費	31,271	24,896
その他	161,974	149,177
営業費用合計	25,596,925	24,061,549

一般管理費			
給料			
役員報酬		181,739	225,885
給料・手当		5,824,767	6,121,741
賞与		609,597	610,533
賞与引当金繰入額		1,033,964	989,925
交際費		26,912	23,136
寄付金		23	-
事務委託費		540,251	317,928
旅費交通費		277,212	229,248
租税公課		161,628	268,527
不動産賃借料		595,051	622,662
退職給付費用		701,070	423,954
固定資産減価償却費		334,024	384,068
諸経費		354,884	335,840
一般管理費合計		10,641,129	10,553,451
営業利益		5,555,832	4,509,246
営業外収益			
受取配当金	1	36,102	106,651
受取利息	1	3,728	745
時効成立分配金・償還金		1,394	1,721
原稿・講演料		1,766	1,474
雑収入		19,472	12,592
営業外収益合計		62,465	123,184
営業外費用			
為替差損		51,385	9,737
雑損失		-	1,084
営業外費用合計		51,385	10,821
経常利益		5,566,912	4,621,608
特別利益			
投資有価証券償還益		13,036	353,462
投資有価証券売却益		38,823	2,579
投資有価証券清算益		29,214	-
特別利益合計		81,075	356,041
特別損失			
固定資産除却損	2	5,300	8,157
投資有価証券償還損		2,313	43,644
投資有価証券売却損		8,184	15,012
ゴルフ会員権売却損		-	3,894
事務所移転費用		-	21,175
特別損失合計		15,798	91,884
税引前当期純利益		5,632,188	4,885,765
法人税、住民税及び事業税		1,598,176	1,391,996
法人税等調整額		41,999	25,454
法人税等合計		1,556,177	1,366,541
当期純利益		4,076,011	3,519,223

(3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

	株主資本								
	資本金	資本剰余金		利益準備金	利益剰余金			利益剰余金 合計	株主資本 合計
		資本準備金	資本剰余金 合計		その他利益剰余金				
				配当準備 積立金	別途積立金	繰越利益 剰余金			
当期首残高	2,000,000	8,628,984	8,628,984	284,245	60,000	1,476,959	18,861,359	20,682,564	31,311,548
当期変動額									
剰余金の配当			-				952,560	952,560	952,560
当期純利益			-				4,076,011	4,076,011	4,076,011
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）			-					-	-
当期変動額合計	-	-	-	-	-	-	3,123,451	3,123,451	3,123,451
当期末残高	2,000,000	8,628,984	8,628,984	284,245	60,000	1,476,959	21,984,811	23,806,015	34,434,999

	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
当期変動額			
剰余金の配当		-	952,560
当期純利益		-	4,076,011
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	116,703	116,703	116,703
当期変動額合計	116,703	116,703	3,006,747
当期末残高	517,775	517,775	34,952,774

当事業年度（自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日）

（単位：千円）

	株主資本								
	資本金	資本剰余金		利益準備金	利益剰余金			利益剰余金 合計	株主資本 合計
		資本準備金	資本剰余金 合計		その他利益剰余金				
				配当準備 積立金	別途積立金	繰越利益 剰余金			
当期首残高	2,000,000	8,628,984	8,628,984	284,245	60,000	1,476,959	21,984,811	23,806,015	34,434,999
当期変動額									
剰余金の配当			-				2,010,960	2,010,960	2,010,960
当期純利益			-				3,519,223	3,519,223	3,519,223
株主資本以外の項目 の当期変動額（純 額）			-					-	-
当期変動額合計	-	-	-	-	-	-	1,508,263	1,508,263	1,508,263
当期末残高	2,000,000	8,628,984	8,628,984	284,245	60,000	1,476,959	23,493,074	25,314,279	35,943,263

	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
当期変動額			
剰余金の配当		-	952,560
当期純利益		-	4,076,011
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	116,703	116,703	116,703
当期変動額合計	116,703	116,703	3,006,747
当期末残高	517,775	517,775	34,952,774

当期首残高	517,775	517,775	34,952,774
当期変動額			
剰余金の配当		-	2,010,960
当期純利益		-	3,519,223
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	190,658	190,658	190,658
当期変動額合計	190,658	190,658	1,317,604
当期末残高	327,116	327,116	36,270,379

[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)並びに平成28年4月1日以降に取得した建物附属設備については、定額法によっております。

なお、主な耐用年数は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あります。

(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あります。

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あります。

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)

法人税法の改正に伴い、「平成28年度税制改正に係る減価償却方法の変更に関する実務上の取扱い」（実務対応報告第32号 平成28年6月17日）を当事業年度に適用し、平成28年4月1日以後に取得した建物附属設備に係る減価償却方法を定率法から定額法に変更しております。

この結果、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2,218千円増加しております。

(追加情報)

「繰延税金資産の回収可能性に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第26号 平成28年3月28日）を当事業年度から適用しております。

(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28年3月31日)	当事業年度 (平成29年3月31日)
建物	281,421千円	291,976千円
器具備品	758,541千円	651,918千円

2 関係会社に対する資産及び負債

	前事業年度 (平成28年3月31日)	当事業年度 (平成29年3月31日)
現金及び預金	4,716,352千円	- 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28年3月31日)	当事業年度 (平成29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、平成35年6月までの賃借料総額の支払保証を行っております。

	前事業年度 (平成28年3月31日)	当事業年度 (平成29年3月31日)
Sumitomo Mitsui Asset Management (New York) Inc.	296,815千円	256,031千円

(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27年 4月 1日 至 平成28年 3月31日)	当事業年度 (自 平成28年 4月 1日 至 平成29年 3月31日)
受取配当金	-	106,640千円
受取利息	1,423千円	18千円

2 固定資産除却損

	前事業年度 (自 平成27年 4月 1日 至 平成28年 3月31日)	当事業年度 (自 平成28年 4月 1日 至 平成29年 3月31日)
建物	-	6,952千円
器具備品	5,300千円	1,204千円

(株主資本等変動計算書関係)

前事業年度(自 平成27年 4月 1日 至 平成28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

(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28年 6月27日開催の第31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28年 6月27日 定時株主総会	普通株式	利益 剰余金	2,010,960	114,000	平成28年 3月31日	平成28年 6月28日

当事業年度(自 平成28年 4月 1日 至 平成29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28年 6月27日 定時株主総会	普通株式	2,010,960	114,000	平成28年 3月31日	平成28年 6月28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29年6月27日開催の第32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29年6月27日 定時株主総会	普通株式	利益 剰余金	1,887,480	107,000	平成29年 3月31日	平成29年 6月28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28年3月31日)	当事業年度 (平成29年3月31日)
1年以内	579,592	626,698
1年超	756,470	191,491
合計	1,336,063	818,190

(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。

投資有価証券については、主に事業推進目的のために保有する当社が設定する投資信託等であり、市場価格の変動リスク及び発行体の信用リスクに晒されています。関係会社株式については、主に全額出資の子会社の株式及び50%出資した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。

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

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、定期的に取り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28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	10,857,507	10,857,507	-
(2)顧客分別金信託	20,006	20,006	-
(3)未収委託者報酬	5,418,116	5,418,116	-
(4)未収運用受託報酬	1,635,461	1,635,461	-
(5)未収投資助言報酬	382,911	382,911	-
(6)投資有価証券			
その他有価証券	13,114,808	13,114,808	-
(7)長期差入保証金	603,625	603,625	-
資産計	32,032,437	32,032,437	-
(1)顧客からの預り金	0	0	-
(2)未払手数料	2,479,778	2,479,778	-
負債計	2,479,778	2,479,778	-

当事業年度（平成29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	13,279,384	13,279,384	-
(2)顧客分別金信託	20,008	20,008	-
(3)未収委託者報酬	5,511,715	5,511,715	-
(4)未収運用受託報酬	1,297,104	1,297,104	-
(5)未収投資助言報酬	343,523	343,523	-
(6)投資有価証券			
その他有価証券	12,098,074	12,098,074	-
(7)長期差入保証金	677,681	677,681	-
資産計	33,227,492	33,227,492	-
(1)顧客からの預り金	304	304	-
(2)未払手数料	2,424,318	2,424,318	-
負債計	2,424,622	2,424,622	-

（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います。

(6)投資有価証券

これらの時価について、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。

(7)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)顧客からの預り金、(2)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28年3月31日)	当事業年度 (平成29年3月31日)
その他有価証券 非上場株式	298	298
合計	298	298
子会社株式及び関連会社株式 非上場株式	10,412,523	10,412,523
合計	10,412,523	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。

(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28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	10,857,507	-	-	-
顧客分別金信託	20,006	-	-	-
未収委託者報酬	5,418,116	-	-	-
未収運用受託報酬	1,635,461	-	-	-
未収投資助言報酬	382,911	-	-	-
長期差入保証金	537,057	66,567	-	-
合計	18,851,060	66,567	-	-

当事業年度(平成29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	13,279,384	-	-	-
顧客分別金信託	20,008	-	-	-
未収委託者報酬	5,511,715	-	-	-
未収運用受託報酬	1,297,104	-	-	-
未収投資助言報酬	343,523	-	-	-
長期差入保証金	31,201	646,480	-	-
合計	20,482,937	646,480	-	-

(有価証券関係)

1. 子会社株式及び関連会社株式

前事業年度（平成28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。

当事業年度（平成29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。

2. その他有価証券

前事業年度（平成28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	7,852,587	7,058,420	794,166
小計	7,852,587	7,058,420	794,166
(2) 貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの 投資信託等	5,262,221	5,310,100	47,878
小計	5,262,221	5,310,100	47,878
合計	13,114,808	12,368,520	746,288

(注) 非上場株式等（貸借対照表計上額 298千円）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。

当事業年度（平成29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	4,921,829	4,267,927	653,902
小計	4,921,829	4,267,927	653,902
(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	7,176,244	7,358,662	182,417
小計	7,176,244	7,358,662	182,417
合計	12,098,074	11,626,589	471,485

(注) 非上場株式等（貸借対照表計上額 298千円）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。

3. 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27年4月1日 至 平成28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
327,278	38,823	8,184

当事業年度(自 平成28年4月1日 至 平成29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
228,204	2,579	15,012

(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27年4月1日 至 平成28年3月31日)	当事業年度 (自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)
退職給付債務の期首残高	2,633,080	3,028,212
勤務費用	225,881	280,524
利息費用	19,247	-
数理計算上の差異の発生額	285,510	15,494
退職給付の支払額	135,507	116,111
退職給付債務の期末残高	3,028,212	3,177,131

(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28年3月31日)	当事業年度 (平成29年3月31日)
非積立型制度の退職給付債務	3,028,212	3,177,131
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	3,028,212	3,177,131

(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27年4月1日 至 平成28年3月31日)	当事業年度 (自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)
勤務費用	225,881	280,524
利息費用	19,247	-
数理計算上の差異の費用処理額	285,510	15,494
その他	170,430	158,924
確定給付制度に係る退職給付費用	701,070	423,954

(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27年 4月 1日 至 平成28年 3月31日)	当事業年度 (自 平成28年 4月 1日 至 平成29年 3月31日)
割引率	0.000%	0.092%

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125,210千円、当事業年度137,310千円であります。

(税効果会計関係)

1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生的主要原因別の内訳

(単位:千円)

	前事業年度 (平成28年 3月31日)	当事業年度 (平成29年 3月31日)
流動の部		
繰延税金資産		
賞与引当金	303,247	308,929
調査費	74,734	79,381
未払金	44,028	45,745
未払事業税	67,598	46,406
その他	7,369	2,071
繰延税金資産小計	496,977	482,535
評価性引当額	2,945	-
繰延税金資産合計	494,032	482,535
固定の部		
繰延税金資産		
退職給付引当金	927,238	972,837
特定外国子会社留保金額	205,413	-
ソフトウェア償却	35,707	18,718
賞与引当金	15,834	12,299
投資有価証券評価損	95	95
その他	5,971	14,592
繰延税金資産小計	1,190,261	1,018,544
評価性引当額	211,267	2,597
繰延税金資産合計	978,994	1,015,946
繰延税金負債		
その他有価証券評価差額金	228,513	144,368
繰延税金負債合計	228,513	144,368
繰延税金資産の純額	1,244,513	1,354,113

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28年3月31日)	当事業年度 (平成29年3月31日)
法定実効税率	33.0%	30.8%
(調整)		
評価性引当額の増減	5.5	0.1
交際費等永久に損金に算入されない項目	0.1	0.2
受取配当等永久に益金に算入されない項目	0.0	0.8
住民税均等割等	0.1	0.1
所得税額控除による税額控除	1.5	2.2
その他	1.3	0.0
税効果会計適用後の法人税等の負担率	27.6	27.9

(注)前事業年度において、独立掲記しておりました「税率変更による期末繰延税金資産の減額修正」は、重要性が乏しくなったため、当事業年度より「その他」に含めて表示しております。この表示方法の変更を反映させるため、前事業年度の内訳の組替えを行っております。この結果、前事業年度の「税率変更による期末繰延税金資産の減額修正」として表示していた1.3%は「その他」として組み替えております。

(セグメント情報等)

前事業年度(自平成27年4月1日至平成28年3月31日)

1. セグメント情報

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

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

2. 関連情報

(1) 製品及びサービスごとの情報

(単位：千円)

	委託者報酬	運用受託報酬	投資助言報酬	その他	合計
外部顧客への営業収益	32,339,255	7,401,835	1,909,892	142,903	41,793,887

(2) 地域ごとの情報

営業収益

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

有形固定資産

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

(3) 主要な顧客ごとの情報

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

3. 報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

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。

当事業年度(自 平成28年 4月 1日 至 平成29年 3月31日)

1. セグメント情報

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

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

2. 関連情報

(1) 製品及びサービスごとの情報

(単位：千円)

	委託者報酬	運用受託報酬	投資助言報酬	その他	合計
外部顧客への 営業収益	31,628,014	5,649,190	1,726,511	120,529	39,124,246

(2) 地域ごとの情報

営業収益

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

有形固定資産

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

(3) 主要な顧客ごとの情報

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

3. 報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

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27年 4月 1日 至 平成28年 3月31日)

1. 関連当事者との取引

(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	1,770,986,505	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	2,740,552	未払手数料	471,118

(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

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)兄弟会社等

(単位:千円)

種類	会社等の名称 又は氏名	所在地	資本金、出資 金 又は基金	事業の内容 又は職業	議決権等の 所有(被所 有) 割合	関連当事者 との 関係	取引の内容	取引金額	科目	期末残高
その他の 関係会社の 子会社	SMB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	子会社株式 の 取得 委託販売 手数料	9,877,717 5,483,224	- 未払手数料	- 912,899

(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

投信の販売委託については、一般取引条件を基に、協議の上決定しております。

2. 親会社に関する注記

該当事項はありません。

当事業年度(自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)

1. 関連当事者との取引

(1)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	Sumitomo Mitsui Asset Management (Hong Kong) Limited	Hong Kong	5,000,000 (ホンコン ド ル)	投資運用業	% (所有) 直接100	投信の助言業 務 役員の兼任	剰余金の配 当	106,640	-	-

(注) 取引条件及び取引条件の決定方針等

受取配当金については、剰余金の分配可能額を基礎とした一定の基準に基づき合理的に決定しております。

(2)兄弟会社等

(単位:千円)

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金、出資金 又は基金	事業の内容 又は職業	議決権等の 所有(被所 有) 割合	関連当事者と の 関係	取引の内容	取引金額	科目	期末残高
親会社の 子会社	(株)三井住 友 銀行	東京都 千代田区	1,770,986,505	銀行業	%	投信の販売委 託 役員の兼任	委託販売 手数料	2,737,677	未払手数料	489,567
親会社の 子会社	SMBC日興 証券(株)	東京都 千代田区	10,000,000	証券業	%	投信の販売委 託	委託販売 手数料	5,485,934	未払手数料	862,697

(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

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。

3. (株)三井住友銀行の属性が、平成28年7月29日付けで、「その他の関係会社」より「親会社」、平成28年10月1日付けで「親会社」より「親会社の子会社」に異動となりました。なお、取引金額の中には、「その他の関係会社」及び「親会社」であった期間の取引金額が含まれております。

4. SMBC日興証券(株)の属性が、平成28年10月1日付けで、「その他の関係会社の子会社」より「親会社の子会社」に異動となりました。

なお、取引金額の中には、「その他の関係会社の子会社」であった期間の取引金額が含まれております。

2. 親会社に関する注記

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

(1 株当たり情報)

	前事業年度 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)	当事業年度 (自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)
1株当たり純資産額	1,981,449.82円	2,056,143.98円
1株当たり当期純利益金額	231,066.40円	199,502.47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おりません。

2. 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27年4月1日 至 平成28年3月31日)	当事業年度 (自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)
1株当たり当期純利益金額		
当期純利益(千円)	4,076,011	3,519,223
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)	4,076,011	3,519,223
期中平均株式数(株)	17,640	17,640

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

5【その他】

- イ 定款の変更、その他の重要事項
平成29年6月27日付で、定款について以下の変更を行いました。
(イ) 監査体制の見直しにより監査役の員数を1名減員し5名以内とする定款の変更
(ロ) 公告の方法を日本経済新聞に掲載する方法から、電子公告(ただし、事故その他やむを得ない事由が生じた場合は、日本経済新聞に掲載)とする平成30年2月1日付効力発生の定款の変更
- ロ 訴訟事件その他会社に重要な影響を与えることが予想される事実
該当ありません。

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

イ 受託会社

- (イ) 名称 三井住友信託銀行株式会社
- (ロ) 資本金の額 342,037百万円(平成29年3月末現在)
- (ハ) 事業の内容 銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

〔参考情報：再信託受託会社の概要〕

- ・ 名称 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29年3月末現在)
- ・ 事業の内容 銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

ロ 販売会社

(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29年3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付、収益分配金、償還金の支払事務等を行います。

3【資本関係】

該当ありません。

第3【その他】

- 目論見書の表紙等にロゴ・マーク、写真、イラスト、図案およびキャッチコピーを採用すること、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。
- 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。
- 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。
- 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。
- 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。
- 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。
- 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。
- 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。
- 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29年 6月16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28年4月1日から平成29年3月31日までの第32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29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。

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29年1月31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27年12月22日から平成28年12月20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28年12月20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29年1月31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27年12月22日から平成28年12月20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28年12月20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29年1月31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27年12月22日から平成28年12月20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28年12月20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29年1月31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27年12月22日から平成28年12月20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28年12月20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。

独立監査人の中間監査報告書

平成29年8月1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 印指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 菅野 雅子 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28年12月21日から平成29年6月20日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

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な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・DC年金プラン・ファンド（ターゲット・イヤー型）2010の平成29年6月20日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（平成28年12月21日から平成29年6月20日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

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。

独立監査人の中間監査報告書

平成29年8月1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 印指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 菅野 雅子 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28年12月21日から平成29年6月20日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

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・DC年金プラン・ファンド（ターゲット・イヤー型）2020の平成29年6月20日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（平成28年12月21日から平成29年6月20日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

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。

独立監査人の中間監査報告書

平成29年8月1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 印指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 菅野 雅子 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28年12月21日から平成29年6月20日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

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・DC年金プラン・ファンド（ターゲット・イヤー型）2030の平成29年6月20日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（平成28年12月21日から平成29年6月20日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

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。

独立監査人の中間監査報告書

平成29年8月1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 印指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 菅野 雅子 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28年12月21日から平成29年6月20日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

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・DC年金プラン・ファンド（ターゲット・イヤー型）2040の平成29年6月20日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（平成28年12月21日から平成29年6月20日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

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。