

## 【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30年3月15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30年3月16日から平成30年9月13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	<a href="http://www.smam-jp.com">http://www.smam-jp.com</a>

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 】

2018年3月16日から2018年9月13日まで

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

（ 8 ） 【 申込取扱場所 】

販売会社において申込みを取り扱います。

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

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

（ 9 ） 【 払込期日 】

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

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

（ 10 ） 【 払込取扱場所 】

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

（ 11 ） 【 振替機関に関する事項 】

当ファンドの振替機関は下記の通りです。

株式会社証券保管振替機構

（ 12 ） 【 その他 】

イ 申込証拠金

ありません。

ロ 日本以外の地域における募集

ありません。

ハ クーリング・オフ制度（金融商品取引法第37条の6）の適用

ありません。

ニ 振替受益権について

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

（ 参考：投資信託振替制度 ）

- ・ファンドの受益権の発生、消滅、移転をコンピュータシステムにて管理するもので、ファンドの設定、解約、償還等がコンピュータシステム上の帳簿(「振替口座簿」といいます。)への記載・記録によって行われます。
- ・受益証券は発行されませんので、盗難や紛失のリスクが削減されます(原則として受益証券を保有することはできません。)
- ・ファンドの設定、解約等における決済リスクが削減されます。
- ・振替口座簿に記録されますので、受益権の所在が明確になります。

## 第二部【ファンド情報】

### 第1【ファンドの状況】

#### 1【ファンドの性格】

##### （1）【ファンドの目的及び基本的性格】

イ 当ファンドは、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す。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
<b>追加型</b>	<b>内外</b>	不動産投信
		その他資産 ( )
		<b>資産複合</b>

(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	<b>年1回</b>	<b>グローバル</b> <b>(日本を含む)</b>	ファミリーファンド	あり
一般	年2回	日本		
大型株	年4回	北米		
中小型株	年6回(隔月)	欧州		
債券	年12回(毎月)	アジア	<b>ファンド・オブ・ファンズ</b>	<b>なし</b>
一般	日々	オセアニア		
公債	その他	中南米		
社債	( )	アフリカ		
その他債券		中近東(中東)		
クレジット属性 ( )		エマージング		
不動産投信				
<b>その他資産</b> <b>(投資信託証券</b> <b>(資産複合(株</b> <b>式、債券)資産配</b> <b>分変更型))</b>				
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】

2001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)

2002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。

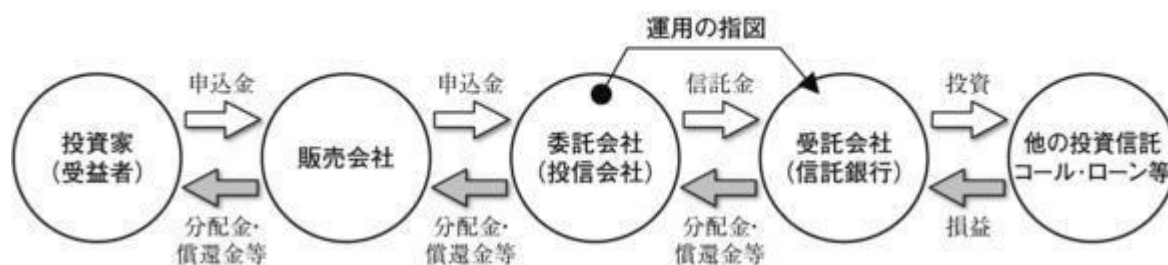
(ロ) 受託会社 「三井住友信託銀行株式会社」

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



ロ 委託会社の概況

(イ) 資本金の額

2,000百万円(2018年1月31日現在)



## (ロ) 会社の沿革

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

## (ハ) 大株主の状況

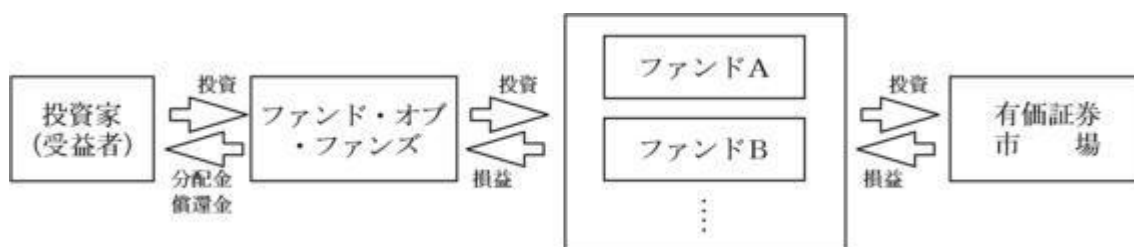
(2018年1月31日現在)

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

## ハ ファンドの運用形態（ファンド・オブ・ファンズによる運用）

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

## 〔ファンド・オブ・ファンズによる運用〕



## 2【投資方針】

## (1)【投資方針】

## イ 基本方針

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。

(ニ) 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）の動きに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）の動きに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	F T S E 世界国債インデックス（除く日本、円ベース）の動きに連動する投資成果を目指した運用を行います。

## 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 1 他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 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 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。

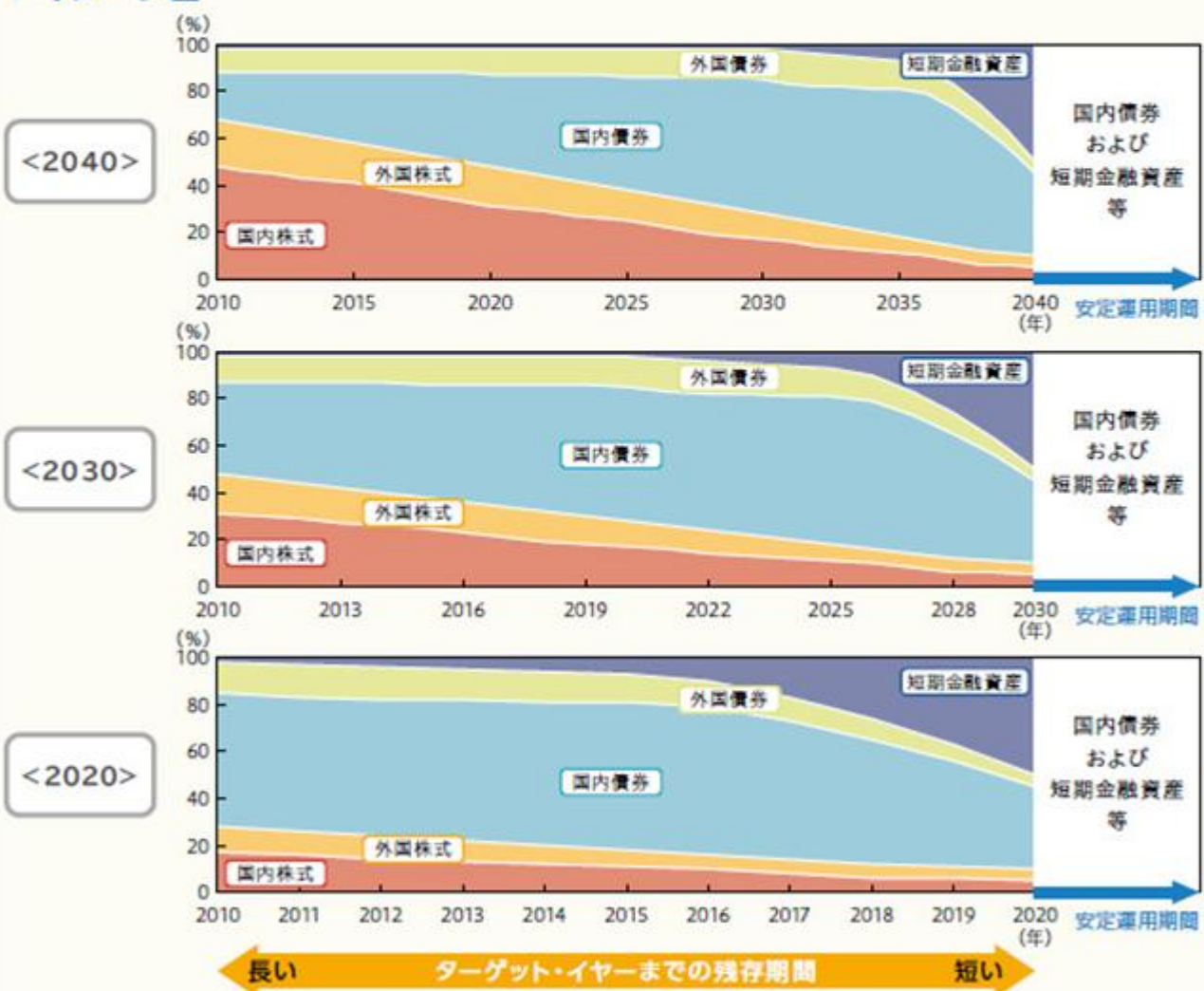
## 基本的な投資資産配分

### ▶基本アロケーション

■2018年1月末現在、各ファンドの基本アロケーションは以下の通りです。

	<2040>	<2030>	<2020>	<2010> 安定運用期間
国内株式	37%	21%	8%	5%
外国株式	17%	13%	6%	5%
国内債券	34%	52%	59%	35%
外国債券	10%	12%	10%	5%
短期金融資産	2%	2%	17%	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)

- 主として日本の株式に投資し、TOPIX(東証株価指数、配当込み)の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。
- 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<sup>\*1</sup>により、推定トラッキングエラー<sup>\*2</sup>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>

- 日本の公社債および短期金融資産を主要投資対象とし、NOMURA-BPI(総合)の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。
- ポートフォリオの作成にあたっては、層化抽出法<sup>\*3</sup>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)の動きに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、FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース）の動きに連動する投資成果を目指した運用を行います。
- 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、FTSE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.、FTSE Fixed Income 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。

## ■投資対象とする投資信託の投資方針等

### ▶ SMAM・国内株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)

形態	国内籍投資信託
主要投資対象	国内株式インデックス・マザーファンド(B号)
運用の基本方針	マザーファンドへの投資を通じて、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、TOPIX(東証株価指数、配当込み)の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。
ベンチマーク	TOPIX(東証株価指数、配当込み)
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> <li>株式への実質投資割合には、制限を設けません。</li> <li>外貨建資産への投資は行いません。</li> </ul>
決算日	原則として毎年11月30日(休業日の場合は翌営業日)
信託報酬	純資産総額に対して年0.081%(税抜き0.075%)
その他の費用	有価証券の売買時の手数料、資産を外国で保管する場合の費用、監査費用等を負担します。 その他の費用・手数料については、ファンドの運営状況等により変動するものであり、事前に料率、上限額等を示すことができません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	追加設定時、一部解約時にそれぞれ0.08%
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
購入の可否	日本において一般投資者は購入できません。



## ▶ SMAM・年金国内債券パッシブファンド&lt;適格機関投資家限定&gt;

形 態	国内籍投資信託
主要投資対象	国内債券(NOMURA-BPI)マザーファンド
運用の基本方針	マザーファンドおよび日本の公社債に投資を行い、NOMURA-BPI(総合)の動きに連動する投資成果を目指します。
ベンチマーク	NOMURA-BPI(総合)
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> <li>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。</li> <li>外貨建資産への投資は行いません。</li> </ul>
決 算 日	原則として毎年6月20日(休業日の場合は翌営業日)
信 託 報 酬	純資産総額に対して年0.054%(税抜き0.05%)
その他の費用	有価証券の売買時の手数料、資産を外国で保管する場合の費用、監査費用等を負担します。 その他の費用・手数料については、ファンドの運営状況等により変動するものであり、事前に料率、上限額等を示すことができません。
申 込 手 数 料	ありません。
信託財産留保額	追加設定時、一部解約時にそれぞれ0.03%
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
購 入 の 可 否	日本において一般投資者は購入できません。

## ▶ SMAM・外国株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)

形態	国内籍投資信託
主要投資対象	外国株式インデックス・マザーファンド
運用の基本方針	マザーファンドへの投資を通じて、世界各国の株式に投資し、MSCIコクサイインデックス(配当込み、円ベース)の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。
ベンチマーク	MSCIコクサイインデックス(配当込み、円ベース)
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> <li>株式への実質投資割合には、制限を設けません。</li> <li>外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。</li> </ul>
決算日	原則として毎年11月30日(休業日の場合は翌営業日)
信託報酬	純資産総額に対して年0.081%(税抜き0.075%)
その他の費用	有価証券の売買時の手数料、資産を外国で保管する場合の費用、監査費用等を負担します。 その他の費用・手数料については、ファンドの運営状況等により変動するものであり、事前に料率、上限額等を示すことができません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	追加設定時、一部解約時にそれぞれ0.15%
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
購入の可否	日本において一般投資者は購入できません。

## ▶ SMAM・年金外国債券パッシブ・ファンド&lt;適格機関投資家限定&gt;

形態	国内籍投資信託
主要投資対象	外国債券パッシブ・マザーファンド
運用の基本方針	マザーファンドへの投資を通じて、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、FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)をベンチマークとし、ベンチマークの動きに連動する投資成果を目指します。
ベンチマーク	FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> <li>● 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。</li> <li>● 外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。</li> </ul>
決算日	原則として毎年12月17日(休業日の場合は翌営業日)
信託報酬	純資産総額に対して年0.0648%(税抜き0.06%)
その他の費用	有価証券の売買時の手数料、資産を外国で保管する場合の費用、監査費用等を負担します。 その他の費用・手数料については、ファンドの運営状況等により変動するものであり、事前に料率、上限額等を示すことができません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	追加設定時、一部解約時にそれぞれ0.1%
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
購入の可否	日本において一般投資者は購入できません。

## ▶ SMAM・マネーインカムファンド<適格機関投資家限定>

形態	国内籍投資信託	
主要投資対象	マネーインカム・マザーファンド	
運用の基本方針	マザーファンドへの投資を通じて、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。	
ベンチマーク	ありません。	
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> <li>● 株式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。</li> <li>● 外貨建資産への投資は行いません。</li> </ul>	
決算日	原則として毎年4月13日(休業日の場合は翌営業日)	
信託報酬	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、次に掲げる率となります。なお、信託報酬率は月次で見直されます。	
	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	
その他の費用	有価証券の売買時の手数料、資産を外国で保管する場合の費用等を負担します。その他の費用・手数料については、ファンドの運営状況等により変動するものであり、事前に料率、上限額等を示すことができません。	
申込手数料	ありません。	
信託財産留保額	一部解約時に0.01%	
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	
購入の可否	日本において一般投資者は購入できません。	

### (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。

#### 八 投資対象とする金融商品

委託会社は、信託金を、上記口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。

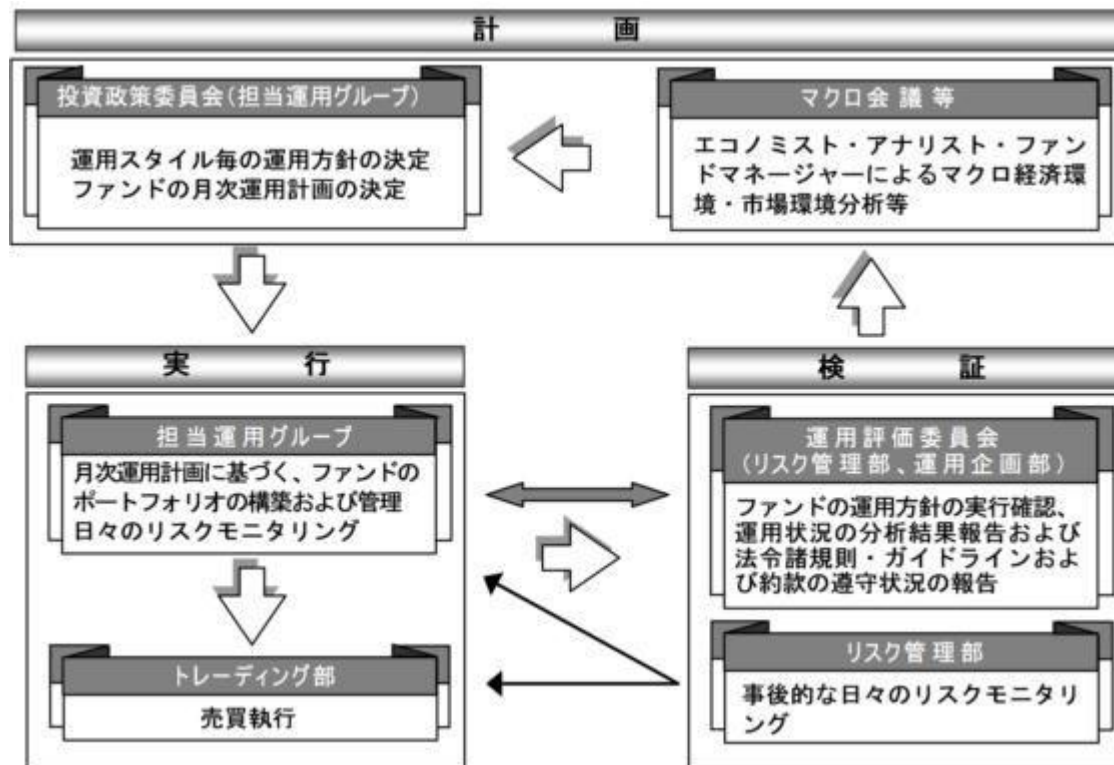
売買執行については、組織的に分離されたトレーディング部が、最良と思われる手法をもって売買を執行します。

##### (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 投資信託証券を組み入れる場合において、一般社団法人投資信託協会規則に定めるエクスポージャーがルックスルーできる場合に該当しないときは、当該投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。
- ホ 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。
- ヘ 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。
- ロ デリバティブ取引にかかる投資制限（金融商品取引業等に関する内閣府令第130条第1項第8号）

委託会社は、信託財産に関し、金利、通貨の価格、金融商品市場における相場その他の指標にかかる変動その他の理由により発生し得る危険に対応する額としてあらかじめ委託会社が定めた合理的な方法により算出した額が当該信託財産の純資産額を超えることとなる場合において、デリバティブ取引（新株予約権証券またはオプションを表示する証券もしくは証書にかかる取引および選択権付債券売買を含みます。）を行い、または継続することを受託会社に指図しないものとします。
- ハ 信用リスク集中回避のための投資制限（金融商品取引業等に関する内閣府令第130条第1項第8号の2）

委託会社は、運用財産に関し、信用リスク（保有する有価証券その他の資産について取引の相手方の債務不履行その他の理由により発生し得る危険をいいます。）を適正に管理する方法と

してあらかじめ委託会社が定めた合理的な方法に反することとなる取引を行うことを受託会社に指図しないものとします。



## 〔参考情報：投資対象とする投資信託の概要〕

## 〔SMAM・国内株式パッシブ・ファンド（適格機関投資家専用）〕

## （１）運用会社等

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

## （２）投資方針等

## イ 基本方針

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

## ロ 投資態度

- （イ）主として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、TOPIX（東証株価指数、配当込み）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。
- （ロ）株価指数先物取引等を含む株式の実質組入比率は、原則として高位を保ちます。ただし、資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。
- （ハ）株式以外の資産（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、TOPIX（東証株価指数、配当込み）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。

東証株価指数（TOPIX）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、TOPIXの算出もしくは公表の方法の変更、TOPIXの算出もしくは公表の停止またはTOPIX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「SMAM・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。
- （ハ）一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

## （３）その他

- イ 信託報酬 純資産総額に対して年0.081%（税抜き0.075%）
- ロ 申込手数料 ありません。
- ハ 信託財産留保額 追加設定時、一部解約時にそれぞれ0.08%
- ニ 決算日 原則として毎年11月30日（休業日の場合は翌営業日）
- ホ 購入の可否 日本において一般投資者は購入できません。

## 〔SMAM・年金国内債券パッシブファンド＜適格機関投資家限定＞〕

## (1) 運用会社等

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

## (2) 投資方針等

## イ 基本方針

SMAM・年金国内債券パッシブファンド＜適格機関投資家限定＞は、国内債券（NOMURA - BPI）マザーファンド（以下「マザーファンド」といいます。）受益証券への投資を通じて、NOMURA - BPI（総合）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。

## ロ 投資態度

- (イ) 主としてマザーファンド受益証券および日本の公社債に投資を行い、NOMURA - BPI（総合）の動き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、主として日本の公社債および短期金融資産に投資し、安定した利子等収益および売買益の確保を目指すとともに、NOMURA - BPI（総合）の動きに連動する投資成果を目指します。

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

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

## (3) その他

- イ 信託報酬 このファンドの信託財産の純資産総額に年0.054%（税抜き0.05%）を乗じて得た額  
 ロ 手数料 取得申込時および換金時には手数料はかかりません。  
 ハ 信託財産留保額 取得申込時および解約請求時にそれぞれ受付日の基準価額に対して0.03%  
 ニ 決算日 毎年1回（原則として6月20日）  
 ホ 購入の可否 日本において一般投資者は購入できません。

## 〔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)〕

## (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)の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。

## ロ 投資態度

(イ) 主としてマザーファンド受益証券への投資を通じて、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)の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。

(ロ) 外貨建資産については、原則として対円で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)の動きに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。

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

## (3) その他

- イ 信託報酬 純資産総額に対して年0.081% (税抜き0.075%)  
 ロ 申込手数料 ありません。  
 ハ 信託財産留保額 追加設定時、一部解約時にそれぞれ0.15%  
 ニ 決算日 原則として毎年11月30日(休業日の場合は翌営業日)  
 ホ 購入の可否 日本において一般投資者は購入できません。

## 〔S M A M ・年金外国債券パッシブ・ファンド&lt;適格機関投資家限定&gt;〕

## (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、F T S E世界国債インデックス(除く日本、円ベース)の動きに連動する投資成果を目指した運用を行います。

## 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) F T S E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、ベンチマークの動きに連動する投資成果を目指します。
- (ロ) ポートフォリオ構築にあたっては、取引コストを極力抑えながら、推定トラッキングエラーを最小化します。
- (ハ) ベンチマークの月次の変化状況とポートフォリオのリスク量の状況を勘案しながらリバランスを行います。
- (ニ) 保有する外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行いません。
- (ホ) 公社債の組入比率は原則として高位を保ちます。
- (ヘ) 資金動向、市況動向等の急変により上記の運用が困難となった場合、暫定的に上記と異なる運用を行う場合があります。

マザーファンドにおいては、F T S E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、ベンチマークの動きに連動する投資成果を目指した運用を行います。

F T S E世界国債インデックス(除く日本、円ベース)は、FTSE Fixed Income LLCの知的財産であり、指数に関するすべての権利はFTSE Fixed Income LLCが有しています。FTSE Fixed Income 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。

## 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、信託財産の純資産総額の5%以内とします。
- (ホ) 同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。
- (ヘ) 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

## (3) その他

- イ 信託報酬 純資産総額に対して年0.0648%（税抜き0.06%）
- ロ 申込手数料 ありません。
- ハ 信託財産留保額 追加設定時、一部解約時にそれぞれ0.1%
- ニ 決算日 原則として毎年12月17日（休業日の場合は翌営業日）
- ホ 購入の可否 日本において一般投資者は購入できません。

## 〔SMAM・マネーインカムファンド＜適格機関投資家限定＞〕

## (1) 運用会社等

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

## (2) 投資方針等

## イ 基本方針

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

## ロ 投資態度

主として、マザーファンドへの投資を通じて、実質的に以下の運用を行います。

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

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

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

## 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 申込手数料

ありません。

## ハ 信託財産留保額

一部解約時に0.01%

## ニ 決算日

原則として毎年4月13日（休業日の場合は翌営業日）

## ホ ベンチマーク

ありません。

## ヘ 購入の可否

日本において一般投資者は購入できません。

### 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おりません。

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>

年間騰落率：  
2013年2月～2018年1月

分配金再投資基準価額：  
2013年2月～2018年1月

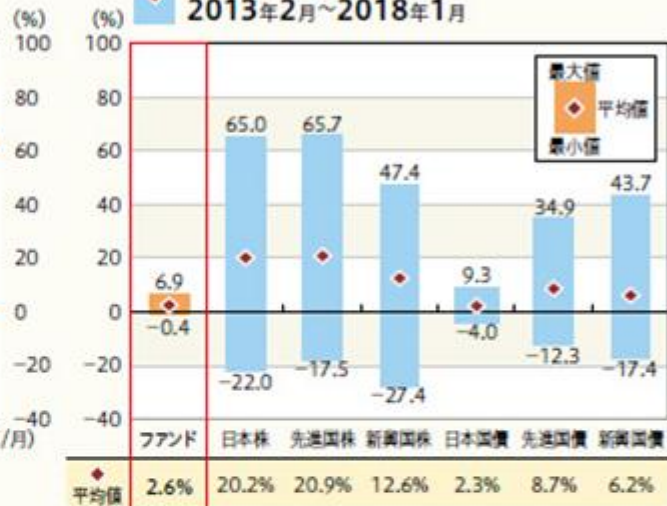


### 〔 ファンドと他の代表的な 資産クラスとの騰落率の比較 〕

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：  
2013年2月～2018年1月

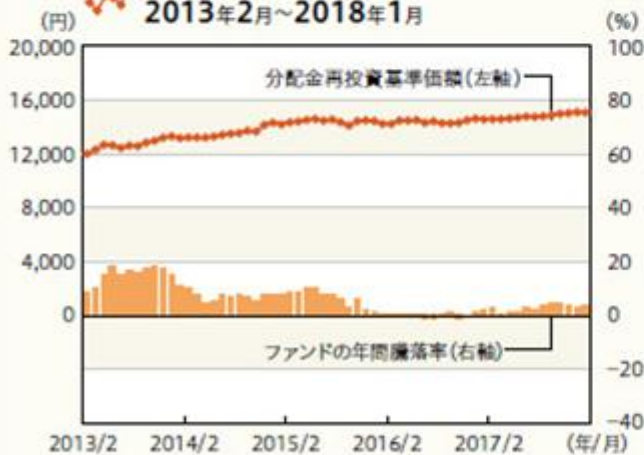
他の資産クラス：  
2013年2月～2018年1月



#### ▶<2020>

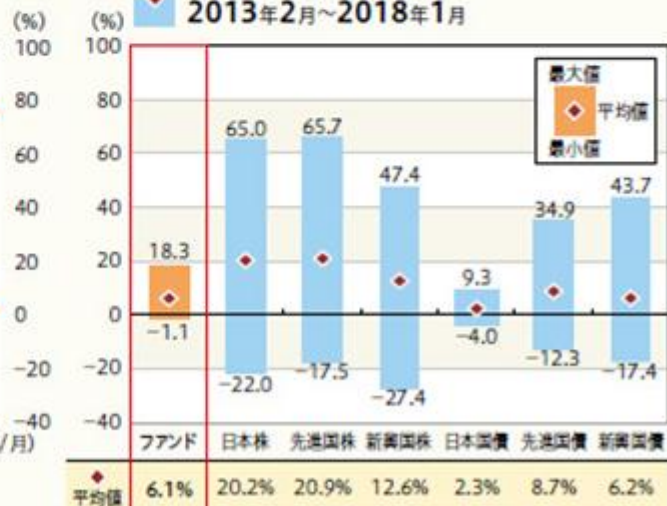
年間騰落率：  
2013年2月～2018年1月

分配金再投資基準価額：  
2013年2月～2018年1月



ファンド：  
2013年2月～2018年1月

他の資産クラス：  
2013年2月～2018年1月



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

※分配実績がない場合は、分配金再投資基準価額は基準価額と同じです。

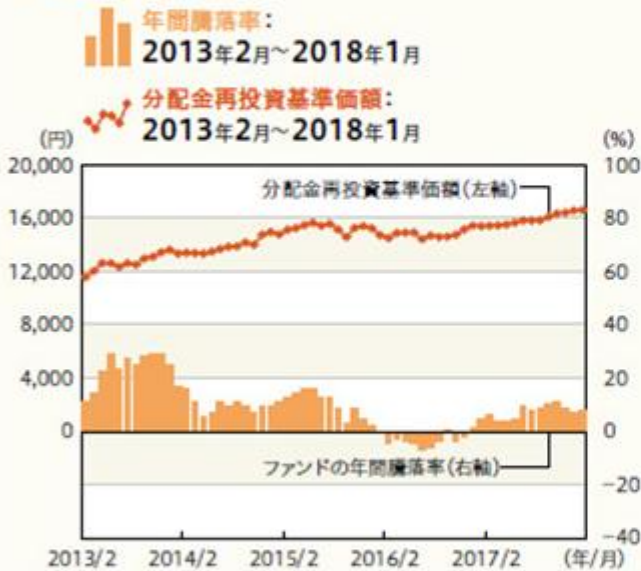
※ファンドの騰落率は、分配金(税引前)を分配時に再投資したものと仮定して計算しており、実際の基準価額をもとに計算したものと異なります。

※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>

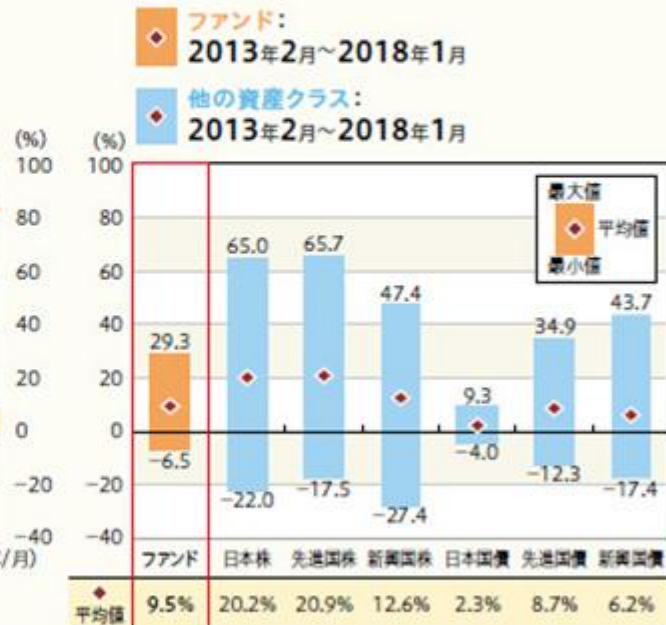


※年間騰落率、分配金再投資基準価額は、分配金(税引前)を分配時に再投資したものと仮定して計算したものです。

※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。



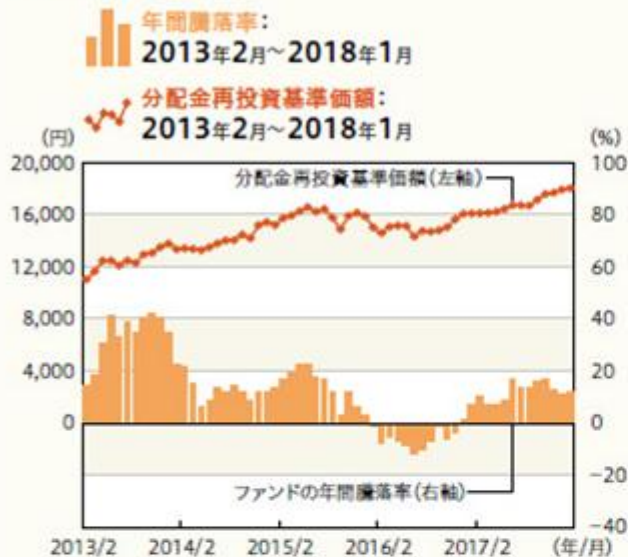
※ファンドの騰落率は、分配金(税引前)を分配時に再投資したものと仮定して計算しており、実際の基準価額をもとに計算したものと異なります。

※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	FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース) FTSE Fixed Income LLCにより運営されている指数で、日本を除く世界の主要国の国債を対象としています。
新興国債	JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ダイバーシファイド(円ベース) J.P. Morganが開発、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（2018年1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0.559440%（税抜き0.5180%）程度
< 2 0 2 0 >	年0.611928%（税抜き0.5666%）程度
< 2 0 3 0 >	年0.596484%（税抜き0.5523%）程度
< 2 0 4 0 >	年0.601668%（税抜き0.5571%）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等は、信託財産中から支弁します。

- 八 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す。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応じて負担することになります。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。

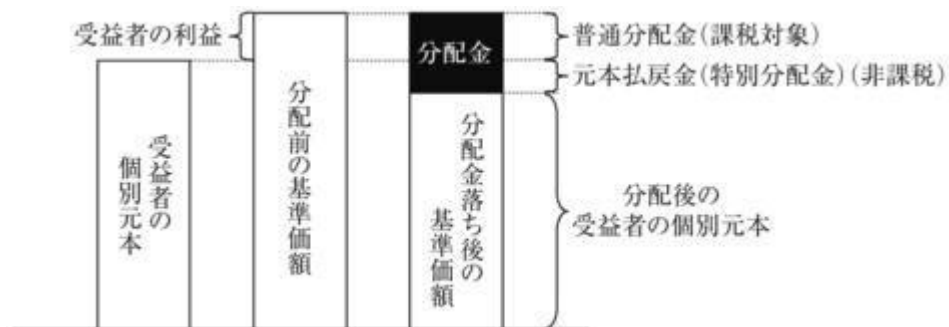
## 八 収益分配金の課税について

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

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（課税対象）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、2018年1月末現在の情報をもとに作成しています。税法の改正等により、変更されることがあります。

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

## 5【運用状況】

## (1)【投資状況】

## 三井住友・DC年金プラン・ファンド(ターゲット・イヤー型)2010

2018年1月31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	520,626,148	99.78
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1,166,347	0.22
合計(純資産総額)		521,792,495	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

2018年1月31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	1,400,079,755	99.94
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		810,981	0.06
合計(純資産総額)		1,400,890,736	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

2018年1月31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	1,682,487,225	99.90
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1,607,826	0.10
合計(純資産総額)		1,684,095,051	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

2018年1月31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	2,451,204,685	99.94
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1,472,266	0.06
合計(純資産総額)		2,452,676,951	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

2018年 1月31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 ・ マネーインカムファンド <適格機関投資家限定>	259,364,527	1.0074	261,309,242	1.0074	261,283,824	50.07
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>	142,440,812	1.2867	183,290,557	1.2823	182,651,853	35.00
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>	14,793,574	1.7739	26,242,897	1.7386	25,720,107	4.93
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)	9,353,360	2.6880	25,141,878	2.7328	25,560,862	4.90
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)	13,703,016	1.8092	24,792,524	1.8543	25,409,502	4.87

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

2018年 1月31日現在

種類	投資比率(%)
投資信託受益証券	99.78
合計	99.78

## 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

2018年 1月31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>	646,830,589	1.2867	832,333,193	1.2823	829,430,864	59.21
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>	237,427,200	1.0074	239,207,745	1.0074	239,184,161	17.07
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>	79,614,144	1.7738	141,227,291	1.7386	138,417,150	9.88
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)	59,602,143	1.8093	107,840,541	1.8543	110,520,253	7.89
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)	30,198,817	2.6880	81,174,420	2.7328	82,527,327	5.89

以上が、当ファンドが保有する有価証券のすべてです。

## ロ 種類別の投資比率

2018年 1月31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)2030

## イ 主要投資銘柄

2018年 1月31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>	687,709,772	1.2867	884,916,738	1.2823	881,850,240	52.36
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)	188,040,564	1.8093	340,224,613	1.8543	348,683,617	20.70
日本	投資信託受益 証券	S M A M ・ 外国株式パッシブ・ファ ンド(適格機関投資家専用)	79,686,871	2.6880	214,198,309	2.7328	217,768,281	12.93
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>	115,211,335	1.7739	204,380,874	1.7386	200,306,427	11.89
日本	投資信託受益 証券	S M A M ・ マネーインカムファンド <適格機関投資家限定>	33,629,800	1.0074	33,882,023	1.0074	33,878,660	2.01

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

2018年 1月31日現在

種類	投資比率（％）
投資信託受益証券	99.90
合計	99.90

## 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

2018年 1月31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）	484,023,595	1.8092	875,741,470	1.8543	897,524,952	36.59
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＞	657,522,395	1.2866	846,018,285	1.2823	843,140,967	34.38
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）	152,307,899	2.6886	409,502,328	2.7328	416,227,026	16.97
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＞	141,046,278	1.7738	250,188,311	1.7386	245,223,058	10.00
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＞	48,728,095	1.0074	49,093,458	1.0074	49,088,682	2.00

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

2018年 1月31日現在

種類	投資比率（％）
投資信託受益証券	99.94
合計	99.94

## 【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8期 (2008年12月22日)	238,566,878	238,566,878	10,578	10,578
第9期 (2009年12月21日)	301,495,735	301,495,735	10,921	10,921
第10期 (2010年12月20日)	324,751,925	324,751,925	10,941	10,941
第11期 (2011年12月20日)	329,392,588	329,392,588	10,818	10,818
第12期 (2012年12月20日)	348,417,250	348,417,250	11,198	11,198
第13期 (2013年12月20日)	406,358,497	406,358,497	11,884	11,884
第14期 (2014年12月22日)	490,170,412	490,170,412	12,303	12,303
第15期 (2015年12月21日)	524,035,669	524,035,669	12,346	12,346
第16期 (2016年12月20日)	553,177,646	553,177,646	12,457	12,457
第17期 (2017年12月20日)	527,274,484	527,274,484	12,663	12,663
2017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	
7月末日	539,382,027		12,504	
8月末日	538,512,203		12,521	
9月末日	534,435,057		12,563	
10月末日	530,797,658		12,611	
11月末日	530,599,313		12,631	
12月末日	527,186,224		12,664	
2018年 1月末日	521,792,495		12,655	

## 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8期 (2008年12月22日)	258,579,003	258,579,003	10,124	10,124
第9期 (2009年12月21日)	364,838,536	364,838,536	10,782	10,782
第10期 (2010年12月20日)	460,154,017	460,154,017	10,871	10,871
第11期 (2011年12月20日)	503,354,494	503,354,494	10,466	10,466
第12期 (2012年12月20日)	605,756,824	605,756,824	11,419	11,419
第13期 (2013年12月20日)	792,418,477	792,418,477	13,210	13,210
第14期 (2014年12月22日)	1,042,332,411	1,042,332,411	14,223	14,223
第15期 (2015年12月21日)	1,219,971,427	1,219,971,427	14,395	14,395
第16期 (2016年12月20日)	1,350,077,224	1,350,077,224	14,620	14,620
第17期 (2017年12月20日)	1,407,255,564	1,407,255,564	15,080	15,080
2017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	
7月末日	1,377,640,765		14,734	
8月末日	1,384,546,541		14,779	
9月末日	1,392,597,609		14,864	
10月末日	1,391,521,493		14,970	
11月末日	1,399,831,799		15,014	
12月末日	1,406,414,442		15,083	
2018年 1月末日	1,400,890,736		15,057	

## 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8期 (2008年12月22日)	146,078,912	146,078,912	9,332	9,332
第9期 (2009年12月21日)	214,049,126	214,049,126	10,168	10,168
第10期 (2010年12月20日)	266,798,732	266,798,732	10,308	10,308
第11期 (2011年12月20日)	273,003,638	273,003,638	9,525	9,525
第12期 (2012年12月20日)	367,329,083	367,329,083	10,766	10,766
第13期 (2013年12月20日)	541,345,607	541,345,607	13,445	13,445
第14期 (2014年12月22日)	773,129,050	773,129,050	14,814	14,814
第15期 (2015年12月21日)	1,197,113,384	1,197,113,384	15,141	15,141
第16期 (2016年12月20日)	1,379,800,736	1,379,800,736	15,465	15,465
第17期 (2017年12月20日)	1,688,498,803	1,688,498,803	16,512	16,512
2017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	
7月末日	1,579,141,649		15,779	
8月末日	1,578,051,025		15,797	
9月末日	1,627,393,415		16,053	
10月末日	1,657,172,848		16,310	
11月末日	1,675,791,853		16,377	
12月末日	1,695,346,847		16,533	
2018年 1月末日	1,684,095,051		16,557	



## 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8期 (2008年12月22日)	134,815,396	134,815,396	8,596	8,596
第9期 (2009年12月21日)	188,270,881	188,270,881	9,559	9,559
第10期 (2010年12月20日)	231,956,041	231,956,041	9,713	9,713
第11期 (2011年12月20日)	230,424,744	230,424,744	8,586	8,586
第12期 (2012年12月20日)	287,659,579	287,659,579	10,038	10,038
第13期 (2013年12月20日)	445,842,340	445,842,340	13,541	13,541
第14期 (2014年12月22日)	588,648,311	588,648,311	15,256	15,256
第15期 (2015年12月21日)	1,837,523,740	1,837,523,740	15,742	15,742
第16期 (2016年12月20日)	2,076,188,532	2,076,188,532	16,160	16,160
第17期 (2017年12月20日)	2,421,821,587	2,421,821,587	17,845	17,845
2017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	
7月末日	2,301,053,800		16,683	
8月末日	2,323,628,199		16,660	
9月末日	2,363,908,928		17,108	
10月末日	2,402,160,194		17,549	
11月末日	2,405,489,179		17,642	
12月末日	2,429,722,148		17,884	
2018年 1月末日	2,452,676,951		17,995	

## 【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8期	2007年12月21日～2008年12月22日	0
第9期	2008年12月23日～2009年12月21日	0
第10期	2009年12月22日～2010年12月20日	0
第11期	2010年12月21日～2011年12月20日	0
第12期	2011年12月21日～2012年12月20日	0
第13期	2012年12月21日～2013年12月20日	0
第14期	2013年12月21日～2014年12月22日	0
第15期	2014年12月23日～2015年12月21日	0
第16期	2015年12月22日～2016年12月20日	0
第17期	2016年12月21日～2017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8期	2007年12月21日～2008年12月22日	0
第9期	2008年12月23日～2009年12月21日	0
第10期	2009年12月22日～2010年12月20日	0
第11期	2010年12月21日～2011年12月20日	0
第12期	2011年12月21日～2012年12月20日	0
第13期	2012年12月21日～2013年12月20日	0
第14期	2013年12月21日～2014年12月22日	0
第15期	2014年12月23日～2015年12月21日	0
第16期	2015年12月22日～2016年12月20日	0
第17期	2016年12月21日～2017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8期	2007年12月21日～2008年12月22日	0
第9期	2008年12月23日～2009年12月21日	0
第10期	2009年12月22日～2010年12月20日	0
第11期	2010年12月21日～2011年12月20日	0
第12期	2011年12月21日～2012年12月20日	0
第13期	2012年12月21日～2013年12月20日	0
第14期	2013年12月21日～2014年12月22日	0
第15期	2014年12月23日～2015年12月21日	0
第16期	2015年12月22日～2016年12月20日	0
第17期	2016年12月21日～2017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8期	2007年12月21日～2008年12月22日	0
第9期	2008年12月23日～2009年12月21日	0
第10期	2009年12月22日～2010年12月20日	0
第11期	2010年12月21日～2011年12月20日	0
第12期	2011年12月21日～2012年12月20日	0
第13期	2012年12月21日～2013年12月20日	0
第14期	2013年12月21日～2014年12月22日	0
第15期	2014年12月23日～2015年12月21日	0
第16期	2015年12月22日～2016年12月20日	0
第17期	2016年12月21日～2017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	1.7

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

## 三井住友・DC年金プラン・ファンド（ターゲット・イヤー型）2020

	収益率（％）
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	3.1

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

## 三井住友・DC年金プラン・ファンド(ターゲット・イヤー型)2030

	収益率(%)
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	6.8

(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	10.4

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

## (4) 【設定及び解約の実績】

## 三井住友・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	26,200,366	53,890,527

(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	90,276,024	80,540,222

(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	210,104,041	79,693,554

(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	276,886,193	204,549,164

(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

## SMAM・国内株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)

2018年 1月30日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
親投資信託受益証券	日本	21,570,002,221	100.01
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		3,108,910	0.01
合計(純資産総額)		21,566,893,311	100.00





## 国内株式インデックス・マザーファンド(B号)

2018年 1月30日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
株式	日本	193,924,845,690	99.16
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1,652,495,389	0.84
合計(純資産総額)		195,577,341,079	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	1,762,725,000	0.90
合計	買建		1,762,725,000	0.90

## S M A M・年金国内債券パッシブファンド&lt;適格機関投資家限定&gt;

2018年 1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	31,983,093,774	100.01
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		2,095,746	0.01
合計(純資産総額)		31,980,998,028	100.00

## 国内債券(NOMURA-BPI)マザーファンド

2018年 1月30日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
国債証券	日本	84,224,108,920	77.25
地方債証券	日本	8,723,219,440	8.00
特殊債券	日本	10,163,161,152	9.32
社債券	日本	4,230,212,000	3.88
	オーストラリア	100,223,000	0.09
	オランダ	100,210,000	0.09
	アメリカ	100,161,000	0.09
	小計	4,530,806,000	4.16
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1,392,312,003	1.27
合計(純資産総額)		109,033,607,515	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）

2018年 1月31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	10,809,428,270	99.97
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		3,618,151	0.03
合計(純資産総額)		10,813,046,421	100.00

## 外国株式インデックス・マザーファンド

2018年 1月31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	115,502,776,707	59.16
	イギリス	12,803,152,740	6.56
	ドイツ	7,659,358,881	3.92
	フランス	7,553,435,338	3.87
	カナダ	7,135,213,015	3.65
	スイス	6,798,807,649	3.48
	オーストラリア	4,571,933,203	2.34
	オランダ	3,827,917,264	1.96
	アイルランド	2,712,813,118	1.39
	スペイン	2,566,291,499	1.31
	スウェーデン	2,086,289,670	1.07
	香港	1,784,885,200	0.91
	イタリア	1,555,613,073	0.80
	デンマーク	1,397,492,750	0.72
	シンガポール	1,396,934,904	0.72
	ジャージー	1,041,459,309	0.53
	バミューダ	883,239,920	0.45
	ベルギー	856,041,095	0.44
	フィンランド	732,325,246	0.38
	ケイマン諸島	538,005,560	0.28
	ノルウェー	512,781,071	0.26
	キュラソー	505,033,278	0.26
	イスラエル	358,245,450	0.18
ルクセンブルグ	265,518,404	0.14	
オーストリア	211,695,478	0.11	
ニュージーランド	127,831,116	0.07	

	ポルトガル	117,191,427	0.06
	リベリア	116,460,235	0.06
	英ヴァージン諸島	52,090,023	0.03
	パプアニューギニア	41,199,169	0.02
	マン島	31,670,146	0.02
	モーリシャス	11,293,842	0.01
	小計	185,754,995,780	95.14
投資証券	アメリカ	2,855,681,320	1.46
	オーストラリア	590,384,295	0.30
	フランス	254,517,661	0.13
	イギリス	161,427,326	0.08
	香港	121,644,201	0.06
	シンガポール	97,700,043	0.05
	カナダ	34,868,779	0.02
	小計	4,116,223,625	2.11
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		5,369,817,249	2.75
合計(純資産総額)		195,241,036,654	100.00

その他以下の取引を行っております。

種類	買建 / 売建	国 / 地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引	買建	アメリカ	3,625,872,789	1.85
	買建	ドイツ	997,721,142	0.51
	買建	イギリス	371,621,992	0.19
	買建	オーストラリア	261,614,200	0.13
合計	買建		5,256,830,123	2.68

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		162,538,500	0.08

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 >

2018年 1月31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	3,764,426,770	100.01
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		285,727	0.01
合計(純資産総額)		3,764,141,043	100.00

## 外国債券パッシブ・マザーファンド

2018年 1月31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	78,312,829,283	41.23
	フランス	19,587,159,595	10.31
	イタリア	19,301,779,726	10.16
	イギリス	13,645,581,118	7.18
	ドイツ	13,071,545,903	6.88
	スペイン	11,240,644,241	5.92
	ベルギー	4,961,510,150	2.61
	オーストラリア	4,169,517,310	2.20
	カナダ	4,073,642,332	2.14
	オランダ	3,885,591,194	2.05
	オーストリア	3,326,244,906	1.75
	アイルランド	1,551,346,320	0.82
	メキシコ	1,449,018,118	0.76
	ポーランド	1,274,481,390	0.67
	フィンランド	1,254,083,665	0.66
	南アフリカ	1,149,042,220	0.60
	デンマーク	1,108,360,605	0.58
	スウェーデン	916,250,862	0.48
	マレーシア	881,089,029	0.46
	シンガポール	734,950,106	0.39
ノルウェー	573,106,485	0.30	
スイス	344,538,004	0.18	
	小計	186,812,312,562	98.35
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		3,140,411,893	1.65
合計(純資産総額)		189,952,724,455	100.00

## S M A M ・ マネーインカムファンド &lt; 適格機関投資家限定 &gt;

2018年 1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	607,846,871	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)		607,847,845	100.00

## マネーインカム・マザーファンド

2018年 1月30日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
特殊債券	日本	1,919,891,890	72.24
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		737,931,416	27.76
合計(純資産総額)		2,657,823,306	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

2018年 1月30日現在

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	投資 比率 (%)
日本	親投資信託受益証券	国内株式インデックス・マザーファンド(B号)	7,626,759,855	2.7242	20,776,819,197	2.8282	21,570,002,221	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

2018年 1月30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)

2018年 1月30日現在

国/地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	投資 比率 (%)
日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	887,300	7,052.86	6,258,006,000	7,629.00	6,769,211,700	3.46
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	5,085,900	793.27	4,034,541,600	839.10	4,267,578,690	2.18
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	324,200	9,484.65	3,074,926,300	9,046.00	2,932,713,200	1.50
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	544,800	4,556.53	2,482,400,474	4,979.00	2,712,559,200	1.39

日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	513,900	5,871.13	3,017,175,100	5,235.00	2,690,266,500	1.38
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	656,700	3,747.97	2,461,294,300	3,925.00	2,577,547,500	1.32
日本	株式	ソニー	電気機器	487,400	5,207.86	2,538,312,700	5,183.00	2,526,194,200	1.29
日本	株式	キーエンス	電気機器	35,800	64,992.79	2,326,742,000	67,020.00	2,399,316,000	1.23
日本	株式	任天堂	その他製品	45,000	45,258.53	2,036,634,000	47,010.00	2,115,450,000	1.08
日本	株式	ファナック	電気機器	69,400	27,996.28	1,942,942,500	29,670.00	2,059,098,000	1.05
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	9,779,300	204.06	1,995,601,400	209.00	2,043,873,700	1.05
日本	株式	KDDI	情報・通信業	644,800	3,209.34	2,069,388,300	2,789.50	1,798,669,600	0.92
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	268,800	6,189.36	1,663,701,300	6,511.00	1,750,156,800	0.89
日本	株式	キヤノン	電気機器	392,800	4,298.90	1,688,611,400	4,243.00	1,666,650,400	0.85
日本	株式	日本たばこ産業	食料品	453,100	3,719.42	1,685,272,400	3,640.00	1,649,284,000	0.84
日本	株式	信越化学工業	化学	127,300	11,776.68	1,499,172,000	12,470.00	1,587,431,000	0.81
日本	株式	日本電産	電気機器	87,800	15,306.83	1,343,940,000	18,025.00	1,582,595,000	0.81
日本	株式	三菱商事	卸売業	504,500	2,817.70	1,421,531,000	3,092.00	1,559,914,000	0.80
日本	株式	日立製作所	電気機器	1,752,000	835.58	1,463,951,800	882.20	1,545,614,400	0.79
日本	株式	小松製作所	機械	352,400	3,490.75	1,230,141,000	4,254.00	1,499,109,600	0.77
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	538,300	2,648.84	1,425,874,100	2,724.50	1,466,598,350	0.75
日本	株式	東日本旅客鉄道	陸運業	131,000	10,872.14	1,424,251,000	11,110.00	1,455,410,000	0.74
日本	株式	三菱電機	電気機器	729,700	1,855.87	1,354,231,650	1,994.50	1,455,386,650	0.74
日本	株式	NTTドコモ	情報・通信業	529,600	2,905.43	1,538,718,950	2,730.00	1,445,808,000	0.74
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	271,200	4,965.27	1,346,583,500	5,208.00	1,412,409,600	0.72
日本	株式	ブリヂストン	ゴム製品	257,800	5,099.96	1,314,771,300	5,380.00	1,386,964,000	0.71
日本	株式	花王	化学	179,400	7,442.34	1,335,156,900	7,708.00	1,382,815,200	0.71
日本	株式	東海旅客鉄道	陸運業	65,400	20,779.47	1,358,977,500	20,965.00	1,371,111,000	0.70
日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	301,300	4,604.50	1,387,338,500	4,535.00	1,366,395,500	0.70
日本	株式	パナソニック	電気機器	833,300	1,668.58	1,390,432,000	1,626.50	1,355,362,450	0.69

## □ 種類別・業種別の投資比率

2018年 1月30日現在

種類	国内/外国	業種	投資比率(%)
株式	国内	水産・農林業	0.10
		鉱業	0.34

建設業	3.15
食料品	4.29
繊維製品	0.68
パルプ・紙	0.27
化学	7.11
医薬品	4.34
石油・石炭製品	0.69
ゴム製品	0.98
ガラス・土石製品	1.01
鉄鋼	1.16
非鉄金属	0.99
金属製品	0.70
機械	5.76
電気機器	13.89
輸送用機器	8.89
精密機器	1.56
その他製品	2.11
電気・ガス業	1.48
陸運業	3.96
海運業	0.24
空運業	0.59
倉庫・運輸関連業	0.19
情報・通信業	7.10
卸売業	4.64
小売業	4.53
銀行業	7.37
証券、商品先物取引業	1.02
保険業	2.23
その他金融業	1.24
不動産業	2.41
サービス業	4.16
合計	99.16

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

2018年 1月30日現在

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	投資 比率 (%)
日本	親投資信託受 益証券	国内債券(NOMURA - BPI) マザーファンド	23,105,832,809	1.3836	31,969,230,275	1.3842	31,983,093,774	100.01

以上が、当ファンドが保有する有価証券のすべてです。



## □ 種類別の投資比率

2018年 1月30日現在

種類	投資比率（％）
親投資信託受益証券	100.01
合計	100.01

## 国内債券（NOMURA - BPI）マザーファンド

## イ 主要投資銘柄（上位30銘柄）

2018年 1月30日現在

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
日本	国債証券	第130回利付国債 (5年)	1,290,000,000	100.92	1,301,868,000	100.68	1,298,784,900	0.100	2021/12/20	1.19
日本	国債証券	第127回利付国債 (5年)	1,275,000,000	100.75	1,284,562,500	100.58	1,282,395,000	0.100	2021/3/20	1.18
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	102.89	1,270,691,500	1.000	2020/9/20	1.17
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	100.50	1,236,162,300	0.100	2020/9/20	1.13
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	104.37	1,215,957,100	1.200	2021/6/20	1.12
日本	国債証券	第306回利付国債 (10年)	1,160,000,000	104.12	1,207,792,000	103.21	1,197,236,000	1.400	2020/3/20	1.10
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	100.61	1,192,228,500	0.100	2021/6/20	1.09
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	104.31	1,147,498,000	1.100	2021/9/20	1.05
日本	国債証券	第344回利付国債 (10年)	1,125,000,000	100.69	1,132,762,500	100.38	1,129,342,500	0.100	2026/9/20	1.04
日本	国債証券	第343回利付国債 (10年)	1,117,000,000	100.70	1,124,903,700	100.45	1,122,127,030	0.100	2026/6/20	1.03
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	104.36	1,064,482,200	1.300	2021/3/20	0.98
日本	国債証券	第312回利付国債 (10年)	985,000,000	104.52	1,029,551,550	103.74	1,021,858,700	1.200	2020/12/20	0.94
日本	国債証券	第345回利付国債 (10年)	975,000,000	100.67	981,587,100	100.35	978,441,750	0.100	2026/12/20	0.90
日本	国債証券	第346回利付国債 (10年)	975,000,000	100.57	980,557,500	100.27	977,652,000	0.100	2027/3/20	0.90
日本	国債証券	第131回利付国債 (5年)	955,000,000	100.90	963,633,200	100.72	961,914,200	0.100	2022/3/20	0.88
日本	国債証券	第328回利付国債 (10年)	900,000,000	103.77	933,930,900	103.39	930,555,000	0.600	2023/3/20	0.85
日本	国債証券	第333回利付国債 (10年)	880,000,000	104.39	918,651,850	103.83	913,756,800	0.600	2024/3/20	0.84

日本	国債証券	第340回利付国債 (10年)	883,000,000	103.25	911,703,150	102.85	908,218,480	0.400	2025/9/20	0.83
日本	国債証券	第339回利付国債 (10年)	875,000,000	103.23	903,262,500	102.83	899,832,500	0.400	2025/6/20	0.83
日本	国債証券	第347回利付国債 (10年)	890,000,000	100.65	895,843,600	100.23	892,064,800	0.100	2027/6/20	0.82
日本	国債証券	第329回利付国債 (10年)	850,000,000	105.13	893,679,400	104.58	888,981,000	0.800	2023/6/20	0.82
日本	国債証券	第342回利付国債 (10年)	860,000,000	100.77	866,622,000	100.52	864,523,600	0.100	2026/3/20	0.79
日本	国債証券	第335回利付国債 (10年)	795,000,000	103.85	825,661,500	103.38	821,910,750	0.500	2024/9/20	0.75
日本	国債証券	第348回利付国債 (10年)	795,000,000	100.53	799,277,000	100.23	796,900,050	0.100	2027/9/20	0.73
日本	国債証券	第338回利付国債 (10年)	762,000,000	103.21	786,460,200	102.81	783,442,680	0.400	2025/3/20	0.72
日本	国債証券	第132回利付国債 (5年)	775,000,000	101.04	783,120,000	100.76	780,959,750	0.100	2022/6/20	0.72
日本	国債証券	第330回利付国債 (10年)	720,000,000	105.32	758,304,000	104.77	754,351,200	0.800	2023/9/20	0.69
日本	国債証券	第332回利付国債 (10年)	695,000,000	104.23	724,440,200	103.74	721,006,900	0.600	2023/12/20	0.66
日本	特殊債券	第3回政府保証地方 公共団体金融機構債 券	700,000,000	103.27	722,953,000	102.36	716,576,000	1.500	2019/8/16	0.66
日本	国債証券	第341回利付国債 (10年)	700,000,000	102.46	717,220,000	102.16	715,141,000	0.300	2025/12/20	0.66

## □ 種類別の投資比率

2018年 1月30日現在

種類	投資比率(%)
国債証券	77.25
地方債証券	8.00
特殊債券	9.32
社債券	4.16
合計	98.72

## 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

2018年 1月31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	3,066,243,517	3.3811	10,367,275,956	3.5253	10,809,428,270	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。

## ロ 種類別の投資比率

2018年 1月31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)

2018年 1月31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	232,651	18,437.72	4,289,556,136	18,164.66	4,226,027,779	2.16
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	329,612	9,066.55	2,988,446,513	10,089.18	3,325,516,314	1.70
アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	小売	18,407	126,334.56	2,325,440,307	156,420.43	2,879,230,999	1.47
アメリカ	株式	FACEBOOK INC-A	ソフトウェア・サービス	106,853	19,052.39	2,035,805,317	20,356.78	2,175,183,526	1.11
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	158,633	11,284.78	1,790,139,568	12,522.81	1,986,532,013	1.02
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	120,993	15,209.92	1,840,295,048	15,494.95	1,874,781,659	0.96
アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORPORATION	エネルギー	191,007	8,950.15	1,709,541,932	9,440.79	1,803,258,160	0.92
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	ソフトウェア・サービス	14,077	111,146.39	1,564,607,752	126,597.83	1,782,117,725	0.91

アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	ソフトウェア・サービス	13,436	112,856.57	1,516,340,877	128,086.08	1,720,964,602	0.88
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	450,935	3,075.49	1,386,847,572	3,468.22	1,563,944,131	0.80
アメリカ	株式	WELLS FARGO & COMPANY	銀行	212,044	6,166.21	1,307,509,360	7,101.81	1,505,896,454	0.77
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	各種金融	56,954	20,657.04	1,176,501,353	23,325.66	1,328,489,862	0.68
スイス	株式	NESTLE SA-REGISTERED	食品・飲料・タバコ	139,895	9,889.87	1,383,544,623	9,367.15	1,310,417,897	0.67
アメリカ	株式	HOME DEPOT INC	小売	53,140	19,283.02	1,024,700,081	21,954.90	1,166,683,912	0.60
アメリカ	株式	CHEVRON CORPORATION	エネルギー	85,426	12,748.01	1,089,011,690	13,623.77	1,163,824,321	0.60
アメリカ	株式	INTEL CORP	半導体・半導体製造装置	211,829	4,781.32	1,012,822,340	5,307.86	1,124,359,544	0.58
アメリカ	株式	AT&T INC	電気通信サービス	275,859	3,968.65	1,094,790,358	4,073.09	1,123,600,631	0.58
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	43,434	24,247.11	1,053,149,201	25,745.15	1,118,214,997	0.57
アメリカ	株式	VISA INC	ソフトウェア・サービス	82,467	11,951.66	985,618,320	13,441.00	1,108,439,318	0.57
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	268,103	3,939.28	1,056,134,368	4,112.26	1,102,509,779	0.56
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	114,952	9,723.65	1,117,753,038	9,459.29	1,087,364,362	0.56
アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS INC	電気通信サービス	183,631	5,428.62	996,863,103	5,863.78	1,076,771,969	0.55
イギリス	株式	HSBC HOLDINGS PLC	銀行	903,181	1,143.99	1,033,236,445	1,171.09	1,057,711,493	0.54
アメリカ	株式	CITIGROUP INC	銀行	122,372	8,163.60	998,996,255	8,553.06	1,046,656,258	0.54
アメリカ	株式	CISCO SYSTEMS INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	225,400	4,077.44	919,057,049	4,596.37	1,036,023,488	0.53
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	99,875	9,744.35	973,217,356	10,016.77	1,000,425,583	0.51
アメリカ	株式	COMCAST CORP-CLASS A	メディア	212,051	4,045.90	857,937,162	4,606.16	976,742,658	0.50

アメリカ	株式	COCA-COLA CO/THE	食品・飲料・タバコ	182,664	4,949.94	904,176,753	5,157.73	942,132,305	0.48
アメリカ	株式	BOEING CO	資本財	25,233	29,297.14	739,254,910	36,739.47	927,047,069	0.47
アメリカ	株式	ABBVIE INC	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	71,861	10,424.25	749,097,590	12,606.58	905,921,819	0.46

□ 種類別・業種別の投資比率

2018年 1月31日現在

種類	国内 / 外国	業種	投資比率 (%)
株式	外国	エネルギー	6.46
		素材	5.00
		資本財	7.34
		商業・専門サービス	0.95
		運輸	1.92
		自動車・自動車部品	1.59
		耐久消費財・アパレル	1.75
		消費者サービス	1.78
		メディア	2.36
		小売	4.21
		食品・生活必需品小売り	1.71
		食品・飲料・タバコ	5.44
		家庭用品・パーソナル用品	1.50
		ヘルスケア機器・サービス	3.90
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	7.92
		銀行	9.47
		各種金融	4.63
		保険	4.11
		不動産	0.81
		ソフトウェア・サービス	10.11
テクノロジー・ハードウェアおよび機器	4.29		
電気通信サービス	2.50		
公益事業	2.83		
半導体・半導体製造装置	2.55		
投資証券			2.11
合計			97.25



## S M A M ・ 年金外国債券パッシブ・ファンド &lt; 適格機関投資家限定 &gt;

## イ 主要投資銘柄

2018年 1月31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	2,145,583,796	1.7922	3,845,315,280	1.7545	3,764,426,770	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

2018年 1月31日現在

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

## 外国債券パッシブ・マザーファンド

## イ 主要投資銘柄 (上位30銘柄)

2018年 1月31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	10,945.29	875,623,512	10,703.06	856,245,298	2.375	2024/8/15	0.45
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.125	7,900,000	10,772.75	851,048,025	10,531.38	831,979,178	2.125	2024/9/30	0.44
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 3	5,000,000	15,473.00	773,650,438	15,227.83	761,391,928	3.000	2022/4/25	0.40
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.5	7,000,000	11,031.98	772,239,016	10,799.10	755,937,514	2.500	2024/5/15	0.40
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 4.25	4,500,000	16,978.47	764,031,391	16,595.65	746,804,639	4.250	2023/10/25	0.39
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 4.5	3,500,000	22,246.32	778,621,382	21,277.93	744,727,784	4.500	2041/4/25	0.39
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.25	7,000,000	10,825.69	757,798,503	10,539.03	737,732,188	2.250	2025/11/15	0.39
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.25	7,000,000	10,782.95	754,807,122	10,465.93	732,615,658	2.250	2027/2/15	0.39
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 3.75	5,000,000	14,624.03	731,201,548	14,510.69	725,534,942	3.750	2019/10/25	0.38
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 2.75	4,500,000	16,430.72	739,382,668	15,913.09	716,089,473	2.750	2027/10/25	0.38
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.25	6,600,000	10,772.75	711,002,149	10,444.68	689,349,539	2.250	2027/8/15	0.36
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.75	6,200,000	11,204.52	694,680,248	10,976.74	680,557,946	2.750	2023/11/15	0.36
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 5.75	3,100,000	22,646.02	702,026,835	21,820.68	676,441,332	5.750	2032/10/25	0.36
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 1.75	4,600,000	15,075.46	693,471,543	14,700.62	676,228,581	1.750	2024/11/25	0.36

アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 3.625	6,000,000	11,285.26	677,115,760	11,201.12	672,067,227	3.625	2020/2/15	0.35
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.25	6,300,000	10,857.75	684,038,376	10,604.47	668,081,942	2.250	2024/11/15	0.35
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 3.5	4,000,000	17,164.88	686,595,430	16,667.65	666,706,251	3.500	2026/4/25	0.35
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 3.25	4,300,000	15,419.11	663,021,809	15,208.25	653,954,834	3.250	2021/10/25	0.34
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2	6,300,000	10,644.42	670,598,558	10,372.44	653,464,133	2.000	2025/8/15	0.34
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 1.5	6,600,000	10,160.98	670,625,076	9,872.69	651,597,705	1.500	2026/8/15	0.34
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 3.625	5,300,000	12,814.37	679,161,827	12,173.43	645,191,846	3.625	2043/8/15	0.34
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 4.75	3,100,000	21,508.78	666,772,440	20,668.18	640,713,752	4.750	2035/4/25	0.34
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2	6,200,000	10,573.87	655,580,442	10,266.20	636,504,795	2.000	2026/11/15	0.34
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.375	6,000,000	10,895.14	653,708,915	10,567.07	634,024,724	2.375	2027/5/15	0.33
イタリア	国債証券	BTPS 6.5	3,360,000	19,263.21	647,244,141	18,846.22	633,233,211	6.500	2027/11/1	0.33
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 1.625	6,300,000	10,287.45	648,109,626	10,003.58	630,225,569	1.625	2026/5/15	0.33
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 4.25	4,400,000	14,414.92	634,256,794	14,310.64	629,668,396	4.250	2019/4/25	0.33
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.125	6,000,000	10,749.81	644,988,712	10,484.63	629,078,175	2.125	2025/5/15	0.33
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 3.625	5,000,000	12,832.12	641,606,023	12,187.87	609,393,984	3.625	2044/2/15	0.32
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 3.125	5,400,000	11,805.41	637,492,401	11,190.92	604,309,754	3.125	2044/8/15	0.32

## ロ 種類別の投資比率

2018年 1月31日現在

種類	投資比率（％）
国債証券	98.35
合計	98.35

## S M A M ・ マネーインカムファンド < 適格機関投資家限定 >

### イ 主要投資銘柄

2018年 1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	マネーインカム・マザーファンド	601,292,780	1.0108	607,786,743	1.0109	607,846,871	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

2018年 1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

## マネーインカム・マザーファンド

## イ 主要投資銘柄

2018年 1月30日現在

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	利率 (％)	償還期限	投資 比率 (％)
日本	特殊債券	第67回政府保証日本 高速道路保有・債 務返済機構債券	300,000,000	101.50	304,503,000	101.22	303,672,000	1.600	2018/10/31	11.43
日本	特殊債券	第71回政府保証日本 高速道路保有・債 務返済機構債券	201,000,000	101.53	204,079,320	101.28	203,590,890	1.400	2018/12/25	7.66
日本	特殊債券	第69回政府保証日本 高速道路保有・債 務返済機構債券	200,000,000	101.80	203,615,000	101.34	202,696,000	1.600	2018/11/28	7.63
日本	特殊債券	第4回政府保証地方 公営企業等金融機構 債券	200,000,000	101.42	202,857,000	101.30	202,604,000	1.300	2019/1/22	7.62
日本	特殊債券	第5回政府保証地方 公営企業等金融機構 債券	100,000,000	101.61	101,612,000	101.40	101,402,000	1.300	2019/2/18	3.82
日本	特殊債券	第24回政府保証中 日本高速道路債券	100,000,000	101.34	101,346,000	101.30	101,302,000	1.300	2019/1/22	3.81
日本	特殊債券	第23回政府保証中 日本高速道路債券	100,000,000	101.20	101,205,000	100.95	100,951,000	1.500	2018/9/14	3.80
日本	特殊債券	第64回政府保証日本 高速道路保有・債 務返済機構債券	100,000,000	101.62	101,624,000	100.94	100,942,000	1.600	2018/8/29	3.80
日本	特殊債券	第62回政府保証日本 高速道路保有・債 務返済機構債券	100,000,000	101.53	101,538,000	100.86	100,862,000	1.700	2018/7/31	3.79
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	100.75	100,751,000	1.800	2018/6/29	3.79
日本	特殊債券	第885回政府保証 公営企業債券	100,000,000	101.24	101,249,000	100.53	100,530,000	1.700	2018/5/22	3.78
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	100.31	100,313,000	1.400	2018/4/20	3.77
日本	特殊債券	第883回政府保証 公営企業債券	100,000,000	100.78	100,780,000	100.18	100,187,000	1.400	2018/3/19	3.77
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	100.08	100,089,000	1.600	2018/2/19	3.77

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

2018年 1月30日現在

種類	投資比率（％）
特殊債券	72.24
合計	72.24

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）

2018年 1月30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	95	日本円	1,808,502,600	1,762,725,000	0.90

(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&lt;適格機関投資家限定&gt;

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

2018年 1月31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 1803	買建	236	米ドル	32,873,145.5	3,576,269,499	33,329,100	3,625,872,789	1.85
	ドイツ	ユーレック ス・ドイツ 金融先物取 引所	DJ EUR 1803	買建	205	ユーロ	7,387,520	997,906,202	7,386,150	997,721,142	0.51
	オース トラリ ア	シドニー先 物取引所	SPI200 1803	買建	20	オースト ラリアド ル	3,003,290	263,658,829	2,980,000	261,614,200	0.13
	イギリ ス	ロンドン国 際金融先物 オプション 取引所	FTSE 1803	買建	32	英ポンド	2,459,414	378,675,974	2,413,600	371,621,992	0.19

(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。

2018年 1月31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	900,000.00	97,902,000	97,893,000	0.05
	カナダドル	売建	70,000.00	6,177,500	6,173,300	0.00
	ユーロ	売建	170,000.00	22,967,000	22,963,600	0.01
	英ポンド	売建	120,000.00	18,481,200	18,475,200	0.00
	スイスフラン	売建	50,000.00	5,821,500	5,821,000	0.00
	スウェーデンクローナ	売建	110,000.00	1,518,000	1,518,000	0.00
	ノルウェークローネ	売建	40,000.00	564,000	563,600	0.00
	デンマーククローネ	売建	50,000.00	907,500	907,500	0.00
	オーストラリアドル	売建	40,000.00	3,509,200	3,510,800	0.00
	香港ドル	売建	160,000.00	2,225,600	2,224,000	0.00
	シンガポールドル	売建	30,000.00	2,487,000	2,488,500	0.00

(注) 日本における対顧客先物相場の仲値で評価しております。

#### 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。

## 参考情報

基準日:2018年1月31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

## ▶&lt;2010&gt;



## 分配の推移

決算期	分配金
2017年12月	0円
2016年12月	0円
2015年12月	0円
2014年12月	0円
2013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。

## ▶&lt;2020&gt;



決算期	分配金
2017年12月	0円
2016年12月	0円
2015年12月	0円
2014年12月	0円
2013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。

## ▶&lt;2030&gt;



決算期	分配金
2017年12月	0円
2016年12月	0円
2015年12月	0円
2014年12月	0円
2013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。

## ▶&lt;2040&gt;



※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
2017年12月	0円
2016年12月	0円
2015年12月	0円
2014年12月	0円
2013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。

## 主要な資産の状況

## ▶&lt;2010&gt;

## 資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
投資信託受益証券	日本	99.78
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		0.22
合計(純資産総額)		100.00

## 主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	比率(%)
日本	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>	50.07
日本	投資信託受益証券	SMAM・年金国内債券パッシブファンド <適格機関投資家限定>	35.00
日本	投資信託受益証券	SMAM・年金外国債券パッシブ・ファンド <適格機関投資家限定>	4.93
日本	投資信託受益証券	SMAM・外国株式パッシブ・ファンド (適格機関投資家専用)	4.90
日本	投資信託受益証券	SMAM・国内株式パッシブ・ファンド (適格機関投資家専用)	4.87

※比率は、ファンドの純資産総額に対する時価の比率です。

※「主要投資銘柄(上位10銘柄)」は組入る有価証券が10銘柄に満たない場合はすべてを記載しています。

## ▶&lt;2020&gt;

## 資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
投資信託受益証券	日本	99.94
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		0.06
合計(純資産総額)		100.00

## 主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	比率(%)
日本	投資信託受益証券	SMAM・年金国内債券パッシブファンド 〈適格機関投資家限定〉	59.21
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〉	17.07
日本	投資信託受益証券	SMAM・年金外国債券パッシブ・ファンド 〈適格機関投資家限定〉	9.88
日本	投資信託受益証券	SMAM・国内株式パッシブ・ファンド (適格機関投資家専用)	7.89
日本	投資信託受益証券	SMAM・外国株式パッシブ・ファンド (適格機関投資家専用)	5.89

## ▶&lt;2030&gt;

## 資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
投資信託受益証券	日本	99.90
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		0.10
合計(純資産総額)		100.00

## 主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	比率(%)
日本	投資信託受益証券	SMAM・年金国内債券パッシブファンド 〈適格機関投資家限定〉	52.36
日本	投資信託受益証券	SMAM・国内株式パッシブ・ファンド (適格機関投資家専用)	20.70
日本	投資信託受益証券	SMAM・外国株式パッシブ・ファンド (適格機関投資家専用)	12.93
日本	投資信託受益証券	SMAM・年金外国債券パッシブ・ファンド 〈適格機関投資家限定〉	11.89
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〉	2.01

## ▶&lt;2040&gt;

## 資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
投資信託受益証券	日本	99.94
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		0.06
合計(純資産総額)		100.00

## 主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	比率(%)
日本	投資信託受益証券	SMAM・国内株式パッシブ・ファンド (適格機関投資家専用)	36.59
日本	投資信託受益証券	SMAM・年金国内債券パッシブファンド 〈適格機関投資家限定〉	34.38
日本	投資信託受益証券	SMAM・外国株式パッシブ・ファンド (適格機関投資家専用)	16.97
日本	投資信託受益証券	SMAM・年金外国債券パッシブ・ファンド 〈適格機関投資家限定〉	10.00
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〉	2.00

※比率は、各ファンドの純資産総額に対する時価の比率です。

※「主要投資銘柄(上位10銘柄)」は組入有価証券が10銘柄に満たない場合はすべてを記載しています。

## ▶投資対象とする投資信託の現況

■SMAM・国内株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用) (2018年1月30日現在)

### 主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	比率(%)
日本	親投資信託受益証券	国内株式インデックス・マザーファンド(B号)	100.01

「国内株式インデックス・マザーファンド(B号)」が投資している有価証券の上位10銘柄は以下の通りです。

国・地域	種類	銘柄名	業種	比率(%)
日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	3.46
日本	株式	三菱UFJフィナンシャルグループ	銀行業	2.18
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	1.50
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	1.39
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	1.38
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	1.32
日本	株式	ソニー	電気機器	1.29
日本	株式	キーエンス	電気機器	1.23
日本	株式	任天堂	その他製品	1.08
日本	株式	ファナック	電気機器	1.05

■SMAM・年金国内債券パッシブファンド<適格機関投資家限定> (2018年1月30日現在)

### 主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	比率(%)
日本	親投資信託受益証券	国内債券(NOMURA-BPI)マザーファンド	100.01

「国内債券(NOMURA-BPI)マザーファンド」が投資している有価証券の上位10銘柄は以下の通りです。

国・地域	種類	銘柄名	利率(%)	償還期限	比率(%)
日本	国債証券	第130回利付国債(5年)	0.100	2021/12/20	1.19
日本	国債証券	第127回利付国債(5年)	0.100	2021/03/20	1.18
日本	国債証券	第310回利付国債(10年)	1.000	2020/09/20	1.17
日本	国債証券	第125回利付国債(5年)	0.100	2020/09/20	1.13
日本	国債証券	第315回利付国債(10年)	1.200	2021/06/20	1.12
日本	国債証券	第306回利付国債(10年)	1.400	2020/03/20	1.10
日本	国債証券	第128回利付国債(5年)	0.100	2021/06/20	1.09
日本	国債証券	第317回利付国債(10年)	1.100	2021/09/20	1.05
日本	国債証券	第344回利付国債(10年)	0.100	2026/09/20	1.04
日本	国債証券	第343回利付国債(10年)	0.100	2026/06/20	1.03

※比率は、投資対象とする投資信託、当該投資信託のマザーファンドのそれぞれの純資産総額に対する時価の比率です。

※「主要投資銘柄(上位10銘柄)」は組入る有価証券が10銘柄に満たない場合はすべてを記載しています。



■SMAM・外国株式パッシブ・ファンド（適格機関投資家専用）（2018年1月31日現在）

主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	比率(%)
日本	親投資信託受益証券	外国株式インデックス・マザーファンド	99.97

「外国株式インデックス・マザーファンド」が投資している有価証券の上位10銘柄は以下の通りです。

国・地域	種類	銘柄名	業種	比率(%)
アメリカ	株式	APPLE INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	2.16
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	1.70
アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	小売	1.47
アメリカ	株式	FACEBOOK INC-A	ソフトウェア・サービス	1.11
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	1.02
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	0.96
アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORPORATION	エネルギー	0.92
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	ソフトウェア・サービス	0.91
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	ソフトウェア・サービス	0.88
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	0.80

■SMAM・年金外国債券パッシブ・ファンド<適格機関投資家限定>（2018年1月31日現在）

主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	比率(%)
日本	親投資信託受益証券	外国債券パッシブ・マザーファンド	100.01

「外国債券パッシブ・マザーファンド」が投資している有価証券の上位10銘柄は以下の通りです。

国・地域	種類	銘柄名	利率(%)	償還期限	比率(%)
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.375	2.375	2024/08/15	0.45
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.125	2.125	2024/09/30	0.44
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 3	3.000	2022/04/25	0.40
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.5	2.500	2024/05/15	0.40
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 4.25	4.250	2023/10/25	0.39
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 4.5	4.500	2041/04/25	0.39
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.25	2.250	2025/11/15	0.39
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.25	2.250	2027/02/15	0.39
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 3.75	3.750	2019/10/25	0.38
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 2.75	2.750	2027/10/25	0.38

※比率は、投資対象とする投資信託、当該投資信託のマザーファンドのそれぞれの純資産総額に対する時価の比率です。

※「主要投資銘柄(上位10銘柄)」は組入る有価証券が10銘柄に満たない場合はすべてを記載しています。

## ■SMAM・マネーインカムファンド<適格機関投資家限定>（2018年1月30日現在）

### 主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	比率(%)
日本	親投資信託受益証券	マネーインカム・マザーファンド	100.00

「マネーインカム・マザーファンド」が投資している有価証券の上位10銘柄は以下の通りです。

国・地域	種類	銘柄名	利率(%)	償還期限	比率(%)
日本	特殊債券	第67回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.600	2018/10/31	11.43
日本	特殊債券	第71回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.400	2018/12/25	7.66
日本	特殊債券	第69回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.600	2018/11/28	7.63
日本	特殊債券	第4回政府保証地方公営企業等金融機構債券	1.300	2019/01/22	7.62
日本	特殊債券	第5回政府保証地方公営企業等金融機構債券	1.300	2019/02/18	3.82
日本	特殊債券	第24回政府保証中日本高速道路債券	1.300	2019/01/22	3.81
日本	特殊債券	第23回政府保証中日本高速道路債券	1.500	2018/09/14	3.80
日本	特殊債券	第64回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.600	2018/08/29	3.80
日本	特殊債券	第62回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.700	2018/07/31	3.79
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	1.800	2018/06/29	3.79

※比率は、投資対象とする投資信託、当該投資信託のマザーファンドのそれぞれの純資産総額に対する時価の比率です。

※「主要投資銘柄(上位10銘柄)」は組入る有価証券が10銘柄に満たない場合はすべてを記載しています。

## 年間収益率の推移(暦年ベース)

### <2010>



### <2020>



※2018年のファンドの収益率は、年初から2018年1月31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。

## ▶&lt;2030&gt;



## ▶&lt;2040&gt;



※2018年のファンドの収益率は、年初から2018年1月31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	<a href="http://www.smam-jp.com">http://www.smam-jp.com</a>

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】

2001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ます。)に支払われます。  
ただし、分配金自動再投資コースにかかる収益分配金は、原則として、税金を差し引いた後、累積投資契約に基づいて、毎計算期間終了日の翌営業日に再投資され、再投資により増加した受益権は、振替口座簿に記載または記録されます。

#### (ロ) 償還金

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

#### 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、委託会社と合意の上、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。

#### ヘ 委託会社の事業の譲渡および承継に伴う取扱い

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

#### ト 公告

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

<http://www.sman-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、委託会社に対し、自己に帰属する受益権を、信託財産をもって買い取るべき旨の請求ができます。

## ホ 帳簿閲覧・謄写請求権

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

### 第3【ファンドの経理状況】

1. 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）ならびに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づいて作成しております。  
なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
2. 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第17期（平成28年12月21日から平成29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16期 (平成28年12月20日現在)	第17期 (平成29年12月20日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
金銭信託	64,497	125,328
コール・ローン	3,042,319	3,678,556
投資信託受益証券	551,247,305	525,808,626
未収入金	270,000	920,000
流動資産合計	554,624,121	530,532,510
資産合計	554,624,121	530,532,510
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払金	-	300,000
未払解約金	262,865	1,790,358
未払受託者報酬	117,486	115,911
未払委託者報酬	1,057,349	1,043,123
未払利息	7	10
その他未払費用	8,768	8,624
流動負債合計	1,446,475	3,258,026
負債合計	1,446,475	3,258,026
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	444,068,361	416,378,200
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	109,109,285	110,896,284
元本等合計	553,177,646	527,274,484
純資産合計	553,177,646	527,274,484
負債純資産合計	554,624,121	530,532,510

## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第16期 自 平成27年12月22日 至 平成28年12月20日	第17期 自 平成28年12月21日 至 平成29年12月20日
<b>営業収益</b>		
受取利息	40	-
有価証券売買等損益	7,450,559	11,131,321
営業収益合計	7,450,599	11,131,321
<b>営業費用</b>		
支払利息	1,630	1,564
受託者報酬	232,099	232,879
委託者報酬	2,088,807	2,095,807
その他費用	17,781	17,543
営業費用合計	2,340,317	2,347,793
営業利益又は営業損失（ ）	5,110,282	8,783,528
経常利益又は経常損失（ ）	5,110,282	8,783,528
当期純利益又は当期純損失（ ）	5,110,282	8,783,528
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（ ）	16,037	296,709
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	99,573,893	109,109,285
剰余金増加額又は欠損金減少額	16,967,844	6,543,377
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	16,967,844	6,543,377
剰余金減少額又は欠損金増加額	12,526,697	13,243,197
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	12,526,697	13,243,197
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（ ）	109,109,285	110,896,284

## （ 3 ）【注記表】

## （ 重要な会計方針の注記 ）

項 目	第17期 自 平成28年12月21日 至 平成29年12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>

## （ 貸借対照表に関する注記 ）

項 目	第16期 (平成28年12月20日現在)	第17期 (平成29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	444,068,361口	416,378,200口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.2457円 (10,000口当たりの純資産額 12,457円)	1口当たり純資産額 1.2663円 (10,000口当たりの純資産額 12,663円)

## （ 損益及び剰余金計算書に関する注記 ）

項 目	第16期 自 平成27年12月22日 至 平成28年12月20日	第17期 自 平成28年12月21日 至 平成29年12月20日
分配金の計算過程	<p>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）であります。分配を行っておりません。</p>	<p>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（8,486,936円）、収益調整金（67,303,293円）、および分配準備積立金（35,106,055円）より、分配対象収益は110,896,284円（1万口当たり2,663.33円）であります。分配を行っておりません。</p>

## （金融商品に関する注記）

## ・金融商品の状況に関する事項

項目	第17期 自 平成28年12月21日 至 平成29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>
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	第17期 (平成29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（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。	

## （有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

## 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

## 第17期（自 平成28年12月21日 至 平成29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	9,835,541円
合計	9,835,541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17期 自 平成28年12月21日 至 平成29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16期 (平成28年12月20日現在)	第17期 (平成29年12月20日現在)
	期首元本額	424,461,776円
期中追加設定元本額	73,067,241円	26,200,366円
期中一部解約元本額	53,460,656円	53,890,527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）	14,459,989	26,161,012	
	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）	9,775,895	26,277,605	
	S M A M ・ 年金外国債券パッシブ・ファンド＜適格機関投資家限定＞	14,680,657	26,043,485	
	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＞	143,158,322	184,216,128	
	S M A M ・ マネーインカムファンド＜適格機関投資家限定＞	261,151,758	263,110,396	
	合計	443,226,621	525,808,626	

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16期 （平成28年12月20日現在）	第17期 （平成29年12月20日現在）
<b>資産の部</b>		
流動資産		
金銭信託	142,862	289,263
コール・ローン	6,738,784	8,490,269
投資信託受益証券	1,346,885,111	1,402,764,356
未収入金	360,000	2,110,000
流動資産合計	1,354,126,757	1,413,653,888
資産合計	1,354,126,757	1,413,653,888
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払金	240,000	630,000
未払解約金	370,634	2,087,466
未払受託者報酬	279,024	298,663
未払委託者報酬	3,138,950	3,359,832
未払利息	16	23
その他未払費用	20,909	22,340
流動負債合計	4,049,533	6,398,324
負債合計	4,049,533	6,398,324
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	923,437,583	933,173,385
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	426,639,641	474,082,179
元本等合計	1,350,077,224	1,407,255,564
純資産合計	1,350,077,224	1,407,255,564
負債純資産合計	1,354,126,757	1,413,653,888

## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第16期 自 平成27年12月22日 至 平成28年12月20日	第17期 自 平成28年12月21日 至 平成29年12月20日
<b>営業収益</b>		
受取利息	103	-
有価証券売買等損益	28,128,455	49,519,245
営業収益合計	28,128,558	49,519,245
<b>営業費用</b>		
支払利息	3,770	3,562
受託者報酬	544,469	585,267
委託者報酬	6,125,189	6,584,049
その他費用	41,884	44,199
営業費用合計	6,715,312	7,217,077
営業利益又は営業損失（ ）	21,413,246	42,302,168
経常利益又は経常損失（ ）	21,413,246	42,302,168
当期純利益又は当期純損失（ ）	21,413,246	42,302,168
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（ ）	383,350	468,514
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	372,500,405	426,639,641
剰余金増加額又は欠損金減少額	57,514,298	42,834,537
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	57,514,298	42,834,537
剰余金減少額又は欠損金増加額	25,171,658	37,225,653
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	25,171,658	37,225,653
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（ ）	426,639,641	474,082,179

## ( 3 ) 【注記表】

## ( 重要な会計方針の注記 )

項 目	第17期 自 平成28年12月21日 至 平成29年12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>

## ( 貸借対照表に関する注記 )

項 目	第16期 (平成28年12月20日現在)	第17期 (平成29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	923,437,583口	933,173,385口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.4620円 (10,000口当たりの純資産額 14,620円)	1口当たり純資産額 1.5080円 (10,000口当たりの純資産額 15,080円)

## ( 損益及び剰余金計算書に関する注記 )

項 目	第16期 自 平成27年12月22日 至 平成28年12月20日	第17期 自 平成28年12月21日 至 平成29年12月20日
分配金の計算過程	<p>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）であります。分配を行っておりません。</p>	<p>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（41,833,781円）、収益調整金（335,299,167円）、および分配準備積立金（169,418,732円）より、分配対象収益は546,551,680円（1万口当たり5,856.89円）であります。分配を行っておりません。</p>

## （金融商品に関する注記）

## ・金融商品の状況に関する事項

項目	第17期 自平成28年12月21日 至平成29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>
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	第17期 (平成29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（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。	

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

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

第17期（自 平成28年12月21日 至 平成29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	45,711,721円
合計	45,711,721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17期 自 平成28年12月21日 至 平成29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16期 (平成28年12月20日現在)	第17期 (平成29年12月20日現在)
	期首元本額	847,471,022円
期中追加設定元本額	133,314,585円	90,276,024円
期中一部解約元本額	57,348,024円	80,540,222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）	77,686,014	140,549,536	
	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）	31,514,471	84,710,898	
	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＞	86,748,288	153,891,462	
	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＞	686,699,344	883,644,715	
	S M A M ・ マネーインカムファンド＜適格機関投資家限定＞	138,925,802	139,967,745	
	合計	1,021,573,919	1,402,764,356	

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16期 (平成28年12月20日現在)	第17期 (平成29年12月20日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
金銭信託	145,892	269,548
コール・ローン	6,881,698	7,911,608
投資信託受益証券	1,377,100,635	1,685,425,164
未収入金	220,000	2,660,000
流動資産合計	1,384,348,225	1,696,266,320
資産合計	1,384,348,225	1,696,266,320
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払金	-	320,000
未払解約金	1,207,106	3,191,849
未払受託者報酬	271,035	345,297
未払委託者報酬	3,049,011	3,884,504
未払利息	17	21
その他未払費用	20,320	25,846
流動負債合計	4,547,489	7,767,517
負債合計	4,547,489	7,767,517
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	892,182,725	1,022,593,212
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	487,618,011	665,905,591
元本等合計	1,379,800,736	1,688,498,803
純資産合計	1,379,800,736	1,688,498,803
負債純資産合計	1,384,348,225	1,696,266,320

## （ 2 ） 【 損益及び剰余金計算書 】

（ 単位：円 ）

	第16期 自 平成27年12月22日 至 平成28年12月20日	第17期 自 平成28年12月21日 至 平成29年12月20日
<b>営業収益</b>		
受取利息	69	-
有価証券売買等損益	40,097,684	110,604,529
営業収益合計	40,097,753	110,604,529
<b>営業費用</b>		
支払利息	4,107	5,093
受託者報酬	528,453	644,589
委託者報酬	5,944,939	7,251,525
その他費用	40,739	48,980
営業費用合計	6,518,238	7,950,187
営業利益又は営業損失（ ）	33,579,515	102,654,342
経常利益又は経常損失（ ）	33,579,515	102,654,342
当期純利益又は当期純損失（ ）	33,579,515	102,654,342
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（ ）	2,979,618	2,625,964
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	406,480,151	487,618,011
剰余金増加額又は欠損金減少額	75,616,971	122,003,774
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	75,616,971	122,003,774
剰余金減少額又は欠損金増加額	31,038,244	43,744,572
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	31,038,244	43,744,572
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（ ）	487,618,011	665,905,591



## （ 3 ）【注記表】

## （ 重要な会計方針の注記 ）

項 目	第17期 自 平成28年12月21日 至 平成29年12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>

## （ 貸借対照表に関する注記 ）

項 目	第16期 (平成28年12月20日現在)	第17期 (平成29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	892,182,725口	1,022,593,212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) 1.5465円 15,465円)	1口当たり純資産額 (10,000口当たりの純資産額) 1.6512円 16,512円)

## （ 損益及び剰余金計算書に関する注記 ）

項 目	第16期 自 平成27年12月22日 至 平成28年12月20日	第17期 自 平成28年12月21日 至 平成29年12月20日
分配金の計算過程	<p>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。</p>	<p>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（100,029,640円）、収益調整金（567,850,852円）、および分配準備積立金（169,198,889円）より、分配対象収益は837,079,381円（1万口当たり8,185.82円）ですが、分配を行っておりません。</p>

## （金融商品に関する注記）

## ・金融商品の状況に関する事項

項目	第17期 自 平成28年12月21日 至 平成29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>
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	第17期 (平成29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（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。	

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

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

第17期（自 平成28年12月21日 至 平成29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	106,059,684円
合計	106,059,684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17期 自 平成28年12月21日 至 平成29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16期 (平成28年12月20日現在)	第17期 (平成29年12月20日現在)
	期首元本額	790,633,233円
期中追加設定元本額	162,461,354円	210,104,041円
期中一部解約元本額	60,911,862円	79,693,554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）	215,010,926	388,997,767	
	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）	82,294,079	221,206,484	
	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＞	113,168,314	200,760,589	
	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＞	654,008,627	841,578,301	
	S M A M ・ マネーインカムファンド＜適格機関投資家限定＞	32,637,244	32,882,023	
	合計	1,097,119,190	1,685,425,164	

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16期 (平成28年12月20日現在)	第17期 (平成29年12月20日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
金銭信託	317,543	360,872
コール・ローン	14,978,413	10,592,107
投資信託受益証券	2,071,027,567	2,417,152,729
未収入金	9,250,000	16,630,000
流動資産合計	2,095,573,523	2,444,735,708
資産合計	2,095,573,523	2,444,735,708
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払金	4,500,000	70,000
未払解約金	9,871,375	16,585,482
未払受託者報酬	406,782	507,809
未払委託者報酬	4,576,241	5,712,765
未払利息	37	28
その他未払費用	30,556	38,037
流動負債合計	19,384,991	22,914,121
負債合計	19,384,991	22,914,121
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	1,284,776,252	1,357,113,281
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	791,412,280	1,064,708,306
元本等合計	2,076,188,532	2,421,821,587
純資産合計	2,076,188,532	2,421,821,587
負債純資産合計	2,095,573,523	2,444,735,708

## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第16期 自 平成27年12月22日 至 平成28年12月20日	第17期 自 平成28年12月21日 至 平成29年12月20日
<b>営業収益</b>		
受取利息	202	-
有価証券売買等損益	75,251,954	241,735,162
営業収益合計	75,252,156	241,735,162
<b>営業費用</b>		
支払利息	6,958	7,607
受託者報酬	792,508	963,215
委託者報酬	8,915,601	10,835,996
その他費用	61,286	73,100
営業費用合計	9,776,353	11,879,918
営業利益又は営業損失（ ）	65,475,803	229,855,244
経常利益又は経常損失（ ）	65,475,803	229,855,244
当期純利益又は当期純損失（ ）	65,475,803	229,855,244
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（ ）	9,604,398	13,865,873
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	670,283,682	791,412,280
剰余金増加額又は欠損金減少額	131,283,960	183,983,114
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	131,283,960	183,983,114
剰余金減少額又は欠損金増加額	85,235,563	126,676,459
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	85,235,563	126,676,459
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（ ）	791,412,280	1,064,708,306

## （ 3 ）【注記表】

## （重要な会計方針の注記）

項 目	第17期 自 平成28年12月21日 至 平成29年12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>

## （貸借対照表に関する注記）

項 目	第16期 （平成28年12月20日現在）	第17期 （平成29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	1,284,776,252口	1,357,113,281口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.6160円 (10,000口当たりの純資産額 16,160円)	1口当たり純資産額 1.7845円 (10,000口当たりの純資産額 17,845円)

## （損益及び剰余金計算書に関する注記）

項 目	第16期 自 平成27年12月22日 至 平成28年12月20日	第17期 自 平成28年12月21日 至 平成29年12月20日
分配金の計算過程	<p>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）であります。分配を行っておりません。</p>	<p>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（215,990,766円）、収益調整金（933,308,847円）、および分配準備積立金（174,575,584円）より、分配対象収益は1,323,875,197円（1万口当たり9,755.06円）であります。分配を行っておりません。</p>

## （金融商品に関する注記）

## ・金融商品の状況に関する事項

項目	第17期 自 平成28年12月21日 至 平成29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>
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	第17期 (平成29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（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。	

## （有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

## 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

## 第17期（自 平成28年12月21日 至 平成29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	226,305,839円
合計	226,305,839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17期 自 平成28年12月21日 至 平成29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16期 (平成28年12月20日現在)	第17期 (平成29年12月20日現在)
	期首元本額	1,167,240,058円
期中追加設定元本額	268,656,486円	276,886,193円
期中一部解約元本額	151,120,292円	204,549,164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)	521,592,644	943,665,411	
	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)	153,688,314	413,114,188	
	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>	135,741,005	240,804,542	
	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>	599,856,257	771,895,031	
	S M A M ・ マネーインカムファンド<適格機関投資家限定>	47,318,667	47,673,557	
合計		1,458,196,887	2,417,152,729	

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表  
該当事項はありません。

## （参考）

「三井住友・DC年金プラン・ファンド（ターゲット・イヤー型）2010」、「三井住友・DC年金プラン・ファンド（ターゲット・イヤー型）2020」、「三井住友・DC年金プラン・ファンド（ターゲット・イヤー型）2030」および「三井住友・DC年金プラン・ファンド（ターゲット・イヤー型）2040」は、「SMAM・国内株式パッシブ・ファンド（適格機関投資家専用）」、「SMAM・年金国内債券パッシブファンド＜適格機関投資家限定＞」、「SMAM・外国株式パッシブ・ファンド（適格機関投資家専用）」、「SMAM・年金外国債券パッシブ・ファンド＜適格機関投資家限定＞」および「SMAM・マネーインカムファンド＜適格機関投資家限定＞」投資信託受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「投資信託受益証券」はこれらの投資信託の受益証券です。

なお、以下に記載した状況は、監査の対象外です。

## SMAM・国内株式パッシブ・ファンド（適格機関投資家専用）

## 貸借対照表

（単位：円）

	（平成28年12月19日現在）	（平成29年12月19日現在）
<b>資産の部</b>		
流動資産		
金銭信託	1,645	9,006
コール・ローン	2,324	11,136
親投資信託受益証券	32,529,989,996	22,353,350,475
未収入金	247,759,995	91,499,992
流動資産合計	32,777,753,960	22,444,870,609
資産合計	32,777,753,960	22,444,870,609
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	247,759,995	91,499,992
未払受託者報酬	726,752	504,777
未払委託者報酬	635,901	441,677
その他未払費用	33,858	33,858
流動負債合計	249,156,506	92,480,304
負債合計	249,156,506	92,480,304
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	21,507,908,809	12,354,563,473
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	11,020,688,645	9,997,826,832
元本等合計	32,528,597,454	22,352,390,305
純資産合計	32,528,597,454	22,352,390,305
負債純資産合計	32,777,753,960	22,444,870,609

## 注記表

## （重要な会計方針の注記）

項 目	自 平成29年12月 1日 至 平成29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28年12月19日現在）	（平成29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	21,507,908,809口	12,354,563,473口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.5124円 (10,000口当たりの純資産額 15,124円)	1口当たり純資産額 1.8092円 (10,000口当たりの純資産額 18,092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29年12月 1日 至 平成29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29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29年12月 1日 至 平成29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28年12月19日現在)	(平成29年12月19日現在)
期首元本額	22,284,529,854円	12,642,159,522円
期中追加設定元本額	207,178円	7,454,259円
期中一部解約元本額	776,828,223円	295,050,308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）	8,101,388,256	22,353,350,475	
合計		8,101,388,256	22,353,350,475	

## 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28年12月19日現在）	（平成29年12月19日現在）
<b>資産の部</b>		
流動資産		
金銭信託	1,087,396,908	855,295,981
コール・ローン	1,535,898,591	1,057,646,672
株式	211,313,924,930	192,479,364,690
派生商品評価勘定	81,998,920	19,028,600
未収入金	35,545,560	-
未収配当金	21,019,390	20,524,236
流動資産合計	214,075,784,299	194,431,860,179
資産合計	214,075,784,299	194,431,860,179
<b>負債の部</b>		
流動負債		
派生商品評価勘定	88,640	-
前受金	82,055,000	19,115,000
未払金	10,990,000	4,000,000
未払解約金	628,285,493	465,836,391
未払利息	4,055	2,930
その他未払費用	25,245	298
流動負債合計	721,448,433	488,954,619
負債合計	721,448,433	488,954,619
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	92,573,739,391	70,289,619,191
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	120,780,596,475	123,653,286,369
元本等合計	213,354,335,866	193,942,905,560
純資産合計	213,354,335,866	193,942,905,560
負債純資産合計	214,075,784,299	194,431,860,179

## 注記表

## （重要な会計方針の注記）

項目	自 平成29年12月 1日 至 平成29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 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 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28年12月19日現在）	（平成29年12月19日現在）
1. 担保資産	<p>代用として、担保に供している資産は次の通りであります。</p> <p>株式 3,572,000,000円</p>	<p>代用として、担保に供している資産は次の通りであります。</p> <p>株式 3,597,000,000円</p>
2. 当計算期間の末日における受益権の総数	92,573,739,391口	70,289,619,191口
3. 1単位当たり純資産の額	<p>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)</p>	<p>1口当たり純資産額 2.7592円 (10,000口当たりの純資産額 27,592円)</p>



## （金融商品に関する注記）

## ・金融商品の状況に関する事項

項 目	自 平成29年12月 1日 至 平成29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す。デリバティブ取引は、価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。 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	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29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（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	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	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

(平成29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	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	1,430,171,400	-	1,449,200,000	19,028,600
	東証株価指数先物	1,430,171,400	-	1,449,200,000	19,028,600
合計		1,430,171,400	-	1,449,200,000	19,028,600

(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29年12月 1日

至 平成29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
SMAM・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(TOPIX)	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
SMAM・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
SMAM・バランスファンドVA安定成長型 < 適格機関投資家限定 >	10,583,112,934円
SMAM・バランスファンドVA25 < 適格機関投資家専用 >	5,882,038,609円
SMAM・バランスファンドVA37.5 < 適格機関投資家専用 >	3,492,466,402円
SMAM・バランスファンドVA50 < 適格機関投資家専用 >	12,937,715,486円
SMAM・バランスファンドVL30 < 適格機関投資家限定 >	71,943,091円
SMAM・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

（平成29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	70,854,907,568円
同期中における追加設定元本額	306,646,867円
同期中における一部解約元本額	871,935,244円
平成29年12月19日現在における元本の内訳	
三井住友・日本株式インデックス年金ファンド	9,676,304,803円
三井住友・DC年金バランス30（債券重点型）	600,486,139円
三井住友・DC年金バランス50（標準型）	2,937,217,581円
三井住友・DC年金バランス70（株式重点型）	2,156,540,102円
SMAM・グローバルバランスファンド（機動的資産配分型）	146,762,753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）	7,072,256円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2025（4資産タイプ）	21,737,956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）	56,441,195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）	61,994,231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）	34,583,133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）	94,966,318円
国内株式指数ファンド（TOPIX）	1,262,957,310円
三井住友・DCつみたてNISA・日本株インデックスファンド	3,690,380,701円
アセットアロケーション・ファンド（安定型）	548,727,701円
アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）	864,332,146円
アセットアロケーション・ファンド（成長型）	862,831,156円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2050	3,694,364円
三井住友・資産最適化ファンド（1安定重視型）	94,840円
三井住友・資産最適化ファンド（2やや安定型）	692,220円
三井住友・資産最適化ファンド（3バランス型）	3,487,601円
三井住友・資産最適化ファンド（4やや成長型）	11,817,760円
三井住友・資産最適化ファンド（5成長重視型）	16,414,139円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	1,033,149円
SMAM・国内株式パッシブ・ファンド（適格機関投資家専用）	8,101,388,256円
バランスファンドVA（安定運用型）<適格機関投資家限定>	33,724,963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>	3,520,857,711円
SMAM・バランスファンドVA25<適格機関投資家専用>	4,159,285,270円
SMAM・バランスファンドVA37.5<適格機関投資家専用>	2,681,966,323円
SMAM・バランスファンドVA50<適格機関投資家専用>	9,873,397,374円
SMAM・バランスファンドVL30<適格機関投資家限定>	59,777,193円
SMAM・バランスファンドVL50<適格機関投資家限定>	241,856,957円
世界6資産バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	1,596,008円
SMAM・バランスファンドVA75<適格機関投資家専用>	1,083,328,933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>	64,742,845円
SMAM・インデックス・バランスVA25<適格機関投資家専用>	405,784,462円
SMAM・インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用>	1,167,685,548円
SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用>	1,413,157,790円
SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>	3,463,405,708円
SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定>	85,304,164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）	1,511,993,306円
SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	74,496,003円
SMAM・バランスファンドVA20<適格機関投資家専用>	117,297,470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）	1,760,482,909円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>	113,589,050円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>	52,998,705円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用>	23,441,238円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>	225,505,581円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	409,221,892円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T<適格機関投資家専用>	171,998,769円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A2<適格機関投資家専用>	119,832,735円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A2<適格機関投資家専用>	60,244,872円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A2<適格機関投資家専用>	11,044,499円
SMAM・アセットバランスファンドVA30L2<適格機関投資家専用>	79,037,378円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L2<適格機関投資家専用>	1,044,312,649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）	209,231,222円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T2<適格機関投資家専用>	20,656,364円
SMAM・グローバルバランスファンド（標準型）VA<適格機関投資家限定>	1,882,837,250円
SMAM・グローバルバランスファンド（債券重視型）VA<適格機関投資家限定>	286,224,350円
SMAM・世界バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	1,772,189,307円
SMAM・世界バランスファンドVA2<適格機関投資家限定>	461,376,503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>	337,854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>	190,956,800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>	91,494,029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>	180,989,397円
合計	70,289,619,191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	3,500	4,065.00	14,227,500	
日本水産	94,600	619.00	58,557,400	
マルハニチロ	15,600	3,435.00	53,586,000	
カネコ種苗	4,100	1,722.00	7,060,200	
サカタのタネ	12,000	3,945.00	47,340,000	
ホクト	8,400	2,012.00	16,900,800	
住石ホールディングス	10,000	153.00	1,530,000	

日鉄鉱業	2,300	7,740.00	17,802,000	
三井松島産業	5,000	1,470.00	7,350,000	
国際石油開発帝石	405,000	1,321.50	535,207,500	
日本海洋掘削	3,200	2,102.00	6,726,400	
石油資源開発	13,200	2,767.00	36,524,400	
K & Oエナジーグループ	5,100	1,830.00	9,333,000	
ショーボンドホールディングス	7,700	7,920.00	60,984,000	
ミライト・ホールディングス	25,200	1,628.00	41,025,600	
タマホーム	9,900	754.00	7,464,600	
インベスターズクラウド	1,600	8,200.00	13,120,000	
ダイセキ環境ソリューション	3,600	1,385.00	4,986,000	
安藤・間	63,800	895.00	57,101,000	
東急建設	31,200	1,107.00	34,538,400	
コムシスホールディングス	29,200	3,305.00	96,506,000	
ミサワホーム	8,100	1,002.00	8,116,200	
ピーアールホールディングス	10,900	435.00	4,741,500	
高松コンストラクショングループ	5,300	3,015.00	15,979,500	
東建コーポレーション	3,000	13,180.00	39,540,000	
大成建設	84,500	5,650.00	477,425,000	
大林組	248,800	1,362.00	338,865,600	
清水建設	253,700	1,169.00	296,575,300	
飛島建設	87,000	160.00	13,920,000	
長谷工コーポレーション	96,600	1,792.00	173,107,200	
松井建設	11,300	960.00	10,848,000	
銭高組	1,400	6,150.00	8,610,000	
鹿島建設	365,000	1,066.00	389,090,000	
不動テトラ	71,700	183.00	13,121,100	
鉄建建設	5,100	3,290.00	16,779,000	
西松建設	19,200	3,175.00	60,960,000	
三井住友建設	60,000	626.00	37,560,000	
大豊建設	30,000	561.00	16,830,000	

前田建設工業	59,300	1,537.00	91,144,100	
ナカノフドー建設	8,600	611.00	5,254,600	
奥村組	13,700	4,565.00	62,540,500	
東鉄工業	9,700	3,690.00	35,793,000	
イチケン	2,000	2,356.00	4,712,000	
浅沼組	31,000	405.00	12,555,000	
戸田建設	97,000	874.00	84,778,000	
熊谷組	13,000	3,070.00	39,910,000	
青木あすなる建設	6,500	1,017.00	6,610,500	
北野建設	21,000	401.00	8,421,000	
三井ホーム	13,000	747.00	9,711,000	
矢作建設工業	12,600	977.00	12,310,200	
ピーエス三菱	11,600	925.00	10,730,000	
日本ハウスホールディングス	19,000	745.00	14,155,000	
大東建託	30,100	22,845.00	687,634,500	
新日本建設	10,400	972.00	10,108,800	
N I P P O	19,000	2,615.00	49,685,000	
東亜道路工業	2,000	4,310.00	8,620,000	
前田道路	26,000	2,603.00	67,678,000	
日本道路	2,500	6,460.00	16,150,000	
東亜建設工業	6,800	3,015.00	20,502,000	
若築建設	5,800	1,725.00	10,005,000	
東洋建設	26,400	671.00	17,714,400	
五洋建設	99,000	838.00	82,962,000	
世紀東急工業	13,900	610.00	8,479,000	
福田組	2,700	6,740.00	18,198,000	
住友林業	53,100	2,005.00	106,465,500	
日成ビルド工業	12,300	1,463.00	17,994,900	
ヤマダ・エスバイエルホーム	67,000	76.00	5,092,000	
大和ハウス工業	245,600	4,373.00	1,074,008,800	
ライト工業	16,000	1,300.00	20,800,000	

積水ハウス	270,800	2,020.00	547,016,000	
日特建設	10,400	718.00	7,467,200	
北陸電気工事	5,400	1,150.00	6,210,000	
ユアテック	13,500	953.00	12,865,500	
中電工	9,900	3,160.00	31,284,000	
関電工	32,100	1,152.00	36,979,200	
きんでん	55,200	1,838.00	101,457,600	
東京エネシス	9,800	1,243.00	12,181,400	
トーエネック	2,800	3,325.00	9,310,000	
住友電設	6,700	2,364.00	15,838,800	
日本電設工業	12,600	2,364.00	29,786,400	
協和エクシオ	30,000	2,868.00	86,040,000	
新日本空調	7,500	1,492.00	11,190,000	
N D S	1,800	4,265.00	7,677,000	
九電工	16,400	5,280.00	86,592,000	
三機工業	17,400	1,327.00	23,089,800	
日揮	71,700	2,053.00	147,200,100	
中外炉工業	3,600	2,397.00	8,629,200	
ヤマト	9,200	832.00	7,654,400	
太平電業	5,700	2,783.00	15,863,100	
高砂熱学工業	22,600	2,059.00	46,533,400	
朝日工業社	2,300	3,450.00	7,935,000	
明星工業	16,300	795.00	12,958,500	
大気社	10,800	3,640.00	39,312,000	
ダイダン	5,600	2,900.00	16,240,000	
日比谷総合設備	9,400	2,333.00	21,930,200	
東芝プラントシステム	17,900	2,142.00	38,341,800	
O S J Bホールディングス	38,800	343.00	13,308,400	
東洋エンジニアリング	10,200	1,241.00	12,658,200	
千代田化工建設	54,000	755.00	40,770,000	
新興プランテック	16,800	1,171.00	19,672,800	



日本製粉	23,700	1,756.00	41,617,200	
日清製粉グループ本社	89,900	2,299.00	206,680,100	
日東富士製粉	1,500	4,830.00	7,245,000	
昭和産業	6,600	2,891.00	19,080,600	
鳥越製粉	9,400	1,008.00	9,475,200	
中部飼料	9,200	2,490.00	22,908,000	
フィード・ワン	50,800	263.00	13,360,400	
日本甜菜製糖	5,300	2,756.00	14,606,800	
三井製糖	5,800	4,740.00	27,492,000	
日新製糖	4,100	2,292.00	9,397,200	
森永製菓	17,600	5,800.00	102,080,000	
中村屋	2,600	5,000.00	13,000,000	
江崎グリコ	20,800	5,670.00	117,936,000	
名糖産業	5,300	1,583.00	8,389,900	
不二家	5,800	2,687.00	15,584,600	
山崎製パン	60,800	2,236.00	135,948,800	
モロゾフ	1,600	7,610.00	12,176,000	
亀田製菓	4,600	4,900.00	22,540,000	
寿スピリッツ	7,100	6,090.00	43,239,000	
カルビー	34,100	3,695.00	125,999,500	
森永乳業	15,000	4,750.00	71,250,000	
六甲バター	4,200	2,903.00	12,192,600	
ヤクルト本社	44,500	8,440.00	375,580,000	
明治ホールディングス	49,000	9,990.00	489,510,000	
雪印メグミルク	18,200	3,260.00	59,332,000	
プリマハム	51,000	822.00	41,922,000	
日本ハム	64,000	2,779.00	177,856,000	
丸大食品	39,000	500.00	19,500,000	
S Foods	5,100	5,000.00	25,500,000	
伊藤ハム米久ホールディングス	42,100	1,058.00	44,541,800	
サッポロホールディングス	27,300	3,560.00	97,188,000	

アサヒグループホールディングス	156,100	5,740.00	896,014,000	
キリンホールディングス	358,100	2,895.00	1,036,699,500	
宝ホールディングス	60,700	1,314.00	79,759,800	
オエノンホールディングス	28,900	376.00	10,866,400	
養命酒製造	3,500	2,542.00	8,897,000	
コカ・コーラボトラーズジャパン	52,000	4,280.00	222,560,000	
サントリー食品インターナショナル	56,500	5,180.00	292,670,000	
ダイドーグループホールディングス	3,800	5,810.00	22,078,000	
伊藤園	24,800	4,550.00	112,840,000	
キーコーヒー	7,500	2,132.00	15,990,000	
日清オイリオグループ	8,600	3,510.00	30,186,000	
不二製油グループ本社	20,400	3,305.00	67,422,000	
かどや製油	1,100	6,630.00	7,293,000	
J - オイルミルズ	3,900	3,935.00	15,346,500	
キッコーマン	57,600	4,550.00	262,080,000	
味の素	171,500	2,111.00	362,036,500	
キューピー	42,500	3,025.00	128,562,500	
ハウス食品グループ本社	28,400	3,815.00	108,346,000	
カゴメ	30,000	4,285.00	128,550,000	
焼津水産化学工業	7,800	1,232.00	9,609,600	
アリアケジャパン	6,600	9,770.00	64,482,000	
ニチレイ	35,400	3,160.00	111,864,000	
東洋水産	40,700	4,880.00	198,616,000	
日清食品ホールディングス	32,300	8,210.00	265,183,000	
永谷園ホールディングス	10,000	1,399.00	13,990,000	
一正蒲鉾	4,600	1,284.00	5,906,400	
フジッコ	8,200	2,488.00	20,401,600	
ロック・フィールド	8,000	2,045.00	16,360,000	
日本たばこ産業	461,100	3,702.00	1,706,992,200	
ケンコーマヨネーズ	5,000	3,760.00	18,800,000	
わらべや日洋ホールディングス	5,000	3,165.00	15,825,000	

なとり	5,300	2,036.00	10,790,800	
北の達人コーポレーション	7,700	1,171.00	9,016,700	
ユーグレナ	29,200	1,034.00	30,192,800	
ミヨシ油脂	4,900	1,547.00	7,580,300	
理研ビタミン	3,100	4,570.00	14,167,000	
片倉工業	10,800	1,440.00	15,552,000	
グンゼ	5,800	5,930.00	34,394,000	
東洋紡	29,600	2,060.00	60,976,000	
ユニチカ	22,200	824.00	18,292,800	
富士紡ホールディングス	4,400	3,710.00	16,324,000	
倉敷紡績	79,000	360.00	28,440,000	
シキボウ	5,700	1,417.00	8,076,900	
日本毛織	22,500	1,070.00	24,075,000	
帝国繊維	8,600	2,209.00	18,997,400	
帝人	63,500	2,472.00	156,972,000	
東レ	565,100	1,084.00	612,568,400	
サカイオーベックス	2,700	2,762.00	7,457,400	
住江織物	2,700	3,080.00	8,316,000	
アツギ	7,900	1,314.00	10,380,600	
ダイニック	4,000	1,137.00	4,548,000	
セーレン	17,900	2,125.00	38,037,500	
小松精練	12,600	931.00	11,730,600	
ワコールホールディングス	21,900	3,565.00	78,073,500	
ホギメディカル	4,900	8,560.00	41,944,000	
レナウン	26,700	187.00	4,992,900	
T S Iホールディングス	29,600	829.00	24,538,400	
三陽商会	4,900	2,141.00	10,490,900	
オンワードホールディングス	48,000	954.00	45,792,000	
ルック	16,000	388.00	6,208,000	
ゴールドウイン	2,300	8,590.00	19,757,000	
デザート	17,800	1,911.00	34,015,800	

特種東海製紙	4,700	4,085.00	19,199,500	
王子ホールディングス	326,000	751.00	244,826,000	
日本製紙	34,500	2,134.00	73,623,000	
三菱製紙	12,200	720.00	8,784,000	
北越紀州製紙	42,000	650.00	27,300,000	
中越パルプ工業	3,700	2,031.00	7,514,700	
巴川製紙所	17,000	294.00	4,998,000	
大王製紙	29,900	1,444.00	43,175,600	
レンゴー	75,000	805.00	60,375,000	
トーモク	5,300	2,145.00	11,368,500	
ザ・パックス	5,500	3,715.00	20,432,500	
クラレ	130,700	2,154.00	281,527,800	
旭化成	485,100	1,457.00	706,790,700	
共和レザー	6,300	1,025.00	6,457,500	
昭和電工	51,800	4,510.00	233,618,000	
住友化学	572,000	807.00	461,604,000	
住友精化	3,200	6,380.00	20,416,000	
日産化学工業	45,100	4,515.00	203,626,500	
ラサ工業	3,400	2,155.00	7,327,000	
クレハ	6,200	7,730.00	47,926,000	
テイカ	6,100	3,075.00	18,757,500	
石原産業	14,300	2,055.00	29,386,500	
日東エフシー	6,500	796.00	5,174,000	
日本曹達	52,000	736.00	38,272,000	
東ソー	112,100	2,563.00	287,312,300	
トクヤマ	22,700	3,440.00	78,088,000	
セントラル硝子	16,000	2,398.00	38,368,000	
東亜合成	46,000	1,424.00	65,504,000	
大阪ソーダ	7,000	2,861.00	20,027,000	
関東電化工業	18,600	1,330.00	24,738,000	
デンカ	28,600	4,355.00	124,553,000	

信越化学工業	129,500	11,795.00	1,527,452,500	
日本カーバイド工業	3,200	2,144.00	6,860,800	
堺化学工業	5,500	2,807.00	15,438,500	
エア・ウォーター	63,900	2,384.00	152,337,600	
大陽日酸	59,400	1,570.00	93,258,000	
日本化学工業	3,300	2,530.00	8,349,000	
日本パーカライズン	40,000	1,842.00	73,680,000	
高圧ガス工業	13,500	957.00	12,919,500	
チタン工業	1,200	2,623.00	3,147,600	
四国化成工業	11,300	1,789.00	20,215,700	
戸田工業	1,700	4,480.00	7,616,000	
ステラ ケミファ	4,200	3,795.00	15,939,000	
保土谷化学工業	2,600	6,300.00	16,380,000	
日本触媒	12,300	7,540.00	92,742,000	
大日精化工業	5,900	5,500.00	32,450,000	
カネカ	105,000	989.00	103,845,000	
三菱瓦斯化学	66,600	3,200.00	213,120,000	
三井化学	70,500	3,580.00	252,390,000	
J S R	78,100	2,237.00	174,709,700	
東京応化工業	13,700	4,935.00	67,609,500	
大阪有機化学工業	6,200	1,281.00	7,942,200	
三菱ケミカルホールディングス	520,400	1,235.00	642,694,000	
K Hネオケム	12,100	2,724.00	32,960,400	
ダイセル	105,200	1,277.00	134,340,400	
住友ベークライト	63,000	958.00	60,354,000	
積水化学工業	161,300	2,281.00	367,925,300	
日本ゼオン	65,900	1,622.00	106,889,800	
アイカ工業	21,800	4,120.00	89,816,000	
宇部興産	39,200	3,250.00	127,400,000	
積水樹脂	11,900	2,277.00	27,096,300	
タキロンシーアイ	17,000	768.00	13,056,000	

旭有機材	5,400	1,977.00	10,675,800	
日立化成	38,200	2,879.00	109,977,800	
ニチバン	4,200	2,977.00	12,503,400	
リケンテクノス	18,300	615.00	11,254,500	
大倉工業	19,000	692.00	13,148,000	
積水化成品工業	10,000	1,461.00	14,610,000	
群栄化学工業	2,300	3,780.00	8,694,000	
ミライアル	3,400	1,780.00	6,052,000	
ダイキョーニシカワ	15,300	1,807.00	27,647,100	
日本化薬	50,500	1,708.00	86,254,000	
カーリットホールディングス	8,900	1,123.00	9,994,700	
日本精化	8,000	1,124.00	8,992,000	
扶桑化学工業	5,500	3,280.00	18,040,000	
A D E K A	34,000	1,984.00	67,456,000	
日油	30,200	3,075.00	92,865,000	
新日本理化	12,100	280.00	3,388,000	
ハリマ化成グループ	8,000	912.00	7,296,000	
花王	182,600	7,711.00	1,408,028,600	
第一工業製薬	15,000	832.00	12,480,000	
三洋化成工業	4,800	5,930.00	28,464,000	
大日本塗料	9,400	1,855.00	17,437,000	
日本ペイントホールディングス	59,800	3,675.00	219,765,000	
関西ペイント	81,500	2,936.00	239,284,000	
中国塗料	22,800	948.00	21,614,400	
日本特殊塗料	5,200	2,154.00	11,200,800	
藤倉化成	12,300	711.00	8,745,300	
太陽ホールディングス	5,900	5,010.00	29,559,000	
D I C	30,600	4,305.00	131,733,000	
サカティンクス	15,700	1,780.00	27,946,000	
東洋インキS Cホールディングス	74,000	658.00	48,692,000	
T & K T O K A	6,500	1,477.00	9,600,500	

富士フィルムホールディングス	154,100	4,653.00	717,027,300	
資生堂	138,400	5,453.00	754,695,200	
ライオン	103,400	2,093.00	216,416,200	
高砂香料工業	4,900	3,475.00	17,027,500	
マングラム	14,100	3,690.00	52,029,000	
ミルボン	4,900	7,870.00	38,563,000	
ファンケル	17,900	3,210.00	57,459,000	
コーセー	12,500	17,230.00	215,375,000	
シーズ・ホールディングス	10,100	5,610.00	56,661,000	
ポーラ・オルビスホールディングス	31,700	4,115.00	130,445,500	
ノエビアホールディングス	4,700	8,190.00	38,493,000	
エステー	5,700	2,731.00	15,566,700	
アグロ カネショウ	3,700	1,881.00	6,959,700	
コニシ	12,200	2,033.00	24,802,600	
長谷川香料	9,800	2,315.00	22,687,000	
星光PMC	5,000	1,157.00	5,785,000	
小林製薬	20,700	7,450.00	154,215,000	
荒川化学工業	6,900	2,265.00	15,628,500	
メック	5,400	2,355.00	12,717,000	
日本高純度化学	2,700	2,602.00	7,025,400	
タカラバイオ	19,400	1,533.00	29,740,200	
JCU	4,600	5,370.00	24,702,000	
新田ゼラチン	7,400	784.00	5,801,600	
デクセリアルズ	19,500	1,407.00	27,436,500	
アース製薬	5,500	5,710.00	31,405,000	
北興化学工業	10,000	775.00	7,750,000	
大成ラミック	2,800	3,170.00	8,876,000	
クミアイ化学工業	33,600	756.00	25,401,600	
日本農薬	21,300	668.00	14,228,400	
アキレス	6,300	2,391.00	15,063,300	
有沢製作所	13,000	1,302.00	16,926,000	

日東電工	56,100	10,270.00	576,147,000	
レック	4,700	2,720.00	12,784,000	
きもと	19,000	338.00	6,422,000	
藤森工業	6,100	3,785.00	23,088,500	
前澤化成工業	5,700	1,240.00	7,068,000	
J S P	4,200	3,745.00	15,729,000	
エフピコ	6,000	6,020.00	36,120,000	
天馬	5,900	2,191.00	12,926,900	
信越ポリマー	15,200	1,227.00	18,650,400	
東リ	22,500	439.00	9,877,500	
ニフコ	13,600	7,580.00	103,088,000	
日本バルカー工業	6,200	3,120.00	19,344,000	
ユニ・チャーム	157,700	2,968.00	468,053,600	
協和発酵キリン	92,500	2,159.00	199,707,500	
武田薬品工業	273,500	6,334.00	1,732,349,000	
アステラス製薬	763,100	1,451.00	1,107,258,100	
大日本住友製薬	54,900	1,657.00	90,969,300	
塩野義製薬	106,300	6,286.00	668,201,800	
田辺三菱製薬	90,000	2,389.00	215,010,000	
あすか製薬	8,700	2,080.00	18,096,000	
日本新薬	19,400	8,230.00	159,662,000	
中外製薬	77,300	5,800.00	448,340,000	
科研製薬	13,500	5,950.00	80,325,000	
エーザイ	88,900	7,105.00	631,634,500	
ロート製薬	41,100	3,090.00	126,999,000	
小野薬品工業	190,300	2,668.00	507,720,400	
久光製薬	22,000	6,570.00	144,540,000	
持田製薬	5,300	8,380.00	44,414,000	
参天製薬	140,300	1,916.00	268,814,800	
扶桑薬品工業	3,500	2,904.00	10,164,000	
日本ケミファ	1,400	4,855.00	6,797,000	



ツムラ	26,700	3,725.00	99,457,500	
日医工	19,400	1,688.00	32,747,200	
キッセイ薬品工業	14,000	3,240.00	45,360,000	
生化学工業	14,700	1,650.00	24,255,000	
栄研化学	6,100	5,200.00	31,720,000	
鳥居薬品	4,700	2,948.00	13,855,600	
J C R ファーマ	5,300	5,030.00	26,659,000	
東和薬品	3,700	6,210.00	22,977,000	
富士製薬工業	2,800	4,260.00	11,928,000	
沢井製薬	13,300	5,000.00	66,500,000	
ゼリア新薬工業	16,000	2,197.00	35,152,000	
第一三共	212,500	2,925.00	621,562,500	
キョーリン製薬ホールディングス	21,000	2,144.00	45,024,000	
大幸薬品	4,400	2,332.00	10,260,800	
ダイト	5,200	3,345.00	17,394,000	
大塚ホールディングス	154,300	5,012.00	773,351,600	
大正製薬ホールディングス	16,500	8,970.00	148,005,000	
ペプチドリーム	30,700	3,945.00	121,111,500	
日本コークス工業	69,000	124.00	8,556,000	
昭和シェル石油	69,300	1,517.00	105,128,100	
ニチレキ	10,000	1,467.00	14,670,000	
ユシロ化学工業	4,500	1,674.00	7,533,000	
ビーピー・カストロール	3,500	2,162.00	7,567,000	
富士石油	19,500	598.00	11,661,000	
MORESCO	3,000	2,162.00	6,486,000	
出光興産	62,200	4,225.00	262,795,000	
J X T Gホールディングス	1,185,400	689.60	817,451,840	
コスモエネルギーホールディングス	20,700	3,775.00	78,142,500	
横浜ゴム	43,300	2,726.00	118,035,800	
東洋ゴム工業	44,400	2,313.00	102,697,200	
ブリヂストン	262,400	5,227.00	1,371,564,800	

住友ゴム工業	71,800	2,100.00	150,780,000	
藤倉ゴム工業	7,000	943.00	6,601,000	
オカモト	27,000	1,157.00	31,239,000	
ニッタ	7,600	4,310.00	32,756,000	
住友理工	14,800	1,206.00	17,848,800	
三ツ星ベルト	19,000	1,459.00	27,721,000	
バンドー化学	15,300	1,289.00	19,721,700	
日東紡績	11,300	3,220.00	36,386,000	
旭硝子	75,900	4,770.00	362,043,000	
日本板硝子	26,900	1,017.00	27,357,300	
日本山村硝子	47,000	189.00	8,883,000	
日本電気硝子	32,500	4,345.00	141,212,500	
オハラ	3,400	2,868.00	9,751,200	
住友大阪セメント	149,000	530.00	78,970,000	
太平洋セメント	46,900	4,875.00	228,637,500	
日本ヒューム	10,500	781.00	8,200,500	
日本コンクリート工業	20,600	469.00	9,661,400	
三谷セキサン	4,400	2,715.00	11,946,000	
アジアパイルホールディングス	12,300	716.00	8,806,800	
東海カーボン	67,500	1,290.00	87,075,000	
日本カーボン	4,100	4,600.00	18,860,000	
東洋炭素	5,100	3,285.00	16,753,500	
ノリタケカンパニーリミテド	4,700	5,710.00	26,837,000	
TOTO	57,200	6,440.00	368,368,000	
日本碍子	90,700	2,095.00	190,016,500	
日本特殊陶業	63,900	2,667.00	170,421,300	
MARUWA	2,700	7,910.00	21,357,000	
品川リフラクトリーズ	2,500	3,345.00	8,362,500	
黒崎播磨	1,900	4,765.00	9,053,500	
フジインコーポレーテッド	7,000	2,410.00	16,870,000	
ニチアス	41,000	1,439.00	58,999,000	

ニチ八	11,300	4,345.00	49,098,500	
新日鐵住金	328,600	2,798.50	919,587,100	
神戸製鋼所	134,700	1,047.00	141,030,900	
中山製鋼所	10,000	732.00	7,320,000	
合同製鐵	4,700	2,221.00	10,438,700	
ジェイ エフ イー ホールディングス	198,400	2,682.50	532,208,000	
日新製鋼	20,500	1,783.00	36,551,500	
東京製鐵	39,000	955.00	37,245,000	
共英製鋼	8,400	2,076.00	17,438,400	
大和工業	15,800	3,120.00	49,296,000	
東京鐵鋼	4,100	1,926.00	7,896,600	
大阪製鐵	5,100	2,255.00	11,500,500	
淀川製鋼所	10,500	3,375.00	35,437,500	
東洋鋼鈑	19,900	465.00	9,253,500	
丸一鋼管	26,200	3,240.00	84,888,000	
モリ工業	2,900	3,495.00	10,135,500	
大同特殊鋼	13,100	6,740.00	88,294,000	
日本冶金工業	63,700	229.00	14,587,300	
山陽特殊製鋼	8,500	2,841.00	24,148,500	
愛知製鋼	4,000	4,605.00	18,420,000	
日立金属	78,800	1,523.00	120,012,400	
日本金属	2,200	2,503.00	5,506,600	
大平洋金属	4,700	2,978.00	13,996,600	
新日本電工	44,800	465.00	20,832,000	
栗本鐵工所	4,400	2,235.00	9,834,000	
三菱製鋼	5,400	2,791.00	15,071,400	
日本精線	1,300	5,200.00	6,760,000	
シンニッタン	8,800	754.00	6,635,200	
大紀アルミニウム工業所	13,100	815.00	10,676,500	
日本輕金属ホールディングス	217,000	314.00	68,138,000	
三井金属鉱業	20,000	6,290.00	125,800,000	

東邦亜鉛	4,200	5,790.00	24,318,000	
三菱マテリアル	48,600	3,825.00	185,895,000	
住友金属鉱山	94,300	4,397.00	414,637,100	
D O W Aホールディングス	18,900	4,430.00	83,727,000	
古河機械金属	12,400	2,210.00	27,404,000	
大阪チタニウムテクノロジーズ	8,500	1,982.00	16,847,000	
東邦チタニウム	14,600	1,077.00	15,724,200	
U A C J	11,300	2,848.00	32,182,400	
古河電気工業	24,600	5,440.00	133,824,000	
住友電気工業	275,500	1,874.50	516,424,750	
フジクラ	89,900	984.00	88,461,600	
タツタ電線	16,100	859.00	13,829,900	
平河ヒューテック	5,000	1,297.00	6,485,000	
リョービ	9,300	3,145.00	29,248,500	
アーレスティ	10,600	899.00	9,529,400	
アサヒホールディングス	12,200	1,983.00	24,192,600	
稲葉製作所	5,100	1,438.00	7,333,800	
宮地エンジニアリンググループ	2,600	2,531.00	6,580,600	
トーカロ	5,200	4,740.00	24,648,000	
アルファC o	3,300	2,342.00	7,728,600	
S U M C O	67,700	2,908.00	196,871,600	
川田テクノロジーズ	1,600	6,010.00	9,616,000	
R S Technologies	1,300	5,720.00	7,436,000	
東洋製罐グループホールディングス	49,900	1,813.00	90,468,700	
ホッカンホールディングス	25,000	443.00	11,075,000	
コロナ	5,300	1,459.00	7,732,700	
横河ブリッジホールディングス	13,800	2,511.00	34,651,800	
駒井ハルテック	2,700	2,572.00	6,944,400	
三和ホールディングス	70,500	1,513.00	106,666,500	
文化シャッター	22,200	1,066.00	23,665,200	
三協立山	10,600	1,642.00	17,405,200	

アルインコ	7,500	1,231.00	9,232,500	
LIXILグループ	107,900	2,967.00	320,139,300	
日本フィルコン	7,300	776.00	5,664,800	
ノーリツ	16,600	2,206.00	36,619,600	
長府製作所	8,300	2,637.00	21,887,100	
リンナイ	13,100	10,050.00	131,655,000	
日東精工	12,800	654.00	8,371,200	
岡部	16,100	1,088.00	17,516,800	
ジーテクト	8,300	2,273.00	18,865,900	
東プレ	13,400	3,245.00	43,483,000	
高周波熱錬	15,000	1,220.00	18,300,000	
東京製綱	6,300	1,620.00	10,206,000	
パイオラックス	10,800	3,225.00	34,830,000	
エイチワン	6,100	1,742.00	10,626,200	
日本発條	73,600	1,225.00	90,160,000	
三益半導体工業	6,800	2,018.00	13,722,400	
日本製鋼所	24,300	3,450.00	83,835,000	
三浦工業	32,100	2,809.00	90,168,900	
タクマ	24,900	1,578.00	39,292,200	
ツガミ	20,000	1,392.00	27,840,000	
オークマ	8,600	7,260.00	62,436,000	
東芝機械	41,000	808.00	33,128,000	
アマダホールディングス	112,500	1,509.00	169,762,500	
アイダエンジニアリング	18,600	1,348.00	25,072,800	
滝澤鉄工所	3,200	2,097.00	6,710,400	
富士機械製造	21,500	2,163.00	46,504,500	
牧野フライス製作所	35,000	1,118.00	39,130,000	
オーエスジー	33,800	2,316.00	78,280,800	
旭ダイヤモンド工業	22,000	1,279.00	28,138,000	
D M G 森精機	40,600	2,308.00	93,704,800	
ソディック	16,100	1,471.00	23,683,100	

ディスコ	9,900	25,990.00	257,301,000	
日東工器	5,100	2,853.00	14,550,300	
パンチ工業	3,500	2,720.00	9,520,000	
豊和工業	4,300	1,690.00	7,267,000	
OKK	4,400	1,270.00	5,588,000	
石川製作所	2,100	3,215.00	6,751,500	
東洋機械金属	6,800	903.00	6,140,400	
津田駒工業	27,000	197.00	5,319,000	
島精機製作所	9,200	7,220.00	66,424,000	
フリー	6,500	1,059.00	6,883,500	
ヤマシンフィルタ	10,500	1,287.00	13,513,500	
日阪製作所	12,600	1,228.00	15,472,800	
やまびこ	14,500	1,662.00	24,099,000	
平田機工	2,000	11,540.00	23,080,000	
ペガサスマシン製造	9,000	773.00	6,957,000	
ナブテスコ	40,300	4,270.00	172,081,000	
三井海洋開発	7,800	2,580.00	20,124,000	
レオン自動機	6,900	1,676.00	11,564,400	
S M C	23,300	45,700.00	1,064,810,000	
新川	7,800	1,159.00	9,040,200	
ホソカワミクロン	2,800	7,840.00	21,952,000	
ユニオンツール	3,400	4,305.00	14,637,000	
オイレス工業	9,600	2,221.00	21,321,600	
日精エー・エス・ピー機械	2,500	6,760.00	16,900,000	
サトーホールディングス	9,700	3,425.00	33,222,500	
技研製作所	3,900	2,969.00	11,579,100	
日精樹脂工業	7,000	1,661.00	11,627,000	
オカダアイヨン	2,700	2,048.00	5,529,600	
ワイエイシイホールディングス	3,900	1,078.00	4,204,200	
小松製作所	358,600	3,968.00	1,422,924,800	
住友重機械工業	42,300	4,775.00	201,982,500	

日立建機	34,400	3,930.00	135,192,000	
日工	3,000	2,318.00	6,954,000	
巴工業	4,100	2,115.00	8,671,500	
井関農機	7,500	2,799.00	20,992,500	
TOWA	6,200	2,169.00	13,447,800	
北川鉄工所	4,300	3,045.00	13,093,500	
ローツェ	3,800	2,640.00	10,032,000	
クボタ	400,500	2,128.50	852,464,250	
三菱化工機	3,000	2,295.00	6,885,000	
月島機械	15,000	1,309.00	19,635,000	
帝国電機製作所	7,000	1,596.00	11,172,000	
新東工業	17,900	1,432.00	25,632,800	
澁谷工業	6,600	4,305.00	28,413,000	
アイチ コーポレーション	13,100	838.00	10,977,800	
小森コーポレーション	18,700	1,520.00	28,424,000	
鶴見製作所	6,400	2,021.00	12,934,400	
住友精密工業	18,000	374.00	6,732,000	
酒井重工業	2,000	4,335.00	8,670,000	
荏原製作所	30,500	4,265.00	130,082,500	
西島製作所	9,300	1,166.00	10,843,800	
北越工業	9,300	1,230.00	11,439,000	
ダイキン工業	101,300	13,280.00	1,345,264,000	
オルガノ	3,300	3,320.00	10,956,000	
トーヨーカネツ	3,400	4,260.00	14,484,000	
栗田工業	40,200	3,715.00	149,343,000	
椿本チエイン	43,000	889.00	38,227,000	
大同工業	4,000	1,710.00	6,840,000	
アネスト岩田	13,500	1,200.00	16,200,000	
ダイフク	36,900	5,930.00	218,817,000	
加藤製作所	3,700	3,235.00	11,969,500	
タダノ	36,100	1,750.00	63,175,000	

フジテック	22,600	1,626.00	36,747,600	
C K D	20,400	2,366.00	48,266,400	
キトー	6,300	1,650.00	10,395,000	
平和	22,700	1,990.00	45,173,000	
理想科学工業	7,200	2,071.00	14,911,200	
S A N K Y O	18,900	3,530.00	66,717,000	
日本金銭機械	7,900	1,125.00	8,887,500	
マースエンジニアリング	4,900	2,439.00	11,951,100	
福島工業	4,600	4,960.00	22,816,000	
ダイコク電機	4,100	1,730.00	7,093,000	
竹内製作所	12,300	2,422.00	29,790,600	
アマノ	22,800	2,954.00	67,351,200	
J U K I	11,100	1,895.00	21,034,500	
サンデンホールディングス	9,200	2,179.00	20,046,800	
蛇の目ミシン工業	9,300	862.00	8,016,600	
マックス	11,600	1,559.00	18,084,400	
グローリー	22,400	4,360.00	97,664,000	
新晃工業	8,000	2,069.00	16,552,000	
大和冷機工業	12,000	1,363.00	16,356,000	
セガサミーホールディングス	73,800	1,394.00	102,877,200	
日本ピストンリング	3,800	2,230.00	8,474,000	
リケン	3,500	6,490.00	22,715,000	
T P R	8,200	3,735.00	30,627,000	
ツバキ・ナカシマ	7,500	2,578.00	19,335,000	
ホシザキ	23,400	10,000.00	234,000,000	
大豊工業	6,500	1,690.00	10,985,000	
日本精工	151,200	1,708.00	258,249,600	
N T N	170,800	542.00	92,573,600	
ジェイテクト	78,300	1,881.00	147,282,300	
不二越	71,000	725.00	51,475,000	
日本トムソン	25,000	746.00	18,650,000	



THK	46,200	4,120.00	190,344,000	
ユーシン精機	3,600	3,105.00	11,178,000	
イーグル工業	8,300	1,996.00	16,566,800	
日本ピラー工業	8,400	1,719.00	14,439,600	
キッツ	33,400	833.00	27,822,200	
マキタ	96,400	4,740.00	456,936,000	
日立造船	57,900	567.00	32,829,300	
三菱重工業	124,600	4,227.00	526,684,200	
IHI	57,100	3,755.00	214,410,500	
スター精密	12,000	1,861.00	22,332,000	
日清紡ホールディングス	45,700	1,536.00	70,195,200	
イビデン	45,800	1,707.00	78,180,600	
コニカミノルタ	173,100	1,070.00	185,217,000	
ブラザー工業	90,600	2,846.00	257,847,600	
ミネベアミツミ	137,500	2,409.00	331,237,500	
日立製作所	1,783,000	873.90	1,558,163,700	
三菱電機	742,200	1,868.50	1,386,800,700	
富士電機	223,000	830.00	185,090,000	
東洋電機製造	4,000	1,920.00	7,680,000	
安川電機	85,800	4,840.00	415,272,000	
シンフォニアテクノロジー	49,000	428.00	20,972,000	
明電舎	64,000	459.00	29,376,000	
オリジン電気	2,700	1,707.00	4,608,900	
山洋電気	3,600	7,930.00	28,548,000	
デンヨー	7,400	1,942.00	14,370,800	
東芝テック	52,000	707.00	36,764,000	
芝浦メカトロニクス	13,000	431.00	5,603,000	
マブチモーター	20,600	5,990.00	123,394,000	
日本電産	89,300	15,535.00	1,387,275,500	
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	3,100	2,701.00	8,373,100	
東光高岳	4,500	1,835.00	8,257,500	

ダブル・スコープ	11,200	2,190.00	24,528,000	
ダイヘン	40,000	1,020.00	40,800,000	
ヤーマン	9,900	1,932.00	19,126,800	
JVCケンウッド	56,000	375.00	21,000,000	
ミマキエンジニアリング	7,600	1,024.00	7,782,400	
第一精工	3,900	2,976.00	11,606,400	
日新電機	17,400	1,353.00	23,542,200	
大崎電気工業	16,800	831.00	13,960,800	
オムロン	78,600	6,640.00	521,904,000	
日東工業	11,100	1,785.00	19,813,500	
I D E C	9,600	2,475.00	23,760,000	
ジーエス・ユアサ コーポレーション	134,000	551.00	73,834,000	
サクサホールディングス	2,400	2,008.00	4,819,200	
メルコホールディングス	3,900	4,160.00	16,224,000	
日本電気	95,900	3,110.00	298,249,000	
富士通	763,000	814.90	621,768,700	
沖電気工業	30,500	1,605.00	48,952,500	
電気興業	4,900	3,130.00	15,337,000	
サンケン電気	44,000	693.00	30,492,000	
アイホン	5,200	1,932.00	10,046,400	
ルネサスエレクトロニクス	37,800	1,261.00	47,665,800	
セイコーエプソン	109,800	2,661.00	292,177,800	
ワコム	58,700	600.00	35,220,000	
アルバック	12,500	7,240.00	90,500,000	
E I Z O	6,800	5,620.00	38,216,000	
ジャパンディスプレイ	108,100	227.00	24,538,700	
日本信号	21,000	1,200.00	25,200,000	
京三製作所	20,000	684.00	13,680,000	
能美防災	9,400	2,002.00	18,818,800	
ホーチキ	5,600	2,422.00	13,563,200	
エレコム	6,700	2,598.00	17,406,600	

パナソニック	848,400	1,664.00	1,411,737,600	
アンリツ	54,700	1,224.00	66,952,800	
富士通ゼネラル	22,900	2,484.00	56,883,600	
日立国際電気	14,300	3,110.00	44,473,000	
ソニー	495,700	5,116.00	2,536,001,200	
T D K	38,700	8,810.00	340,947,000	
タムラ製作所	29,100	836.00	24,327,600	
アルプス電気	63,500	3,275.00	207,962,500	
池上通信機	34,000	175.00	5,950,000	
パイオニア	120,000	217.00	26,040,000	
日本電波工業	9,500	756.00	7,182,000	
日本トリム	1,900	5,040.00	9,576,000	
ローランド ディー . ジー .	4,200	3,125.00	13,125,000	
フォスター電機	8,900	2,810.00	25,009,000	
クラリオン	39,000	416.00	16,224,000	
S M K	21,000	567.00	11,907,000	
ヨコオ	5,700	1,510.00	8,607,000	
ホシデン	18,900	1,748.00	33,037,200	
ヒロセ電機	12,000	16,270.00	195,240,000	
日本航空電子工業	19,000	1,900.00	36,100,000	
T O A	8,700	1,450.00	12,615,000	
マクセルホールディングス	14,500	2,487.00	36,061,500	
古野電気	10,800	827.00	8,931,600	
ユニデンホールディングス	25,000	297.00	7,425,000	
アルパイン	18,000	2,344.00	42,192,000	
スミダコーポレーション	8,000	1,981.00	15,848,000	
アイコム	4,800	2,687.00	12,897,600	
リオン	3,600	2,281.00	8,211,600	
本多通信工業	6,400	1,099.00	7,033,600	
船井電機	9,200	863.00	7,939,600	
横河電機	74,300	2,161.00	160,562,300	

新電元工業	2,700	8,060.00	21,762,000	
アズビル	22,300	4,895.00	109,158,500	
日本光電工業	31,300	2,748.00	86,012,400	
チノー	4,000	1,773.00	7,092,000	
共和電業	13,000	463.00	6,019,000	
堀場製作所	14,800	6,840.00	101,232,000	
アドバンテスト	41,600	2,169.00	90,230,400	
エスベック	6,700	2,689.00	18,016,300	
キーエンス	36,400	64,160.00	2,335,424,000	
日置電機	4,700	2,921.00	13,728,700	
シスメックス	57,600	8,680.00	499,968,000	
日本マイクロニクス	13,200	1,159.00	15,298,800	
メガチップス	6,100	3,200.00	19,520,000	
OBARA GROUP	4,300	7,640.00	32,852,000	
澤藤電機	1,200	2,219.00	2,662,800	
コーセル	10,700	1,848.00	19,773,600	
イリソ電子工業	6,200	6,570.00	40,734,000	
新日本無線	5,500	981.00	5,395,500	
オブテックスグループ	6,200	5,660.00	35,092,000	
千代田インテグレ	3,900	2,849.00	11,111,100	
アイ・オー・データ機器	4,300	1,073.00	4,613,900	
レーザーテック	16,400	2,867.00	47,018,800	
スタンレー電気	56,700	4,660.00	264,222,000	
岩崎電気	3,500	1,650.00	5,775,000	
ウシオ電機	45,300	1,605.00	72,706,500	
ヘリオス テクノ ホールディング	7,200	1,036.00	7,459,200	
日本セラミック	7,700	2,843.00	21,891,100	
遠藤照明	5,300	1,237.00	6,556,100	
古河電池	5,900	1,163.00	6,861,700	
双信電機	3,700	765.00	2,830,500	
山一電機	5,600	2,027.00	11,351,200	

図研	5,500	1,885.00	10,367,500	
日本電子	28,000	616.00	17,248,000	
カシオ計算機	60,000	1,621.00	97,260,000	
ファナック	70,600	27,050.00	1,909,730,000	
日本シイエムケイ	13,800	994.00	13,717,200	
エンプラス	3,500	4,575.00	16,012,500	
大真空	3,700	1,671.00	6,182,700	
ローム	33,200	11,810.00	392,092,000	
浜松ホトニクス	54,000	3,760.00	203,040,000	
三井ハイテック	10,000	1,996.00	19,960,000	
新光電気工業	28,200	874.00	24,646,800	
京セラ	121,900	7,539.00	919,004,100	
太陽誘電	33,700	1,728.00	58,233,600	
村田製作所	77,900	15,025.00	1,170,447,500	
ユーシン	13,400	774.00	10,371,600	
双葉電子工業	12,200	2,333.00	28,462,600	
北陸電気工業	4,100	1,702.00	6,978,200	
ニチコン	23,300	1,459.00	33,994,700	
日本ケミコン	6,100	3,570.00	21,777,000	
K O A	10,500	2,202.00	23,121,000	
市光工業	11,500	1,028.00	11,822,000	
小糸製作所	44,200	7,810.00	345,202,000	
ミツバ	13,800	1,623.00	22,397,400	
S C R E E Nホールディングス	14,100	9,560.00	134,796,000	
キヤノン電子	6,800	2,499.00	16,993,200	
キヤノン	399,800	4,349.00	1,738,730,200	
リコー	222,800	1,015.00	226,142,000	
東京エレクトロン	49,500	21,275.00	1,053,112,500	
トヨタ紡織	21,800	2,286.00	49,834,800	
芦森工業	1,900	2,914.00	5,536,600	
ユニプレス	14,400	2,948.00	42,451,200	

豊田自動織機	59,800	7,080.00	423,384,000	
モリタホールディングス	12,000	2,033.00	24,396,000	
三櫻工業	11,700	871.00	10,190,700	
デンソー	164,800	6,553.00	1,079,934,400	
東海理化電機製作所	19,600	2,305.00	45,178,000	
三井造船	26,900	1,645.00	44,250,500	
川崎重工業	57,400	3,645.00	209,223,000	
名村造船所	23,300	674.00	15,704,200	
日本車輛製造	33,000	329.00	10,857,000	
三菱ロジスネクスト	9,800	1,000.00	9,800,000	
日産自動車	875,900	1,107.50	970,059,250	
いすゞ自動車	215,500	1,837.50	395,981,250	
トヨタ自動車	902,900	7,194.00	6,495,462,600	代用有価証券 500,000株
日野自動車	105,700	1,434.00	151,573,800	
三菱自動車工業	274,600	815.00	223,799,000	
エフテック	5,500	1,678.00	9,229,000	
武蔵精密工業	8,000	3,420.00	27,360,000	
日産車体	29,000	1,149.00	33,321,000	
新明和工業	31,300	1,059.00	33,146,700	
極東開発工業	14,000	1,994.00	27,916,000	
日信工業	14,800	2,153.00	31,864,400	
トピー工業	6,200	3,380.00	20,956,000	
ティラド	3,200	3,895.00	12,464,000	
曙ブレーキ工業	36,700	304.00	11,156,800	
タチエス	13,000	2,066.00	26,858,000	
N O K	40,100	2,641.00	105,904,100	
フタバ産業	23,200	1,033.00	23,965,600	
K Y B	7,800	6,460.00	50,388,000	
大同メタル工業	11,700	1,084.00	12,682,800	
プレス工業	40,200	665.00	26,733,000	

ミクニ	12,700	796.00	10,109,200	
太平洋工業	15,900	1,693.00	26,918,700	
ケーヒン	17,000	2,195.00	37,315,000	
河西工業	9,400	1,773.00	16,666,200	
アイシン精機	60,800	6,130.00	372,704,000	
マツダ	233,200	1,505.50	351,082,600	
今仙電機製作所	8,500	1,353.00	11,500,500	
本田技研工業	668,300	3,889.00	2,599,018,700	
スズキ	147,200	6,441.00	948,115,200	
S U B A R U	230,500	3,742.00	862,531,000	
安永	3,700	2,623.00	9,705,100	
ヤマハ発動機	104,300	3,645.00	380,173,500	
ショーワ	19,600	1,329.00	26,048,400	
T B K	14,500	537.00	7,786,500	
エクセディ	8,800	3,445.00	30,316,000	
豊田合成	27,100	2,866.00	77,668,600	
愛三工業	13,600	1,284.00	17,462,400	
ヨロズ	7,500	2,470.00	18,525,000	
エフ・シー・シー	12,300	2,918.00	35,891,400	
シマノ	29,900	15,520.00	464,048,000	
テイ・エス テック	17,300	4,655.00	80,531,500	
ジャムコ	3,900	2,766.00	10,787,400	
テルモ	113,800	5,310.00	604,278,000	
日機装	26,900	1,133.00	30,477,700	
島津製作所	88,500	2,558.00	226,383,000	
J M S	11,500	630.00	7,245,000	
長野計器	6,800	1,265.00	8,602,000	
ブイ・テクノロジー	1,700	18,540.00	31,518,000	
東京計器	5,700	1,373.00	7,826,100	
東京精密	13,400	4,590.00	61,506,000	
マニー	9,300	3,410.00	31,713,000	

ニコン	129,200	2,271.00	293,413,200	
トプコン	40,200	2,382.00	95,756,400	
オリンパス	110,500	4,255.00	470,177,500	
理研計器	7,200	2,523.00	18,165,600	
タムロン	6,400	2,434.00	15,577,600	
H O Y A	152,900	5,680.00	868,472,000	
ノーリツ鋼機	7,800	2,309.00	18,010,200	
シチズン時計	90,000	824.00	74,160,000	
リズム時計工業	4,000	2,321.00	9,284,000	
大研医器	10,000	761.00	7,610,000	
メニコン	5,200	6,280.00	32,656,000	
松風	6,200	1,484.00	9,200,800	
セイコーホールディングス	10,900	3,245.00	35,370,500	
ニプロ	52,400	1,570.00	82,268,000	
スノーピーク	3,000	1,408.00	4,224,000	
パラマウントベッドホールディングス	7,800	5,340.00	41,652,000	
トランザクション	4,000	1,028.00	4,112,000	
ニホンフラッシュ	4,100	2,950.00	12,095,000	
前田工織	7,500	2,011.00	15,082,500	
永大産業	14,000	567.00	7,938,000	
アートネイチャー	11,000	793.00	8,723,000	
ダンロップスポーツ	6,300	1,645.00	10,363,500	
バンダイナムコホールディングス	76,600	3,745.00	286,867,000	
S H O E I	3,500	4,590.00	16,065,000	
フランスベッドホールディングス	11,100	1,034.00	11,477,400	
パイロットコーポレーション	13,000	5,490.00	71,370,000	
萩原工業	5,000	2,061.00	10,305,000	
トッパン・フォームズ	13,800	1,245.00	17,181,000	
フジシールインターナショナル	16,400	3,630.00	59,532,000	
タカラトミー	31,000	1,517.00	47,027,000	
アーク	40,900	119.00	4,867,100	



プロネクス	8,500	1,454.00	12,359,000	
大建工業	5,800	2,882.00	16,715,600	
凸版印刷	208,000	1,018.00	211,744,000	
大日本印刷	96,800	2,506.00	242,580,800	
図書印刷	5,700	978.00	5,574,600	
共同印刷	2,500	3,610.00	9,025,000	
N I S S H A	14,700	3,425.00	50,347,500	
宝印刷	5,300	1,718.00	9,105,400	
アシックス	73,800	1,769.00	130,552,200	
ツツミ	3,100	2,134.00	6,615,400	
小松ウオール工業	3,400	2,401.00	8,163,400	
ヤマハ	49,900	4,095.00	204,340,500	
河合楽器製作所	3,300	2,576.00	8,500,800	
クリナップ	8,800	862.00	7,585,600	
ビジョン	44,900	4,345.00	195,090,500	
キングジム	8,300	997.00	8,275,100	
リンテック	17,600	3,080.00	54,208,000	
イトーキ	16,900	825.00	13,942,500	
任天堂	45,700	42,690.00	1,950,933,000	
三菱鉛筆	12,000	2,460.00	29,520,000	
タカラスタンド	15,100	1,758.00	26,545,800	
コクヨ	35,600	2,091.00	74,439,600	
ナカバヤシ	9,900	721.00	7,137,900	
グローブライド	4,500	1,996.00	8,982,000	
岡村製作所	25,700	1,503.00	38,627,100	
美津濃	7,300	3,315.00	24,199,500	
東京電力ホールディングス	591,400	450.00	266,130,000	
中部電力	227,700	1,377.00	313,542,900	
関西電力	303,400	1,408.00	427,187,200	
中国電力	101,700	1,212.00	123,260,400	
北陸電力	73,300	926.00	67,875,800	

東北電力	173,000	1,451.00	251,023,000	
四国電力	66,900	1,295.00	86,635,500	
九州電力	162,800	1,197.00	194,871,600	
北海道電力	74,800	757.00	56,623,600	
沖縄電力	12,000	2,915.00	34,980,000	
電源開発	59,200	3,080.00	182,336,000	
エフオン	4,300	1,444.00	6,209,200	
イーレックス	12,400	1,061.00	13,156,400	
東京瓦斯	158,700	2,610.00	414,207,000	
大阪瓦斯	144,500	2,216.50	320,284,250	
東邦瓦斯	36,900	3,075.00	113,467,500	
広島ガス	22,200	365.00	8,103,000	
西部瓦斯	9,100	2,713.00	24,688,300	
静岡ガス	21,300	926.00	19,723,800	
メタウォーター	4,500	2,806.00	12,627,000	
SBSホールディングス	8,700	1,089.00	9,474,300	
東武鉄道	79,000	3,695.00	291,905,000	
相鉄ホールディングス	24,500	2,967.00	72,691,500	
東京急行電鉄	200,500	1,796.00	360,098,000	
京浜急行電鉄	102,000	2,142.00	218,484,000	
小田急電鉄	109,700	2,415.00	264,925,500	
京王電鉄	41,300	5,050.00	208,565,000	
京成電鉄	51,800	3,680.00	190,624,000	
富士急行	10,400	3,225.00	33,540,000	
東日本旅客鉄道	133,400	11,070.00	1,476,738,000	
西日本旅客鉄道	67,100	8,333.00	559,144,300	
東海旅客鉄道	66,500	20,565.00	1,367,572,500	
西武ホールディングス	94,800	2,060.00	195,288,000	
鴻池運輸	10,700	1,916.00	20,501,200	
西日本鉄道	20,500	3,045.00	62,422,500	
ハマキョウレックス	5,100	3,090.00	15,759,000	

サカイ引越センター	3,900	5,480.00	21,372,000	
近鉄グループホールディングス	69,900	4,380.00	306,162,000	
阪急阪神ホールディングス	93,400	4,575.00	427,305,000	
南海電気鉄道	33,600	2,823.00	94,852,800	
京阪ホールディングス	31,800	3,315.00	105,417,000	
神戸電鉄	2,500	3,915.00	9,787,500	
名古屋鉄道	54,200	2,794.00	151,434,800	
山陽電気鉄道	6,000	2,782.00	16,692,000	
日本通運	27,500	7,430.00	204,325,000	
ヤマトホールディングス	123,800	2,299.00	284,616,200	
山九	18,300	4,860.00	88,938,000	
丸全昭和運輸	29,000	529.00	15,341,000	
センコーグループホールディングス	40,200	779.00	31,315,800	
トナミホールディングス	1,800	5,630.00	10,134,000	
ニッコンホールディングス	26,500	3,110.00	82,415,000	
福山通運	10,100	4,110.00	41,511,000	
セイノーホールディングス	52,700	1,792.00	94,438,400	
神奈川中央交通	2,400	3,640.00	8,736,000	
日立物流	14,800	2,935.00	43,438,000	
丸和運輸機関	4,000	3,510.00	14,040,000	
C & F ロジホールディングス	8,600	1,605.00	13,803,000	
九州旅客鉄道	59,300	3,570.00	211,701,000	
日本郵船	58,400	2,692.00	157,212,800	
商船三井	44,200	3,610.00	159,562,000	
川崎汽船	32,800	2,847.00	93,381,600	
N S ユナイテッド海運	3,800	2,954.00	11,225,200	
飯野海運	37,700	600.00	22,620,000	
乾汽船	9,000	745.00	6,705,000	
日本航空	130,800	4,337.00	567,279,600	
A N A ホールディングス	138,100	4,706.00	649,898,600	
トランコム	2,100	7,880.00	16,548,000	

日新	6,300	3,095.00	19,498,500	
三菱倉庫	24,300	2,960.00	71,928,000	
三井倉庫ホールディングス	45,000	368.00	16,560,000	
住友倉庫	51,000	811.00	41,361,000	
澁澤倉庫	5,200	2,017.00	10,488,400	
東陽倉庫	22,300	334.00	7,448,200	
日本トランスシティ	22,000	486.00	10,692,000	
川西倉庫	1,900	2,433.00	4,622,700	
安田倉庫	8,700	922.00	8,021,400	
東洋埠頭	3,500	1,827.00	6,394,500	
上組	44,200	2,547.00	112,577,400	
キューソー流通システム	2,400	3,190.00	7,656,000	
郵船ロジスティクス	6,900	1,496.00	10,322,400	
近鉄エクスプレス	13,000	2,336.00	30,368,000	
エーアイティー	6,300	1,320.00	8,316,000	
N E C ネットエスアイ	8,000	2,845.00	22,760,000	
システナ	6,000	3,630.00	21,780,000	
デジタルアーツ	3,700	4,730.00	17,501,000	
新日鉄住金ソリューションズ	11,200	2,965.00	33,208,000	
キューブシステム	6,900	814.00	5,616,600	
コア	3,800	1,535.00	5,833,000	
ソフトクリエイイトホールディングス	5,000	1,537.00	7,685,000	
T I S	24,500	4,005.00	98,122,500	
電算システム	3,700	2,141.00	7,921,700	
グリー	45,400	735.00	33,369,000	
コーエーテクモホールディングス	12,400	2,318.00	28,743,200	
三菱総合研究所	3,600	3,735.00	13,446,000	
ファインデックス	8,000	792.00	6,336,000	
ヒト・コミュニケーションズ	2,300	2,425.00	5,577,500	
K L a b	14,500	1,890.00	27,405,000	

ポールトゥウィン・ピットクルーホールディングス	6,100	2,120.00	12,932,000	
ネクソン	81,600	3,295.00	268,872,000	
アイスタイル	18,100	902.00	16,326,200	
エムアップ	2,900	1,371.00	3,975,900	
エイチーム	5,300	2,934.00	15,550,200	
テクノスジャパン	7,300	960.00	7,008,000	
コロブラ	24,000	1,260.00	30,240,000	
ブロードリーフ	19,000	1,110.00	21,090,000	
ハーツユナイテッドグループ	4,600	1,747.00	8,036,200	
メディアドゥホールディングス	2,700	2,427.00	6,552,900	
フィックスターズ	1,500	6,050.00	9,075,000	
VOYAGE GROUP	4,300	1,417.00	6,093,100	
オブティム	1,700	2,668.00	4,535,600	
セレス	3,000	2,211.00	6,633,000	
ティーガイア	7,200	2,627.00	18,914,400	
日本アジアグループ	11,800	471.00	5,557,800	
豆蔵ホールディングス	6,600	1,340.00	8,844,000	
テクマトリックス	4,800	1,867.00	8,961,600	
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	200,000	320.00	64,000,000	
GMOペイメントゲートウェイ	5,200	9,060.00	47,112,000	
インターネットイニシアティブ	11,900	2,038.00	24,252,200	
さくらインターネット	9,900	838.00	8,296,200	
GMOクラウド	2,000	2,378.00	4,756,000	
SRAホールディングス	4,300	3,695.00	15,888,500	
フリービット	6,400	1,104.00	7,065,600	
コムチュア	4,400	2,928.00	12,883,200	
メディカル・データ・ビジョン	3,300	2,198.00	7,253,400	
gumi	9,200	1,100.00	10,120,000	
PCIホールディングス	1,600	3,100.00	4,960,000	
オープンドア	1,200	7,070.00	8,484,000	

アカツキ	1,500	7,010.00	10,515,000	
L I N E	20,500	4,695.00	96,247,500	
オークネット	3,700	1,460.00	5,402,000	
A O I T Y O H o l d i n g s	6,800	1,225.00	8,330,000	
マクロミル	9,600	2,611.00	25,065,600	
フェイス	5,000	1,373.00	6,865,000	
野村総合研究所	48,600	5,230.00	254,178,000	
サイバネットシステム	7,900	710.00	5,609,000	
インテージホールディングス	9,600	1,425.00	13,680,000	
フォーカスシステムズ	5,600	936.00	5,241,600	
クレスコ	1,800	4,560.00	8,208,000	
フジ・メディア・ホールディングス	76,700	1,763.00	135,222,100	
オービック	23,000	8,170.00	187,910,000	
ジャストシステム	12,000	2,235.00	26,820,000	
T D C ソフト	4,800	1,118.00	5,366,400	
ヤフー	524,000	510.00	267,240,000	
トレンドマイクロ	35,600	6,520.00	232,112,000	
日本オラクル	11,800	10,040.00	118,472,000	
アルファシステムズ	3,400	2,465.00	8,381,000	
フューチャー	11,300	1,239.00	14,000,700	
C A C H o l d i n g s	7,900	1,081.00	8,539,900	
ソフトバンク・テクノロジー	3,600	1,896.00	6,825,600	
トーセ	2,200	2,165.00	4,763,000	
オービックビジネスコンサルタント	3,800	6,270.00	23,826,000	
伊藤忠テクノソリューションズ	16,700	4,875.00	81,412,500	
アイティフォー	14,400	785.00	11,304,000	
大塚商会	21,800	8,730.00	190,314,000	
サイボウズ	14,500	500.00	7,250,000	
電通国際情報サービス	4,900	2,570.00	12,593,000	
デジタルガレージ	13,400	3,010.00	40,334,000	
E M システムズ	3,600	2,456.00	8,841,600	

ウェザーニューズ	3,300	3,395.00	11,203,500	
WOWOW	3,700	3,275.00	12,117,500	
スカラ	7,000	718.00	5,026,000	
イマジカ・ロボット ホールディングス	7,100	1,138.00	8,079,800	
ネットワンシステムズ	29,900	1,710.00	51,129,000	
アルゴグラフィックス	3,800	3,380.00	12,844,000	
マーベラス	13,300	1,045.00	13,898,500	
エイベックス	14,000	1,611.00	22,554,000	
日本ユニシス	20,100	2,265.00	45,526,500	
兼松エレクトロニクス	4,700	3,360.00	15,792,000	
東京放送ホールディングス	44,200	2,793.00	123,450,600	
日本テレビホールディングス	67,100	1,981.00	132,925,100	
朝日放送	10,200	908.00	9,261,600	
テレビ朝日ホールディングス	20,000	2,313.00	46,260,000	
スカパーJ S A Tホールディングス	53,200	500.00	26,600,000	
テレビ東京ホールディングス	6,200	2,419.00	14,997,800	
ビジョン	2,200	2,606.00	5,733,200	
ワイヤレスゲート	4,400	1,339.00	5,891,600	
コネクシオ	5,500	2,364.00	13,002,000	
日本電信電話	523,000	5,355.00	2,800,665,000	
K D D I	656,100	2,857.50	1,874,805,750	
光通信	8,800	15,970.00	140,536,000	
N T T ドコモ	539,400	2,670.00	1,440,198,000	
エムティーアイ	11,600	624.00	7,238,400	
G M O インターネット	26,700	2,092.00	55,856,400	
カドカワ	21,300	1,389.00	29,585,700	
学研ホールディングス	3,300	4,725.00	15,592,500	
ゼンリン	9,000	3,710.00	33,390,000	
アイネット	5,600	1,685.00	9,436,000	
松竹	4,900	19,210.00	94,129,000	
東宝	48,000	3,920.00	188,160,000	

東映	2,800	12,000.00	33,600,000	
エヌ・ティ・ティ・データ	225,500	1,346.00	303,523,000	
D T S	7,600	3,615.00	27,474,000	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	33,900	5,550.00	188,145,000	
シーイーシー	4,800	3,100.00	14,880,000	
カプコン	16,000	3,545.00	56,720,000	
ジャステック	5,800	1,259.00	7,302,200	
S C S K	17,500	5,260.00	92,050,000	
日本システムウエア	2,800	2,647.00	7,411,600	
アイネス	11,500	1,117.00	12,845,500	
T K C	6,900	4,020.00	27,738,000	
富士ソフト	10,100	3,545.00	35,804,500	
N S D	11,600	2,324.00	26,958,400	
コナミホールディングス	29,900	6,420.00	191,958,000	
福井コンピュータホールディングス	2,500	3,295.00	8,237,500	
J B C Cホールディングス	8,500	1,137.00	9,664,500	
ミロク情報サービス	6,600	3,045.00	20,097,000	
ソフトバンクグループ	329,900	9,060.00	2,988,894,000	
伊藤忠食品	2,000	6,180.00	12,360,000	
エレマテック	3,600	2,635.00	9,486,000	
J A L U X	2,700	2,818.00	7,608,600	
あらた	3,700	6,020.00	22,274,000	
東京エレクトロン デバイス	3,800	2,021.00	7,679,800	
フィールズ	6,700	1,234.00	8,267,800	
双日	433,300	328.00	142,122,400	
アルフレッサ ホールディングス	81,400	2,616.00	212,942,400	
横浜冷凍	18,000	1,143.00	20,574,000	
アルコニックス	8,000	2,210.00	17,680,000	
神戸物産	4,800	4,560.00	21,888,000	
ペッパーフードサービス	3,900	5,790.00	22,581,000	
あい ホールディングス	10,800	2,706.00	29,224,800	



ダイワボウホールディングス	6,300	4,710.00	29,673,000	
マクニカ・富士エレホールディングス	13,400	2,488.00	33,339,200	
ラクト・ジャパン	1,200	4,390.00	5,268,000	
バイタルケーエスケー・ホールディングス	15,500	1,027.00	15,918,500	
U K Cホールディングス	5,500	2,201.00	12,105,500	
ジュテックホールディングス	2,100	1,316.00	2,763,600	
T O K A Iホールディングス	38,700	883.00	34,172,100	
三洋貿易	4,400	2,637.00	11,602,800	
ウイン・パートナーズ	5,500	1,368.00	7,524,000	
シップヘルスケアホールディングス	15,300	3,705.00	56,686,500	
コメダホールディングス	13,900	2,018.00	28,050,200	
小野建	7,200	2,037.00	14,666,400	
佐島電機	8,100	1,020.00	8,262,000	
伯東	5,300	1,870.00	9,911,000	
コンドーテック	8,000	1,048.00	8,384,000	
ナガイレーベン	9,800	2,643.00	25,901,400	
三菱食品	7,600	3,365.00	25,574,000	
松田産業	6,300	1,819.00	11,459,700	
第一興商	11,000	5,550.00	61,050,000	
メディバルホールディングス	73,400	2,213.00	162,434,200	
萩原電気	2,900	3,330.00	9,657,000	
アズワン	5,800	6,740.00	39,092,000	
尾家産業	4,400	1,332.00	5,860,800	
シモジマ	6,000	1,233.00	7,398,000	
ドウシシャ	8,200	2,282.00	18,712,400	
高速	6,400	1,274.00	8,153,600	
黒田電気	9,100	2,708.00	24,642,800	
丸文	8,500	1,091.00	9,273,500	
ハビネット	5,400	2,077.00	11,215,800	
日本ライフライン	10,500	4,605.00	48,352,500	
エクセル	3,300	2,588.00	8,540,400	

マルカキカイ	3,700	2,143.00	7,929,100	
I D O M	22,700	824.00	18,704,800	
日本エム・ディ・エム	6,500	892.00	5,798,000	
進和	5,200	2,595.00	13,494,000	
ダイトロン	4,100	2,405.00	9,860,500	
シークス	4,700	4,690.00	22,043,000	
オーハシテクニカ	5,600	1,740.00	9,744,000	
伊藤忠商事	536,800	1,964.00	1,054,275,200	
丸紅	602,000	781.20	470,282,400	
長瀬産業	44,600	2,025.00	90,315,000	
蝶理	5,500	2,102.00	11,561,000	
豊田通商	81,600	4,380.00	357,408,000	
三共生興	18,800	484.00	9,099,200	
兼松	30,800	1,585.00	48,818,000	
三井物産	621,800	1,748.00	1,086,906,400	
日本紙パルプ商事	4,000	4,165.00	16,660,000	
日立ハイテクノロジーズ	25,400	4,820.00	122,428,000	
カメイ	10,000	1,857.00	18,570,000	
スターゼン	3,100	5,470.00	16,957,000	
山善	28,100	1,319.00	37,063,900	
住友商事	461,800	1,858.50	858,255,300	
内田洋行	3,700	3,215.00	11,895,500	
三菱商事	513,300	2,957.00	1,517,828,100	
第一実業	3,900	3,290.00	12,831,000	
キヤノンマーケティングジャパン	21,100	3,060.00	64,566,000	
西華産業	5,000	2,884.00	14,420,000	
佐藤商事	8,700	1,249.00	10,866,300	
菱洋エレクトロ	7,300	1,971.00	14,388,300	
東京産業	12,500	525.00	6,562,500	
ユアサ商事	7,000	3,990.00	27,930,000	
神鋼商事	1,900	3,015.00	5,728,500	

阪和興業	14,000	4,670.00	65,380,000	
正栄食品工業	4,200	5,050.00	21,210,000	
カナデン	9,100	1,464.00	13,322,400	
菱電商事	6,700	1,803.00	12,080,100	
フルサト工業	5,800	1,821.00	10,561,800	
岩谷産業	16,500	3,535.00	58,327,500	
すてきナイスグループ	4,900	1,544.00	7,565,600	
イワキ	14,000	485.00	6,790,000	
三愛石油	19,500	1,582.00	30,849,000	
稲畑産業	17,400	1,679.00	29,214,600	
ワキタ	16,000	1,347.00	21,552,000	
東邦ホールディングス	22,100	2,471.00	54,609,100	
サンゲツ	25,200	2,053.00	51,735,600	
ミツウロコグループホールディングス	12,600	842.00	10,609,200	
シナネンホールディングス	4,200	2,547.00	10,697,400	
伊藤忠エネクス	16,100	1,082.00	17,420,200	
サンリオ	21,000	1,873.00	39,333,000	
サンワテクノス	5,000	2,147.00	10,735,000	
リョーサン	9,400	4,245.00	39,903,000	
新光商事	8,500	2,061.00	17,518,500	
トーホー	4,100	2,802.00	11,488,200	
三信電気	7,400	1,782.00	13,186,800	
東陽テクニカ	10,700	967.00	10,346,900	
モスフードサービス	9,600	3,405.00	32,688,000	
加賀電子	6,700	3,150.00	21,105,000	
ソーダニッカ	12,800	601.00	7,692,800	
立花エレテック	5,700	1,941.00	11,063,700	
PALTAC	10,000	5,180.00	51,800,000	
三谷産業	13,600	431.00	5,861,600	
太平洋興発	5,600	1,060.00	5,936,000	
西本Wismettacホールディングス	1,600	3,945.00	6,312,000	

ヤマタネ	5,200	2,280.00	11,856,000	
日鉄住金物産	5,500	6,150.00	33,825,000	
トラスコ中山	15,100	3,260.00	49,226,000	
オートバックスセブン	29,100	2,136.00	62,157,600	
モリト	7,900	1,025.00	8,097,500	
加藤産業	11,200	4,050.00	45,360,000	
イノテック	8,000	1,050.00	8,400,000	
イエローハット	7,100	3,235.00	22,968,500	
J Kホールディングス	10,300	997.00	10,269,100	
日伝	6,200	2,282.00	14,148,400	
杉本商事	6,000	1,745.00	10,470,000	
因幡電機産業	9,500	5,060.00	48,070,000	
バイテックホールディングス	4,000	1,762.00	7,048,000	
ミスミグループ本社	84,900	3,230.00	274,227,000	
タキヒヨー	3,200	2,363.00	7,561,600	
スズケン	33,400	4,575.00	152,805,000	
ジェコス	6,500	1,391.00	9,041,500	
ローソン	18,500	7,910.00	146,335,000	
サンエー	5,400	5,390.00	29,106,000	
カワチ薬品	5,800	2,774.00	16,089,200	
エービーシー・マート	13,400	6,480.00	86,832,000	
ハードオフコーポレーション	5,800	1,212.00	7,029,600	
アスクル	7,700	3,155.00	24,293,500	
ゲオホールディングス	13,300	2,173.00	28,900,900	
アダストリア	11,300	2,522.00	28,498,600	
くらコーポレーション	4,400	6,260.00	27,544,000	
キャンドゥ	5,100	1,749.00	8,919,900	
パルグループホールディングス	4,000	3,490.00	13,960,000	
エディオン	27,800	1,303.00	36,223,400	
サーラコーポレーション	14,300	695.00	9,938,500	
ハローズ	3,200	2,582.00	8,262,400	

あみやき亭	1,900	5,320.00	10,108,000	
ひらまつ	14,200	567.00	8,051,400	
ゲンキー	3,400	4,057.00	13,793,800	
大黒天物産	2,000	5,040.00	10,080,000	
ハニーズホールディングス	8,800	1,145.00	10,076,000	
アルペン	6,100	2,384.00	14,542,400	
クオール	7,500	2,106.00	15,795,000	
ジinz	5,100	5,900.00	30,090,000	
ビックカメラ	41,800	1,627.00	68,008,600	
D C Mホールディングス	39,700	1,084.00	43,034,800	
M o n o t a R O	26,300	3,415.00	89,814,500	
D Dホールディングス	1,700	4,565.00	7,760,500	
アークランドサービスホールディングス	6,400	2,676.00	17,126,400	
J . フロント リテイリング	87,100	1,979.00	172,370,900	
ドトール・日レスホールディングス	12,800	2,790.00	35,712,000	
マツモトキヨシホールディングス	15,100	9,210.00	139,071,000	
ブロンコビリー	4,300	3,570.00	15,351,000	
スタートトゥデイ	71,900	3,645.00	262,075,500	
物語コーポレーション	2,200	10,870.00	23,914,000	
ココカラファイン	7,600	7,470.00	56,772,000	
三越伊勢丹ホールディングス	136,500	1,363.00	186,049,500	
H a m e e	2,700	1,626.00	4,390,200	
ウエルシアホールディングス	19,300	5,030.00	97,079,000	
クリエイトSDホールディングス	10,700	3,000.00	32,100,000	
チムニー	2,700	2,877.00	7,767,900	
シュッピン	2,400	3,105.00	7,452,000	
ネクステージ	7,800	861.00	6,715,800	
ジョイフル本田	11,900	3,455.00	41,114,500	
鳥貴族	3,100	3,710.00	11,501,000	
ホットランド	5,300	1,505.00	7,976,500	
すかいらーく	45,200	1,642.00	74,218,400	

綿半ホールディングス	3,400	3,100.00	10,540,000	
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホール	21,800	1,158.00	25,244,400	
あさひ	6,500	1,376.00	8,944,000	
日本調剤	2,900	3,490.00	10,121,000	
コスモス薬品	3,700	23,880.00	88,356,000	
セブン&アイ・ホールディングス	306,500	4,742.00	1,453,423,000	
薬王堂	3,300	3,310.00	10,923,000	
クリエイト・レストランツ・ホールディング	19,500	1,318.00	25,701,000	
ツルハホールディングス	14,700	16,200.00	238,140,000	
サンマルクホールディングス	4,900	3,025.00	14,822,500	
トリドールホールディングス	9,100	4,125.00	37,537,500	
TOKYO BASE	1,500	4,725.00	7,087,500	
パロックジャパンリミテッド	7,200	1,000.00	7,200,000	
クスリのアオキホールディングス	5,700	6,210.00	35,397,000	
スシローグローバルホールディングス	6,900	4,165.00	28,738,500	
LIXILピバ	7,500	1,901.00	14,257,500	
メディカルシステムネットワーク	12,200	640.00	7,808,000	
総合メディカル	3,200	6,180.00	19,776,000	
ノジマ	12,800	2,683.00	34,342,400	
カッパ・クリエイト	11,200	1,270.00	14,224,000	
ライトオン	8,000	906.00	7,248,000	
良品計画	9,700	35,700.00	346,290,000	
アドヴァン	9,000	1,053.00	9,477,000	
アルピス	2,000	4,055.00	8,110,000	
コナカ	14,000	622.00	8,708,000	
G-7ホールディングス	2,800	2,694.00	7,543,200	
コジマ	16,600	372.00	6,175,200	
コーナン商事	10,600	2,428.00	25,736,800	
エコス	4,800	1,244.00	5,971,200	
ワタミ	10,000	1,592.00	15,920,000	
ドンキホーテホールディングス	47,400	5,770.00	273,498,000	

西松屋チェーン	15,900	1,307.00	20,781,300	
ゼンショーホールディングス	38,500	1,943.00	74,805,500	
幸楽苑ホールディングス	5,500	1,808.00	9,944,000	
サイゼリヤ	10,800	3,680.00	39,744,000	
V Tホールディングス	26,000	568.00	14,768,000	
ユナイテッドアローズ	9,200	4,530.00	41,676,000	
ハイデイ日高	8,100	3,745.00	30,334,500	
京都きもの友禅	7,200	775.00	5,580,000	
コロワイド	24,000	2,153.00	51,672,000	
ピーシーデポコーポレーション	11,900	854.00	10,162,600	
巻番屋	5,100	4,550.00	23,205,000	
スギホールディングス	16,200	5,840.00	94,608,000	
ヴィア・ホールディングス	9,300	750.00	6,975,000	
スクロール	15,700	519.00	8,148,300	
ヨンドシーホールディングス	7,700	2,933.00	22,584,100	
ユニー・ファミリーマートホールディングス	23,400	8,060.00	188,604,000	
木曽路	9,300	2,741.00	25,491,300	
S R Sホールディングス	11,800	925.00	10,915,000	
千趣会	15,300	637.00	9,746,100	
ケーヨー	15,700	711.00	11,162,700	
上新電機	8,700	4,060.00	35,322,000	
日本瓦斯	13,500	3,915.00	52,852,500	
ロイヤルホールディングス	12,900	3,185.00	41,086,500	
いなげや	8,400	1,834.00	15,405,600	
島忠	19,400	3,315.00	64,311,000	
チヨダ	8,500	3,000.00	25,500,000	
ライフコーポレーション	5,400	2,995.00	16,173,000	
リンガーハット	9,000	2,554.00	22,986,000	
MrMaxHD	11,400	868.00	9,895,200	
AOKIホールディングス	14,700	1,658.00	24,372,600	
オークワ	12,000	1,156.00	13,872,000	

コメリ	12,000	3,280.00	39,360,000	
青山商事	14,400	4,230.00	60,912,000	
しまむら	8,500	13,500.00	114,750,000	
高島屋	115,000	1,152.00	132,480,000	
松屋	15,000	1,453.00	21,795,000	
エイチ・ツー・オー リテイリング	35,000	2,273.00	79,555,000	
近鉄百貨店	3,000	4,000.00	12,000,000	
パルコ	7,200	1,610.00	11,592,000	
丸井グループ	70,300	2,017.00	141,795,100	
アクシアル リテイリング	5,900	4,220.00	24,898,000	
イオン	281,900	1,928.00	543,503,200	
イズミ	13,300	7,010.00	93,233,000	
平和堂	14,600	2,490.00	36,354,000	
フジ	8,400	2,425.00	20,370,000	
ヤオコー	8,200	5,490.00	45,018,000	
ゼビオホールディングス	9,900	2,166.00	21,443,400	
ケーズホールディングス	31,300	2,938.00	91,959,400	
O l y m p i cグループ	9,100	590.00	5,369,000	
日産東京販売ホールディングス	15,700	398.00	6,248,600	
アインホールディングス	10,600	7,230.00	76,638,000	
元気寿司	2,400	3,785.00	9,084,000	
ヤマダ電機	244,800	614.00	150,307,200	
アークランドサカモト	12,800	1,915.00	24,512,000	
ニトリホールディングス	29,000	17,570.00	509,530,000	
グルメ杵屋	7,000	1,138.00	7,966,000	
吉野家ホールディングス	25,600	1,917.00	49,075,200	
松屋フーズ	3,700	4,110.00	15,207,000	
サガミチェーン	11,200	1,395.00	15,624,000	
関西スーパーマーケット	6,900	1,223.00	8,438,700	
王将フードサービス	5,300	5,240.00	27,772,000	
プレナス	8,200	2,418.00	19,827,600	



ミニストップ	5,700	2,442.00	13,919,400	
アークス	13,500	2,675.00	36,112,500	
パローホールディングス	17,500	2,608.00	45,640,000	
ベルク	3,300	6,580.00	21,714,000	
大庄	5,600	1,705.00	9,548,000	
ファーストリテイリング	12,200	45,430.00	554,246,000	
サンドラッグ	31,000	5,310.00	164,610,000	
サックスパー ホールディングス	7,900	1,355.00	10,704,500	
ペルーナ	18,000	1,341.00	24,138,000	
じもとホールディングス	53,000	193.00	10,229,000	
めぶきフィナンシャルグループ	378,000	483.00	182,574,000	
東京ＴＹフィナンシャルグループ	10,100	3,360.00	33,936,000	
九州フィナンシャルグループ	121,200	698.00	84,597,600	
ゆうちょ銀行	205,400	1,479.00	303,786,600	
富山第一銀行	20,000	540.00	10,800,000	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	445,600	691.00	307,909,600	
西日本フィナンシャルホールディングス	50,000	1,361.00	68,050,000	
新生銀行	63,300	1,936.00	122,548,800	
あおぞら銀行	43,600	4,470.00	194,892,000	
三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	5,174,500	817.70	4,231,188,650	
りそなホールディングス	803,000	648.30	520,584,900	
三井住友トラスト・ホールディングス	143,900	4,491.00	646,254,900	
三井住友フィナンシャルグループ	554,300	4,875.00	2,702,212,500	
第四銀行	9,100	5,170.00	47,047,000	
北越銀行	7,600	2,630.00	19,988,000	
千葉銀行	261,000	933.00	243,513,000	
群馬銀行	150,000	704.00	105,600,000	
武蔵野銀行	12,000	3,740.00	44,880,000	
千葉興業銀行	21,000	589.00	12,369,000	
筑波銀行	31,800	394.00	12,529,200	
七十七銀行	23,200	2,820.00	65,424,000	

青森銀行	5,800	3,535.00	20,503,000	
秋田銀行	4,900	3,105.00	15,214,500	
山形銀行	8,500	2,484.00	21,114,000	
岩手銀行	5,000	4,610.00	23,050,000	
東邦銀行	67,000	411.00	27,537,000	
東北銀行	4,000	1,525.00	6,100,000	
みちのく銀行	5,000	1,790.00	8,950,000	
ふくおかフィナンシャルグループ	298,000	627.00	186,846,000	
静岡銀行	191,000	1,177.00	224,807,000	
十六銀行	10,000	3,410.00	34,100,000	
スルガ銀行	74,900	2,415.00	180,883,500	
八十二銀行	130,800	662.00	86,589,600	
山梨中央銀行	46,000	502.00	23,092,000	
大垣共立銀行	11,700	2,881.00	33,707,700	
福井銀行	6,400	2,743.00	17,555,200	
北國銀行	8,200	4,540.00	37,228,000	
清水銀行	2,600	3,330.00	8,658,000	
富山銀行	1,500	4,300.00	6,450,000	
滋賀銀行	70,000	593.00	41,510,000	
南都銀行	8,800	3,140.00	27,632,000	
百五銀行	69,000	547.00	37,743,000	
京都銀行	27,900	6,140.00	171,306,000	
紀陽銀行	28,000	1,880.00	52,640,000	
三重銀行	3,500	2,604.00	9,114,000	
ほくほくフィナンシャルグループ	49,000	1,793.00	87,857,000	
広島銀行	108,500	953.00	103,400,500	
山陰合同銀行	44,000	1,081.00	47,564,000	
中国銀行	51,000	1,541.00	78,591,000	
伊予銀行	105,000	944.00	99,120,000	
百十四銀行	79,000	372.00	29,388,000	
四国銀行	11,500	1,589.00	18,273,500	

阿波銀行	59,000	721.00	42,539,000	
大分銀行	4,300	4,475.00	19,242,500	
宮崎銀行	5,000	3,855.00	19,275,000	
佐賀銀行	4,700	2,652.00	12,464,400	
十八銀行	46,000	312.00	14,352,000	
沖縄銀行	7,200	4,585.00	33,012,000	
琉球銀行	14,500	1,685.00	24,432,500	
セブン銀行	276,400	385.00	106,414,000	
みずほフィナンシャルグループ	9,950,000	204.50	2,034,775,000	
山口フィナンシャルグループ	69,000	1,375.00	94,875,000	
名古屋銀行	6,000	4,505.00	27,030,000	
北洋銀行	112,000	380.00	42,560,000	
愛知銀行	2,500	5,440.00	13,600,000	
第三銀行	4,500	1,883.00	8,473,500	
中京銀行	3,300	2,335.00	7,705,500	
大光銀行	2,800	2,566.00	7,184,800	
愛媛銀行	10,500	1,374.00	14,427,000	
みなと銀行	7,000	2,089.00	14,623,000	
京葉銀行	63,000	509.00	32,067,000	
関西アーバン銀行	10,500	1,463.00	15,361,500	
栃木銀行	39,000	470.00	18,330,000	
北日本銀行	2,400	3,210.00	7,704,000	
東和銀行	13,300	1,491.00	19,830,300	
福島銀行	7,500	919.00	6,892,500	
大東銀行	3,800	1,663.00	6,319,400	
トモニホールディングス	62,000	590.00	36,580,000	
フィデアホールディングス	73,000	203.00	14,819,000	
池田泉州ホールディングス	79,000	419.00	33,101,000	
F P G	26,600	1,361.00	36,202,600	
S B Iホールディングス	83,000	2,455.00	203,765,000	
ジャフコ	10,600	6,780.00	71,868,000	

大和証券グループ本社	627,000	716.10	448,994,700	
野村ホールディングス	1,322,000	675.00	892,350,000	
岡三証券グループ	63,000	696.00	43,848,000	
丸三証券	24,000	1,033.00	24,792,000	
東洋証券	27,000	315.00	8,505,000	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	85,000	733.00	62,305,000	
水戸証券	24,000	411.00	9,864,000	
いちよし証券	16,000	1,288.00	20,608,000	
松井証券	36,500	965.00	35,222,500	
マネックスグループ	80,000	338.00	27,040,000	
カブドットコム証券	49,000	346.00	16,954,000	
極東証券	10,200	1,663.00	16,962,600	
岩井コスモホールディングス	7,600	1,421.00	10,799,600	
藍澤証券	14,800	761.00	11,262,800	
マネーパートナーズグループ	11,000	441.00	4,851,000	
かんぽ生命保険	27,800	2,614.00	72,669,200	
S O M P Oホールディングス	143,600	4,420.00	634,712,000	
アニコム ホールディングス	5,100	3,505.00	17,875,500	
M S & A Dインシュアランスグループホールディングス	191,400	3,813.00	729,808,200	
ソニーフィナンシャルホールディングス	60,300	1,967.00	118,610,100	
第一生命ホールディングス	414,200	2,350.50	973,577,100	
東京海上ホールディングス	276,000	5,108.00	1,409,808,000	
T & Dホールディングス	226,200	1,939.50	438,714,900	
アドバンスクリエイト	2,000	1,957.00	3,914,000	
全国保証	20,900	4,985.00	104,186,500	
クレディセゾン	55,600	2,050.00	113,980,000	
芙蓉総合リース	8,600	7,480.00	64,328,000	
興銀リース	14,000	2,864.00	40,096,000	
東京センチュリー	14,700	5,310.00	78,057,000	
日本証券金融	33,000	615.00	20,295,000	

アイフル	127,000	393.00	49,911,000	
リコーリース	6,200	3,835.00	23,777,000	
イオンフィナンシャルサービス	51,900	2,543.00	131,981,700	
アコム	148,400	478.00	70,935,200	
ジャックス	9,100	2,595.00	23,614,500	
オリエントコーポレーション	162,700	180.00	29,286,000	
日立キャピタル	20,500	2,760.00	56,580,000	
オリックス	488,400	1,925.00	940,170,000	
三菱UFJリース	185,500	668.00	123,914,000	
日本取引所グループ	214,700	1,997.00	428,755,900	
イー・ギャランティ	2,500	3,290.00	8,225,000	
NECキャピタルソリューション	3,800	2,253.00	8,561,400	
いちご	103,000	425.00	43,775,000	
日本駐車場開発	96,800	189.00	18,295,200	
ヒューリック	152,900	1,296.00	198,158,400	
三栄建築設計	3,300	2,528.00	8,342,400	
野村不動産ホールディングス	48,900	2,567.00	125,526,300	
三重交通グループホールディングス	17,500	471.00	8,242,500	
サムティ	6,800	1,720.00	11,696,000	
日本商業開発	4,700	1,688.00	7,933,600	
プレサンスコーポレーション	10,700	1,518.00	16,242,600	
ユニゾホールディングス	8,700	3,010.00	26,187,000	
日本管理センター	5,800	1,612.00	9,349,600	
フージャースホールディングス	10,900	1,291.00	14,071,900	
オープンハウス	11,800	5,830.00	68,794,000	
東急不動産ホールディングス	175,800	802.00	140,991,600	
飯田グループホールディングス	60,800	2,083.00	126,646,400	
ムゲンエステート	5,600	1,166.00	6,529,600	
ケイアイスター不動産	3,000	2,928.00	8,784,000	
パーク24	41,000	2,907.00	119,187,000	
パラカ	3,400	2,496.00	8,486,400	

三井不動産	365,500	2,561.00	936,045,500	
三菱地所	545,100	1,962.50	1,069,758,750	
平和不動産	13,400	2,043.00	27,376,200	
東京建物	80,100	1,536.00	123,033,600	
ダイビル	19,300	1,348.00	26,016,400	
京阪神ビルディング	17,100	876.00	14,979,600	
住友不動産	176,000	3,736.00	657,536,000	
大京	11,200	2,201.00	24,651,200	
テーオーシー	26,300	956.00	25,142,800	
東京楽天地	1,900	5,930.00	11,267,000	
レオパレス21	92,100	905.00	83,350,500	
スターツコーポレーション	9,700	2,886.00	27,994,200	
フジ住宅	13,400	856.00	11,470,400	
空港施設	13,400	668.00	8,951,200	
ゴールドクレスト	6,100	2,291.00	13,975,100	
日本エスリード	3,700	2,442.00	9,035,400	
日神不動産	11,100	902.00	10,012,200	
日本エスコン	14,100	709.00	9,996,900	
タカラレーベン	34,400	495.00	17,028,000	
サンヨーハウジング名古屋	6,500	1,194.00	7,761,000	
イオンモール	47,500	2,253.00	107,017,500	
トーセイ	10,100	1,083.00	10,938,300	
エヌ・ティ・ティ都市開発	46,200	1,300.00	60,060,000	
サンフロンティア不動産	8,300	1,274.00	10,574,200	
エフ・ジェー・ネクスト	7,200	999.00	7,192,800	
日本空港ビルデング	21,500	4,285.00	92,127,500	
日本工営	5,000	3,580.00	17,900,000	
LIFULL	25,200	1,094.00	27,568,800	
ジェイエイシーリクルートメント	6,100	2,188.00	13,346,800	
日本M&Aセンター	24,700	5,480.00	135,356,000	
タケエイ	8,700	1,291.00	11,231,700	

トラスト・テック	3,300	3,385.00	11,170,500	
コシダカホールディングス	3,900	5,330.00	20,787,000	
パソナグループ	6,200	2,032.00	12,598,400	
リンクアンドモチベーション	13,900	916.00	12,732,400	
G C A	9,500	1,119.00	10,630,500	
エス・エム・エス	14,100	3,800.00	53,580,000	
パーソルホールディングス	65,300	2,790.00	182,187,000	
リニカル	5,400	1,551.00	8,375,400	
クックパッド	23,800	631.00	15,017,800	
学情	4,300	1,850.00	7,955,000	
スタジオアリス	4,300	2,752.00	11,833,600	
シミックホールディングス	5,300	1,757.00	9,312,100	
総合警備保障	28,200	6,060.00	170,892,000	
カカクコム	55,300	1,839.00	101,696,700	
アイロムグループ	3,000	1,710.00	5,130,000	
ルネサンス	4,600	1,922.00	8,841,200	
ディップ	10,000	2,906.00	29,060,000	
オプトホールディング	6,100	1,353.00	8,253,300	
ツクイ	18,300	1,018.00	18,629,400	
エムスリー	74,800	3,965.00	296,582,000	
アウトソーシング	21,000	2,099.00	44,079,000	
ウェルネット	7,000	1,209.00	8,463,000	
ワールドホールディングス	2,400	3,555.00	8,532,000	
ディー・エヌ・エー	38,600	2,323.00	89,667,800	
博報堂D Yホールディングス	97,900	1,467.00	143,619,300	
ぐるなび	11,800	1,342.00	15,835,600	
エスアールジータカミヤ	10,700	618.00	6,612,600	
ジャパンベストレスキューシステム	11,500	622.00	7,153,000	
ファンコミュニケーションズ	20,100	904.00	18,170,400	
ライク	3,200	2,671.00	8,547,200	
W D Bホールディングス	3,600	3,705.00	13,338,000	

バリューコマース	7,500	744.00	5,580,000	
インフォマート	36,900	659.00	24,317,100	
J Pホールディングス	26,000	334.00	8,684,000	
E P Sホールディングス	11,100	2,465.00	27,361,500	
プレステージ・インターナショナル	15,500	1,383.00	21,436,500	
アミューズ	5,000	3,055.00	15,275,000	
ドリームインキュベータ	3,100	2,278.00	7,061,800	
クイック	4,900	1,794.00	8,790,600	
ケネディクス	98,500	734.00	72,299,000	
電通	86,300	4,765.00	411,219,500	
テイクアンドギヴ・ニーズ	6,000	1,189.00	7,134,000	
ぴあ	2,500	6,970.00	17,425,000	
イオンファンタジー	2,500	4,925.00	12,312,500	
シーティーエス	8,500	798.00	6,783,000	
ネクシィーズグループ	3,200	1,871.00	5,987,200	
みらかホールディングス	21,400	4,910.00	105,074,000	
アルプス技研	3,400	4,500.00	15,300,000	
日本空調サービス	10,100	793.00	8,009,300	
オリエンタルランド	83,900	10,570.00	886,823,000	
ダスキン	19,800	2,984.00	59,083,200	
明光ネットワークジャパン	10,100	1,317.00	13,301,700	
ファルコホールディングス	5,500	1,763.00	9,696,500	
ラウンドワン	22,400	1,891.00	42,358,400	
リゾートトラスト	30,700	2,556.00	78,469,200	
ビー・エム・エル	9,200	2,812.00	25,870,400	
りらいあコミュニケーションズ	11,400	1,254.00	14,295,600	
リソー教育	13,600	889.00	12,090,400	
ユー・エス・エス	87,000	2,399.00	208,713,000	
サイバーエージェント	46,800	4,345.00	203,346,000	
楽天	364,500	1,030.50	375,617,250	
クリーク・アンド・リバー社	4,400	1,173.00	5,161,200	



テー・オー・ダブリュー	8,700	921.00	8,012,700	
セントラルスポーツ	3,100	4,295.00	13,314,500	
フルキャストホールディングス	6,300	2,205.00	13,891,500	
テクノプロ・ホールディングス	12,900	6,280.00	81,012,000	
イー・ガーディアン	4,100	2,652.00	10,873,200	
ジャパンマテリアル	6,600	3,790.00	25,014,000	
ベクトル	9,000	1,666.00	14,994,000	
I B J	6,600	1,090.00	7,194,000	
アサンテ	4,100	1,938.00	7,945,800	
N・フィールド	4,600	1,606.00	7,387,600	
バリューHR	1,100	5,050.00	5,555,000	
M&Aキャピタルパートナーズ	1,500	7,620.00	11,430,000	
アビスト	1,300	5,590.00	7,267,000	
ウィルグループ	3,700	1,735.00	6,419,500	
エスクロー・エージェント・ジャパン	11,000	588.00	6,468,000	
リクルートホールディングス	547,500	2,815.00	1,541,212,500	
日本郵政	401,800	1,304.00	523,947,200	
ベルシステム24ホールディングス	12,400	1,374.00	17,037,600	
エボラブルアジア	2,000	2,081.00	4,162,000	
ストライク	800	5,580.00	4,464,000	
ソラスト	4,800	2,758.00	13,238,400	
リログループ	38,900	2,983.00	116,038,700	
東祥	4,800	3,540.00	16,992,000	
エイチ・アイ・エス	11,000	3,970.00	43,670,000	
共立メンテナンス	12,600	4,560.00	57,456,000	
イチネンホールディングス	9,500	1,559.00	14,810,500	
建設技術研究所	7,000	1,199.00	8,393,000	
スペース	5,200	1,769.00	9,198,800	
東京テアトル	4,400	1,488.00	6,547,200	
ナガワ	1,600	4,860.00	7,776,000	
よみうりランド	2,100	4,995.00	10,489,500	

東京都競馬	5,500	4,440.00	24,420,000	
常磐興産	4,800	1,856.00	8,908,800	
カナモト	10,900	3,440.00	37,496,000	
東京ドーム	29,500	1,154.00	34,043,000	
西尾レントオール	6,300	3,640.00	22,932,000	
トランス・コスモス	7,900	2,807.00	22,175,300	
乃村工藝社	16,500	2,521.00	41,596,500	
藤田観光	3,400	3,575.00	12,155,000	
KNT - CTホールディングス	4,900	1,743.00	8,540,700	
日本管財	8,000	2,029.00	16,232,000	
トーカイ	3,600	4,950.00	17,820,000	
セコム	75,300	8,595.00	647,203,500	
セントラル警備保障	4,400	2,336.00	10,278,400	
丹青社	14,500	1,232.00	17,864,000	
メイテック	8,500	5,910.00	50,235,000	
アサツー ディ・ケイ	13,500	3,625.00	48,937,500	
応用地質	9,000	1,472.00	13,248,000	
船井総研ホールディングス	9,900	3,790.00	37,521,000	
オオバ	10,400	510.00	5,304,000	
ベネッセホールディングス	26,100	4,030.00	105,183,000	
イオンディライト	8,500	4,190.00	35,615,000	
ナック	7,200	969.00	6,976,800	
ニチイ学館	14,000	1,463.00	20,482,000	
ダイセキ	12,700	3,080.00	39,116,000	
合 計	89,136,800		192,479,364,690	

## (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 &lt; 適格機関投資家限定 &gt;

## 貸借対照表

(単位：円)

	(平成28年12月19日現在)	(平成29年12月19日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
金銭信託	1,723	5,620
コール・ローン	2,433	6,949
親投資信託受益証券	33,685,920,979	32,281,902,133
未収入金	-	2,099,999
流動資産合計	33,685,925,135	32,284,014,701
資産合計	33,685,925,135	32,284,014,701
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	-	2,099,999
未払受託者報酬	4,357,700	4,309,702
未払委託者報酬	4,357,643	4,309,643
その他未払費用	486,017	486,000
流動負債合計	9,201,360	11,205,344
負債合計	9,201,360	11,205,344
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	26,284,958,851	25,080,240,082
剰余金		
剰余金又は欠損金( )	7,391,764,924	7,192,569,275
元本等合計	33,676,723,775	32,272,809,357
純資産合計	33,676,723,775	32,272,809,357
負債純資産合計	33,685,925,135	32,284,014,701

## 注記表

## （重要な会計方針の注記）

項 目	自 平成29年 6月21日 至 平成29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28年12月19日現在）	（平成29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	26,284,958,851口	25,080,240,082口
2. 1単位当たり純資産の額	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)	1口当たり純資産額 1.2868円 (10,000口当たりの純資産額 12,868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29年 6月21日 至 平成29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29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29年 6月21日 至 平成29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28年12月19日現在)	(平成29年12月19日現在)
期首元本額	25,082,572,318円	25,180,303,864円
期中追加設定元本額	1,976,421,861円	1,050,937,196円
期中一部解約元本額	774,035,328円	1,151,000,978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 - BPI）マザーファンド	23,242,783,594	32,281,902,133	
合計		23,242,783,594	32,281,902,133	

## デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## （参考）

S M A M ・年金国内債券パッシブファンド＜適格機関投資家限定＞は、「国内債券（N O M U R A - B P I）マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同マザーファンドの受益証券です。

なお、以下に記載した状況は、監査の対象外です。

## 国内債券（N O M U R A - B P I）マザーファンド

## 貸借対照表

	（単位：円）	
	（平成28年12月19日現在）	（平成29年12月19日現在）
<b>資産の部</b>		
流動資産		
金銭信託	298,302,534	229,024,233
コール・ローン	421,338,739	283,208,063
国債証券	87,229,070,140	84,674,149,610
地方債証券	8,565,085,580	8,744,347,600
特殊債券	12,397,365,037	10,400,372,316
社債券	4,973,357,000	4,944,492,000
未収入金	-	94,661,200
未収利息	421,237,380	380,702,190
前払費用	10,392,333	4,867,871
流動資産合計	114,316,148,743	109,755,825,083
資産合計	114,316,148,743	109,755,825,083
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	28,071,898	146,106,272
未払利息	1,112	784
その他未払費用	12,758	141
流動負債合計	28,085,768	146,107,197
負債合計	28,085,768	146,107,197
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	82,693,627,894	78,917,892,696
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	31,594,435,081	30,691,825,190
元本等合計	114,288,062,975	109,609,717,886
純資産合計	114,288,062,975	109,609,717,886
負債純資産合計	114,316,148,743	109,755,825,083

## 注記表

## （重要な会計方針の注記）

項 目	自 平成29年 6月21日 至 平成29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28年12月19日現在）	（平成29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	82,693,627,894口	78,917,892,696口
2. 1単位当たり純資産の額	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)	1口当たり純資産額 1.3889円 (10,000口当たりの純資産額 13,889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29年 6月21日 至 平成29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29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29年 6月21日
至 平成29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

(平成29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	80,438,898,647円
同期中における追加設定元本額	4,039,747,833円
同期中における一部解約元本額	5,560,753,784円
平成29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	42,279,276,152円
S M A M ・国内債券インデックス・ファンド	13,281,876,866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>	113,956,084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>	23,242,783,594円
合計	78,917,892,696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123回利付国債(5年)	599,000,000	602,234,600	
	第124回利付国債(5年)	370,000,000	372,175,600	
	第125回利付国債(5年)	1,230,000,000	1,237,970,400	
	第126回利付国債(5年)	380,000,000	382,686,600	
	第127回利付国債(5年)	1,335,000,000	1,344,999,150	
	第128回利付国債(5年)	1,185,000,000	1,194,361,500	
	第129回利付国債(5年)	455,000,000	458,853,850	
	第130回利付国債(5年)	1,290,000,000	1,301,390,700	
	第131回利付国債(5年)	955,000,000	963,747,800	
	第132回利付国債(5年)	775,000,000	782,703,500	
	第133回利付国債(5年)	450,000,000	454,725,000	
	第2回利付国債(40年)	162,000,000	223,436,880	
	第3回利付国債(40年)	135,000,000	187,039,800	
	第4回利付国債(40年)	210,000,000	292,189,800	
	第5回利付国債(40年)	197,000,000	263,375,210	
	第6回利付国債(40年)	210,000,000	275,018,100	
	第7回利付国債(40年)	230,000,000	287,352,800	
	第8回利付国債(40年)	265,000,000	305,796,750	
	第9回利付国債(40年)	366,000,000	303,567,720	
	第10回利付国債(40年)	275,000,000	270,679,750	
第305回利付国債(10年)	640,000,000	658,457,600		
第306回利付国債(10年)	1,310,000,000	1,355,247,400		
第308回利付国債(10年)	505,000,000	523,079,000		
第309回利付国債(10年)	640,000,000	659,705,600		

第310回利付国債(10年)	1,235,000,000	1,273,309,700	
第312回利付国債(10年)	985,000,000	1,024,262,100	
第313回利付国債(10年)	1,020,000,000	1,067,338,200	
第315回利付国債(10年)	1,165,000,000	1,218,986,100	
第317回利付国債(10年)	1,100,000,000	1,150,732,000	
第319回利付国債(10年)	590,000,000	618,910,000	
第320回利付国債(10年)	575,000,000	600,863,500	
第321回利付国債(10年)	395,000,000	413,869,150	
第322回利付国債(10年)	460,000,000	480,010,000	
第323回利付国債(10年)	295,000,000	308,531,650	
第324回利付国債(10年)	545,000,000	567,535,750	
第325回利付国債(10年)	345,000,000	359,983,350	
第326回利付国債(10年)	620,000,000	645,234,000	
第327回利付国債(10年)	570,000,000	596,060,400	
第328回利付国債(10年)	900,000,000	933,696,000	
第329回利付国債(10年)	850,000,000	892,517,000	
第330回利付国債(10年)	720,000,000	757,461,600	
第332回利付国債(10年)	695,000,000	724,127,450	
第333回利付国債(10年)	880,000,000	918,121,600	
第334回利付国債(10年)	595,000,000	621,620,300	
第335回利付国債(10年)	795,000,000	826,283,250	
第336回利付国債(10年)	415,000,000	431,782,600	
第337回利付国債(10年)	355,000,000	364,361,350	
第338回利付国債(10年)	817,000,000	844,949,570	
第339回利付国債(10年)	1,100,000,000	1,138,093,000	
第340回利付国債(10年)	788,000,000	815,580,000	
第341回利付国債(10年)	710,000,000	729,659,900	
第342回利付国債(10年)	860,000,000	869,597,600	
第343回利付国債(10年)	1,117,000,000	1,128,884,880	
第344回利付国債(10年)	1,125,000,000	1,136,328,750	
第345回利付国債(10年)	885,000,000	893,363,250	

第346回利付国債(10年)	975,000,000	983,550,750	
第347回利付国債(10年)	795,000,000	801,407,700	
第348回利付国債(10年)	795,000,000	800,795,550	
第2回利付国債(30年)	150,000,000	190,897,500	
第4回利付国債(30年)	160,000,000	215,609,600	
第5回利付国債(30年)	100,000,000	126,451,000	
第7回利付国債(30年)	180,000,000	232,133,400	
第10回利付国債(30年)	230,000,000	257,195,200	
第11回利付国債(30年)	150,000,000	181,363,500	
第12回利付国債(30年)	230,000,000	292,254,100	
第14回利付国債(30年)	250,000,000	330,292,500	
第15回利付国債(30年)	250,000,000	334,870,000	
第16回利付国債(30年)	195,000,000	261,740,700	
第18回利付国債(30年)	190,000,000	249,439,600	
第19回利付国債(30年)	160,000,000	210,395,200	
第21回利付国債(30年)	102,000,000	134,422,740	
第22回利付国債(30年)	149,000,000	201,687,890	
第23回利付国債(30年)	151,000,000	204,552,150	
第24回利付国債(30年)	135,000,000	183,323,250	
第25回利付国債(30年)	185,000,000	244,682,850	
第26回利付国債(30年)	219,000,000	294,110,430	
第27回利付国債(30年)	206,000,000	281,058,160	
第28回利付国債(30年)	271,000,000	370,635,860	
第29回利付国債(30年)	190,000,000	257,134,600	
第30回利付国債(30年)	285,000,000	381,318,600	
第31回利付国債(30年)	307,000,000	405,786,460	
第32回利付国債(30年)	327,000,000	440,413,410	
第33回利付国債(30年)	380,000,000	489,421,000	
第34回利付国債(30年)	369,000,000	491,943,420	
第35回利付国債(30年)	395,000,000	510,474,300	
第36回利付国債(30年)	200,000,000	258,988,000	

第37回利付国債(30年)	375,000,000	477,986,250	
第38回利付国債(30年)	300,000,000	376,038,000	
第39回利付国債(30年)	180,000,000	229,964,400	
第40回利付国債(30年)	215,000,000	269,831,450	
第41回利付国債(30年)	200,000,000	246,428,000	
第42回利付国債(30年)	260,000,000	320,486,400	
第43回利付国債(30年)	190,000,000	234,298,500	
第44回利付国債(30年)	282,000,000	347,883,660	
第45回利付国債(30年)	292,000,000	346,218,560	
第46回利付国債(30年)	295,000,000	349,796,250	
第47回利付国債(30年)	305,000,000	369,144,550	
第48回利付国債(30年)	330,000,000	382,780,200	
第49回利付国債(30年)	315,000,000	365,333,850	
第50回利付国債(30年)	325,000,000	327,639,000	
第51回利付国債(30年)	307,000,000	269,813,090	
第52回利付国債(30年)	307,000,000	285,138,530	
第53回利付国債(30年)	267,000,000	254,429,640	
第54回利付国債(30年)	235,000,000	235,836,600	
第55回利付国債(30年)	335,000,000	335,800,650	
第56回利付国債(30年)	315,000,000	315,378,000	
第46回利付国債(20年)	289,000,000	305,897,830	
第48回利付国債(20年)	368,000,000	397,208,160	
第50回利付国債(20年)	223,000,000	237,771,520	
第52回利付国債(20年)	210,000,000	227,564,400	
第54回利付国債(20年)	275,000,000	300,624,500	
第56回利付国債(20年)	320,000,000	350,585,600	
第58回利付国債(20年)	300,000,000	328,779,000	
第59回利付国債(20年)	280,000,000	305,466,000	
第61回利付国債(20年)	140,000,000	148,156,400	
第63回利付国債(20年)	156,000,000	172,331,640	
第64回利付国債(20年)	210,000,000	234,213,000	

第65回利付国債(20年)	370,000,000	414,396,300	
第69回利付国債(20年)	200,000,000	227,430,000	
第70回利付国債(20年)	380,000,000	441,533,400	
第72回利付国債(20年)	300,000,000	344,136,000	
第74回利付国債(20年)	388,000,000	447,201,040	
第75回利付国債(20年)	230,000,000	266,142,200	
第78回利付国債(20年)	340,000,000	390,177,200	
第82回利付国債(20年)	288,000,000	336,159,360	
第84回利付国債(20年)	424,000,000	493,196,800	
第85回利付国債(20年)	332,000,000	390,601,320	
第88回利付国債(20年)	329,000,000	394,122,260	
第90回利付国債(20年)	418,000,000	499,100,360	
第92回利付国債(20年)	295,000,000	350,893,650	
第93回利付国債(20年)	242,000,000	286,738,540	
第95回利付国債(20年)	186,000,000	226,406,640	
第97回利付国債(20年)	400,000,000	484,836,000	
第99回利付国債(20年)	337,000,000	406,529,840	
第100回利付国債(20年)	310,000,000	378,119,400	
第102回利付国債(20年)	285,000,000	354,742,350	
第105回利付国債(20年)	337,000,000	410,196,400	
第107回利付国債(20年)	418,000,000	510,323,660	
第109回利付国債(20年)	335,000,000	402,716,900	
第111回利付国債(20年)	413,000,000	511,859,810	
第113回利付国債(20年)	515,000,000	633,862,000	
第114回利付国債(20年)	373,000,000	460,345,410	
第116回利付国債(20年)	350,000,000	437,314,500	
第118回利付国債(20年)	305,000,000	374,439,350	
第119回利付国債(20年)	180,000,000	216,561,600	
第121回利付国債(20年)	180,000,000	219,128,400	
第122回利付国債(20年)	290,000,000	349,415,200	
第123回利付国債(20年)	125,000,000	155,677,500	

第124回利付国債(20年)	190,000,000	234,213,000	
第125回利付国債(20年)	155,000,000	195,499,950	
第126回利付国債(20年)	195,000,000	240,906,900	
第127回利付国債(20年)	185,000,000	226,160,650	
第128回利付国債(20年)	270,000,000	330,534,000	
第129回利付国債(20年)	150,000,000	181,657,500	
第130回利付国債(20年)	270,000,000	327,580,200	
第131回利付国債(20年)	225,000,000	269,975,250	
第132回利付国債(20年)	270,000,000	324,261,900	
第133回利付国債(20年)	275,000,000	334,226,750	
第134回利付国債(20年)	128,000,000	155,823,360	
第135回利付国債(20年)	145,000,000	174,397,300	
第136回利付国債(20年)	205,000,000	243,734,750	
第137回利付国債(20年)	130,000,000	156,587,600	
第138回利付国債(20年)	130,000,000	152,838,400	
第139回利付国債(20年)	140,000,000	166,555,200	
第140回利付国債(20年)	580,000,000	699,120,400	
第141回利付国債(20年)	180,000,000	217,099,800	
第142回利付国債(20年)	180,000,000	219,852,000	
第143回利付国債(20年)	175,000,000	208,771,500	
第144回利付国債(20年)	180,000,000	211,950,000	
第145回利付国債(20年)	402,000,000	486,054,180	
第146回利付国債(20年)	300,000,000	363,156,000	
第147回利付国債(20年)	610,000,000	729,377,000	
第148回利付国債(20年)	332,000,000	391,584,040	
第149回利付国債(20年)	337,000,000	397,747,620	
第150回利付国債(20年)	385,000,000	448,598,150	
第151回利付国債(20年)	605,000,000	684,751,100	
第152回利付国債(20年)	440,000,000	497,582,800	
第153回利付国債(20年)	452,000,000	518,516,320	
第154回利付国債(20年)	505,000,000	570,528,800	



	第155回利付国債(20年)	405,000,000	443,191,500	
	第156回利付国債(20年)	425,000,000	419,645,000	
	第157回利付国債(20年)	463,000,000	439,479,600	
	第158回利付国債(20年)	415,000,000	415,000,000	
	第159回利付国債(20年)	438,000,000	444,824,040	
	第160回利付国債(20年)	435,000,000	449,089,650	
	第161回利付国債(20年)	505,000,000	510,792,350	
	第162回利付国債(20年)	355,000,000	358,159,500	
国債証券合計		76,800,000,000	84,674,149,610	
地方債証券	第1回東京都公募公債(20年)	200,000,000	216,586,000	
	第7回東京都公募公債(20年)	100,000,000	116,066,000	
	第8回東京都公募公債(30年)	100,000,000	127,710,000	
	第13回東京都公募公債(30年)	200,000,000	246,434,000	
	第668回東京都公募公債	200,000,000	203,770,000	
	第681回東京都公募公債	200,000,000	206,150,000	
	平成20年度第7回北海道公募公債	200,000,000	202,592,000	
	平成29年度第6回北海道公募公債(5年)	200,000,000	199,768,000	
	第7回神奈川県公募公債(20年)	200,000,000	237,756,000	
	第59回神奈川県公募公債(5年)	100,000,000	100,209,000	
	第164回神奈川県公募公債	100,000,000	102,237,000	
	第192回神奈川県公募公債	100,000,000	103,654,000	
	第89回大阪府公募公債(5年)	100,000,000	100,003,000	
	第311回大阪府公募公債(10年)	150,000,000	150,480,000	
	第333回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	102,901,000	
	第361回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	103,997,000	
	第5回兵庫県公募公債(15年)	100,000,000	111,116,000	
	第9回兵庫県公募公債(20年)	100,000,000	122,301,000	
	平成21年度第3回兵庫県公募公債	100,000,000	102,260,000	
	第7回静岡県公募公債(30年)	100,000,000	124,761,000	
	平成20年度第1回静岡県公募公債	100,000,000	116,042,000	
	平成21年度第10回静岡県公募公債	100,000,000	103,072,000	

平成20年度第10回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	101,838,000	
平成21年度第2回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	102,200,000	
平成21年度第7回愛知県公募公債（10年）	200,000,000	205,086,000	
平成21年度第8回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	102,421,000	
平成26年度第14回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	103,292,000	
平成26年度第18回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	102,634,000	
平成26年度第1回広島県公募公債	100,000,000	103,977,000	
平成21年度第2回埼玉県公募公債	246,000,000	251,436,600	
平成26年度第4回埼玉県公募公債	100,000,000	103,923,000	
平成27年度第2回埼玉県公募公債（5年）	100,000,000	100,248,000	
平成24年度第10回福岡県公募公債	100,000,000	100,016,000	
平成25年度第5回福岡県公募公債	200,000,000	200,338,000	
平成25年度第11回福岡県公募公債	100,000,000	104,005,000	
平成26年度第5回福岡県公募公債	100,000,000	103,196,000	
平成20年度第8回千葉県公募公債	100,000,000	101,719,000	
平成21年度第1回千葉県公募公債	100,000,000	102,021,000	
平成26年度第3回千葉県公募公債	100,000,000	103,688,000	
平成20年度第2回新潟県公募公債	100,000,000	101,775,000	
第66回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,165,000	
第69回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,555,000	
第75回共同発行市場公募地方債	300,000,000	307,317,000	
第76回共同発行市場公募地方債	200,000,000	204,376,000	
第78回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,402,000	
第79回共同発行市場公募地方債	200,000,000	204,842,000	
第82回共同発行市場公募地方債	200,000,000	205,830,000	
第84回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,052,000	
第91回共同発行市場公募地方債	300,000,000	307,398,000	
第115回共同発行市場公募地方債	300,000,000	311,139,000	
第137回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,399,000	
第140回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,083,000	
第154回共同発行市場公募地方債	150,000,000	153,489,000	

	平成21年度第4回大阪市公募公債	200,000,000	205,304,000	
	第464回名古屋市公募公債(10年)	100,000,000	101,190,000	
	平成21年度第1回京都市公募公債	100,000,000	102,560,000	
	平成23年度第4回京都市公募公債	100,000,000	104,131,000	
	第16回横浜市公募公債(20年)	100,000,000	122,252,000	
	平成20年度第3回横浜市公募公債	300,000,000	303,294,000	
	平成27年度第5回福岡市公募公債	100,000,000	102,891,000	
地方債証券合計		8,346,000,000	8,744,347,600	
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	507,135,000	
	第9回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	101,000,000	103,863,350	
	第15回政府保証日本政策投資銀行債券	100,000,000	108,147,000	
	第22回政府保証日本政策投資銀行債券	100,000,000	112,281,000	
	第4回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	133,408,000	
	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	212,318,000	
	第22回日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	285,186,000	
	第27回道路債券	100,000,000	114,622,000	
	第32回道路債券	100,000,000	115,852,000	
	第37回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	122,330,000	
	第38回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,937,000	
	第42回道路債券	100,000,000	115,258,000	
	第42回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,629,000	
	第77回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,664,000	
	第79回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	120,958,000	
	第92回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	121,532,000	
	第99回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	122,866,000	
	第100回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,151,000	
第104回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	206,782,000		
第112回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,969,000		

第120回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,672,000	
第207回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	208,538,000	
第2回政府保証地方公営企業等金融機構債券	100,000,000	101,487,000	
第3回政府保証地方公共団体金融機構債券	700,000,000	717,822,000	
第4回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,317,000	
第4回公営企業債券(20年)	200,000,000	223,342,000	
第4回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,284,000	
第5回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,262,000	
第8回政府保証地方公営企業等金融機構債券	100,000,000	102,192,000	
第9回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	206,432,000	
第12回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,340,000	
第14回政府保証地方公共団体金融機構債券(6年)	200,000,000	201,168,000	
第16回地方公共団体金融機構債券(5年)	100,000,000	100,307,000	
第18回公営企業債券(20年)	100,000,000	120,492,000	
第22回公営企業債券(20年)	200,000,000	240,182,000	
第39回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,503,000	
第61回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,958,000	
第5回政府保証日本政策金融公庫債券	100,000,000	102,331,000	
第34回株式会社日本政策金融公庫社債	100,000,000	100,111,000	
第30回国際協力銀行債券	100,000,000	100,465,000	
第13回関西国際空港株式会社社債	100,000,000	101,294,000	
第6回独立行政法人福祉医療機構債券	100,000,000	114,455,000	
第199回政府保証預金保険機構債	100,000,000	100,111,000	
第203回政府保証預金保険機構債	200,000,000	200,560,000	
第208回政府保証預金保険機構債	400,000,000	401,500,000	
第1回貸付債権担保住宅金融公庫債券	10,145,000	10,188,724	
第1回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	15,193,000	15,701,053	
第1回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	17,905,000	19,008,485	
第2回貸付債権担保住宅金融公庫債券	9,831,000	9,874,256	
第2回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	15,539,000	16,117,361	

第 5 回貸付債権担保 S 種住宅金融公庫債券	15,740,000	16,396,830	
第 7 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	10,906,000	11,031,637	
第 9 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	11,828,000	12,012,871	
第 9 回貸付債権担保 S 種住宅金融公庫債券	17,419,000	18,504,029	
第 1 0 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	12,724,000	12,997,566	
第 1 0 回貸付債権担保 S 種住宅金融公庫債券	17,777,000	18,896,239	
第 1 2 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	13,824,000	14,242,867	
第 1 4 回貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券	22,191,000	22,888,019	
第 1 8 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	14,566,000	15,086,151	
第 2 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	36,444,000	39,149,238	
第 3 0 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	16,194,000	16,740,223	
第 3 2 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	19,287,000	20,073,909	
第 3 2 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	35,780,000	38,193,718	
第 3 5 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	19,837,000	20,758,031	
第 3 7 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	18,839,000	19,739,880	
第 3 7 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	39,744,000	42,068,626	
第 4 0 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	20,860,000	22,081,561	
第 4 2 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	17,883,000	19,000,687	
第 4 8 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	17,642,000	18,753,269	
第 4 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	41,077,000	43,718,251	
第 5 1 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	45,083,000	47,842,530	
第 5 5 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	56,572,000	59,643,859	
第 5 7 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	54,018,000	56,998,173	
第 5 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	55,342,000	58,415,141	
第 6 7 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	62,527,000	65,106,238	
第 6 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	64,286,000	67,614,729	
第 7 0 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	57,488,000	60,279,617	
第 7 3 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	63,830,000	67,292,139	
第 8 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	67,712,000	70,091,399	
第 1 1 3 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	95,327,000	95,354,644	
第 1 2 3 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	98,819,000	99,388,197	

	第124回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	99,125,000	99,364,882
	第125回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	99,466,000	99,692,782
	第130回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	118,619,000
	第2回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	19,422,000	20,596,836
	第3回貸付債権担保5種住宅金融支援機構債券	18,817,000	20,065,319
	い第776号商工債	100,000,000	100,105,000
	い第752号農林債	400,000,000	400,116,000
	い第753号農林債	100,000,000	100,043,000
	第281回信金中金債(5年)	100,000,000	100,080,000
	第298回信金中金債(5年)	200,000,000	200,478,000
	第304回信金中金債(5年)	200,000,000	200,724,000
	第184号商工債(3年)	100,000,000	100,034,000
	第195号商工債(3年)	200,000,000	199,810,000
	第16回政府保証東日本高速道路債券	200,000,000	203,380,000
特殊債券合計		9,848,009,000	10,400,372,316
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	100,196,000
	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	100,327,000
	第21回コーペラティブ・セントラル・ライフイゼン・ポエレンリーバンク・ピー・エー	100,000,000	100,272,000
	第13回大和ハウス工業株式会社無担保社債	100,000,000	100,112,000
	第10回アサヒグループホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	100,089,000
	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	100,409,000
	第30回東レ株式会社無担保社債	100,000,000	99,129,000
	第56回住友化学株式会社無担保社債	100,000,000	99,739,000
	第15回旭硝子株式会社無担保社債	100,000,000	99,954,000
	第3回新日鐵住金株式会社無担保社債	100,000,000	100,118,000
	第11回株式会社小松製作所無担保社債	100,000,000	100,077,000
	第44回三菱電機株式会社無担保社債	100,000,000	100,218,000
	第12回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	100,632,000
	第13回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	101,612,000

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	100,457,000	
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	100,422,000	
第1回ユニ・ファミリーマートホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	100,145,000	
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	100,429,000	
第25回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	100,000,000	103,145,000	
第57回株式会社東京三菱銀行無担保社債	100,000,000	110,174,000	
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	102,461,000	
第4回株式会社りそな銀行無担保社債	100,000,000	103,802,000	
第9回三菱UFJ信託銀行株式会社無担保社債	100,000,000	104,602,000	
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	103,083,000	
第20回株式会社三井住友銀行無担保社債	100,000,000	103,203,000	
第70回日立キャピタル株式会社無担保社債	100,000,000	100,025,000	
第48回三菱UFJリース株式会社無担保社債	100,000,000	99,898,000	
第65回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	119,872,000	
第38回京王電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	99,875,000	
第24回東日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	107,719,000	
第32回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	113,338,000	
第69回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	103,057,000	
第10回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	111,129,000	
第7回東海旅客鉄道株式会社社債	100,000,000	109,273,000	
第13回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	111,393,000	
第63回日本電信電話株式会社電信電話債券	100,000,000	102,705,000	
第19回KDDI株式会社無担保社債	100,000,000	102,339,000	
第457回東京電力株式会社社債	100,000,000	101,753,000	
第528回東京電力株式会社社債	100,000,000	102,565,000	
第536回東京電力株式会社社債	100,000,000	100,173,000	
第499回中部電力株式会社社債	100,000,000	105,474,000	
第507回中部電力株式会社社債	100,000,000	102,370,000	
第448回関西電力株式会社社債	100,000,000	101,080,000	

第476回東北電力株式会社社債	100,000,000	101,980,000	
第253回四国電力株式会社社債	100,000,000	104,473,000	
第328回北海道電力株式会社社債	100,000,000	100,820,000	
第38回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	104,392,000	
第19回大阪瓦斯株式会社無担保社債	100,000,000	103,982,000	
社債券合計	4,800,000,000	4,944,492,000	
合計		108,763,361,526	

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28年12月20日現在)	(平成29年12月20日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
金銭信託	104	174,217
コール・ローン	4,886	5,113,507
親投資信託受益証券	18,048,564,518	11,341,567,642
未収入金	279,169,989	36,749,988
流動資産合計	18,327,739,497	11,383,605,354
資産合計	18,327,739,497	11,383,605,354
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	279,169,989	36,749,988
未払受託者報酬	589,000	372,374
未払委託者報酬	214,171	135,402
未払利息	-	13
その他未払費用	37,460	37,466
流動負債合計	280,010,620	37,295,243
負債合計	280,010,620	37,295,243
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	7,896,547,097	4,221,145,371
剰余金		
剰余金又は欠損金( )	10,151,181,780	7,125,164,740
元本等合計	18,047,728,877	11,346,310,111
純資産合計	18,047,728,877	11,346,310,111
負債純資産合計	18,327,739,497	11,383,605,354

## 注記表

## （重要な会計方針の注記）

項 目	自 平成29年12月 1日 至 平成29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28年12月20日現在）	（平成29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	7,896,547,097口	4,221,145,371口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 2.2855円 (10,000口当たりの純資産額 22,855円)	1口当たり純資産額 2.6880円 (10,000口当たりの純資産額 26,880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29年12月 1日 至 平成29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	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29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（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29年12月 1日 至 平成29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28年12月20日現在)	(平成29年12月20日現在)
期首元本額	8,355,446,305円	4,392,336,284円
期中追加設定元本額	-円	471,745円
期中一部解約元本額	458,899,208円	171,662,658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	3,271,197,151	11,341,567,642	
合計		3,271,197,151	11,341,567,642	

## 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28年12月20日現在）	（平成29年12月20日現在）
<b>資産の部</b>		
流動資産		
預金	-	3,573,223,298
金銭信託	52,862,229	7,812,744
コール・ローン	2,493,500,168	229,315,029
株式	164,241,513,059	186,044,625,761
投資証券	4,139,703,818	4,504,991,956
派生商品評価勘定	14,709,818	47,349,447
未収入金	2,184,411,192	1,896,480
未収配当金	225,309,843	222,888,605
差入委託証拠金	1,950,673,312	2,194,526,974
流動資産合計	175,302,683,439	196,826,630,294
資産合計	175,302,683,439	196,826,630,294
<b>負債の部</b>		
流動負債		
派生商品評価勘定	417,144	503,600
前受金	13,776,635	47,258,447
未払金	983,681,225	-
未払解約金	2,532,175,876	257,581,634
未払利息	6,255	624
その他未払費用	7,863	643
流動負債合計	3,530,064,998	305,344,948
負債合計	3,530,064,998	305,344,948
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	58,294,769,147	56,682,258,401
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	113,477,849,294	139,839,026,945
元本等合計	171,772,618,441	196,521,285,346
純資産合計	171,772,618,441	196,521,285,346

負債純資産合計

175,302,683,439

196,826,630,294

## 注記表

## （重要な会計方針の注記）

項目	自 平成29年12月 1日 至 平成29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28年12月20日現在）		（平成29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	58,294,769,147口		56,682,258,401口	
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額	2.9466円	1口当たり純資産額	3.4671円
	(10,000口当たりの純資産額)	29,466円)	(10,000口当たりの純資産額)	34,671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29年12月 1日 至 平成29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、株式、投資証券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。 当計算期間については、先物取引、為替予約取引を行っております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2)金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>
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29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（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
	イスラエルシェケル	4,547,430	-	4,548,000	570

合計	3,479,138,695	-	3,492,399,291	14,292,674
----	---------------	---	---------------	------------

（平成29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	4,807,693,196	-	4,854,951,643	47,258,447
	SPMINI 1803	3,285,219,849	-	3,320,289,408	35,069,559
	DJ EUR 1803	901,905,148	-	908,005,972	6,100,824
	FTSE 1803	336,153,597	-	339,698,268	3,544,671
	SPI200 1803	284,414,602	-	286,957,995	2,543,393
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	1,368,859,500	-	1,369,272,100	412,600
	米ドル	939,564,800	-	939,752,200	187,400
	カナダドル	49,139,200	-	49,151,200	12,000
	ユーロ	179,150,800	-	179,278,600	127,800
	英ポンド	92,259,500	-	92,299,100	39,600
	スイスフラン	41,264,700	-	41,281,200	16,500
	スウェーデンクローナ	13,698,900	-	13,719,000	20,100
	ノルウェークローネ	3,243,800	-	3,244,800	1,000
	デンマーククローネ	9,156,300	-	9,169,800	13,500
	オーストラリアドル	14,702,900	-	14,703,500	600
	ニュージーランドドル	788,100	-	788,200	100
	香港ドル	18,346,300	-	18,338,800	7,500
	シンガポールドル	7,544,200	-	7,545,700	1,500
	合計	6,176,552,696	-	6,224,223,743	46,845,847

（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29年12月 1日 至 平成29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・DC外国株式インデックスファンドS	9,969,952,133円
三井住友・DC年金バランス30（債券重点型）	212,285,026円
三井住友・DC年金バランス50（標準型）	901,148,591円
三井住友・DC年金バランス70（株式重点型）	614,153,063円
SMAM・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・DCターゲットイヤーファンド2020	3,182,251円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2025	8,454,317円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2030	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・外国株式パッシブ・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

(平成29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	58,029,292,656円
同期中における追加設定元本額	73,035,566円
同期中における一部解約元本額	1,420,069,821円
平成29年12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	11,488,943,325円
三井住友・DC年金バランス30（債券重点型）	240,066,930円
三井住友・DC年金バランス50（標準型）	1,007,745,686円
三井住友・DC年金バランス70（株式重点型）	687,646,481円
SMAM・グローバルバランスファンド（機動的資産配分型）	65,764,018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）	2,795,730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）	8,257,320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）	24,251,129円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2035（4資産タイプ）	33,378,458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）	20,175,724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）	57,014,905円
外国株式指数ファンド	436,142,119円
三井住友・DCつみたてNISA・全海外株インデックスファンド	1,584,251,991円
アセットアロケーション・ファンド（安定型）	460,424,190円
アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）	505,026,299円
アセットアロケーション・ファンド（成長型）	451,757,957円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2050	2,501,205円
三井住友・資産最適化ファンド（1安定重視型）	75,581円
三井住友・資産最適化ファンド（2やや安定型）	575,062円
三井住友・資産最適化ファンド（3バランス型）	2,783,876円
三井住友・資産最適化ファンド（4やや成長型）	9,441,396円
三井住友・資産最適化ファンド（5成長重視型）	13,105,280円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	1,677,115円
SMAM・外国株式パッシブ・ファンド（適格機関投資家専用）	3,271,197,151円

バランスファンドVA(安定運用型) <適格機関投資家限定>	13,270,935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>	1,370,190,084円
SMAM・バランスファンドVA25 <適格機関投資家専用>	2,199,767,241円
SMAM・バランスファンドVA37.5 <適格機関投資家専用>	1,865,442,606円
SMAM・バランスファンドVA50 <適格機関投資家専用>	7,874,889,399円
SMAM・バランスファンドVL30 <適格機関投資家限定>	23,772,348円
SMAM・バランスファンドVL50 <適格機関投資家限定>	129,240,251円
世界6資産バランスファンドVA <適格機関投資家限定>	954,047円
SMAM・バランスファンドVA75 <適格機関投資家専用>	986,017,627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>	77,947,358円
SMAM・インデックス・バランスVA25 <適格機関投資家専用>	211,371,159円
SMAM・インデックス・バランスVA50 <適格機関投資家専用>	921,052,665円
SMAM・バランスファンドVA40 <適格機関投資家専用>	1,122,090,149円
SMAM・バランスファンドVA35 <適格機関投資家専用>	2,058,670,737円
SMAM・バランスVA株40T <適格機関投資家限定>	68,486,181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)	945,385,809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)	1,207,165,480円
SMAM・グローバルバランス40VA <適格機関投資家限定>	179,874,370円
SMAM・バランスファンドVA20 <適格機関投資家専用>	91,754,518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)	1,405,010,422円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A <適格機関投資家専用>	30,229,026円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A <適格機関投資家専用>	16,976,371円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A <適格機関投資家専用>	8,024,832円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L <適格機関投資家専用>	59,519,416円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L <適格機関投資家専用>	139,324,192円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T <適格機関投資家専用>	135,500,059円
SMAM・グローバルバランスファンド(標準型)VA <適格機関投資家限定>	1,479,212,088円
SMAM・グローバルバランスファンド(債券重視型)VA <適格機関投資家限定>	226,775,783円
SMAM・世界バランスファンドVA <適格機関投資家限定>	7,643,309,867円
SMAM・世界バランスファンドVA2 <適格機関投資家限定>	1,183,995,641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>	2,368,095,606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>	190,295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>	108,687,095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>	52,067,293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>	102,998,523円
合計	56,682,258,401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	25,836	49.39	1,276,040.04	
	ANDEAVOR	6,701	110.38	739,656.38	
	ANTERO RESOURCES CORP	9,233	18.00	166,194.00	
	APACHE CORPORATION	18,392	40.25	740,278.00	
	BAKER HUGHES A GE CO	19,422	31.83	618,202.26	
	CABOT OIL & GAS CORPORATION	22,544	26.82	604,630.08	

CHENIERE ENERGY INC	9,800	49.28	482,944.00
CHEVRON CORPORATION	86,819	119.84	10,404,388.96
CIMAREX ENERGY CO	4,080	113.05	461,244.00
CONCHO RESOURCES INC	6,589	140.31	924,502.59
CONOCOPHILLIPS	55,881	52.68	2,943,811.08
CONTINENTAL RESOURCES, INC.	4,535	48.35	219,267.25
DEVON ENERGY CORPORATION	22,056	38.70	853,567.20
DIAMONDBACK ENERGY INC	4,270	111.81	477,428.70
EOG RESOURCES INC	26,182	101.43	2,655,640.26
EQT CORPORATION	11,310	54.42	615,490.20
EXXON MOBIL CORPORATION	194,160	82.44	16,006,550.40
HALLIBURTON CO	39,283	45.87	1,801,911.21
HELMERICH & PAYNE INC	5,249	59.60	312,840.40
HESS CORPORATION	12,398	43.36	537,577.28
HOLLYFRONTIER CORP	8,311	47.59	395,520.49
KINDER MORGAN INC	92,715	17.92	1,661,452.80
MARATHON OIL CORP	36,817	16.02	589,808.34
MARATHON PETROLEUM CORPORATION	23,452	64.75	1,518,517.00
NATIONAL-OILWELL VARCO INC.	16,848	33.62	566,429.76
NEWFIELD EXPLORATION CO	8,254	29.84	246,299.36
NOBLE ENERGY INC	20,924	27.23	569,760.52
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	35,678	70.90	2,529,570.20
ONEOK INC	16,822	51.86	872,388.92
PARSLEY ENERGY INC-CLASS A	9,208	26.84	247,142.72
PHILLIPS 66	20,398	99.14	2,022,257.72
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	8,061	160.20	1,291,372.20
PLAINS GP HOLDINGS LP-CL A	7,806	21.52	167,985.12
RANGE RESOURCES CORPORATION	12,946	15.70	203,252.20
SCHLUMBERGER LTD	63,804	64.39	4,108,339.56
TARGA RESOURCES CORP	10,314	45.69	471,246.66
TECHNIPFMC PLC	21,073	28.69	604,584.37



VALERO ENERGY CORP	20,743	88.07	1,826,836.01
WILLIAMS COS INC	37,959	30.06	1,141,047.54
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	9,803	162.52	1,593,183.56
ALBEMARLE CORPORATION	5,093	132.02	672,377.86
ARCONIC INC	19,855	25.63	508,883.65
AVERY DENNISON CORP	3,941	117.10	461,491.10
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	10,777	31.39	338,290.03
BALL CORPORATION	15,897	38.26	608,219.22
CELANESE CORPORATION	6,541	107.98	706,297.18
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	10,139	41.20	417,726.80
CHEMOURS CO	8,067	49.75	401,333.25
CROWN HOLDINGS INC	6,721	56.53	379,938.13
DOWDUPONT INC	106,763	71.42	7,625,013.46
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	6,801	92.33	627,936.33
ECOLAB INC	11,711	135.09	1,582,038.99
FMC CORPORATION	6,579	94.47	621,518.13
FREEPORT-MCMORAN INC	64,051	17.33	1,110,003.83
INTERNATIONAL PAPER CO	18,570	57.76	1,072,603.20
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	3,501	154.40	540,554.40
LYONDELLBASELL INDU-CL A	15,530	108.95	1,691,993.50
MARTIN MARIETTA MATERIALS	2,965	203.67	603,881.55
MONSANTO CO	19,889	116.00	2,307,124.00
MOSAIC CO/THE	15,550	24.49	380,819.50
NEWMONT MINING CORP	23,519	36.35	854,915.65
NUCOR CORP	14,127	62.43	881,948.61
PACKAGING CORP OF AMERICA	4,046	118.84	480,826.64
PPG INDUSTRIES INC	12,077	116.31	1,404,675.87
PRAXAIR INC	13,305	154.17	2,051,231.85
SEALED AIR CORP	9,198	49.66	456,772.68
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	3,778	411.87	1,556,044.86
STEEL DYNAMICS, INC.	10,191	41.40	421,907.40

VULCAN MATERIALS CO	6,233	119.26	743,347.58
WESTROCK CO	11,330	63.40	718,322.00
WR GRACE & CO	3,500	70.83	247,905.00
3M COMPANY	27,403	238.39	6,532,601.17
ACUITY BRANDS INC	1,884	171.86	323,784.24
AERCAP HOLDINGS NV	6,986	52.74	368,441.64
AGCO CORP	3,447	72.39	249,528.33
ALLEGION PLC	4,545	80.07	363,918.15
AMETEK INC	10,396	72.06	749,135.76
BOEING CO	25,785	297.25	7,664,591.25
CATERPILLAR INC	26,903	150.91	4,059,931.73
CUMMINS INC	7,515	174.00	1,307,610.00
DANAHER CORP	28,352	94.38	2,675,861.76
DEERE & CO	12,807	154.48	1,978,425.36
DOVER CORP	7,562	99.54	752,721.48
EATON CORP PLC	19,994	76.86	1,536,738.84
EMERSON ELECTRIC CO	28,887	68.54	1,979,914.98
FASTENAL COMPANY	12,895	53.33	687,690.35
FLOWSERVE CORPORATION	6,566	41.17	270,322.22
FLUOR CORP	7,277	50.62	368,361.74
FORTIVE CORP	14,905	72.73	1,084,040.65
GENERAL DYNAMICS CORP	11,518	199.83	2,301,641.94
GENERAL ELECTRIC CO	395,696	17.59	6,960,292.64
HD SUPPLY HOLDINGS INC	9,689	38.68	374,770.52
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	32,961	154.11	5,079,619.71
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES	2,185	238.00	520,030.00
IDEX CORP	3,666	132.13	484,388.58
ILLINOIS TOOL WORKS	14,018	167.46	2,347,454.28
INGERSOLL-RAND PLC	11,999	86.74	1,040,793.26
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	6,091	66.39	404,381.49
JARDINE MATHESON HOLDINGS LIMITED	9,400	61.93	582,142.00

JARDINE STRATEGIC HOLDINGS LIMITED	10,700	39.58	423,506.00
L3 TECHNOLOGIES INC	3,802	192.94	733,557.88
LENNOX INTERNATIONAL INC	1,823	205.97	375,483.31
LOCKHEED MARTIN CORPORATION	11,796	319.97	3,774,366.12
MASCO CORP	14,295	43.00	614,685.00
MIDDLEBY CORP	2,764	130.85	361,669.40
NORTHROP GRUMMAN CORP	7,488	307.12	2,299,714.56
OWENS CORNING	4,859	88.76	431,284.84
PACCAR INC	16,516	70.90	1,170,984.40
PARKER HANNIFIN CORPORATIOM	5,939	198.07	1,176,337.73
PENTAIR PLC-REGISTERED	8,359	69.19	578,359.21
RAYTHEON COMPANY	13,149	187.43	2,464,517.07
ROCKWELL AUTOMATION INC	6,039	193.84	1,170,599.76
ROCKWELL COLLINS INC	7,592	134.89	1,024,084.88
ROPER TECHNOLOGIES INC	4,795	259.14	1,242,576.30
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	8,127	52.31	425,123.37
SNAP-ON INC	2,448	172.35	421,912.80
SPIRIT AEROSYSTEMS HOLD CL A	5,166	85.38	441,073.08
STANLEY BLACK & DECKER INC	7,037	168.65	1,186,790.05
TEXTRON INC	12,033	56.35	678,059.55
TRANSDIGM GROUP INC	2,341	270.92	634,223.72
UNITED RENTALS INC	3,677	166.38	611,779.26
UNITED TECHNOLOGIES CORP	34,574	126.78	4,383,291.72
WABTEC CORP	4,279	78.91	337,655.89
MW GRAINGER INC	2,422	228.59	553,644.98
XYLEM INC	7,965	67.86	540,504.90
CINTAS CORP	4,082	158.99	648,997.18
EQUIFAX INC	5,368	119.44	641,153.92
IHS MARKIT LTD	18,255	45.07	822,752.85
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	41,939	37.46	1,571,034.94
MANPOWERGROUP	3,240	126.29	409,179.60

NIELSEN HOLDINGS PLC	17,482	37.50	655,575.00
REPUBLIC SERVICES INC	10,936	65.50	716,308.00
ROBERT HALF INTL INC	5,854	55.40	324,311.60
ROLLINS INC	4,301	46.92	201,802.92
STERICYCLE, INC.	4,280	67.78	290,098.40
TRANSUNION	6,673	55.93	373,220.89
VERISK ANALYTICS INC	7,039	96.00	675,744.00
WASTE CONNECTIONS INC	12,525	70.32	880,758.00
WASTE MANAGEMENT INC	19,810	85.65	1,696,726.50
AMERCO	390	381.88	148,933.20
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	5,676	51.44	291,973.44
C.H.ROBINSON WORLDWIDE, INC.	6,063	86.63	525,237.69
CSX CORPORATION	41,351	54.85	2,268,102.35
DELTA AIR LINES INC	8,839	55.75	492,774.25
EXPEDITORS INTL WASH INC	7,961	64.67	514,837.87
FEDEX CORP	11,877	242.54	2,880,647.58
J.B. HUNT TRANSPORT SERVICES INC	4,314	112.74	486,360.36
KANSAS CITY SOUTHERN	4,649	112.07	521,013.43
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	6,699	43.75	293,081.25
MACQUARIE INFRASTRUCTURE CORP	3,832	64.46	247,010.72
NORFOLK SOUTHERN CORP	12,996	143.72	1,867,785.12
OLD DOMINION FREIGHT LINE	2,639	129.78	342,489.42
SOUTHWEST AIRLINES	6,837	65.92	450,695.04
UNION PACIFIC CORP	36,538	133.24	4,868,323.12
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS INC	3,729	64.43	240,259.47
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	31,344	119.00	3,729,936.00
APTIV PLC	12,626	85.62	1,081,038.12
AUTOLIV INC	4,001	127.15	508,727.15
BORGWARNER INC	10,109	52.20	527,689.80
FORD MOTOR COMPANY	167,512	12.69	2,125,727.28
GENERAL MOTORS CO	61,045	42.49	2,593,802.05

GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	12,942	32.17	416,344.14
HARLEY-DAVIDSON INC	7,347	51.19	376,092.93
LEAR CORP	3,136	177.37	556,232.32
TESLA INC	6,257	331.10	2,071,692.70
WABCO HOLDINGS INC	2,109	142.95	301,481.55
D.R.HORTON INC	15,658	50.80	795,426.40
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY	7,685	67.69	520,197.65
GARMIN LTD	5,834	58.58	341,755.72
HANESBRANDS INC	17,562	20.87	366,518.94
HASBRO INC	5,514	91.67	505,468.38
LEGGETT & PLATT INC	6,887	46.94	323,275.78
LENNAR CORP-CL A	9,166	61.88	567,192.08
LULULEMON ATHLETICA INC	4,279	76.57	327,643.03
MATTEL INC	14,058	15.10	212,275.80
MICHAEL KORS HOLDINGS LIMITED	7,155	63.36	453,340.80
MOHAWK INDUSTRIES INC	2,863	276.56	791,791.28
NEWELL BRANDS INC	22,542	30.81	694,519.02
NIKE INC -CL B	60,253	64.24	3,870,652.72
NVR INC	170	3,387.63	575,897.10
POLARIS INDUSTRIES INC	2,467	123.65	305,044.55
PULTE GROUP INC	12,930	33.37	431,474.10
PVH CORP	3,303	136.60	451,189.80
RALPH LAUREN CORPORATION	2,646	97.33	257,535.18
SMITH(A.O.) CORP	6,960	61.29	426,578.40
TAPESTRY INC	13,914	43.48	604,980.72
TOLL BROTHERS INC	7,061	47.44	334,973.84
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	11,107	15.43	171,381.01
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	11,448	14.10	161,416.80
VF CORP	14,902	73.85	1,100,512.70
WHIRLPOOL CORP	3,391	166.10	563,245.10
ARAMARK	10,783	42.90	462,590.70

CARNIVAL CORP	15,490	68.13	1,055,333.70
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	1,281	313.17	401,170.77
DARDEN RESTAURANTS INC	5,372	96.69	519,418.68
DOMINO'S PIZZA INC	2,314	187.06	432,856.84
H&R BLOCK INC	10,833	27.63	299,315.79
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS INC	8,498	77.81	661,229.38
LAS VEGAS SANDS CORP	18,147	71.97	1,306,039.59
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	14,276	133.14	1,900,706.64
MCDONALD'S CORPORATION	37,038	173.39	6,422,018.82
MELCO RESORTS & ENTERTAINMENET-ADR	12,822	28.24	362,093.28
MGM MIRAGE	20,106	32.84	660,281.04
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDINGS	9,141	55.59	508,148.19
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	8,032	126.55	1,016,449.60
STARBUCKS CORP	66,303	58.01	3,846,237.03
VAIL RESORTS INC	1,924	219.26	421,856.24
WYNDHAM WORLDWIDE CORP	4,622	113.56	524,874.32
WYNN RESORTS LTD	4,008	166.14	665,889.12
YUM! BRANDS INC	15,212	82.86	1,260,466.32
CBS CORP-CL B	15,692	59.46	933,046.32
CHARTER COMMUNICATTIONS INC-A	9,010	316.97	2,855,899.70
COMCAST CORP-CLASS A	216,001	39.14	8,454,279.14
DISCOVERY COMMUNICATIONS INC-A	7,075	22.01	155,720.75
DISCOVERY COMMUNICATIONS INC-C	11,427	20.84	238,138.68
DISH NETWORK CORP.	9,780	48.47	474,036.60
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	19,116	20.39	389,775.24
LIBERTY BROADBAND-C	4,953	82.06	406,443.18
LIBERTY GLOBAL PLC-A	8,432	32.53	274,292.96
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	26,274	31.51	827,893.74
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	8,568	35.74	306,220.32
LIBERTY SIRIUS GROUP-C	7,648	39.48	301,943.04
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-A	4,141	39.61	164,025.01

LIVE NATION ENTERTAINMENT INC	6,065	44.06	267,223.90
NEWS CORP-CLASS A	16,662	16.27	271,090.74
OMNICOM GROUP	10,146	73.87	749,485.02
SCRIPPS NETWORKS INTERACTIVE	4,484	83.77	375,624.68
SIRIUS XM HOLDINGS INC	68,252	5.32	363,100.64
THE WALT DISNEY CO.	70,564	111.81	7,889,760.84
TIME WARNER INC	35,347	89.88	3,176,988.36
TWENTY-FIRST CE CL-A	47,349	35.06	1,660,055.94
TWENTY-FIRST CE CL-B	19,170	34.37	658,872.90
VIACOM INC-CLASS B	16,489	30.93	510,004.77
ADVANCE AUTO PARTS	3,304	99.73	329,507.92
AMAZON.COM INC	18,721	1,187.38	22,228,940.98
AUTONATION INC	2,851	52.61	149,991.11
AUTOZONE INC	1,330	701.01	932,343.30
BEST BUY COMPANY INC	12,762	65.80	839,739.60
CARMAX INC	8,650	67.85	586,902.50
DOLLAR GENERAL CORP	12,568	92.10	1,157,512.80
DOLLAR TREE INC	11,048	109.17	1,206,110.16
EXPEDIA INC	5,777	121.46	701,674.42
GAP INC/THE	11,623	34.31	398,785.13
GENUINE PARTS CO	6,648	93.01	618,330.48
HOME DEPOT INC	54,130	185.98	10,067,097.40
IAC/INTERACTIVECORP	3,231	125.16	404,391.96
KOHL'S CORP	7,962	52.88	421,030.56
L BRANDS INC	10,675	60.34	644,129.50
LIBERTY INTERACTIVE CORP QVC GROUP-A	18,982	26.23	497,897.86
LKQ CORPORATION	13,945	40.80	568,956.00
LOWE'S COMPANIES INC	38,040	88.86	3,380,234.40
MACY'S INC	13,521	25.25	341,405.25
NETFLIX INC	19,645	187.02	3,674,007.90
NORDSTROM INC	6,499	46.51	302,268.49

O'REILLY AUTOMOTIVE INC NEW	3,999	243.03	971,876.97
PRICELINE GROUP INC/THE	2,253	1,780.62	4,011,736.86
ROSS STORES INC	18,425	78.54	1,447,099.50
TARGET CORP	23,279	64.06	1,491,252.74
TIFFANY & CO	5,367	100.42	538,954.14
TJX COMPANIES INC	29,515	76.06	2,244,910.90
TRACTOR SUPPLY COMPANY	6,466	70.50	455,853.00
TRIPADVISOR INC-W/I	5,813	34.77	202,118.01
ULTA BEAUTY INC	2,623	227.47	596,653.81
COSTCO WHOLESALE CORP	20,140	188.33	3,792,966.20
CVS HEALTH CORPORATION	46,680	72.31	3,375,430.80
KROGER CO	41,574	26.95	1,120,419.30
SYSCO CORP	23,455	61.02	1,431,224.10
WAL-MART STORES INC	68,585	98.80	6,776,198.00
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	41,767	72.19	3,015,159.73
ALTRIA GROUP INC	88,099	73.90	6,510,516.10
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	25,078	40.13	1,006,380.14
BROWN-FORMAN CORPORATION	9,061	67.70	613,429.70
BUNGE LIMITED	5,968	66.91	399,318.88
CAMPBELL SOUP CO	9,028	48.78	440,385.84
COCA-COLA CO/THE	185,327	46.13	8,549,134.51
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS PLC	9,352	39.37	368,188.24
CONAGRA BRANDS INC	19,565	37.98	743,078.70
CONSTELLATION BRANDS INC-A	7,959	223.23	1,776,687.57
DR.PEPPER SNAPPLE GROUP, INC	8,175	94.23	770,330.25
GENERAL MILLS INC	27,208	57.63	1,567,997.04
HORMEL FOODS CORPORATION	12,443	36.82	458,151.26
INGREDION INC	3,320	140.33	465,895.60
JM SMUCKER CO/THE-NEW COM	5,344	121.47	649,135.68
KELLOGG CO	12,172	65.47	796,900.84
KRAFT HEINZ COMPANY	27,971	78.52	2,196,282.92



MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	5,606	101.57	569,401.42
MOLSON COORS BREWING COMPANY	8,674	80.70	699,991.80
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	69,230	43.25	2,994,197.50
MONSTER BEVERAGE CORPORATION	18,608	64.21	1,194,819.68
PEPSICO INC	65,458	118.61	7,763,973.38
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL INC.	71,321	108.12	7,711,226.52
THE HERSHEY COMPANY	6,522	115.45	752,964.90
TYSON FOODS INC-CL A	13,712	81.46	1,116,979.52
CHURCH & DWIGHT CO INC	11,613	49.22	571,591.86
CLOROX COMPANY	6,196	148.05	917,317.80
COLGATE-PALMOLIVE COMPANY	37,963	74.85	2,841,530.55
COTY INC-CL A	22,574	19.38	437,484.12
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	10,512	127.84	1,343,854.08
KIMBERLY-CLARK CORP	15,936	120.57	1,921,403.52
PROCTER & GAMBLE CO	116,722	91.68	10,701,072.96
SPECTRUM BRANDS HOLDINGS INC	942	108.27	101,990.34
ABBOTT LABORATORIES	79,782	56.80	4,531,617.60
AETNA INC	15,047	178.80	2,690,403.60
ALIGN TECHNOLOGY INC	3,613	235.05	849,235.65
AMERISOURCEBERGEN CORP	8,030	93.79	753,133.70
ANTHEM INC	12,058	227.99	2,749,103.42
BARD(C.R.) INC	3,396	333.83	1,133,686.68
BAXTER INTERNATIONAL INC	23,119	65.78	1,520,767.82
BECTON DICKINSON & CO	10,602	221.33	2,346,540.66
BOSTON SCIENTIFIC CORP	61,699	25.49	1,572,707.51
CARDINAL HEALTH INC	14,409	63.01	907,911.09
CENTENE CORP	7,965	100.94	803,987.10
CERNER CORP	13,575	68.63	931,652.25
CIGNA CORP	11,401	207.26	2,362,971.26
COOPER COMPANIES INC (THE)	2,431	223.88	544,252.28
DAVITA INC	6,953	71.80	499,225.40

DENTSPLY SIRONA INC	10,852	66.60	722,743.20
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	9,840	114.32	1,124,908.80
ENVISION HEALTHCARE CORP	6,386	33.14	211,632.04
EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO	26,662	73.66	1,963,922.92
HCA HEALTHCARE INC	12,883	88.83	1,144,396.89
HENRY SCHEIN INC	7,253	71.49	518,516.97
HOLOGIC INC	12,110	43.49	526,663.90
HUMANA INC.	6,505	245.16	1,594,765.80
IDEXX LABORATORIES INC	3,797	157.39	597,609.83
INTUITIVE SURGICAL INC	5,244	367.35	1,926,383.40
LABORATORY CRP OF AMR HLDGS	4,675	163.95	766,466.25
MCKESSON CORP	9,631	159.97	1,540,671.07
MEDTRONIC PLC	62,385	82.04	5,118,065.40
QUEST DIAGNOSTICS	6,477	99.48	644,331.96
RESMED INC	6,572	86.12	565,980.64
STRYKER CORP	15,241	155.26	2,366,317.66
TELEFLEX INC	2,137	254.23	543,289.51
TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES-SP ADR	40,020	17.90	716,358.00
UNITEDHEALTH GROUP INC	44,247	222.04	9,824,603.88
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	3,760	113.04	425,030.40
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	4,120	110.70	456,084.00
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	5,035	56.66	285,283.10
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	9,546	121.38	1,158,693.48
ABBVIE INC	73,200	97.92	7,167,744.00
AGILENT TECHNOLOGIES INC	14,256	67.75	965,844.00
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	10,367	115.72	1,199,669.24
ALKERMES PLC	6,413	51.80	332,193.40
ALLERGAN PLC	15,156	169.57	2,570,002.92
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	3,908	122.85	480,097.80
AMGEN INC	33,506	176.87	5,926,206.22
BIOGEN INC	9,709	327.02	3,175,037.18

BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	8,552	90.85	776,949.20
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	74,775	61.56	4,603,149.00
CELGENE CORP	35,925	107.06	3,846,130.50
ELI LILLY & CO	45,501	86.71	3,945,391.71
GILEAD SCIENCES INC	59,967	74.35	4,458,546.45
ILLUMINA INC	6,747	214.74	1,448,850.78
INCYTE CORP	8,108	95.02	770,422.16
IQVIA HOLDINGS INC	6,737	101.26	682,188.62
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	2,977	133.55	397,578.35
JOHNSON & JOHNSON	123,012	141.78	17,440,641.36
MERCK & CO. INC.	124,651	56.23	7,009,125.73
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL INC	1,195	635.07	758,908.65
MYLAN NV	21,984	41.24	906,620.16
PERRIGO CO PLC	6,231	85.89	535,180.59
PFIZER INC	272,182	36.94	10,054,403.08
REGENERON PHARMACEUTICALS	3,623	385.72	1,397,463.56
SEATTLE GENETICS INC	4,290	52.57	225,525.30
TESARO INC	1,725	76.90	132,652.50
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	18,200	193.89	3,528,798.00
UNITED THERAPEUTICS CORP	2,169	135.52	293,942.88
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	11,815	145.15	1,714,947.25
WATERS CORP	3,789	198.08	750,525.12
ZOETIS INC	22,572	72.80	1,643,241.60
BANK OF AMERICA CORP	460,226	29.45	13,553,655.70
BB & T CORPORATION	37,726	50.03	1,887,431.78
CIT GROUP INC	5,683	49.58	281,763.14
CITIGROUP INC	124,670	74.70	9,312,849.00
CITIZENS FINANCIAL GROUP	24,026	42.08	1,011,014.08
COMERICA INC	7,688	86.54	665,319.52
EAST WEST BANCORP INC	6,233	61.14	381,085.62
FIFTH THIRD BANCORP	33,830	30.62	1,035,874.60

FIRST REPUBLIC BANK/CA	7,244	88.40	640,369.60
HUNTINGTON BANCSHARES INC	48,927	14.61	714,823.47
JPMORGAN CHASE & CO	161,275	106.51	17,177,400.25
KEYCORP	50,045	20.12	1,006,905.40
M & T BANK CORP	6,279	173.90	1,091,918.10
NEW YORK COMMUNITY BANCORP	21,911	13.30	291,416.30
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL INC	14,035	19.04	267,226.40
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	21,775	145.10	3,159,552.50
REGIONS FINANCIAL CORPORATION	56,865	17.30	983,764.50
SIGNATURE BANK	2,508	137.46	344,749.68
SUNTRUST BANKS INC	21,527	65.63	1,412,817.01
SVB FINANCIAL GROUP	2,333	238.23	555,790.59
US BANCORP	76,209	54.56	4,157,963.04
WELLS FARGO & COMPANY	215,988	60.36	13,037,035.68
ZIONS BANCORPORATION	8,874	50.89	451,597.86
AFFILIATED MANAGERS GROUP	2,602	202.20	526,124.40
ALLY FINANCIAL INC	20,762	28.85	598,983.70
AMERICAN EXPRESS COMPANY	34,166	99.15	3,387,558.90
AMERIPRISE FINANCIAL INC	6,855	171.33	1,174,467.15
BANK OF NEW YORK MELLON CORP(THE)	47,442	54.20	2,571,356.40
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	58,015	197.91	11,481,748.65
BLACKROCK INC	5,620	515.82	2,898,908.40
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	22,500	98.74	2,221,650.00
CBOE GLOBAL MARKETS INC	4,473	124.65	557,559.45
CME GROUP INC.	15,608	150.16	2,343,697.28
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	16,652	75.95	1,264,719.40
E*TRADE FINANCIAL CORPORATION	11,942	49.57	591,964.94
EATON VANCE CORP	5,530	57.08	315,652.40
FIRST DATA CORP-CLASS A	20,984	16.40	344,137.60
FRANKLIN RESOURCES INC	15,511	43.68	677,520.48
GOLDMAN SACHS GROUP INC	16,877	256.48	4,328,612.96

INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	27,023	71.07	1,920,524.61
INVESCO LIMITED	18,328	36.61	670,988.08
LEUCADIA NATIONAL CORPORATION	15,290	25.71	393,105.90
MOODY'S CORP	8,081	150.15	1,213,362.15
MORGAN STANLEY	63,251	52.93	3,347,875.43
MSCI INC-A	4,420	126.97	561,207.40
NASDAQ INC	5,343	76.11	406,655.73
NORTHERN TRUST CORP	9,967	98.02	976,965.34
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	6,359	88.67	563,852.53
S&P GLOBAL INC	11,801	172.00	2,029,772.00
SCHWAB (CHARLES) CORP	54,693	51.81	2,833,644.33
SEI INVESTMENTS COMPANY	5,862	71.80	420,891.60
STATE STREET CORP	17,257	97.87	1,688,942.59
SYNCHRONY FINANCIAL	36,521	38.18	1,394,371.78
T ROWE PRICE GROUP INC	10,711	103.14	1,104,732.54
TD AMERITRADE HOLDING CORPORATION	11,079	51.96	575,664.84
AFLAC INC	18,230	87.98	1,603,875.40
ALLEGHANY CORPORATION	735	577.50	424,462.50
ALLSTATE CORP	16,593	104.38	1,731,977.34
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	3,539	105.55	373,541.45
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	42,003	59.78	2,510,939.34
AON PLC	12,107	136.87	1,657,085.09
ARCH CAPITAL GROUP LTD.	5,941	90.52	537,779.32
ARTHUR J GALLAGHER & CO	8,878	64.40	571,743.20
ASSURANT INC	2,198	98.69	216,920.62
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	4,807	50.49	242,705.43
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	3,961	50.20	198,842.20
BRIGHTHOUSE FINANCIAL INC	4,258	58.34	248,411.72
CHUBB LTD	21,372	147.62	3,154,934.64
CINCINNATI FINANCIAL CORP	7,401	73.55	544,343.55
EVEREST RE GROUP LTD	1,971	218.88	431,412.48

FNF GROUP	13,005	39.18	509,535.90
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	16,782	56.73	952,042.86
LINCOLN NATIONAL CORP	10,383	76.81	797,518.23
LOEWS CORPORATION	12,803	49.64	635,540.92
MARKEL CORP	629	1,130.91	711,342.39
MARSH & MCLENNAN COS	23,535	82.52	1,942,108.20
METLIFE INC	41,485	50.79	2,107,023.15
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	12,796	70.86	906,724.56
PROGRESSIVE CORP	27,383	55.79	1,527,697.57
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	19,572	116.86	2,287,183.92
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	2,972	154.89	460,333.08
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	2,159	127.03	274,257.77
TORCHMARK CORPORATION	5,560	90.14	501,178.40
TRAVELERS COS INC(THE)	12,974	135.54	1,758,495.96
UNUM GROUP	9,769	54.21	529,577.49
VOYA FINANCIAL INC	7,528	46.28	348,395.84
W.R.BERKLEY CORPORATION	5,072	70.10	355,547.20
WILLIS TOWERS WATSON PLC	5,872	154.15	905,168.80
XL GROUP LTD	11,562	35.32	408,369.84
CBRE GROUP INC-A	13,193	43.50	573,895.50
CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP	18,743	108.55	2,034,552.65
EQUINIX INC	3,505	448.52	1,572,062.60
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	52,300	7.16	374,468.00
JONES LANG LASALLE INC	2,007	146.87	294,768.09
ACCENTURE PLC-CL A	28,377	152.22	4,319,546.94
ACTIVISION BLIZZARD INC	32,412	64.90	2,103,538.80
ADOBE SYSTEMS INC	22,463	174.97	3,930,351.11
AKAMAI TECHNOLOGIES	8,040	66.82	537,232.80
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	2,222	244.85	544,056.70
ALPHABET INC-CL A	13,654	1,079.78	14,743,316.12
ALPHABET INC-CL C	14,339	1,070.68	15,352,480.52

ANSYS INC	3,662	147.63	540,621.06
AUTODESK INC	9,500	105.39	1,001,205.00
AUTOMATIC DATA PROCESSING	20,405	118.34	2,414,727.70
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS	5,375	91.16	489,985.00
CA INC	15,176	33.65	510,672.40
CADENCE DESIGN SYS INC	13,205	43.76	577,850.80
CDK GLOBAL INC	6,275	71.46	448,411.50
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES	5,898	104.94	618,936.12
CITRIX SYSTEMS INC	7,019	87.86	616,689.34
COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS CORPORATION	27,438	71.93	1,973,615.34
COSTAR GROUP INC	1,621	298.86	484,452.06
EBAY INC	46,957	37.80	1,774,974.60
ELECTRONIC ARTS INC	13,865	107.00	1,483,555.00
FACEBOOK INC-A	108,655	179.51	19,504,659.05
FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES	15,620	95.00	1,483,900.00
FISERV INC	9,928	132.16	1,312,084.48
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	4,319	188.86	815,686.34
FORTINET INC	6,882	45.09	310,309.38
GARTNER INC	4,011	123.45	495,157.95
GLOBAL PAYMENTS INC	7,016	102.72	720,683.52
INTL BUSINESS MACHINES CORP	40,654	153.23	6,229,412.42
INTUIT INC	11,301	159.88	1,806,803.88
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	3,649	117.89	430,180.61
LEIDOS HOLDINGS INC	6,074	64.74	393,230.76
MASTERCARD INC-CL A	43,360	151.68	6,576,844.80
MERCADOLIBRE INC	1,842	329.28	606,533.76
MICROSOFT CORP	335,606	85.83	28,805,062.98
ORACLE CORPORATION	142,465	47.82	6,812,676.30
PAYCHEX INC	15,071	69.26	1,043,817.46
PAYPAL HOLDINGS INC	52,453	74.50	3,907,748.50
RED HAT INC	8,290	128.86	1,068,249.40

SABRE CORP	9,850	20.29	199,856.50
SALESFORCE.COM, INC.	31,029	104.26	3,235,083.54
SERVICENOW INC	7,913	129.96	1,028,373.48
SPLUNK INC	6,247	84.21	526,059.87
SQUARE INC-A	11,069	36.92	408,667.48
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	8,124	40.84	331,784.16
SYMANTEC CORPORATION	29,000	28.31	820,990.00
SYNOPSYS INC	7,080	88.37	625,659.60
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE INC	4,808	109.28	525,418.24
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	7,179	79.67	571,950.93
TWITTER INC	27,825	25.08	697,851.00
VANTIV INC-CL A	7,565	75.01	567,450.65
VERISIGN INC	3,837	115.55	443,365.35
VISA INC	83,884	112.14	9,406,751.76
VMWARE INC	3,055	128.14	391,467.70
WESTERN UNION COMPANY	21,476	19.59	420,714.84
WORKDAY INC-CLASS A	6,281	102.93	646,503.33
ZILLOW GROUP INC-C	5,320	43.21	229,877.20
AMPHENOL CORPORATION -CL A	14,394	88.80	1,278,187.20
APPLE INC	236,988	174.54	41,363,885.52
ARISTA NETWORKS INC	2,325	236.00	548,700.00
ARROW ELECTRONICS INC	4,130	80.44	332,217.20
AVNET INC	6,544	39.86	260,843.84
CDW CORP/DE	6,951	70.02	486,709.02
CISCO SYSTEMS INC	229,599	38.30	8,793,641.70
COGNEX CORP	8,160	62.46	509,673.60
COMMSCOPE HOLDING CO INC	8,803	37.83	333,017.49
CORNING INC	40,447	32.26	1,304,820.22
DELL TECHNOLOGIES INC-CL V	9,818	83.34	818,232.12
DXC TECHNOLOGY CO	12,719	94.93	1,207,414.67
F5 NETWORKS INC	3,213	131.51	422,541.63



FLEX LTD	23,204	18.50	429,274.00
FLIR SYSTEMS INC	7,048	47.47	334,568.56
HARRIS CORP	5,639	142.57	803,952.23
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE C	77,323	14.80	1,144,380.40
HP INC	75,701	21.42	1,621,515.42
IPG PHOTONICS CORP	1,776	213.14	378,536.64
JUNIPER NETWORKS INC	16,739	28.44	476,057.16
MOTOROLA SOLUTIONS INC	7,367	93.28	687,193.76
NETAPP INC	12,712	57.91	736,151.92
PALO ALTO NETWORKS INC	4,461	148.94	664,421.34
QORVO INC	5,998	66.79	400,606.42
QUALCOMM INC	67,780	64.50	4,371,810.00
SEAGATE TECHNOLOGY	12,422	42.18	523,959.96
SKYWORKS SOLUTIONS INC	8,791	95.68	841,122.88
TE CONNECTIVITY LTD	15,877	95.91	1,522,763.07
TRIMBLE INC	11,778	41.23	485,606.94
WESTERN DIGITAL CORP	13,691	84.24	1,153,329.84
XEROX CORP	9,697	30.01	291,006.97
AT&T INC	281,944	38.05	10,727,969.20
CENTURYLINK INC	42,717	17.40	743,275.80
SBA COMMUNICATIONS CORP	5,325	157.99	841,296.75
SPRINT CORP	36,740	5.58	205,009.20
T-MOBILE US INC	13,706	63.64	872,249.84
VERIZON COMMUNICATIONS INC	187,323	52.83	9,896,274.09
ZAYO GROUP HOLDINGS INC	9,150	36.29	332,053.50
AES CORPORATION	27,194	10.65	289,616.10
ALLIANT ENERGY CORP	11,268	42.77	481,932.36
AMEREN CORPORATION	11,882	59.49	706,860.18
AMERICAN ELECTRIC POWER	22,824	74.51	1,700,616.24
AMERICAN WATER WORKS CO INC	8,207	89.00	730,423.00
ATMOS ENERGY CORP	4,697	87.19	409,531.43

CENTERPOINT ENERGY INC	17,622	28.01	493,592.22
CMS ENERGY CORPORATION	13,269	47.72	633,196.68
CONSOLIDATED EDISON INC	14,672	85.56	1,255,336.32
DOMINION ENERGY INC	29,777	81.34	2,422,061.18
DTE ENERGY COMPANY	7,944	109.01	865,975.44
DUKE ENERGY CORP	31,757	85.01	2,699,662.57
EDISON INTERNATIONAL	14,473	69.85	1,010,939.05
ENTERGY CORP	8,107	81.03	656,910.21
EVERSOURCE ENERGY	15,099	62.59	945,046.41
EXELON CORP	44,432	39.62	1,760,395.84
FIRSTENERGY CORP	20,824	31.01	645,752.24
NEXTERA ENERGY INC	21,334	154.10	3,287,569.40
NISOURCE INC	15,794	25.30	399,588.20
OGE ENERGY CORP	9,056	33.34	301,927.04
P G & E CORPORATION	22,921	52.05	1,193,038.05
PINNACLE WEST CAPITAL CORPORATION	5,120	86.59	443,340.80
PPL CORPORATION	30,510	32.42	989,134.20
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	22,788	51.32	1,169,480.16
SCANA CORP	6,498	41.90	272,266.20
SEMPRA ENERGY	11,232	112.19	1,260,118.08
SOUTHERN CO	46,439	49.81	2,313,126.59
UGI CORPORATION	7,497	46.79	350,784.63
VISTRA ENERGY CORP	11,939	18.00	214,902.00
WEC ENERGY GROUP INC	14,732	66.13	974,227.16
WESTAR ENERGY INC	6,480	53.47	346,485.60
XCEL ENERGY INC	22,653	49.33	1,117,472.49
ADVANCED MICRO DEVICES	39,124	10.95	428,407.80
ANALOG DEVICES INC	17,006	87.95	1,495,677.70
APPLIED MATERIALS INC	48,972	52.96	2,593,557.12
BROADCOM LTD	18,670	263.70	4,923,279.00
INTEL CORP	215,775	47.04	10,150,056.00

	KLA-TENCOR CORPORATION	7,240	111.62	808,128.80
	LAM RESEARCH CORP	7,275	186.11	1,353,950.25
	MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	18,948	22.37	423,866.76
	MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	12,942	53.17	688,126.14
	MICROCHIP TECHNOLOGY INC	11,069	89.59	991,671.71
	MICRON TECHNOLOGY INC	47,799	43.98	2,102,200.02
	NVIDIA CORP	27,552	196.11	5,403,222.72
	NXP SEMICONDUCTORS NV	15,599	116.45	1,816,503.55
	TEXAS INSTRUMENTS INC	45,462	104.10	4,732,594.20
	XILINX INC	11,509	69.80	803,328.20
	米ドル 小計	14,056,263		1,080,317,316.69 (122,043,447,266)
カナダドル	ALTAGAS LTD	6,948	28.81	200,171.88
	ARC RESOURCES LTD	17,074	13.92	237,670.08
	CAMECO CORP	16,384	13.15	215,449.60
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	49,617	43.49	2,157,843.33
	GENOVUS ENERGY INC	51,211	10.98	562,296.78
	CRESCENT POINT ENERGY CORP	22,509	8.52	191,776.68
	ENBRIDGE INC	74,700	49.96	3,732,012.00
	ENCANA CORP	41,829	14.42	603,174.18
	HUSKY ENERGY INC	14,553	17.18	250,020.54
	IMPERIAL OIL LTD	12,999	38.59	501,631.41
	INTER PIPELINE LTD	18,081	25.70	464,681.70
	KEYERA CORP	8,467	35.32	299,054.44
	PEMBINA PIPELINE CORP	24,398	44.75	1,091,810.50
	PRAIRIESKY ROYALTY LTD	9,038	31.54	285,058.52
	SEVEN GENERATIONS ENERGY-A	14,441	16.98	245,208.18
	SUNCOR ENERGY INC	75,235	44.27	3,330,653.45
	TOURMALINE OIL CORP	12,887	20.69	266,632.03
	TRANSCANADA CORP	40,507	61.77	2,502,117.39
	VERMILION ENERGY INC	5,586	42.75	238,801.50

AGNICO EAGLE MINES LIMITED	11,237	56.44	634,216.28
AGRIUM INC	6,241	140.88	879,232.08
BARRICK GOLD CORP	55,199	18.38	1,014,557.62
CCL INDUSTRIES INC-CL B	6,935	58.85	408,124.75
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	31,672	16.92	535,890.24
FRANCO-NEVADA CORPORATION	8,072	98.22	792,831.84
GOLDCORP INC	40,330	15.86	639,633.80
KINROSS GOLD CORP	57,099	5.29	302,053.71
LUNDIN MINING CORP	28,209	7.65	215,798.85
METHANEX CORPORATION	4,361	75.38	328,732.18
POTASH CORP OF SASKATCHEWAN	38,862	25.26	981,654.12
TECK RESOURCES LIMITED-CL B	26,787	30.88	827,182.56
TURQUOISE HILL RESOURCES LTD	45,107	4.22	190,351.54
WEST FRASER TIMBER CO LTD	2,873	80.42	231,046.66
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	19,578	28.06	549,358.68
BOMBARDIER INC 'B'	75,852	3.06	232,107.12
CAE INC	13,932	22.75	316,953.00
FINNING INTERNATIONAL INC	7,972	31.53	251,357.16
SNC-LAVALIN GROUP INC	8,250	56.74	468,105.00
CANADIAN NATL RAILWAY CO	34,067	104.63	3,564,430.21
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	6,754	230.56	1,557,202.24
LINAMAR CORP	2,200	76.02	167,244.00
MAGNA INTERNATIONAL INC	15,539	73.56	1,143,048.84
GILDAN ACTIVEWEAR INC	11,557	41.37	478,113.09
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	10,669	78.38	836,236.22
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	19,379	29.23	566,448.17
THOMSON REUTERS CORP	12,371	55.99	692,652.29
CANADIAN TIRE CORP -CL A	3,029	163.69	495,817.01
DOLLARAMA INC	4,808	155.04	745,432.32
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC-B	19,916	66.47	1,323,816.52
EMPIRE CO LTD A	7,235	24.19	175,014.65

JEAN COUTU GROUP INC A	2,801	24.37	68,260.37
LOBLAW COMPANIES LTD	9,974	68.65	684,715.10
METRO INC	11,379	40.35	459,142.65
WESTON (GEORGE) LTD	1,960	110.91	217,383.60
SAPUTO INC	9,854	44.94	442,838.76
VALEANT PHARMACEUTICALS INTERN	14,555	26.83	390,510.65
BANK OF MONTREAL	29,360	101.11	2,968,589.60
BANK OF NOVA SCOTIA	54,490	82.37	4,488,341.30
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	19,992	121.65	2,432,026.80
NATIONAL BANK OF CANADA	16,348	63.52	1,038,424.96
ROYAL BANK OF CANADA	66,561	102.66	6,833,152.26
TORONTO-DOMINION BANK	84,055	72.52	6,095,668.60
CI FINANCIAL CORP	11,041	29.51	325,819.91
ELEMENT FLEET MANAGEMENT CORP	19,611	9.90	194,148.90
IGM FINANCIAL INC	3,023	44.80	135,430.40
ONEX CORPORATION	4,217	93.33	393,572.61
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	1,335	665.00	887,775.00
GREAT-WEST LIFECO INC	14,200	35.24	500,408.00
INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANCE AND FINANC	4,851	59.54	288,828.54
INTACT FINANCIAL CORPORATION	6,264	104.00	651,456.00
MANULIFE FINANCIAL CORP	92,030	26.82	2,468,244.60
POWER CORP OF CANADA	18,003	32.93	592,838.79
POWER FINANCIAL CORP	11,076	35.19	389,764.44
SUN LIFE FINANCIAL INC	28,816	52.18	1,503,618.88
BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT INC	39,570	55.86	2,210,380.20
FIRST CAPITAL REALTY INC	6,546	20.52	134,323.92
CGI GROUP INC - CL A	10,225	68.69	702,355.25
CONSTELLATION SOFTWARE	938	763.56	716,219.28
OPEN TEXT CORPORATION	11,689	42.05	491,522.45
SHOPIFY INC-CLASS A	3,397	136.00	461,992.00
BLACKBERRY LIMITED	23,701	13.97	331,102.97

	BCE INC	6,928	61.33	424,894.24
	ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	15,965	64.54	1,030,381.10
	TELUS CORPORATION	9,642	48.01	462,912.42
	ATCO LTD-CLASS I	3,030	44.97	136,259.10
	CANADIAN UTILITIES LIMITED	6,417	37.46	240,380.82
	EMERA INC	2,409	47.35	114,066.15
	FORTIS INC	19,452	46.06	895,959.12
	HYDRO ONE LTD	14,952	22.54	337,018.08
	カナダドル 小計	1,863,213		82,061,434.76 (7,203,352,743)
ユーロ	ENI SPA	118,622	13.98	1,658,335.56
	GALP ENERGIA SGPS S.A	23,404	15.61	365,336.44
	NESTE OYJ	6,415	53.15	340,957.25
	OMV AG	6,408	52.23	334,689.84
	REPSOL SA	54,255	15.05	816,537.75
	REPSOL SA-RTS-NEW	54,255	0.38	20,888.17
	TENARIS S.A.	23,321	12.89	300,607.69
	TOTAL SA	109,089	46.15	5,034,457.35
	VOPAK	3,130	36.33	113,712.90
	AIR LIQUIDE SA	19,472	107.80	2,099,081.60
	AKZO NOBEL	11,567	74.38	860,353.46
	ARCELORMITTAL	30,294	26.85	813,393.90
	ARKEMA	3,250	103.50	336,375.00
	BASF SE	41,873	94.28	3,947,786.44
	COVESTRO AG	5,296	88.20	467,107.20
	CRH PLC	38,667	29.30	1,132,943.10
	EVONIK INDUSTRIES AG	8,771	31.36	275,058.56
	FUCHS PETROLUB SE-PREF	3,370	44.93	151,414.10
	HEIDELBERGCEMENT AG	6,574	90.34	593,895.16
	IMERYS SA	1,384	78.58	108,754.72
	K+S AG	9,644	20.36	196,351.84

KONINKLIJKE DSM NV	7,986	81.70	652,456.20
LANXESS	4,159	64.81	269,544.79
LINDE AG - TENDER	8,607	196.50	1,691,275.50
SOLVAY SA	3,317	116.30	385,767.10
STORA ENSO OYJ-R SHS	25,821	13.38	345,484.98
SYMRISE AG	6,010	71.64	430,556.40
THYSSENKRUPP AG	19,367	24.12	467,228.87
UMICORE	8,810	39.76	350,329.65
UPM-KYMMENE OYJ	23,383	26.17	611,933.11
VOESTALPINE AG	5,079	49.78	252,858.01
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	11,117	32.62	362,636.54
AIRBUS SE	26,672	85.67	2,284,990.24
ALSTOM RGPT	6,452	34.45	222,271.40
ANDRITZ AG	3,705	47.15	174,709.27
BOSKALIS WESTMINSTER NV	3,784	31.09	117,663.48
BOUYGUES SA	10,290	43.91	451,885.35
BRENTAG AG	6,629	54.42	360,750.18
CNH INDUSTRIAL NV	46,980	11.22	527,115.60
COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	23,156	47.05	1,089,489.80
DASSAULT AVIATION SA	117	1,327.60	155,329.20
EIFFAGE SA	3,580	93.42	334,443.60
FERROVIAL SA	22,033	18.71	412,347.59
GEA GROUP AG	8,178	40.00	327,120.00
HOCHTIEF AG	825	147.55	121,728.75
KION GROUP AG	3,179	70.48	224,055.92
KONE OYJ-B	15,799	44.70	706,215.30
KONINKLIJKE PHILIPS NV	43,206	33.05	1,428,174.33
LEGRAND SA	12,654	64.05	810,488.70
LEONARDO SPA	18,310	10.22	187,128.20
MAN SE	1,403	95.22	133,593.66
METSO OYJ	5,502	28.61	157,412.22

MTU AERO ENGINES AG	2,451	152.25	373,164.75
OSRAM LICHT AG	4,588	74.45	341,576.60
PRYSMIAN SPA	9,379	27.56	258,485.24
REXEL SA	12,854	15.28	196,473.39
SAFRAN SA	15,399	88.10	1,356,651.90
SCHNEIDER ELECTRIC SE	25,673	71.52	1,836,132.96
SIEMENS AG-REG	35,128	118.70	4,169,693.60
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY	12,469	11.64	145,139.16
THALES SA	4,530	92.32	418,209.60
VINCI S.A.	23,522	87.21	2,051,353.62
WARTSILA OYJ-B SHARES	6,301	52.90	333,322.90
ZODIAC AEROSPACE	10,335	24.90	257,393.17
BIC	1,337	91.86	122,816.82
BUREAU VERITAS SA	12,626	22.88	288,882.88
EDENRED	9,497	24.00	227,928.00
PADDY POWER BETFAIR PLC	3,857	98.62	380,377.34
RANDSTAD HOLDING NV	5,759	51.77	298,143.43
TELEPERFORMANCE	2,489	118.75	295,568.75
ABERTIS INFRAESTRUCTURAS SA	31,359	18.55	581,709.45
AENA SME SA	3,145	171.60	539,682.00
AEROPORTS DE PARIS (ADP)	1,346	158.25	213,004.50
ATLANTIA SPA	20,462	26.71	546,540.02
BOLLORE	39,433	4.53	178,710.35
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	12,281	30.85	378,930.25
DEUTSCHE POST AG-REG	45,754	40.80	1,866,991.97
FRAPORT AG	1,856	90.95	168,803.20
GROUPE EUROTUNNEL SE	23,484	10.82	254,096.88
INTERNATIONAL CONSOLIDATED AIRLINES GROUP	30,145	7.27	219,154.15
RYANAIR HOLDINGS PLC	1,614	14.95	24,129.30
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	14,872	87.10	1,295,351.20
BAYERISCHE MOTOREN WERKE(BMW)AG-PFD	2,508	73.79	185,065.32



CONTINENTAL AG	4,924	227.60	1,120,702.40
DAIMLER AG	44,207	71.17	3,146,212.19
FAURECIA	3,127	66.51	207,976.77
FERRARI NV	5,718	89.25	510,331.50
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	50,265	15.43	775,588.95
MICHELIN (CGDE)-B	7,634	122.35	934,019.90
NOKIAN RENKAAT OYJ	5,507	36.66	201,886.62
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE PREF	6,624	71.38	472,821.12
PSA PEUGEOT CITROEN	26,121	17.14	447,844.54
RENAULT SA	8,755	84.40	738,922.00
SCHAEFFLER AG	9,576	14.60	139,809.60
VALEO SA	11,137	61.58	685,816.46
VOLKSWAGEN AG	1,615	172.55	278,668.25
VOLKSWAGEN AG PFD	8,600	172.75	1,485,650.00
ADIDAS AG	8,763	172.75	1,513,808.25
HERMES INTERNATIONAL	1,466	445.45	653,029.70
HUGO BOSS AG	3,149	71.96	226,602.04
KERING	3,479	395.65	1,376,466.35
LUXOTTICA GROUP SPA	7,229	51.45	371,932.05
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	12,804	252.60	3,234,290.40
SEB SA	1,032	152.55	157,431.60
ACCOR SA	9,357	42.30	395,801.10
SODEXO	3,900	114.05	444,795.00
ALTICE NV -A W/I	22,625	8.23	186,226.37
AXEL SPRINGER SE	1,698	67.20	114,105.60
EUTELSAT COMMUNICATIONS	8,726	19.11	166,753.86
JC DECAUX SA	2,828	33.67	95,218.76
LAGARDERE S.C.A.	6,108	27.38	167,237.04
PROSIEBEN SAT.1 MEDIA SE-REG	10,851	28.93	313,919.43
PUBLICIS GROUPE	9,116	56.63	516,239.08
RELX NV	43,033	19.20	826,448.76

RTL GROUP	1,615	68.05	109,900.75
SES	17,656	13.13	231,823.28
TELENET GROUP HOLDINGS NV	2,794	57.43	160,459.42
WOLTERS KLUWER-CVA	13,701	44.05	603,529.05
INDITEX	50,844	29.80	1,515,405.42
CARREFOUR SA	26,320	17.37	457,310.00
CASINO GUICHARD PERRACHON	2,725	49.26	134,247.12
COLRUYT NV	2,173	42.78	92,960.94
JERONIMO MARTINS SGPS S.A.	12,270	15.90	195,093.00
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	58,630	18.47	1,083,189.25
METRO AG	8,344	16.25	135,590.00
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	34,989	94.66	3,312,058.74
DANONE	27,520	70.92	1,951,718.40
DAVIDE CAMPARI-MILANO SPA	22,958	6.46	148,308.68
HEINEKEN HOLDING NV	5,292	83.33	440,982.36
HEINEKEN NV	12,531	88.57	1,109,870.67
KERRY GROUP PLC-A	7,286	94.02	685,029.72
PERNOD-RICARD SA	9,828	130.70	1,284,519.60
REMY COINTREAU	1,273	116.75	148,622.75
UNILEVER NV-CVA	74,802	48.30	3,612,936.60
BEIERSDORF AG	4,666	100.60	469,399.60
HENKEL AG & CO KGAA	4,681	101.85	476,759.85
HENKEL AG & CO KGAA	7,969	112.25	894,520.25
L'OREAL	11,569	188.85	2,184,805.65
BIOMERIEUX	1,779	74.17	131,948.43
ESSILOR INTERNATIONAL	9,711	114.10	1,108,025.10
FRESENIUS MEDICAL CARE AG AND CO.KGAA	9,899	87.76	868,736.24
FRESENIUS SE & CO KGAA	19,402	65.22	1,265,398.44
BAYER AG	37,824	106.60	4,032,038.40
EUROFINS SCIENTIFIC	484	506.00	244,904.00
GRIFOLS S.A.	13,951	24.52	342,148.27

IPSEN	1,807	102.50	185,217.50
MERCK KGAA	6,109	91.42	558,484.78
ORION OYJ	4,259	30.70	130,751.30
QIAGEN N.V.	10,011	27.52	275,502.72
RECORDATI SPA	4,578	37.23	170,438.94
SANOFI	52,174	73.20	3,819,136.80
UCB SA	5,753	66.08	380,158.24
ZALANDO SE	5,372	43.54	233,923.74
ABN AMRO GROUP NV-CVA	18,916	26.79	506,854.22
AIB GROUP PLC	36,918	5.75	212,278.50
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	302,226	7.28	2,200,507.50
BANCO DE SABADELL SA	268,348	1.70	457,264.99
BANCO ESPIRITO SANTO,S.A(BES)	187,906	0.01	1,879.06
BANCO SANTANDER SA	736,732	5.67	4,179,480.63
BANK OF IRELAND GROUP PLC	43,303	7.07	306,325.42
BANKIA SA	48,396	4.04	195,519.84
BANKINTER,S.A.	34,025	7.95	270,804.97
BNP PARIBAS	51,154	63.06	3,225,771.24
CAIXABANK	166,584	3.96	660,838.72
COMMERZBANK AG	46,644	12.85	599,608.62
CREDIT AGRICOLE SA	55,258	14.27	788,531.66
ERSTE GROUP BANK AG	14,000	36.64	513,030.00
INTESA SANPAOLO	628,258	2.79	1,754,096.33
INTESA SANPAOLO-RSP	32,509	2.68	87,189.13
KBC GROUPE SA	11,402	71.85	819,233.70
NATIXIS	45,362	6.67	302,655.26
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG	6,677	30.72	205,117.44
SOCIETE GENERALE	34,594	43.70	1,511,757.80
UNICREDIT SPA	91,351	16.53	1,510,032.03
AMUNDI SA	2,379	72.78	173,143.62
DEUTSCHE BANK AG -REG	93,176	16.80	1,565,822.68

DEUTSCHE BOERSE AG	9,016	96.88	873,470.08
EURAZEO	2,022	76.88	155,451.36
EXOR NV	4,683	51.25	240,003.75
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	3,978	91.05	362,196.90
ING GROEP NV-CVA	176,587	15.56	2,747,693.72
MEDIOBANCA SPA	26,782	9.44	252,955.99
WENDEL	1,532	144.00	220,608.00
AEGON NV	87,281	5.36	468,262.56
AGEAS	8,915	41.68	371,577.20
ALLIANZ SE-REG	20,556	198.95	4,089,616.20
ASSICURAZIONI GENERALI	58,390	15.41	899,789.90
AXA SA	87,938	25.48	2,240,660.24
CNP ASSURANCES	8,978	19.37	173,903.86
HANNOVER RUECKVERSICHERUNG SE	3,033	106.90	324,227.70
MAPFRE SA	46,367	2.71	125,747.30
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	7,189	186.90	1,343,624.10
NN GROUP NV	14,071	37.32	525,129.72
POSTE ITALIANE SPA	26,562	6.37	169,199.94
SAMPO OYJ-A SHS	20,944	46.06	964,680.64
SCOR SE	8,353	34.25	286,090.25
UNIPOLSAI SPA	49,963	1.96	98,027.40
DEUTSCHE WOHNEN SE	15,822	37.62	595,223.64
VONOVIA SE	21,996	41.64	915,913.44
AMADEUS IT GROUP SA	20,150	61.00	1,229,150.00
ATOS SE	4,258	124.50	530,121.00
CAPGEMINI SA	7,328	98.61	722,614.08
DASSAULT SYSTEMES SA	6,196	90.15	558,569.40
SAP SE	45,130	97.02	4,378,512.60
UBISOFT ENTERTAINMENT SA	2,839	64.72	183,740.08
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	5,981	58.57	350,307.17
WIRECARD AG	5,532	93.65	518,071.80

INGENICO S.A.	2,691	88.23	237,426.93
NOKIA OYJ	266,819	3.95	1,055,002.32
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	153,050	15.10	2,311,820.25
DRILLISCH AG	2,188	68.54	149,965.52
ELISA OYJ	5,909	33.02	195,115.18
ILIAD SA	1,281	199.55	255,623.55
KONINKLIJKE KPN NV	162,533	2.94	477,847.02
ORANGE S.A.	91,611	14.68	1,345,307.53
PROXIMUS SA	6,313	27.89	176,101.13
TELECOM ITALIA SPA	547,534	0.74	405,175.16
TELECOM ITALIA-RNC	251,378	0.60	152,712.13
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	40,394	4.22	170,664.65
TELEFONICA S.A.	204,797	8.39	1,718,451.62
VIVENDI SA	48,538	22.74	1,103,754.12
E.ON SE	103,353	9.39	971,208.14
EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	101,010	2.92	295,454.25
ELECTRICITE DE FRANCE(EDF)	23,877	10.53	251,424.81
ENAGAS	10,471	24.21	253,502.91
ENDESA S.A.	15,037	18.48	277,883.76
ENEL SPA	373,477	5.31	1,985,030.25
ENGIE	81,947	14.51	1,189,460.70
FORTUM OYJ	21,758	17.16	373,367.28
GAS NATURAL SDG SA	16,170	19.29	311,919.30
IBERDROLA SA	263,897	6.53	1,723,775.20
INNOGY SE	5,851	32.64	191,005.89
RED ELECTRICA CORPORATION SA	18,384	18.80	345,619.20
RWE AG	25,177	17.09	430,400.81
SNAM SPA	99,978	4.13	413,509.00
SUEZ	17,725	14.74	261,355.12
TERNA SPA	66,384	5.02	333,247.68
UNIPER SE	8,953	26.32	235,642.96

	VEOLIA ENVIRONNEMENT	23,863	21.22	506,492.17
	ASML HOLDING NV	18,143	149.15	2,706,028.45
	INFINEON TECHNOLOGIES AG	51,065	23.13	1,181,388.77
	STMICROELECTRONICS NV	29,841	18.69	557,877.49
	ユーロ 小計	9,273,034		186,424,358.99 (24,941,714,989)
英ボンド	BP PLC	907,027	5.07	4,605,883.10
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	207,124	24.15	5,003,080.22
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	171,646	24.44	4,195,886.47
	WOOD GROUP (JOHN) PLC	32,660	6.39	208,697.40
	ANGLO AMERICAN PLC	62,567	14.65	916,606.55
	ANTOFAGASTA PLC	19,439	9.40	182,823.79
	BHP BILLITON PLC	98,568	14.15	1,394,737.20
	CRODA INTERNATIONAL PLC	6,223	43.65	271,633.95
	FRESNILLO PLC	8,512	13.26	112,869.12
	GLENCORE PLC	554,816	3.67	2,039,781.02
	JOHNSON MATTHEY PLC	9,426	30.79	290,226.54
	MONDI PLC	17,158	18.27	313,476.66
	RANDGOLD RESOURCES LTD	4,535	70.45	319,490.75
	RIO TINTO PLC	55,982	36.44	2,040,263.99
	ASHTREAD GROUP PLC	23,187	19.56	453,537.72
	BAE SYSTEMS PLC	141,730	5.64	799,357.20
	BUNZL PLC	16,237	20.68	335,781.16
	COBHAM PLC	108,087	1.24	134,135.96
	DCC PLC	3,732	72.85	271,876.20
	FERGUSON PLC	11,452	54.20	620,698.40
	IMI PLC	12,034	13.16	158,367.44
	MEGGITT PLC	36,960	4.82	178,184.16
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	78,620	8.62	677,704.40
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC-C ENTITLEMENT	3,616,520	0.00	3,616.52
	SMITHS GROUP PLC	18,742	14.79	277,194.18

TRAVIS PERKINS PLC	12,496	15.45	193,063.20
WEIR GROUP PLC/THE	9,222	20.93	193,016.46
BABCOCK INTERNATIONAL GROUP PLC	11,442	7.07	80,952.15
CAPITA PLC	30,870	4.02	124,251.75
EXPERIAN PLC	41,178	15.93	655,965.54
G4S PLC	74,291	2.58	192,116.52
INTERTEK GROUP PLC	7,844	51.05	400,436.20
MERLIN ENTERTAINMENTS PLC	32,557	3.60	117,335.42
EASYJET PLC	7,630	14.16	108,040.80
ROYAL MAIL PLC	36,064	4.54	163,946.94
GKN PLC	76,881	2.99	230,258.59
BURBERRY GROUP PLC	20,414	17.61	359,490.54
PERSIMMON PLC	13,916	27.19	378,376.04
TAYLOR WIMPEY PLC	157,966	2.06	326,515.72
THE BERKELEY GROUP HOLDINGS	5,336	41.98	224,005.28
CARNIVAL PLC	8,091	49.82	403,093.62
COMPASS GROUP PLC	73,801	15.66	1,155,723.66
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	8,683	46.16	400,807.28
TUI AG-DI	21,058	15.10	317,975.80
WHITBREAD PLC	7,771	38.64	300,271.44
ITV PLC	151,064	1.65	249,708.79
PEARSON PLC	38,689	7.20	278,560.80
RELX PLC	49,597	17.22	854,060.34
SKY PLC	46,118	10.21	470,864.78
WPP PLC	59,313	13.55	803,691.15
KINGFISHER PLC	100,357	3.39	340,712.01
MARKS & SPENCER GROUP PLC	71,350	3.09	220,471.50
NEXT PLC	6,971	42.38	295,430.98
SAINSBURY (J) PLC	89,242	2.37	212,038.99
TESCO PLC	373,597	2.06	769,609.82
WILLIAM MORRISON SUPERMARKETS PLC	100,809	2.12	214,521.55

ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	16,771	28.14	471,935.94
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	104,818	49.95	5,235,659.10
COCA-COLA HBC AG-CDI	8,704	23.53	204,805.12
DIAGEO PLC	114,782	26.67	3,061,809.85
IMPERIAL BRANDS PLC	44,572	31.43	1,400,897.96
UNILEVER PLC	57,387	41.83	2,400,498.21
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	49,137	6.46	317,425.02
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	31,106	66.67	2,073,837.02
CONVATEC GROUP PLC	61,239	2.09	128,479.42
MEDICLINIC INTERNATIONAL PLC	19,832	5.79	114,827.28
SMITH & NEPHEW PLC	39,633	12.86	509,680.38
ASTRAZENECA PLC	57,615	48.87	2,815,933.12
GLAXOSMITHKLINE PLC	223,940	13.10	2,933,614.00
SHIRE PLC	42,973	39.20	1,684,541.60
BARCLAYS PLC	792,430	2.04	1,618,142.06
HSBC HOLDINGS PLC	919,730	7.56	6,955,917.99
LLOYDS BANKING GROUP PLC	3,266,597	0.67	2,193,519.88
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	171,575	2.77	475,777.47
STANDARD CHARTERED PLC	152,372	7.71	1,174,788.12
3I GROUP PLC	44,300	9.01	399,143.00
HARGREAVES LANSDOWN PLC	11,038	17.40	192,061.20
INVESTEC PLC	33,008	5.15	169,991.20
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP PLC	14,680	37.88	556,078.40
SCHRODERS PLC	6,213	35.24	218,946.12
ADMIRAL GROUP PLC	7,842	19.38	151,977.96
AVIVA PLC	180,213	5.05	910,976.71
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	63,289	3.69	233,662.98
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	278,131	2.70	752,344.35
OLD MUTUAL PLC	225,291	2.18	492,936.70
PRUDENTIAL PLC	117,365	18.71	2,195,899.15
RSA INSURANCE GROUP PLC	50,045	6.14	307,526.52



	ST JAMES'S PLACE PLC	26,198	12.01	314,637.98
	STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	117,114	4.23	496,329.13
	AUTO TRADER GROUP PLC	42,053	3.50	147,437.81
	MICRO FOCUS INTERNATIONAL	20,358	24.85	505,896.30
	SAGE GROUP PLC/THE	49,630	7.88	391,332.55
	WORLDPAY GROUP PLC	90,562	4.31	390,503.34
	BT GROUP PLC	391,083	2.73	1,070,589.71
	VODAFONE GROUP PLC	1,224,564	2.33	2,853,846.40
	CENTRICA PLC	263,264	1.37	361,988.00
	NATIONAL GRID PLC	154,147	8.73	1,345,857.45
	SEVERN TRENT PLC	9,868	21.10	208,214.80
	SSE PLC	47,103	13.11	617,520.33
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	33,192	8.30	275,493.60
	英ボンド 小計	17,643,366		88,174,504.99 (13,342,566,095)
スイスフラン	CLARIANT AG-REG	10,101	27.70	279,797.70
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	421	660.00	277,860.00
	GIVAUDAN-REG	409	2,229.00	911,661.00
	LAFARGEHOLCIM LTD	20,950	54.10	1,133,395.00
	SIKA AG	99	7,635.00	755,865.00
	ABB LTD	83,337	26.12	2,176,762.44
	GEBERIT AG-REG	1,756	425.60	747,353.60
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	1,025	221.60	227,140.00
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	1,977	225.70	446,208.90
	ADECCO GROUP AG-REG	7,019	74.30	521,511.70
	SGS SA	252	2,483.00	625,716.00
	KUEHNE&NAGEL INTL AG-REG	2,362	172.80	408,153.60
	CIE FINANCIERE RICHEMONT SA-REGD A	24,348	88.45	2,153,580.60
	THE SWATCH GROUP AG-B	1,330	395.50	526,015.00
	THE SWATCH GROUP AG-REG	2,516	75.40	189,706.40
	DUFREY AG-REG	1,650	137.30	226,545.00

	BARRY CALLEBAUT AG-REG	109	1,923.00	209,607.00	
	LINDT & SPRUENGLI AG	45	5,810.00	261,450.00	
	LINDT & SPRUENGLI AG-REG	5	69,950.00	349,750.00	
	NESTLE SA-REGISTERED	142,846	83.60	11,941,925.60	
	SONOVA HOLDING AG	2,643	153.10	404,643.30	
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	435	688.00	299,280.00	
	LONZA GROUP AG-REG	3,490	262.60	916,474.00	
	NOVARTIS AG-REG SHS	101,741	83.80	8,525,895.80	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	32,132	244.70	7,862,700.40	
	VIFOR PHARMA AG	2,258	122.30	276,153.40	
	CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	112,838	17.52	1,976,921.76	
	JULIUS BAER GROUP LTD	10,863	59.60	647,434.80	
	PARGESA HOLDING SA-BR	1,867	85.20	159,068.40	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	818	670.00	548,060.00	
	UBS GROUP AG	166,157	18.15	3,015,749.55	
	BALOISE HOLDING AG	2,397	153.50	367,939.50	
	SWISS LIFE HOLDING AG	1,472	344.70	507,398.40	
	SWISS RE AG	14,456	91.60	1,324,169.60	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	6,837	300.30	2,053,151.10	
	SWISS PRIME SITE-REG	3,552	88.60	314,707.20	
	SWISSCOM AG-REG	1,163	523.00	608,249.00	
	スイスフラン 小計	767,676		54,178,000.75 (6,212,591,346)	
スウェーデンク ローナ	LUNDIN PETROLEUM AB	8,864	188.50	1,670,864.00	
	BOLIDEN AB	12,948	274.70	3,556,815.60	
	ALFA LAVAL AB	14,942	196.20	2,931,620.40	
	ASSA ABLOY AB-B	46,662	171.40	7,997,866.80	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	31,018	361.00	11,197,498.00	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	18,062	321.00	5,797,902.00	
	SANDVIK AB	50,953	146.30	7,454,423.90	
	SKANSKA AB-B SHS	15,711	171.50	2,694,436.50	

	SKF AB-B SHARES	16,642	185.40	3,085,426.80	
	VOLVO AB-B SHS	69,797	162.30	11,328,053.10	
	SECURITAS AB-B SHS	16,445	145.30	2,389,458.50	
	ELECTROLUX AB-SER B	11,716	270.20	3,165,663.20	
	HUSQVARNA AB-B SHS	18,593	81.10	1,507,892.30	
	HENNES & MAURITZ AB-B SHS	44,075	172.10	7,585,307.50	
	ICA GRUPPEN AB	3,550	295.80	1,050,090.00	
	SWEDISH MATCH AB	7,555	329.30	2,487,861.50	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	28,218	240.00	6,772,320.00	
	GETINGE AB-B SHS	9,989	120.80	1,206,671.20	
	NORDEA BANK AB	136,911	100.90	13,814,319.90	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN AB-A	70,814	99.00	7,010,586.00	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	69,942	114.70	8,022,347.40	
	SWEDBANK AB - A SHARES	41,807	203.00	8,486,821.00	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	6,266	203.20	1,273,251.20	
	INVESTOR AB-B SHS	21,167	385.40	8,157,761.80	
	KINNEVIK AB-B SHS	11,257	283.10	3,186,856.70	
	LUNDBERGS AB-B SHS	1,567	623.50	977,024.50	
	ERICSSON LM-B SHS	136,331	55.75	7,600,453.25	
	HEXAGON AB-B SHS	11,805	413.50	4,881,367.50	
	MILLICOM INTL CELLULAR-SDR	2,694	550.00	1,481,700.00	
	TELE2 AB-B SHS	18,224	106.80	1,946,323.20	
	TELIA CO AB	123,204	37.50	4,620,150.00	
	スウェーデンクローナ 小計	1,077,729		155,339,133.75 (2,089,311,348)	
ノルウェーク ローネ	STATOIL ASA	52,082	169.50	8,827,899.00	
	NORSK HYDRO ASA	60,434	58.10	3,511,215.40	
	YARA INTERNATIONAL ASA	8,716	382.00	3,329,512.00	
	SCIBSTED ASA-B SHS	3,724	212.00	789,488.00	
	MARINE HARVEST ASA	18,939	136.40	2,583,279.60	
	ORKLA ASA	39,257	86.60	3,399,656.20	

	DNB ASA	43,520	153.50	6,680,320.00	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	10,018	153.30	1,535,759.40	
	TELENOR ASA	35,540	178.50	6,343,890.00	
	ノルウェークローネ 小計	272,230		37,001,019.60 (500,623,795)	
デンマーククローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	4,916	565.50	2,779,998.00	
	NOVOZYMES A/S-B SHARES	10,279	348.40	3,581,203.60	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	10,030	428.40	4,296,852.00	
	ISS A/S	8,394	237.90	1,996,932.60	
	A P MOLLER-MAERSK A/S-A	168	10,130.00	1,701,840.00	
	A P MOLLER-MAERSK A/S-B	295	10,640.00	3,138,800.00	
	DSV A/S	8,324	492.70	4,101,234.80	
	PANDORA A/S	5,235	645.50	3,379,192.50	
	CARLSBERG AS-B	4,678	750.50	3,510,839.00	
	COLOPLAST-B	5,699	495.00	2,821,005.00	
	WILLIAM DEMANT HOLDING	4,455	174.60	777,843.00	
	GENMAB A/S	2,773	1,023.00	2,836,779.00	
	H LUNDBECK A/S	3,618	308.30	1,115,429.40	
	NOVO NORDISK A/S-B	85,614	332.30	28,449,532.20	
	DANSKE BANK A/S	33,659	242.10	8,148,843.90	
	TRYG A/S	5,005	154.60	773,773.00	
TDC A/S	37,115	38.56	1,431,154.40		
ORSTED A/S	8,516	348.20	2,965,271.20		
	デンマーククローネ 小計	238,773		77,806,523.60 (1,398,961,294)	
オーストラリアドル	CALTEX AUSTRALIA LIMITED	12,579	34.60	435,233.40	
	OIL SEARCH LTD	60,868	7.48	455,292.64	
	ORIGIN ENERGY LIMITED	83,171	9.24	768,500.04	
	SANTOS LTD	80,415	5.07	407,704.05	
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	38,819	32.14	1,247,642.66	
	ALUMINA LTD	106,977	2.39	255,675.03	

AMCOR LIMITED	50,321	15.59	784,504.39
BHP BILLITON LTD	147,478	28.47	4,198,698.66
BLUESCOPE STEEL LTD	23,089	14.11	325,785.79
BORAL LIMITED	55,663	7.85	436,954.55
FORTESCUE METALS GROUP LIMITED	72,860	4.90	357,014.00
INCITEC PIVOT LTD	85,406	3.81	325,396.86
JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	18,691	22.23	415,500.93
NEWCREST MINING LIMITED	36,681	22.06	809,182.86
ORICA LIMITED	17,981	18.12	325,815.72
RIO TINTO LIMITED	19,456	72.33	1,407,252.48
SOUTH32 LTD	251,784	3.37	848,512.08
CIMIC GROUP LTD	4,062	52.51	213,295.62
BRAMBLES LIMITED	72,482	9.99	724,095.18
SEEK LIMITED	16,538	18.80	310,914.40
AURIZON HOLDINGS LTD	100,415	4.94	496,050.10
ARISTOCRAT LEISURE LTD	23,822	23.70	564,581.40
CROWN RESORTS LTD	16,521	13.00	214,773.00
DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES LIMITED	3,373	42.99	145,005.27
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD	2,650	44.28	117,342.00
TABCORP HOLDINGS LIMITED	33,749	5.42	182,919.58
TABCORP HOLDINGS LIMITED-NEW	54,450	5.42	295,119.00
REA GROUP LTD	2,708	77.78	210,628.24
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	33,786	4.04	136,495.44
WESFARMERS LIMITED	52,630	44.79	2,357,297.70
WOOLWORTHS GROUP LTD	57,791	27.35	1,580,583.85
COCA-COLA AMATIL LIMITED	26,828	8.56	229,647.68
TREASURY WINE ESTATES LTD	35,556	16.42	583,829.52
COCHLEAR LIMITED	2,911	176.37	513,413.07
HEALTHSCOPE LTD	76,014	2.02	153,548.28
RAMSAY HEALTH CARE LTD	6,175	69.80	431,015.00
SONIC HEALTHCARE LTD	17,837	23.22	414,175.14

	CSL LIMITED	20,719	142.47	2,951,835.93	
	AUST AND NZ BANKING GROUP LT	133,345	29.02	3,869,671.90	
	BANK OF QUEENSLAND LIMITED	17,851	12.65	225,815.15	
	BENDIGO AND ADELAIDE BANK	19,841	11.53	228,766.73	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	79,152	80.30	6,355,905.60	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	121,834	29.85	3,636,744.90	
	WESTPAC BANKING CORPORATION	154,456	31.50	4,865,364.00	
	ASX LTD	9,287	56.45	524,251.15	
	CHALLENGER FINANCIAL SERVICE	30,000	14.28	428,400.00	
	MACQUARIE GROUP LTD	15,141	99.62	1,508,346.42	
	AMP LIMITED	129,763	5.24	679,958.12	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP LT	112,664	7.28	820,193.92	
	MEDIBANK PRIVATE LTD	128,724	3.27	420,927.48	
	QBE INSURANCE GROUP LIMITED	68,615	10.66	731,435.90	
	SUNCORP GROUP LTD	59,211	14.15	837,835.65	
	COMPUTERSHARE LIMITED	19,458	16.83	327,478.14	
	TELSTRA CORPORATION LIMITED	186,382	3.70	689,613.40	
	TPG TELECOM LTD	17,758	6.63	117,735.54	
	AGL ENERGY LIMITED	31,366	24.90	781,013.40	
	AUSNET SERVICES	85,220	1.86	158,509.20	
	オーストラリアドル 小計	3,243,324		53,839,198.14 (4,657,629,031)	
ニュージーランドドル	FLETCHER BUILDING LTD	33,434	7.72	258,110.48	
	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	37,455	6.61	247,577.55	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	26,889	14.09	378,866.01	
	RYMAN HEALTHCARE LIMITED	19,820	10.28	203,749.60	
	SPARK NEW ZEALAND LIMITED	79,808	3.63	289,703.04	
	MERCURY NZ LTD	43,195	3.37	145,783.12	
	MERIDIAN ENERGY LTD	49,475	2.94	145,456.50	
	ニュージーランドドル 小計	290,076		1,669,246.30 (131,603,378)	

香港ドル	NWS HOLDINGS LTD	69,500	13.88	964,660.00	
	MTR CORPORATION	72,500	45.30	3,284,250.00	
	MINTH GROUP LTD	32,000	45.15	1,444,800.00	
	LI & FUNG LTD	237,200	4.22	1,000,984.00	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	65,500	47.25	3,094,875.00	
	YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	27,000	29.70	801,900.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LIMITED	106,000	62.10	6,582,600.00	
	MGM CHINA HOLDINGS LTD	44,000	23.55	1,036,200.00	
	SANDS CHINA LTD	107,200	40.05	4,293,360.00	
	SHANGRI-LA ASIA LTD.	64,000	16.30	1,043,200.00	
	SJM HOLDINGS LIMITED	80,000	6.89	551,200.00	
	WYNN MACAU LTD	78,000	24.60	1,918,800.00	
	WH GROUP LIMITED	397,500	8.50	3,378,750.00	
	BANK OF EAST ASIA	52,820	32.70	1,727,214.00	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	170,000	38.85	6,604,500.00	
	HANG SENG BANK LTD	37,800	188.70	7,132,860.00	
	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	125,924	96.55	12,157,962.20	
	FIRST PACIFIC COMPANY	86,000	5.35	460,100.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEARING LIMITED	53,900	233.20	12,569,480.00	
	KINGSTON FINANCIAL GROUP LIMITED	162,000	7.64	1,237,680.00	
	AIA GROUP LTD	551,200	63.15	34,808,280.00	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	120,424	66.80	8,044,323.20	
	HANG LUNG GROUP LTD	42,000	28.05	1,178,100.00	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	98,000	18.50	1,813,000.00	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	56,020	50.00	2,801,000.00	
	HYSAN DEVELOPMENT CO	29,000	41.95	1,216,550.00	
	KERRY PROPERTIES LTD	27,500	33.10	910,250.00	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	261,333	11.18	2,921,702.94	
	SINO LAND CO	160,200	13.30	2,130,660.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	64,000	128.00	8,192,000.00	
SWIRE PACIFIC LTD 'A'	25,500	73.20	1,866,600.00		

	SWIRE PROPERTIES LIMITED	53,000	25.10	1,330,300.00	
	WHARF HOLDINGS LTD	59,000	26.25	1,548,750.00	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	59,000	51.50	3,038,500.00	
	WHEELLOCK&COMPANY LTD	33,000	53.00	1,749,000.00	
	PCCW LIMITED	194,000	4.56	884,640.00	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD	30,000	66.00	1,980,000.00	
	CLP HOLDINGS LTD	74,600	79.60	5,938,160.00	
	HK ELECTRIC INVESTMENTS-SS	111,000	7.12	790,320.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	396,079	15.10	5,980,792.90	
	POWER ASSETS HOLDINGS LIMITED	60,000	65.25	3,915,000.00	
	ASM PACIFIC TECHNOLOGY	12,300	108.20	1,330,860.00	
	香港ドル 小計	4,586,000		165,654,164.24 (2,393,702,673)	
シンガポールドル	KEPPEL CORP LTD	70,300	7.50	527,250.00	
	SEBCCORP INDUSTRIES LTD	43,720	3.02	132,034.40	
	SINGAPORE TECHNOLOGIES ENG	68,300	3.17	216,511.00	
	YANGZIJIANG SHIPBUILDING HOLDINGS LTD	90,000	1.49	134,100.00	
	COMFORTDELGRO CORP LTD	107,000	1.91	204,370.00	
	SATS LTD	26,800	5.26	140,968.00	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	25,066	10.65	266,952.90	
	GENTING SINGAPORE PLC	280,700	1.34	376,138.00	
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	56,350	2.61	147,073.50	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	4,700	40.98	192,606.00	
	GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	353,600	0.37	132,600.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	69,900	3.10	216,690.00	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	82,400	24.71	2,036,104.00	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	147,700	12.25	1,809,325.00	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	61,300	26.02	1,595,026.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	35,600	7.43	264,508.00	
	CAPITALAND LTD	124,300	3.51	436,293.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	16,100	12.37	199,157.00	



	GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES LIMITED	128,600	3.36	432,096.00	
	UOL GROUP LIMITED	21,700	8.85	192,045.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	377,615	3.61	1,363,190.15	
	STARHUB LIMITED	21,900	2.88	63,072.00	
	シンガポールドル 小計	2,213,651		11,078,109.95	(929,010,300)
イスラエルシュケル	FRUTAROM INDUSTRIES LTD	1,842	295.00	543,390.00	
	ISRAEL CHEMICALS LIMITED	21,574	13.89	299,662.86	
	ELBIT SYSTEMS LTD	1,198	465.20	557,309.60	
	BANK HAPOLIM BM	53,450	24.55	1,312,197.50	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	65,574	20.26	1,328,529.24	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	5,442	62.42	339,689.64	
	AZRIELI GROUP	2,383	187.10	445,859.30	
	NICE LTD	2,768	312.40	864,723.20	
	BEZEQ ISRAELI TELECOMMUNICATION CORP LTD	100,118	5.09	509,800.85	
	イスラエルシュケル 小計	254,349		6,201,162.19	(200,111,503)
	合 計	55,779,684		186,044,625,761	(186,044,625,761)

(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 605銘柄	62.1%	65.6%
カナダドル	株式 89銘柄	3.7%	3.9%
ユーロ	株式 242銘柄	12.7%	13.4%
英ポンド	株式 100銘柄	6.8%	7.2%
スイスフラン	株式 37銘柄	3.2%	3.3%
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 9銘柄	0.3%	0.3%
デンマーククローネ	株式 18銘柄	0.7%	0.8%
オーストラリアドル	株式 57銘柄	2.4%	2.5%
ニュージーランドドル	株式 7銘柄	0.1%	0.1%
香港ドル	株式 42銘柄	1.2%	1.3%
シンガポールドル	株式 22銘柄	0.5%	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	19,807	396,536.14	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITIES, INC.	4,326	569,301.60	
		AMERICAN TOWER CORP	19,474	2,762,581.64	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	54,341	643,940.85	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	6,474	1,150,559.28	
		BOSTON PROPERTIES INC	7,005	902,524.20	
		BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	12,150	221,737.50	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	4,242	388,270.26	
		COLONY NORTHSTAR INC-CLASS A	24,561	290,556.63	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	9,619	1,075,211.82	
		DUKE REALTY CORP	16,657	454,236.39	
		EQUITY RESIDENTIAL	17,242	1,108,660.60	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	3,108	754,684.56	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	5,405	465,911.00	
		FEDERAL REALTY INVESTMENT TRUST	3,224	425,664.72	
		GGP INC	29,033	678,501.21	
		HCP, INC.	22,100	576,810.00	
		HOST HOTELS AND RESORTS INC	35,763	725,273.64	
		HUTCHISON PORT HOLDINGS TRUST	283,000	114,615.00	
		INVITATION HOMES INC	14,734	348,753.78	
		IRON MOUNTAIN INC	12,165	461,661.75	
		KIMCO REALTY CORPORATION	20,926	383,155.06	
		LIBERTY PROPERTY TRUST	6,876	296,974.44	
MACERICH COMPANY/THE	5,229	344,381.94			
MID-AMERICA APARTMENT COMMUNITIES	5,619	559,090.50			
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	6,416	275,503.04			
PROLOGIS INC	24,581	1,557,943.78			

	PUBLIC STORAGE	7,048	1,467,464.08	
	REALTY INCOME CORPORATION	13,190	743,256.50	
	REGENCY CENTERS CORP	7,446	513,774.00	
	SIMON PROPERTY GROUP INC	14,072	2,370,006.24	
	SL GREEN REALTY CORP	4,854	493,263.48	
	UDR INC	13,130	500,778.20	
	VENTAS INC	16,268	1,005,850.44	
	VEREIT INC	44,740	351,209.00	
	VORNADO REALTY TRUST	7,603	594,402.54	
	WELLTOWER INC	16,834	1,085,456.32	
	WEYERHAEUSER CO	33,634	1,193,334.32	
米ドル 小計		852,896	28,251,836.45	(3,191,609,963)
カナダドル	H&R REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	8,036	168,916.72	
	RIOCAN REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	7,441	186,843.51	
	SMARTCENTRES REAL ESTATE INVESTMENT TRUS	1,625	49,968.75	
カナダドル 小計		17,102	405,728.98	(35,614,889)
ユーロ	FONCIERE DES REGIONS	1,550	145,917.00	
	GECINA SA	2,152	327,534.40	
	ICADE	1,265	103,426.40	
	KLEPIERRE	9,305	337,213.20	
	UNIBAIL-RODAMCO SE	4,682	1,018,100.90	
ユーロ 小計		18,954	1,932,191.90	(258,507,954)
英ポンド	BRITISH LAND CO PLC	47,527	322,708.33	
	HAMMERSON PLC	34,414	183,770.76	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	32,703	323,923.21	
	SEGRO PLC	49,582	286,336.05	

英ポンド 小計		164,226	1,116,738.35 (168,984,847)
オーストラリアドル	APA GROUP	48,387	417,095.94
	DEXUS	47,512	485,097.52
	GOODMAN GROUP	77,655	688,023.30
	GPT GROUP	87,590	475,613.70
	LENDLEASE GROUP	25,262	408,991.78
	MIRVAC GROUP	182,452	447,007.40
	SCENTRE GROUP	234,290	1,009,789.90
	STOCKLAND	118,563	560,802.99
	SYDNEY AIRPORT	49,760	372,204.80
	TRANSURBAN GROUP	93,469	1,213,227.62
	TRANSURBAN GROUP-RTS-NEW	8,043	13,512.24
	VICINITY CENTRES	146,656	415,036.48
WESTFIELD CORP	87,803	820,958.05	
オーストラリアドル 小計		1,207,442	7,327,361.72 (633,890,062)
香港ドル	HKT TRUST AND HKT LTD	182,000	1,778,140.00
	LINK REIT	101,000	7,176,050.00
香港ドル 小計		283,000	8,954,190.00 (129,388,045)
シンガポールドル	ASCENDAS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	118,300	318,227.00
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	130,000	250,900.00
	CAPITALAND MALL TRUST	102,800	221,020.00
	SUNTEC REIT	112,900	247,251.00
シンガポールドル 小計		464,000	1,037,398.00 (86,996,196)
合計			4,504,991,956 (4,504,991,956)

(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 38銘柄	1.6%	70.8%
カナダドル	投資証券 3銘柄	0.0%	0.8%
ユーロ	投資証券 5銘柄	0.1%	5.7%
英ポンド	投資証券 4銘柄	0.1%	3.8%
オーストラリアドル	投資証券 13銘柄	0.3%	14.1%
香港ドル	投資証券 2銘柄	0.1%	2.9%
シンガポールドル	投資証券 4銘柄	0.0%	1.9%

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 &lt; 適格機関投資家限定 &gt;

## 貸借対照表

(単位：円)

	(平成28年12月20日現在)	(平成29年12月20日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
金銭信託	209	330
コール・ローン	9,835	9,678
親投資信託受益証券	2,605,037,268	3,177,097,602
未収入金	-	1,289,999
流動資産合計	2,605,047,312	3,178,397,609
資産合計	2,605,047,312	3,178,397,609
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	-	1,289,999
未払受託者報酬	3,092	7,519
未払委託者報酬	1,546	3,758
その他未払費用	386	939
流動負債合計	5,024	1,302,215
負債合計	5,024	1,302,215
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	1,539,170,048	1,790,930,806
剰余金		
剰余金又は欠損金( )	1,065,872,240	1,386,164,588
元本等合計	2,605,042,288	3,177,095,394
純資産合計	2,605,042,288	3,177,095,394
負債純資産合計	2,605,047,312	3,178,397,609

## 注記表

## （重要な会計方針の注記）

項 目	自 平成29年12月19日 至 平成29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28年12月20日現在）	（平成29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	1,539,170,048口	1,790,930,806口
2. 1単位当たり純資産の額	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)	1口当たり純資産額 1.7740円 (10,000口当たりの純資産額 17,740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29年12月19日 至 平成29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	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29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（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29年12月19日 至 平成29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28年12月20日現在)	(平成29年12月20日現在)
期首元本額	1,539,170,048円	1,791,658,838円
期中追加設定元本額	-円	-円
期中一部解約元本額	-円	728,032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	1,774,815,710	3,177,097,602	
合計		1,774,815,710	3,177,097,602	

## 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28年12月20日現在）	（平成29年12月20日現在）
<b>資産の部</b>		
流動資産		
預金	1,273,061,387	405,471,755
金銭信託	9,352,570	8,092,878
コール・ローン	441,158,759	237,537,381
国債証券	176,728,680,500	193,072,354,181
派生商品評価勘定	2,518,000	2,211
未収入金	-	1,029,377,863
未収利息	1,434,187,906	1,500,463,204
前払費用	22,195,549	21,285,199
流動資産合計	179,911,154,671	196,274,584,672
資産合計	179,911,154,671	196,274,584,672
<b>負債の部</b>		
流動負債		
派生商品評価勘定	41,850	6,059,594
未払解約金	632,657,000	490,590,136
未払利息	1,106	647
その他未払費用	7,794	478
流動負債合計	632,707,750	496,650,855
負債合計	632,707,750	496,650,855
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	105,043,968,082	109,365,735,384
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	74,234,478,839	86,412,198,433
元本等合計	179,278,446,921	195,777,933,817
純資産合計	179,278,446,921	195,777,933,817
負債純資産合計	179,911,154,671	196,274,584,672

## 注記表

## （重要な会計方針の注記）

項目	自 平成29年12月19日 至 平成29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 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。</p>
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建資産等の会計処理 「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。</p>

## （貸借対照表に関する注記）

項目	（平成28年12月20日現在）	（平成29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	105,043,968,082口	109,365,735,384口
2. 1単位当たり純資産の額	<p>1口当たり純資産額 1.7067円</p> <p>(10,000口当たりの純資産額 17,067円)</p>	<p>1口当たり純資産額 1.7901円</p> <p>(10,000口当たりの純資産額 17,901円)</p>

## （金融商品に関する注記）

## ・金融商品の状況に関する事項

項目	自 平成29年12月19日 至 平成29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、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、価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。 当計算期間については、為替予約取引を行っております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2)金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する委員会をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用グループに是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用グループは、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。その後、当該関連運用グループの対処の実施や対処方針の決定等に関し、必要に応じてリスク管理を行う部署が当該部署の担当役員、当該関連運用グループの担当役員およびリスク管理委員会へ報告を行う体制となっております。</p> <p>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する部会にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。</p>
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって認める評価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。

## ・金融商品の時価等に関する事項

項目	(平成29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

(平成29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
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	228,387	-	229,058	671
	米ドル	71,162	-	71,408	246
	英ポンド	48,280	-	48,457	177
	デンマーククローネ	37,335	-	37,571	236
	オーストラリアドル	71,610	-	71,622	12
	売建	1,574,924,543	-	1,580,982,597	6,058,054
	米ドル	669,893,912	-	671,377,339	1,483,427
	カナダドル	42,940,128	-	43,055,552	115,424
	ユーロ	660,819,161	-	664,610,106	3,790,945
	英ポンド	99,276,432	-	99,597,537	321,105
	ノルウェークローネ	15,124,204	-	15,129,799	5,595
	デンマーククローネ	30,733,437	-	30,998,562	265,125
	オーストラリアドル	56,137,269	-	56,213,702	76,433
合計	1,575,152,930	-	1,581,211,655	6,057,383	

(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29年12月19日

至 平成29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
SMAM・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
SMAM・年金外国債券パッシブ・ファンド<適格機関投資家限定>	1,526,359,213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>	3,377,004,481円
SMAM・バランスファンドVA25<適格機関投資家専用>	17,643,484,733円
SMAM・バランスファンドVA37.5<適格機関投資家専用>	7,371,088,826円
SMAM・バランスファンドVA50<適格機関投資家専用>	16,466,642,012円
SMAM・バランスファンドVL30<適格機関投資家限定>	45,061,279円
SMAM・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
SMAM・バランスファンドVA75<適格機関投資家専用>	1,002,314,233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>	152,420,385円
SMAM・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
SMAM・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
SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用>	5,074,689,743円
SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>	8,893,095,939円
SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定>	152,226,438円
SMAM・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
SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	254,769,722円
SMAM・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
SMAM・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
SMAM・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
SMAM・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
SMAM・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
SMAM・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
SMAM・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

SMAM・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
SMAM・アセットバランスファンドVA35A2<適格機関投資家専用>	57,239,716円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A2<適格機関投資家専用>	7,011,810円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L2<適格機関投資家専用>	1,748,852,664円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T2<適格機関投資家専用>	26,356,319円
SMAM・FG新興国重視型バランス20VA<適格機関投資家限定>	171,310円
SMAM・FGグローバルバランス25VA<適格機関投資家限定>	4,647,684円
SMAM・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
SMAM・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
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>	479,601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>	309,855,468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>	148,488,043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>	195,895,157円
合計	105,043,968,082円

(平成29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	109,632,576,441円
同期中における追加設定元本額	11,686,625円
同期中における一部解約元本額	278,527,682円
平成29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	9,319,472,192円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	459,274,015円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	1,286,373,553円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	657,438,711円
SMAM・グローバルバランスファンド(機動的資産配分型)	104,361,905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)	9,157,799円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2025(4資産タイプ)	29,418,160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)	76,368,088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)	68,080,490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)	34,550,724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)	89,885,625円
三井住友・DC年金バランスゼロ(債券型)	9,924,702円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	104,851,315円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	563,157,541円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	599,753,814円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2050	1,913,352円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	266,414円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	1,256,239円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	3,562,224円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	7,669,864円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	3,244,789円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	3,205,926円
SMAM・年金外国債券パッシブ・ファンド<適格機関投資家限定>	1,774,815,710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>	1,319,549,606円
SMAM・バランスファンドVA25<適格機関投資家専用>	14,851,179,195円
SMAM・バランスファンドVA37.5<適格機関投資家専用>	6,648,961,958円
SMAM・バランスファンドVA50<適格機関投資家専用>	15,054,801,682円
SMAM・バランスファンドVL30<適格機関投資家限定>	43,696,403円
SMAM・バランスファンドVL50<適格機関投資家限定>	121,974,110円
世界6資産バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	1,213,202円
SMAM・バランスファンドVA75<適格機関投資家専用>	938,475,522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>	147,725,620円
SMAM・インデックス・バランスVA25<適格機関投資家専用>	1,434,030,519円



SMAM・インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用>	1,765,339,037円
SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用>	3,225,831,390円
SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>	7,898,243,395円
SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定>	130,657,843円
SMAM・外国債券パッシブファンドVA<適格機関投資家限定>	12,770,657,962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)	1,147,033,015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)	2,304,641,226円
SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	229,263,825円
SMAM・バランスファンドVA20<適格機関投資家専用>	713,185,726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)	2,688,539,060円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>	171,817,237円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>	48,083,151円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用>	15,190,605円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>	171,912,206円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	624,328,555円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T<適格機関投資家専用>	196,185,158円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A2<適格機関投資家専用>	183,960,784円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A2<適格機関投資家専用>	54,582,186円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A2<適格機関投資家専用>	7,027,104円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L2<適格機関投資家専用>	1,592,315,188円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T2<適格機関投資家専用>	23,792,981円
SMAM・グローバルバランスファンド(標準型)VA<適格機関投資家限定>	4,637,499,307円
SMAM・グローバルバランスファンド(債券重視型)VA<適格機関投資家限定>	2,248,436,510円
SMAM・世界バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	7,143,194,418円
SMAM・世界バランスファンドVA2<適格機関投資家限定>	2,637,262,820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>	720,813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>	398,221,098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>	190,808,561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>	377,393,254円
合計	109,365,735,384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 0.75	2,000,000.00	1,975,781.26	
		US TREASURY N/B 0.75	2,000,000.00	1,965,937.50	
		US TREASURY N/B 0.75	3,000,000.00	2,946,328.14	
		US TREASURY N/B 0.875	4,000,000.00	3,949,687.52	
		US TREASURY N/B 0.875	3,000,000.00	2,960,625.00	
		US TREASURY N/B 0.875	3,000,000.00	2,957,812.50	
		US TREASURY N/B 0.875	2,000,000.00	1,970,000.00	

US TREASURY N/B 0.875	3,000,000.00	2,949,375.00	
US TREASURY N/B 1	3,000,000.00	2,978,671.89	
US TREASURY N/B 1	4,000,000.00	3,960,312.52	
US TREASURY N/B 1	3,000,000.00	2,962,968.75	
US TREASURY N/B 1	2,300,000.00	2,267,656.25	
US TREASURY N/B 1	2,000,000.00	1,970,156.26	
US TREASURY N/B 1	2,000,000.00	1,969,062.50	
US TREASURY N/B 1	2,000,000.00	1,967,656.26	
US TREASURY N/B 1	3,000,000.00	2,950,312.50	
US TREASURY N/B 1.125	3,000,000.00	2,978,437.50	
US TREASURY N/B 1.125	3,000,000.00	2,977,500.00	
US TREASURY N/B 1.125	3,000,000.00	2,975,390.64	
US TREASURY N/B 1.125	2,000,000.00	1,980,468.76	
US TREASURY N/B 1.125	3,000,000.00	2,955,234.39	
US TREASURY N/B 1.125	2,800,000.00	2,751,656.26	
US TREASURY N/B 1.125	3,000,000.00	2,945,625.00	
US TREASURY N/B 1.125	3,800,000.00	3,693,421.89	
US TREASURY N/B 1.125	3,000,000.00	2,902,500.00	
US TREASURY N/B 1.125	3,000,000.00	2,898,984.39	
US TREASURY N/B 1.125	4,000,000.00	3,860,000.00	
US TREASURY N/B 1.125	3,500,000.00	3,373,671.87	
US TREASURY N/B 1.25	3,000,000.00	2,985,937.50	
US TREASURY N/B 1.25	3,000,000.00	2,984,296.89	
US TREASURY N/B 1.25	3,000,000.00	2,983,125.00	
US TREASURY N/B 1.25	4,000,000.00	3,975,625.00	
US TREASURY N/B 1.25	3,000,000.00	2,978,203.14	
US TREASURY N/B 1.25	2,000,000.00	1,984,687.50	
US TREASURY N/B 1.25	2,000,000.00	1,983,593.76	
US TREASURY N/B 1.25	2,000,000.00	1,977,968.76	
US TREASURY N/B 1.25	3,000,000.00	2,959,921.89	
US TREASURY N/B 1.25	3,000,000.00	2,959,218.75	

US TREASURY N/B 1.25	3,600,000.00	3,509,437.50	
US TREASURY N/B 1.25	3,500,000.00	3,387,617.20	
US TREASURY N/B 1.25	3,000,000.00	2,836,640.64	
US TREASURY N/B 1.375	2,000,000.00	1,992,968.76	
US TREASURY N/B 1.375	2,000,000.00	1,991,562.50	
US TREASURY N/B 1.375	2,000,000.00	1,989,843.76	
US TREASURY N/B 1.375	3,000,000.00	2,970,000.00	
US TREASURY N/B 1.375	3,000,000.00	2,968,593.75	
US TREASURY N/B 1.375	4,000,000.00	3,957,812.52	
US TREASURY N/B 1.375	3,000,000.00	2,966,718.75	
US TREASURY N/B 1.375	5,000,000.00	4,942,578.15	
US TREASURY N/B 1.375	4,000,000.00	3,952,187.52	
US TREASURY N/B 1.375	4,000,000.00	3,949,062.52	
US TREASURY N/B 1.375	3,000,000.00	2,960,625.00	
US TREASURY N/B 1.375	4,000,000.00	3,940,000.00	
US TREASURY N/B 1.375	1,900,000.00	1,871,648.44	
US TREASURY N/B 1.375	3,000,000.00	2,952,656.25	
US TREASURY N/B 1.375	3,700,000.00	3,638,718.75	
US TREASURY N/B 1.375	3,000,000.00	2,941,875.00	
US TREASURY N/B 1.375	4,000,000.00	3,911,250.00	
US TREASURY N/B 1.375	4,000,000.00	3,906,875.00	
US TREASURY N/B 1.375	3,000,000.00	2,859,843.75	
US TREASURY N/B 1.375	4,000,000.00	3,805,000.00	
US TREASURY N/B 1.375	3,000,000.00	2,851,406.25	
US TREASURY N/B 1.5	3,700,000.00	3,688,148.45	
US TREASURY N/B 1.5	2,000,000.00	1,993,125.00	
US TREASURY N/B 1.5	4,000,000.00	3,984,687.52	
US TREASURY N/B 1.5	3,000,000.00	2,985,000.00	
US TREASURY N/B 1.5	3,000,000.00	2,979,609.39	
US TREASURY N/B 1.5	5,000,000.00	4,964,453.15	
US TREASURY N/B 1.5	3,000,000.00	2,969,296.89	

US TREASURY N/B 1.5	1,000,000.00	989,609.38	
US TREASURY N/B 1.5	2,000,000.00	1,977,968.76	
US TREASURY N/B 1.5	3,000,000.00	2,922,656.25	
US TREASURY N/B 1.5	3,000,000.00	2,890,546.89	
US TREASURY N/B 1.5	3,000,000.00	2,887,968.75	
US TREASURY N/B 1.5	7,000,000.00	6,485,937.50	
US TREASURY N/B 1.625	5,000,000.00	4,987,109.40	
US TREASURY N/B 1.625	4,000,000.00	3,989,687.52	
US TREASURY N/B 1.625	3,000,000.00	2,989,921.89	
US TREASURY N/B 1.625	2,000,000.00	1,992,968.76	
US TREASURY N/B 1.625	3,000,000.00	2,988,515.64	
US TREASURY N/B 1.625	4,000,000.00	3,978,437.52	
US TREASURY N/B 1.625	3,500,000.00	3,473,476.58	
US TREASURY N/B 1.625	3,000,000.00	2,975,859.39	
US TREASURY N/B 1.625	2,700,000.00	2,671,945.32	
US TREASURY N/B 1.625	3,000,000.00	2,926,640.64	
US TREASURY N/B 1.625	4,000,000.00	3,895,312.52	
US TREASURY N/B 1.625	3,500,000.00	3,406,210.95	
US TREASURY N/B 1.625	3,000,000.00	2,903,906.25	
US TREASURY N/B 1.625	3,000,000.00	2,900,625.00	
US TREASURY N/B 1.625	3,000,000.00	2,889,843.75	
US TREASURY N/B 1.625	6,000,000.00	5,643,281.28	
US TREASURY N/B 1.625	6,300,000.00	5,912,156.25	
US TREASURY N/B 1.75	4,000,000.00	3,991,562.52	
US TREASURY N/B 1.75	2,300,000.00	2,285,984.37	
US TREASURY N/B 1.75	2,000,000.00	1,985,156.26	
US TREASURY N/B 1.75	3,000,000.00	2,955,468.75	
US TREASURY N/B 1.75	3,000,000.00	2,951,953.14	
US TREASURY N/B 1.75	3,500,000.00	3,439,296.87	
US TREASURY N/B 1.75	3,000,000.00	2,945,390.64	
US TREASURY N/B 1.75	3,000,000.00	2,949,375.00	

US TREASURY N/B 1.75	3,000,000.00	2,943,984.39	
US TREASURY N/B 1.75	3,000,000.00	2,941,640.64	
US TREASURY N/B 1.75	3,000,000.00	2,936,015.64	
US TREASURY N/B 1.75	3,000,000.00	2,928,984.39	
US TREASURY N/B 1.75	5,700,000.00	5,551,265.62	
US TREASURY N/B 1.875	3,000,000.00	2,996,250.00	
US TREASURY N/B 1.875	3,000,000.00	2,973,515.64	
US TREASURY N/B 1.875	4,000,000.00	3,954,375.00	
US TREASURY N/B 1.875	4,000,000.00	3,953,125.00	
US TREASURY N/B 1.875	2,000,000.00	1,975,000.00	
US TREASURY N/B 1.875	3,000,000.00	2,960,390.64	
US TREASURY N/B 1.875	3,000,000.00	2,961,796.89	
US TREASURY N/B 1.875	4,000,000.00	3,939,375.00	
US TREASURY N/B 1.875	3,000,000.00	2,952,421.89	
US TREASURY N/B 2	3,000,000.00	3,004,218.75	
US TREASURY N/B 2	2,300,000.00	2,302,335.94	
US TREASURY N/B 2	1,600,000.00	1,600,875.00	
US TREASURY N/B 2	3,000,000.00	2,997,187.50	
US TREASURY N/B 2	3,000,000.00	2,993,437.50	
US TREASURY N/B 2	3,000,000.00	2,988,281.25	
US TREASURY N/B 2	3,000,000.00	2,985,937.50	
US TREASURY N/B 2	4,300,000.00	4,283,539.08	
US TREASURY N/B 2	4,200,000.00	4,175,062.50	
US TREASURY N/B 2	3,100,000.00	3,082,562.50	
US TREASURY N/B 2	3,000,000.00	2,973,750.00	
US TREASURY N/B 2	500,000.00	494,960.94	
US TREASURY N/B 2	3,000,000.00	2,968,828.14	
US TREASURY N/B 2	5,500,000.00	5,435,976.59	
US TREASURY N/B 2	2,000,000.00	1,959,375.00	
US TREASURY N/B 2	5,000,000.00	4,894,531.25	
US TREASURY N/B 2	2,500,000.00	2,445,898.45	

US TREASURY N/B 2	6,300,000.00	6,140,039.09	
US TREASURY N/B 2	6,300,000.00	6,123,304.71	
US TREASURY N/B 2	6,200,000.00	5,974,281.25	
US TREASURY N/B 2.125	3,000,000.00	3,013,593.75	
US TREASURY N/B 2.125	2,700,000.00	2,708,859.37	
US TREASURY N/B 2.125	1,700,000.00	1,702,125.00	
US TREASURY N/B 2.125	4,000,000.00	4,003,437.52	
US TREASURY N/B 2.125	3,000,000.00	3,000,000.00	
US TREASURY N/B 2.125	3,000,000.00	2,998,593.75	
US TREASURY N/B 2.125	3,000,000.00	2,990,625.00	
US TREASURY N/B 2.125	4,000,000.00	3,979,375.00	
US TREASURY N/B 2.125	4,000,000.00	3,959,687.52	
US TREASURY N/B 2.125	2,000,000.00	1,975,781.26	
US TREASURY N/B 2.125	4,000,000.00	3,949,375.00	
US TREASURY N/B 2.125	7,900,000.00	7,779,648.47	
US TREASURY N/B 2.125	6,000,000.00	5,890,312.50	
US TREASURY N/B 2.25	3,000,000.00	3,019,453.14	
US TREASURY N/B 2.25	2,000,000.00	2,012,656.26	
US TREASURY N/B 2.25	2,800,000.00	2,814,656.26	
US TREASURY N/B 2.25	3,000,000.00	2,987,578.14	
US TREASURY N/B 2.25	2,000,000.00	1,991,562.50	
US TREASURY N/B 2.25	1,500,000.00	1,488,632.82	
US TREASURY N/B 2.25	6,300,000.00	6,249,796.87	
US TREASURY N/B 2.25	7,000,000.00	6,916,875.00	
US TREASURY N/B 2.25	7,000,000.00	6,879,140.66	
US TREASURY N/B 2.25	6,600,000.00	6,476,250.00	
US TREASURY N/B 2.25	2,500,000.00	2,452,539.07	
US TREASURY N/B 2.25	5,000,000.00	4,432,812.50	
US TREASURY N/B 2.375	2,000,000.00	2,022,187.50	
US TREASURY N/B 2.375	8,000,000.00	8,003,125.04	
US TREASURY N/B 2.375	6,000,000.00	5,956,406.28	

US TREASURY N/B 2.5	5,000,000.00	5,058,593.75	
US TREASURY N/B 2.5	7,000,000.00	7,060,703.16	
US TREASURY N/B 2.5	5,100,000.00	4,788,023.46	
US TREASURY N/B 2.5	5,300,000.00	4,958,398.46	
US TREASURY N/B 2.5	5,000,000.00	4,680,078.15	
US TREASURY N/B 2.625	4,000,000.00	4,070,312.52	
US TREASURY N/B 2.625	5,500,000.00	5,600,976.59	
US TREASURY N/B 2.75	3,000,000.00	3,032,343.75	
US TREASURY N/B 2.75	6,200,000.00	6,357,421.90	
US TREASURY N/B 2.75	5,100,000.00	5,221,921.87	
US TREASURY N/B 2.75	2,000,000.00	1,984,687.50	
US TREASURY N/B 2.75	5,000,000.00	4,957,421.90	
US TREASURY N/B 2.75	800,000.00	787,562.50	
US TREASURY N/B 2.75	1,500,000.00	1,477,851.57	
US TREASURY N/B 2.875	3,000,000.00	3,038,671.89	
US TREASURY N/B 2.875	4,000,000.00	4,038,125.00	
US TREASURY N/B 2.875	4,500,000.00	4,540,781.25	
US TREASURY N/B 3	1,800,000.00	1,868,343.75	
US TREASURY N/B 3	4,000,000.00	4,139,375.00	
US TREASURY N/B 3	4,000,000.00	4,138,750.00	
US TREASURY N/B 3	4,900,000.00	5,065,757.83	
US TREASURY N/B 3	2,500,000.00	2,586,523.45	
US TREASURY N/B 3	2,200,000.00	2,275,968.75	
US TREASURY N/B 3.125	2,000,000.00	2,035,937.50	
US TREASURY N/B 3.125	3,000,000.00	3,106,171.89	
US TREASURY N/B 3.125	2,000,000.00	2,120,781.26	
US TREASURY N/B 3.125	2,000,000.00	2,120,468.76	
US TREASURY N/B 3.125	700,000.00	740,960.94	
US TREASURY N/B 3.125	5,400,000.00	5,718,093.75	
US TREASURY N/B 3.375	5,000,000.00	5,142,578.15	
US TREASURY N/B 3.375	4,000,000.00	4,421,562.52	

US TREASURY N/B 3.5	4,500,000.00	4,666,640.62	
US TREASURY N/B 3.5	1,500,000.00	1,691,601.57	
US TREASURY N/B 3.625	5,000,000.00	5,143,750.00	
US TREASURY N/B 3.625	6,000,000.00	6,220,781.28	
US TREASURY N/B 3.625	5,000,000.00	5,243,750.00	
US TREASURY N/B 3.625	5,300,000.00	6,095,828.12	
US TREASURY N/B 3.625	5,000,000.00	5,759,765.65	
US TREASURY N/B 3.75	1,400,000.00	1,424,828.13	
US TREASURY N/B 3.75	2,000,000.00	2,338,906.26	
US TREASURY N/B 3.75	4,000,000.00	4,699,062.52	
US TREASURY N/B 3.875	1,500,000.00	1,785,000.00	
US TREASURY N/B 4.25	1,000,000.00	1,249,218.75	
US TREASURY N/B 4.25	2,000,000.00	2,508,750.00	
US TREASURY N/B 4.375	500,000.00	632,421.87	
US TREASURY N/B 4.375	1,500,000.00	1,906,406.25	
US TREASURY N/B 4.375	1,400,000.00	1,783,796.88	
US TREASURY N/B 4.375	1,800,000.00	2,300,343.75	
US TREASURY N/B 4.5	1,500,000.00	1,914,609.37	
US TREASURY N/B 4.5	1,000,000.00	1,286,093.75	
US TREASURY N/B 4.5	1,000,000.00	1,290,703.13	
US TREASURY N/B 4.625	2,100,000.00	2,758,382.82	
US TREASURY N/B 4.75	1,500,000.00	2,010,820.32	
US TREASURY N/B 5	500,000.00	679,296.87	
US TREASURY N/B 5.25	500,000.00	631,328.12	
US TREASURY N/B 5.25	500,000.00	633,789.06	
US TREASURY N/B 5.375	1,320,000.00	1,743,018.75	
US TREASURY N/B 5.5	500,000.00	640,898.44	
US TREASURY N/B 6	1,000,000.00	1,265,859.38	
US TREASURY N/B 6.125	1,000,000.00	1,321,640.63	
US TREASURY N/B 6.25	800,000.00	968,937.50	
US TREASURY N/B 6.25	1,000,000.00	1,398,359.38	



	US TREASURY N/B 6.5	500,000.00	662,851.56	
	US TREASURY N/B 8	1,300,000.00	1,588,031.25	
	US TREASURY N/B 8.75	1,000,000.00	1,175,781.25	
	US TREASURY N/B 8.875	1,100,000.00	1,190,234.37	
	米ドル 小計	729,120,000.00	732,766,075.12 (82,780,583,506)	
カナダドル	CANADA-GOV'T 0.5	2,000,000.00	1,984,480.00	
	CANADA-GOV'T 0.5	2,000,000.00	1,978,580.00	
	CANADA-GOV'T 0.5	2,000,000.00	1,901,060.00	
	CANADA-GOV'T 0.75	2,000,000.00	1,978,960.00	
	CANADA-GOV'T 0.75	1,000,000.00	976,500.00	
	CANADA-GOV'T 0.75	2,000,000.00	1,944,298.00	
	CANADA-GOV'T 0.75	2,000,000.00	1,932,600.00	
	CANADA-GOV'T 1	1,000,000.00	919,300.00	
	CANADA-GOV'T 1.25	700,000.00	699,734.00	
	CANADA-GOV'T 1.25	1,500,000.00	1,485,780.00	
	CANADA-GOV'T 1.5	2,000,000.00	1,994,020.00	
	CANADA-GOV'T 1.5	2,000,000.00	1,969,840.00	
	CANADA-GOV'T 1.5	1,600,000.00	1,550,720.00	
	CANADA-GOV'T 1.75	1,000,000.00	1,003,520.00	
	CANADA-GOV'T 1.75	1,000,000.00	1,002,680.00	
	CANADA-GOV'T 1.75	900,000.00	898,182.00	
	CANADA-GOV'T 2.25	1,100,000.00	1,128,523.00	
	CANADA-GOV'T 2.5	1,800,000.00	1,872,216.00	
	CANADA-GOV'T 2.75	1,000,000.00	1,045,700.00	
	CANADA-GOV'T 2.75	1,800,000.00	2,022,300.00	
	CANADA-GOV'T 2.75	500,000.00	585,480.00	
	CANADA-GOV'T 3.25	1,000,000.00	1,051,810.00	
	CANADA-GOV'T 3.5	2,000,000.00	2,088,620.00	
	CANADA-GOV'T 3.5	1,500,000.00	1,899,705.00	
	CANADA-GOV'T 3.75	2,500,000.00	2,579,250.00	

	CANADA-GOV'T 4	1,500,000.00	1,988,955.00	
	CANADA-GOV'T 5	1,500,000.00	2,174,715.00	
	CANADA-GOV'T 5.75	1,000,000.00	1,381,760.00	
	CANADA-GOV'T 5.75	1,500,000.00	2,222,025.00	
	CANADA-GOV'T 8	500,000.00	760,940.00	
	カナダドル 小計	43,900,000.00	47,022,253.00 (4,127,613,368)	
メキシコペソ	MEXICAN BONOS 10	40,000,000.00	45,443,600.00	
	MEXICAN BONOS 5.75	20,000,000.00	17,866,200.00	
	MEXICAN BONOS 6.5	35,000,000.00	33,678,050.00	
	MEXICAN BONOS 8	50,000,000.00	50,615,500.00	
	MEXICAN BONOS 8	20,000,000.00	20,495,200.00	
	MEXICAN BONOS 8.5	7,000,000.00	7,072,240.00	
	MEXICAN BONOS 8.5	45,000,000.00	48,342,150.00	
	MEXICAN BONOS 8.5	40,000,000.00	43,416,000.00	
	メキシコペソ 小計	257,000,000.00	266,928,940.00 (1,569,542,167)	
ユーロ	BELGIAN 0326 4	1,000,000.00	1,415,490.00	
	BELGIAN 0.8	1,300,000.00	1,353,105.00	
	BELGIAN 0.8	1,800,000.00	1,839,204.00	
	BELGIAN 0291 5.5	2,000,000.00	2,997,980.00	
	BELGIAN 0304 5	2,000,000.00	3,245,580.00	
	BELGIAN 0308 4	1,500,000.00	1,780,275.00	
	BELGIAN 0315 4	1,500,000.00	1,588,560.00	
	BELGIAN 0318 3.75	2,000,000.00	2,238,400.00	
	BELGIAN 0320 4.25	1,700,000.00	2,690,335.00	
	BELGIAN 0321 4.25	1,700,000.00	2,000,118.00	
	BELGIAN 0324 4.5	1,000,000.00	1,346,240.00	
	BELGIAN 0325 4.25	2,000,000.00	2,429,940.00	
	BELGIAN 0327 3	1,000,000.00	1,063,910.00	
	BELGIAN 0328 2.25	1,500,000.00	1,696,155.00	

BELGIAN 0332 2.6	2,000,000.00	2,329,980.00	
BELGIAN 0333 3	500,000.00	644,435.00	
BELGIAN 0338 0.5	500,000.00	512,225.00	
BELGIAN 0338 2.25	500,000.00	564,345.00	
BELGIAN 1	1,400,000.00	1,470,966.00	
BELGIAN 1	1,000,000.00	1,008,950.00	
BELGIAN 1.6	500,000.00	499,415.00	
BELGIAN 1.9	700,000.00	776,076.00	
BELGIAN 2.15	500,000.00	543,120.00	
BELGIAN 3.75	1,000,000.00	1,510,030.00	
BTPS 0.05	1,000,000.00	1,005,200.00	
BTPS 0.1	1,000,000.00	1,005,290.00	
BTPS 0.2	2,000,000.00	2,008,460.00	
BTPS 0.35	500,000.00	504,730.00	
BTPS 0.35	1,500,000.00	1,501,485.00	
BTPS 0.45	2,000,000.00	2,018,300.00	
BTPS 0.65	1,600,000.00	1,627,584.00	
BTPS 0.65	2,000,000.00	1,962,240.00	
BTPS 0.7	2,000,000.00	2,036,380.00	
BTPS 0.9	800,000.00	810,744.00	
BTPS 0.95	2,000,000.00	2,016,080.00	
BTPS 1.05	2,000,000.00	2,049,180.00	
BTPS 1.2	1,000,000.00	1,029,950.00	
BTPS 1.25	2,000,000.00	1,919,660.00	
BTPS 1.35	2,000,000.00	2,070,820.00	
BTPS 1.45	2,000,000.00	2,076,320.00	
BTPS 1.5	2,000,000.00	2,058,200.00	
BTPS 1.5	2,000,000.00	2,006,200.00	
BTPS 1.6	2,000,000.00	1,987,500.00	
BTPS 1.65	2,000,000.00	1,833,100.00	
BTPS 1.85	1,000,000.00	1,041,410.00	

BTPS 2	2,000,000.00	2,063,860.00	
BTPS 2.15	2,000,000.00	2,139,960.00	
BTPS 2.2	1,000,000.00	1,029,740.00	
BTPS 2.25	1,200,000.00	1,130,496.00	
BTPS 2.45	1,000,000.00	994,240.00	
BTPS 2.5	3,000,000.00	3,115,680.00	
BTPS 2.5	2,000,000.00	2,155,020.00	
BTPS 2.7	2,000,000.00	1,860,760.00	
BTPS 2.8	1,000,000.00	882,860.00	
BTPS 3.25	1,500,000.00	1,559,265.00	
BTPS 3.45	500,000.00	528,880.00	
BTPS 3.5	3,000,000.00	3,408,570.00	
BTPS 3.75	2,500,000.00	2,788,550.00	
BTPS 3.75	2,000,000.00	2,239,160.00	
BTPS 3.75	3,300,000.00	3,714,843.00	
BTPS 3.75	2,000,000.00	2,320,680.00	
BTPS 4	2,500,000.00	2,769,900.00	
BTPS 4	3,000,000.00	3,588,270.00	
BTPS 4.25	2,400,000.00	2,523,288.00	
BTPS 4.25	3,500,000.00	3,768,940.00	
BTPS 4.25	2,300,000.00	2,521,789.00	
BTPS 4.5	2,700,000.00	2,855,736.00	
BTPS 4.5	2,700,000.00	2,965,761.00	
BTPS 4.5	2,300,000.00	2,741,025.00	
BTPS 4.5	3,000,000.00	3,607,320.00	
BTPS 4.5	2,300,000.00	2,814,096.00	
BTPS 4.75	2,600,000.00	3,027,544.00	
BTPS 4.75	2,500,000.00	3,028,800.00	
BTPS 4.75	2,100,000.00	2,648,331.00	
BTPS 4.75	1,600,000.00	2,094,816.00	
BTPS 5	2,000,000.00	2,378,560.00	

BTPS 5	2,600,000.00	3,246,386.00	
BTPS 5	2,670,000.00	3,560,578.50	
BTPS 5	2,000,000.00	2,687,980.00	
BTPS 5	1,900,000.00	2,535,341.00	
BTPS 5.25	2,700,000.00	3,581,415.00	
BTPS 5.5	2,000,000.00	2,454,320.00	
BTPS 5.5	2,000,000.00	2,461,400.00	
BTPS 5.75	2,200,000.00	3,112,956.00	
BTPS 6	3,100,000.00	4,426,149.00	
BTPS 6.5	3,360,000.00	4,755,710.40	
BTPS 7.25	1,000,000.00	1,457,660.00	
BTPS 9	1,000,000.00	1,454,880.00	
BUNDESUBL-168 1	1,000,000.00	1,021,220.00	
BUNDESUBL-169 0.5	2,000,000.00	2,034,140.00	
BUNDESUBL-170 0.25	1,000,000.00	1,017,930.00	
BUNDESUBL-171 0	2,000,000.00	2,031,380.00	
BUNDESUBL-172 0.25	2,000,000.00	2,049,260.00	
BUNDESUBL-173 0	2,500,000.00	2,544,500.00	
BUNDESUBL-174 0	3,000,000.00	3,052,650.00	
DEUTSCHLAND REP 0	3,000,000.00	2,941,140.00	
DEUTSCHLAND REP 0.25	3,000,000.00	2,986,050.00	
DEUTSCHLAND REP 0.5	2,000,000.00	2,066,640.00	
DEUTSCHLAND REP 0.5	2,800,000.00	2,878,680.00	
DEUTSCHLAND REP 0.5	1,000,000.00	1,011,700.00	
DEUTSCHLAND REP 1	2,000,000.00	2,136,560.00	
DEUTSCHLAND REP 1	2,500,000.00	2,674,125.00	
DEUTSCHLAND REP 1.5	2,500,000.00	2,716,775.00	
DEUTSCHLAND REP 1.5	2,500,000.00	2,725,800.00	
DEUTSCHLAND REP 1.5	2,000,000.00	2,184,900.00	
DEUTSCHLAND REP 1.5	2,000,000.00	2,199,400.00	
DEUTSCHLAND REP 1.75	2,500,000.00	2,741,475.00	

DEUTSCHLAND REP 1.75	2,000,000.00	2,227,240.00	
DEUTSCHLAND REP 2	2,000,000.00	2,197,860.00	
DEUTSCHLAND REP 2	1,500,000.00	1,683,870.00	
DEUTSCHLAND REP 2.25	1,500,000.00	1,617,930.00	
DEUTSCHLAND REP 2.25	2,000,000.00	2,204,680.00	
DEUTSCHLAND REP 2.5	2,000,000.00	2,189,120.00	
DEUTSCHLAND REP 2.5	2,200,000.00	2,899,094.00	
DEUTSCHLAND REP 2.5	2,500,000.00	3,328,050.00	
DEUTSCHLAND REP 3	3,000,000.00	3,280,080.00	
DEUTSCHLAND REP 3.25	3,000,000.00	3,245,190.00	
DEUTSCHLAND REP 3.25	2,000,000.00	2,268,820.00	
DEUTSCHLAND REP 3.25	1,500,000.00	2,212,935.00	
DEUTSCHLAND REP 3.5	3,000,000.00	3,199,950.00	
DEUTSCHLAND REP 3.75	1,100,000.00	1,152,569.00	
DEUTSCHLAND REP 4	2,700,000.00	4,168,206.00	
DEUTSCHLAND REP 4.25	1,500,000.00	2,461,260.00	
DEUTSCHLAND REP 4.75	1,300,000.00	1,876,043.00	
DEUTSCHLAND REP 4.75	2,100,000.00	3,390,303.00	
DEUTSCHLAND REP 4.75	1,700,000.00	2,997,644.00	
DEUTSCHLAND REP 5.5	1,800,000.00	2,905,038.00	
DEUTSCHLAND REP 5.625	1,580,000.00	2,395,675.00	
DEUTSCHLAND REP 6.25	1,200,000.00	1,661,988.00	
DEUTSCHLAND REP 6.25	1,000,000.00	1,667,960.00	
DEUTSCHLAND REP 6.5	1,000,000.00	1,579,140.00	
FINNISH GOV'T 0.75	500,000.00	496,450.00	
FINNISH GOV'T 1.5	1,000,000.00	1,085,100.00	
FINNISH GOV'T 1.625	1,000,000.00	1,087,590.00	
FINNISH GOV'T 2	1,000,000.00	1,121,510.00	
FINNISH GOV'T 2.625	500,000.00	664,390.00	
FINNISH GOV'T 2.75	600,000.00	733,818.00	
FINNISH GOV'T 3.375	700,000.00	763,987.00	

FINNISH GOV'T 3.5	1,000,000.00	1,130,800.00	
FINNISH GOV'T 4	1,000,000.00	1,282,160.00	
FINNISH GOV'T 4.375	1,000,000.00	1,077,930.00	
FRANCE O.A.T. 0	2,000,000.00	2,016,320.00	
FRANCE O.A.T. 0	3,000,000.00	3,038,580.00	
FRANCE O.A.T. 0	2,000,000.00	2,025,620.00	
FRANCE O.A.T. 0	1,000,000.00	1,009,650.00	
FRANCE O.A.T. 0.25	2,300,000.00	2,347,380.00	
FRANCE O.A.T. 0.25	3,000,000.00	2,946,330.00	
FRANCE O.A.T. 0.5	3,000,000.00	3,064,710.00	
FRANCE O.A.T. 0.5	3,500,000.00	3,575,705.00	
FRANCE O.A.T. 0.5	3,000,000.00	3,034,770.00	
FRANCE O.A.T. 1	2,000,000.00	2,047,500.00	
FRANCE O.A.T. 1	2,000,000.00	2,113,000.00	
FRANCE O.A.T. 1	2,000,000.00	2,082,660.00	
FRANCE O.A.T. 1.25	2,000,000.00	1,998,100.00	
FRANCE O.A.T. 1.5	3,000,000.00	3,207,750.00	
FRANCE O.A.T. 1.75	4,000,000.00	4,402,040.00	
FRANCE O.A.T. 1.75	4,600,000.00	5,114,280.00	
FRANCE O.A.T. 1.75	1,400,000.00	1,502,452.00	
FRANCE O.A.T. 1.75	1,000,000.00	979,230.00	
FRANCE O.A.T. 2	1,000,000.00	1,080,370.00	
FRANCE O.A.T. 2.25	3,200,000.00	3,578,720.00	
FRANCE O.A.T. 2.25	3,300,000.00	3,767,478.00	
FRANCE O.A.T. 2.5	3,500,000.00	3,799,810.00	
FRANCE O.A.T. 2.5	3,500,000.00	4,178,650.00	
FRANCE O.A.T. 2.75	4,500,000.00	5,435,730.00	
FRANCE O.A.T. 3	5,000,000.00	5,715,700.00	
FRANCE O.A.T. 3.25	4,300,000.00	4,900,065.00	
FRANCE O.A.T. 3.25	2,700,000.00	3,719,790.00	
FRANCE O.A.T. 3.5	4,000,000.00	4,382,560.00	

FRANCE O.A.T. 3.5	4,000,000.00	5,057,520.00	
FRANCE O.A.T. 3.75	5,000,000.00	5,409,250.00	
FRANCE O.A.T. 3.75	3,900,000.00	4,449,276.00	
FRANCE O.A.T. 4	2,300,000.00	3,445,883.00	
FRANCE O.A.T. 4	1,370,000.00	2,220,948.10	
FRANCE O.A.T. 4	1,500,000.00	2,496,825.00	
FRANCE O.A.T. 4.25	4,400,000.00	4,693,392.00	
FRANCE O.A.T. 4.25	4,500,000.00	5,638,635.00	
FRANCE O.A.T. 4.5	3,500,000.00	5,682,425.00	
FRANCE O.A.T. 4.75	3,100,000.00	4,882,252.00	
FRANCE O.A.T. 5.5	3,000,000.00	4,568,100.00	
FRANCE O.A.T. 5.75	3,100,000.00	5,149,999.00	
FRANCE O.A.T. 6	3,000,000.00	4,362,870.00	
FRANCE O.A.T. 8.5	850,000.00	994,721.00	
FRANCE O.A.T. 8.5	1,200,000.00	1,755,612.00	
IRISH GOVT 0.8	700,000.00	729,792.00	
IRISH GOVT 1	1,000,000.00	1,035,760.00	
IRISH GOVT 2	1,000,000.00	1,068,730.00	
IRISH GOVT 2.4	1,000,000.00	1,162,970.00	
IRISH GOVT 3.4	1,000,000.00	1,201,130.00	
IRISH GOVT 3.9	500,000.00	602,470.00	
IRISH GOVT 4.4	1,000,000.00	1,075,110.00	
IRISH GOVT 4.5	990,000.00	1,108,295.10	
IRISH GOVT 5	1,000,000.00	1,158,030.00	
IRISH GOVT 5.4	1,200,000.00	1,632,492.00	
IRISH GOVT 5.9	800,000.00	895,304.00	
NETHERLANDS GOVT 0	2,000,000.00	2,027,840.00	
NETHERLANDS GOVT 0.25	2,000,000.00	2,038,800.00	
NETHERLANDS GOVT 0.25	2,000,000.00	2,010,420.00	
NETHERLANDS GOVT 0.5	1,500,000.00	1,523,835.00	
NETHERLANDS GOVT 0.75	900,000.00	923,553.00	



NETHERLANDS GOVT 1.25	1,400,000.00	1,430,254.00	
NETHERLANDS GOVT 1.75	1,600,000.00	1,766,800.00	
NETHERLANDS GOVT 2	1,000,000.00	1,129,570.00	
NETHERLANDS GOVT 2.25	1,500,000.00	1,675,710.00	
NETHERLANDS GOVT 2.5	1,100,000.00	1,361,877.00	
NETHERLANDS GOVT 2.75	1,900,000.00	2,621,525.00	
NETHERLANDS GOVT 3.25	1,500,000.00	1,701,060.00	
NETHERLANDS GOVT 3.5	1,500,000.00	1,659,120.00	
NETHERLANDS GOVT 3.75	1,000,000.00	1,201,940.00	
NETHERLANDS GOVT 3.75	1,500,000.00	2,354,925.00	
NETHERLANDS GOVT 4	1,500,000.00	1,612,410.00	
NETHERLANDS GOVT 4	1,900,000.00	2,921,212.00	
NETHERLANDS GOVT 5.5	700,000.00	1,047,697.00	
REP OF AUSTRIA 0.25	1,000,000.00	1,015,490.00	
REP OF AUSTRIA 0.5	2,400,000.00	2,393,976.00	
REP OF AUSTRIA 0.75	1,900,000.00	1,951,946.00	
REP OF AUSTRIA 1.2	1,200,000.00	1,286,664.00	
REP OF AUSTRIA 1.5	500,000.00	506,210.00	
REP OF AUSTRIA 1.65	1,000,000.00	1,104,340.00	
REP OF AUSTRIA 1.75	1,000,000.00	1,104,550.00	
REP OF AUSTRIA 1.95	1,000,000.00	1,038,170.00	
REP OF AUSTRIA 2.4	800,000.00	966,344.00	
REP OF AUSTRIA 3.15	500,000.00	702,020.00	
REP OF AUSTRIA 3.4	1,000,000.00	1,177,180.00	
REP OF AUSTRIA 3.5	2,000,000.00	2,293,180.00	
REP OF AUSTRIA 3.65	1,000,000.00	1,170,650.00	
REP OF AUSTRIA 3.8	500,000.00	849,935.00	
REP OF AUSTRIA 3.9	1,500,000.00	1,670,670.00	
REP OF AUSTRIA 4.15	1,300,000.00	1,987,609.00	
REP OF AUSTRIA 4.35	1,200,000.00	1,274,136.00	
REP OF AUSTRIA 4.85	1,000,000.00	1,376,540.00	

REP OF AUSTRIA 6.25	1,000,000.00	1,550,360.00	
SPANISH GOV'T 0.25	2,000,000.00	2,014,540.00	
SPANISH GOV'T 0.4	2,000,000.00	2,021,640.00	
SPANISH GOV'T 0.75	2,000,000.00	2,053,620.00	
SPANISH GOV'T 1.15	2,000,000.00	2,068,680.00	
SPANISH GOV'T 1.3	2,000,000.00	2,010,420.00	
SPANISH GOV'T 1.4	2,000,000.00	2,069,520.00	
SPANISH GOV'T 1.45	1,000,000.00	997,390.00	
SPANISH GOV'T 1.5	1,500,000.00	1,518,450.00	
SPANISH GOV'T 1.6	2,000,000.00	2,103,020.00	
SPANISH GOV'T 1.95	2,200,000.00	2,336,642.00	
SPANISH GOV'T 1.95	2,000,000.00	2,029,420.00	
SPANISH GOV'T 2.15	2,000,000.00	2,166,940.00	
SPANISH GOV'T 2.35	1,000,000.00	1,032,640.00	
SPANISH GOV'T 2.75	3,000,000.00	3,128,670.00	
SPANISH GOV'T 2.75	3,000,000.00	3,399,840.00	
SPANISH GOV'T 2.9	1,000,000.00	1,037,220.00	
SPANISH GOV'T 3.45	900,000.00	990,423.00	
SPANISH GOV'T 3.8	2,400,000.00	2,871,240.00	
SPANISH GOV'T 4	2,500,000.00	2,748,950.00	
SPANISH GOV'T 4.2	2,050,000.00	2,668,567.00	
SPANISH GOV'T 4.3	2,000,000.00	2,173,760.00	
SPANISH GOV'T 4.4	2,000,000.00	2,447,620.00	
SPANISH GOV'T 4.6	2,500,000.00	2,700,275.00	
SPANISH GOV'T 4.65	2,500,000.00	3,182,250.00	
SPANISH GOV'T 4.7	1,500,000.00	2,096,910.00	
SPANISH GOV'T 4.8	2,000,000.00	2,506,160.00	
SPANISH GOV'T 4.85	2,000,000.00	2,284,380.00	
SPANISH GOV'T 4.9	2,000,000.00	2,853,700.00	
SPANISH GOV'T 5.15	1,500,000.00	2,026,605.00	
SPANISH GOV'T 5.15	1,500,000.00	2,222,085.00	

	SPANISH GOV'T 5.4	2,500,000.00	3,140,425.00	
	SPANISH GOV'T 5.5	2,700,000.00	3,199,257.00	
	SPANISH GOV'T 5.75	2,200,000.00	3,275,074.00	
	SPANISH GOV'T 5.85	2,500,000.00	3,091,525.00	
	SPANISH GOV'T 5.9	2,500,000.00	3,462,500.00	
	SPANISH GOV'T 6	2,000,000.00	2,889,840.00	
	ユーロ 小計	509,270,000.00	595,175,345.10 (79,628,509,420)	
英ポンド	UK TSY GILT 0.5	1,000,000.00	989,400.00	
	UK TSY GILT 1.25	1,000,000.00	1,001,240.00	
	UK TSY GILT 1.5	2,900,000.00	2,983,636.00	
	UK TSY GILT 1.5	2,500,000.00	2,579,925.00	
	UK TSY GILT 1.5	1,000,000.00	935,840.00	
	UK TSY GILT 1.75	3,000,000.00	3,061,650.00	
	UK TSY GILT 1.75	3,000,000.00	3,140,340.00	
	UK TSY GILT 1.75	600,000.00	598,908.00	
	UK TSY GILT 2	2,500,000.00	2,596,550.00	
	UK TSY GILT 2	2,500,000.00	2,681,700.00	
	UK TSY GILT 2.25	2,700,000.00	2,910,870.00	
	UK TSY GILT 2.5	1,500,000.00	1,951,095.00	
	UK TSY GILT 2.75	1,900,000.00	2,124,314.00	
	UK TSY GILT 3.25	2,500,000.00	3,242,500.00	
	UK TSY GILT 3.5	2,500,000.00	3,400,950.00	
	UK TSY GILT 3.5	2,000,000.00	3,323,840.00	
	UK TSY GILT 3.75	2,000,000.00	2,113,520.00	
	UK TSY GILT 3.75	2,000,000.00	2,175,700.00	
	UK TSY GILT 3.75	1,400,000.00	1,562,260.00	
	UK TSY GILT 3.75	1,900,000.00	2,914,714.00	
	UK TSY GILT 4	1,500,000.00	1,709,775.00	
	UK TSY GILT 4	2,000,000.00	3,447,420.00	
	UK TSY GILT 4.25	1,300,000.00	1,670,721.00	

	UK TSY GILT 4.25	1,300,000.00	1,757,496.00	
	UK TSY GILT 4.25	1,900,000.00	2,664,161.00	
	UK TSY GILT 4.25	1,500,000.00	2,171,970.00	
	UK TSY GILT 4.25	1,600,000.00	2,345,616.00	
	UK TSY GILT 4.25	1,900,000.00	2,947,546.00	
	UK TSY GILT 4.25	1,700,000.00	2,738,972.00	
	UK TSY GILT 4.25	2,100,000.00	3,629,241.00	
	UK TSY GILT 4.5	2,000,000.00	2,098,860.00	
	UK TSY GILT 4.5	1,800,000.00	2,553,498.00	
	UK TSY GILT 4.5	2,000,000.00	3,087,500.00	
	UK TSY GILT 4.75	1,700,000.00	1,861,228.00	
	UK TSY GILT 4.75	1,300,000.00	1,808,898.00	
	UK TSY GILT 4.75	1,500,000.00	2,292,945.00	
	UK TSY GILT 5	1,600,000.00	2,050,912.00	
	UK TSY GILT 6	1,100,000.00	1,631,641.00	
	UK TSY GILT 8	1,620,000.00	2,031,609.60	
	英ポンド 小計	71,820,000.00	90,788,961.60 (13,738,185,669)	
スイスフラン	SWISS (GOVT) 2.25	900,000.00	969,930.00	
	SWISS (GOVT) 3	500,000.00	527,700.00	
	SWISS (GOVT) 4	400,000.00	494,680.00	
	SWISS (GOVT) 4	700,000.00	1,001,000.00	
	スイスフラン 小計	2,500,000.00	2,993,310.00 (343,242,857)	
スウェーデンクローナ	SWEDISH GOVRNMNT 1	8,000,000.00	8,330,640.00	
	SWEDISH GOVRNMNT 1.5	7,000,000.00	7,568,330.00	
	SWEDISH GOVRNMNT 2.5	6,000,000.00	6,949,140.00	
	SWEDISH GOVRNMNT 3.5	11,000,000.00	12,787,500.00	
	SWEDISH GOVRNMNT 3.5	6,000,000.00	8,191,320.00	
	SWEDISH GOVRNMNT 4.25	10,000,000.00	10,625,800.00	
	SWEDISH GOVRNMNT 5	11,000,000.00	12,772,100.00	

スウェーデンクローナ 小計		59,000,000.00	67,224,830.00 (904,173,963)
ノルウェークローネ	NORWEGIAN GOV'T 1.5	5,000,000.00	5,034,000.00
	NORWEGIAN GOV'T 1.75	5,000,000.00	5,129,500.00
	NORWEGIAN GOV'T 2	10,000,000.00	10,460,000.00
	NORWEGIAN GOV'T 3	4,000,000.00	4,424,800.00
	NORWEGIAN GOV'T 3.75	11,000,000.00	12,071,950.00
	NORWEGIAN GOV'T 4.5	6,000,000.00	6,347,100.00
ノルウェークローネ 小計		41,000,000.00	43,467,350.00 (588,113,245)
デンマーククローネ	DENMARK - BULLET 0.25	4,000,000.00	4,033,560.00
	DENMARK - BULLET 1.5	5,000,000.00	5,451,000.00
	DENMARK - BULLET 1.75	11,000,000.00	12,381,160.00
	DENMARK - BULLET 3	10,000,000.00	11,321,000.00
	DENMARK - BULLET 4	8,000,000.00	8,707,200.00
	DENMARK - BULLET 4.5	14,000,000.00	23,861,600.00
デンマーククローネ 小計		52,000,000.00	65,755,520.00 (1,182,284,249)
ポーランドズロチ	POLAND GOVT BOND 1.5	5,500,000.00	5,447,750.00
	POLAND GOVT BOND 1.75	3,000,000.00	2,940,900.00
	POLAND GOVT BOND 2	3,000,000.00	2,967,000.00
	POLAND GOVT BOND 2.5	4,000,000.00	3,788,400.00
	POLAND GOVT BOND 3.25	5,000,000.00	5,035,000.00
	POLAND GOVT BOND 4	2,000,000.00	2,130,200.00
	POLAND GOVT BOND 5.25	2,000,000.00	2,178,000.00
	POLAND GOVT BOND 5.5	4,000,000.00	4,270,000.00
	POLAND GOVT BOND 5.75	4,000,000.00	4,500,400.00
	POLAND GOVT BOND 5.75	4,200,000.00	4,793,418.00
	POLAND GOVT BOND 5.75	1,000,000.00	1,242,430.00
	ポーランドズロチ 小計		37,700,000.00

オーストラリアドル	AUSTRALIAN GOVT. 1.75	3,000,000.00	2,968,350.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 2	1,000,000.00	990,400.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 2.25	2,500,000.00	2,404,750.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 2.75	3,000,000.00	3,042,660.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 2.75	2,500,000.00	2,551,117.50	
	AUSTRALIAN GOVT. 2.75	2,000,000.00	2,020,000.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 2.75	1,000,000.00	1,010,367.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 2.75	1,000,000.00	960,300.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 3	1,000,000.00	943,955.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 3.25	2,900,000.00	3,041,520.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 3.25	2,100,000.00	2,208,990.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 3.25	1,000,000.00	1,007,300.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 3.75	1,200,000.00	1,328,040.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 4.25	3,300,000.00	3,728,010.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 4.5	3,000,000.00	3,168,204.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 4.5	1,300,000.00	1,554,280.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 4.75	3,200,000.00	3,794,880.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 5.25	1,700,000.00	1,770,237.20	
	AUSTRALIAN GOVT. 5.5	2,500,000.00	2,890,750.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 5.75	3,000,000.00	3,349,500.00	
AUSTRALIAN GOVT. 5.75	3,000,000.00	3,446,550.00		
オーストラリアドル 小計		45,200,000.00	48,180,160.70	(4,168,065,702)
シンガポールドル	SINGAPORE GOV'T 2.25	500,000.00	509,350.00	
	SINGAPORE GOV'T 2.75	1,000,000.00	1,048,000.00	
	SINGAPORE GOV'T 2.75	400,000.00	427,200.00	
	SINGAPORE GOV'T 2.75	500,000.00	534,635.00	
	SINGAPORE GOV'T 2.875	400,000.00	430,120.00	
	SINGAPORE GOV'T 3	1,000,000.00	1,067,500.00	
	SINGAPORE GOV'T 3.125	1,000,000.00	1,062,000.00	
	SINGAPORE GOV'T 3.25	1,000,000.00	1,043,500.00	

	SINGAPORE GOV'T 3.375	500,000.00	570,647.50	
	SINGAPORE GOV'T 3.5	1,500,000.00	1,689,120.00	
	SINGAPORE GOV'T 4	600,000.00	610,140.00	
	シンガポールドル 小計	8,400,000.00	8,992,212.50 (754,086,940)	
マレーシアリングット	MALAYSIA GOVT 3.418	8,000,000.00	7,895,792.00	
	MALAYSIA GOVT 3.502	9,000,000.00	8,438,589.00	
	MALAYSIA GOVT 4.378	8,000,000.00	8,180,000.00	
	MALAYSIA GOVT 4.498	4,000,000.00	4,006,000.00	
	MALAYSIA GOVT 4.736	3,000,000.00	2,931,711.00	
	マレーシアリングット 小計	32,000,000.00	31,452,092.00 (870,279,385)	
南アフリカランド	REP SOUTH AFRICA 6.5	60,000,000.00	42,594,000.00	
	REP SOUTH AFRICA 6.75	30,000,000.00	29,100,000.00	
	REP SOUTH AFRICA 7	60,000,000.00	49,914,000.00	
	REP SOUTH AFRICA 8	10,000,000.00	10,058,900.00	
	南アフリカランド 小計	160,000,000.00	131,666,900.00 (1,166,568,734)	
	合計		193,072,354,181 (193,072,354,181)	

（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 228銘柄	42.3%	42.9%
カナダドル	国債証券 30銘柄	2.1%	2.1%
メキシコペソ	国債証券 8銘柄	0.8%	0.8%
ユーロ	国債証券 268銘柄	40.7%	41.2%
英ポンド	国債証券 39銘柄	7.0%	7.1%
スイスフラン	国債証券 4銘柄	0.2%	0.2%
スウェーデンクローナ	国債証券 7銘柄	0.5%	0.5%
ノルウェークローネ	国債証券 6銘柄	0.3%	0.3%
デンマーククローネ	国債証券 6銘柄	0.6%	0.6%
ポーランドズロチ	国債証券 11銘柄	0.6%	0.6%
オーストラリアドル	国債証券 21銘柄	2.1%	2.2%

シンガポールドル	国債証券	11銘柄	0.4%	0.4%
マレーシアリングット	国債証券	5銘柄	0.4%	0.5%
南アフリカランド	国債証券	4銘柄	0.6%	0.6%

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 &lt; 適格機関投資家限定 &gt;

## 貸借対照表

(単位：円)

	(平成28年12月19日現在)	(平成29年12月19日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
金銭信託	409	435
コール・ローン	578	539
親投資信託受益証券	460,263,512	507,207,072
未収入金	-	360,000
流動資産合計	460,264,499	507,568,046
資産合計	460,264,499	507,568,046
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	-	360,000
流動負債合計	-	360,000
負債合計	-	360,000
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	456,510,471	503,416,563
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	3,754,028	3,791,483
元本等合計	460,264,499	507,208,046
純資産合計	460,264,499	507,208,046
負債純資産合計	460,264,499	507,568,046

## 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28年12月19日現在）	（平成29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	456,510,471口	503,416,563口
2. 1単位当たり純資産の額	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)	1口当たり純資産額 1.0075円 (10,000口当たりの純資産額 10,075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29年 4月14日 至 平成29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29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29年 4月14日 至 平成29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28年12月19日現在)	(平成29年12月19日現在)
期首元本額	433,581,490円	490,073,343円
期中追加設定元本額	33,815,417円	33,896,451円
期中一部解約元本額	10,886,436円	20,553,231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	501,688,499	507,207,072	
合計		501,688,499	507,207,072	

## 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28年12月19日現在)	(平成29年12月19日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
金銭信託	141,829,685	346,533,566
コール・ローン	200,327,968	428,518,410
特殊債券	1,005,832,000	1,920,448,580
未収利息	3,613,655	4,376,562
前払費用	579,178	5,302,078
流動資産合計	1,352,182,486	2,705,179,196
資産合計	1,352,182,486	2,705,179,196
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	41,680,000	15,471,069
未払利息	528	1,187
その他未払費用	3,041	32
流動負債合計	41,683,569	15,472,288
負債合計	41,683,569	15,472,288
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	1,295,396,140	2,660,488,891
剰余金		
剰余金又は欠損金( )	15,102,777	29,218,017
元本等合計	1,310,498,917	2,689,706,908
純資産合計	1,310,498,917	2,689,706,908
負債純資産合計	1,352,182,486	2,705,179,196

## 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12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28年12月19日現在）	（平成29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	1,295,396,140口	2,660,488,891口
2. 1単位当たり純資産の額	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)	1口当たり純資産額 1.0110円 (10,000口当たりの純資産額 10,110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29年 4月14日 至 平成29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、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 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29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（特殊債券） 「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29年 4月14日	至 平成29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



(平成29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	1,308,650,457円
同期中における追加設定元本額	1,849,317,468円
同期中における一部解約元本額	497,479,034円
平成29年12月19日現在における元本の内訳	
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2020(4資産タイプ)	59,435,039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)	35,767,892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)	12,175,201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)	10,893,530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)	5,520,498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)	14,539,743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>	501,688,499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>	487,692,909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>	1,532,379,068円
合計	2,660,488,891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 2 1 回政府保証日本政策投資銀行債券	100,000,000	100,276,000	
	第 5 6 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,478,000	
	第 6 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	100,965,000	
	第 6 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	101,064,000	
	第 6 4 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,133,000	
	第 6 7 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	304,245,000	
	第 6 9 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	203,082,000	
	第 7 1 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	201,000,000	203,930,580	
	第 4 回政府保証地方公営企業等金融機構債券	100,000,000	101,459,000	
	第 5 回政府保証地方公営企業等金融機構債券	100,000,000	101,558,000	
	第 8 8 3 回政府保証公営企業債券	100,000,000	100,352,000	
	第 8 8 5 回政府保証公営企業債券	100,000,000	100,731,000	
	第 1 9 5 回政府保証預金保険機構債	200,000,000	200,044,000	
	第 2 3 回政府保証中日本高速道路債券	100,000,000	101,131,000	
	合計	1,901,000,000	1,920,448,580	

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## 2【ファンドの現況】

## 【純資産額計算書】

## 三井住友・DC年金プラン・ファンド(ターゲット・イヤー型)2010

2018年 1月31日現在

資産総額	526,001,365円
負債総額	4,208,870円
純資産総額( - )	521,792,495円
発行済口数	412,329,458口
1口当たり純資産額( / )	1.2655円
(1万口当たり純資産額)	(12,655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

2018年 1月31日現在

資産総額	1,402,695,772円
負債総額	1,805,036円
純資産総額( - )	1,400,890,736円
発行済口数	930,421,781口
1口当たり純資産額( / )	1.5057円
(1万口当たり純資産額)	(15,057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

2018年 1月31日現在

資産総額	1,688,128,423円
負債総額	4,033,372円
純資産総額( - )	1,684,095,051円
発行済口数	1,017,129,771口
1口当たり純資産額( / )	1.6557円
(1万口当たり純資産額)	(16,557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

2018年 1月31日現在

資産総額	2,471,593,115円
負債総額	18,916,164円
純資産総額( - )	2,452,676,951円
発行済口数	1,362,976,074口
1口当たり純資産額( / )	1.7995円
(1万口当たり純資産額)	(17,995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

	2018年1月31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。

###### ハ 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。

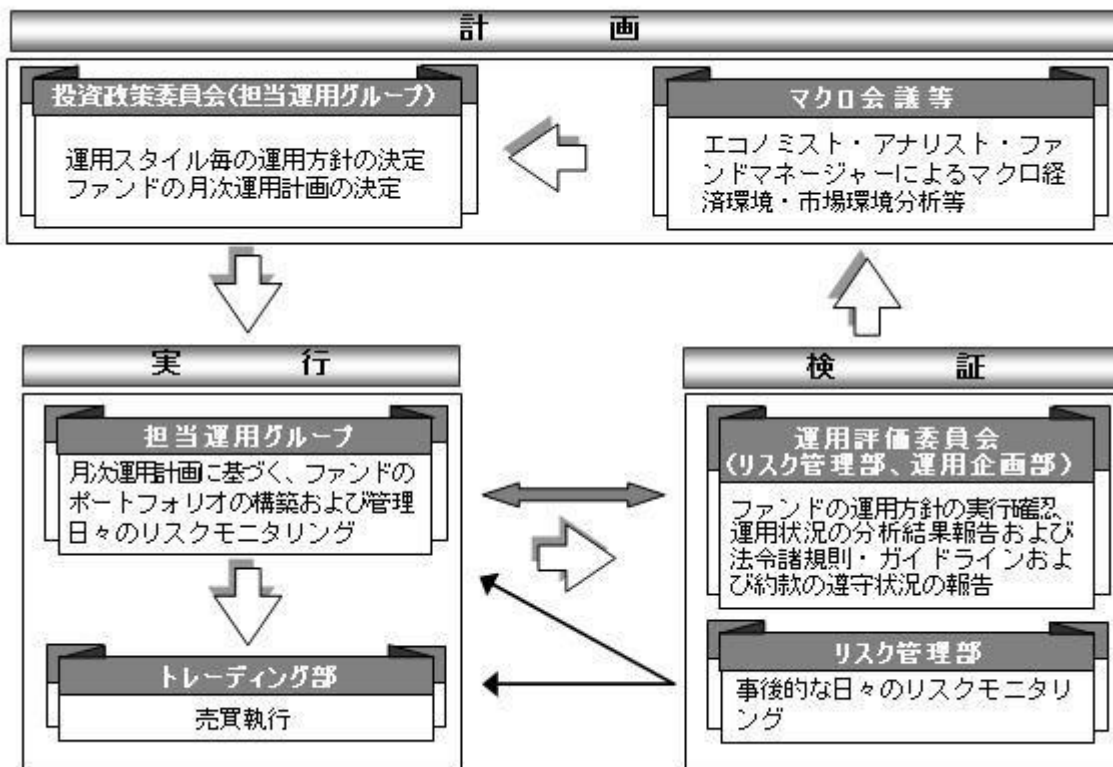
取締役の任期は、選任後1年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会の終結の時までとし、補欠または増員によって選任された取締役の任期は、他の現任取締役の任期の満了する時までとします。

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。

2018年1月31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。

（2018年1月31日現在）

		本 数 (本)	純資産総額 (百万円)
株式投資信託	単位型	82 ( 34)	327,104 ( 235,399)
	追加型	453 ( 195)	5,742,847 ( 2,864,408)
	計	535 ( 229)	6,069,951 ( 3,099,808)
公社債投資信託	単位型	108 ( 108)	357,883 ( 357,883)
	追加型	1 ( 0)	32,241 ( 0)
	計	109 ( 108)	390,124 ( 357,883)
合 計		644 ( 337)	6,460,075 ( 3,457,691)

（ ）内は、私募投資信託分であり、内書き表記しております。

### 3【委託会社等の経理状況】

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

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

2 当社は、第32期(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、第33期中間会計期間(平成29年4月1日から平成29年9月30日まで)の中間財務諸表については、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、有限責任 あずさ監査法人の中間監査を受けております。



## (1)【貸借対照表】

(単位：千円)

		前事業年度 (平成28年3月31日)	当事業年度 (平成29年3月31日)
<b>資産の部</b>			
<b>流動資産</b>			
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
<b>流動資産合計</b>		<b>19,249,357</b>	<b>21,352,691</b>
<b>固定資産</b>			
<b>有形固定資産</b>			
建物	1	154,246	198,767
器具備品		240,748	261,096
<b>有形固定資産合計</b>		<b>394,995</b>	<b>459,864</b>
<b>無形固定資産</b>			
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
<b>無形固定資産合計</b>		<b>595,627</b>	<b>634,903</b>
<b>投資その他の資産</b>			
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
<b>投資その他の資産合計</b>		<b>24,931,569</b>	<b>24,129,257</b>
<b>固定資産合計</b>		<b>25,922,192</b>	<b>25,224,025</b>
<b>資産合計</b>		<b>45,171,549</b>	<b>46,576,717</b>

(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)
<b>負債の部</b>		
<b>流動負債</b>		
顧客からの預り金	0	304
その他の預り金	73,103	80,380
<b>未払金</b>		
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
<b>未払費用</b>		
未払消費税等	2,092,669	2,564,625
未払法人税等	317,444	160,571
賞与引当金	992,491	661,467
その他の流動負債	982,654	1,001,068
	-	445
<b>流動負債合計</b>	<b>7,138,557</b>	<b>7,086,864</b>
<b>固定負債</b>		
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
<b>固定負債合計</b>	<b>3,080,216</b>	<b>3,219,473</b>
<b>負債合計</b>	<b>10,218,774</b>	<b>10,306,337</b>
<b>純資産の部</b>		
<b>株主資本</b>		
資本金	2,000,000	2,000,000
<b>資本剰余金</b>		
資本準備金	8,628,984	8,628,984
<b>資本剰余金合計</b>	<b>8,628,984</b>	<b>8,628,984</b>
<b>利益剰余金</b>		
利益準備金	284,245	284,245
<b>その他利益剰余金</b>		
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
<b>利益剰余金合計</b>	<b>23,806,015</b>	<b>25,314,279</b>
<b>株主資本計</b>	<b>34,434,999</b>	<b>35,943,263</b>
<b>評価・換算差額等</b>		
その他有価証券評価差額金	517,775	327,116
<b>評価・換算差額等合計</b>	<b>517,775</b>	<b>327,116</b>
<b>純資産合計</b>	<b>34,952,774</b>	<b>36,270,379</b>
<b>負債・純資産合計</b>	<b>45,171,549</b>	<b>46,576,717</b>

## (2) 【損益計算書】

(単位：千円)

	前事業年度		当事業年度	
	(自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)		(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）

（単位：千円）

	株主資本								株主資本 合計
	資本金	資本剰余金		利益剰余金	利益剰余金			利益剰余金 合計	
		資本準備金	資本剰余金 合計		その他利益剰余金				
					利益準備金	配当準備 積立金	別途積立金		
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								株主資本 合計
	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	
		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	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おります。

## (2) 退職給付引当金

従業員の退職金支給に備えるため、当事業年度末における退職給付債務の見込額に基づき計上しております。

退職給付見込額の期間帰属方法

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

数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法

過去勤務費用については、その発生時において一時に費用処理しております。

数理計算上の差異については、その発生時において一時に費用処理しております。

## 4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

## 消費税等の会計処理

消費税等の会計処理は税抜方式によっております。

## (会計方針の変更)

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の主な原因別の内訳

(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)
<b>流動の部</b>		
<b>繰延税金資産</b>		
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
<b>固定の部</b>		
<b>繰延税金資産</b>		
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
<b>繰延税金負債</b>		
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	1,770,996,505	銀行業	% (被所有) 直接 40	投信の販売委託 役員の兼任	委託販売 手数料	2,740,552	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	SMBC日興 証券(株)	東京都 千代田区	10,000,000	証券業	%	投信の販売委託 役員の兼任	子会社株式 の取得	9,877,717	-	-
							委託販売 手数料	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	1,770,996,505	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。

## 中間財務諸表

## ( 1 ) 中間貸借対照表

( 単位：千円 )

		第33期中間会計期間 (平成29年9月30日)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
現金及び預金		14,667,306
顧客分別金信託		20,009
前払費用		398,529
未収委託者報酬		5,467,704
未収運用受託報酬		1,390,552
未収投資助言報酬		331,978
未収収益		30,823
繰延税金資産		484,857
その他		20,343
流動資産合計		22,812,104
固定資産		
有形固定資産	1	449,121
無形固定資産		689,045
投資その他の資産		
投資有価証券		11,924,034
関係会社株式		10,412,523
その他		1,439,858
投資その他の資産合計		23,776,417
固定資産合計		24,914,583
資産合計		47,726,688
<b>負債の部</b>		
流動負債		
顧客からの預り金		243
その他の預り金		18,672
未払金		2,563,327
未払費用		3,141,458
未払法人税等		908,285
前受収益		8,531
賞与引当金		977,049
その他	2	255,033
流動負債合計		7,872,601
固定負債		
退職給付引当金		3,313,253
賞与引当金		20,083
その他		995
固定負債合計		3,334,332
負債合計		11,206,933
<b>純資産の部</b>		
株主資本		

資本金	2,000,000
資本剰余金	
資本準備金	8,628,984
資本剰余金合計	8,628,984
利益剰余金	
利益準備金	284,245
その他利益剰余金	
配当準備積立金	60,000
別途積立金	1,476,959
繰越利益剰余金	23,341,758
利益剰余金合計	25,162,963
株主資本合計	35,791,947
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	727,807
評価・換算差額等合計	727,807
純資産合計	36,519,754
負債純資産合計	47,726,688

## ( 2 ) 中間損益計算書

( 単位 : 千円 )

		第33期中間会計期間 ( 自 平成29年 4 月 1 日 至 平成29年 9 月30日 )	
営業収益			
委託者報酬			17,308,525
運用受託報酬			2,835,650
投資助言報酬			727,606
その他の営業収益			74,834
営業収益計			20,946,618
営業費用			13,255,417
一般管理費	1		5,122,317
営業利益			2,568,883
営業外収益	2		49,201
営業外費用	3		8,278
経常利益			2,609,805
特別利益	4		31,986
特別損失	5		106,330
税引前中間純利益			2,535,462
法人税、住民税及び事業税			827,642
法人税等調整額			28,344
法人税等合計			799,298
中間純利益			1,736,163



## ( 3 ) 中間株主資本等変動計算書

第33期中間会計期間（自 平成29年4月1日 至 平成29年9月30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	23,493,074	25,314,279	35,943,263
当中間期変動額									
剰余金の配当							1,887,480	1,887,480	1,887,480
中間純利益							1,736,163	1,736,163	1,736,163
株主資本以外の項目の 当中間期変動額（純額）									
当中間期変動額合計	-	-	-	-	-	-	151,316	151,316	151,316
当中間期末残高	2,000,000	8,628,984	8,628,984	284,245	60,000	1,476,959	23,341,758	25,162,963	35,791,947

	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	327,116	327,116	36,270,379
当中間期変動額			
剰余金の配当			1,887,480
中間純利益			1,736,163
株主資本以外の項目の 当中間期変動額（純額）	400,690	400,690	400,690
当中間期変動額合計	400,690	400,690	249,374
当中間期末残高	727,807	727,807	36,519,754

## 注記事項

## （重要な会計方針）

## 1．資産の評価基準及び評価方法

## (1)有価証券

満期保有目的の債券

償却原価法

子会社株式及び関連会社株式

移動平均法による原価法

その他有価証券

時価のあるもの

中間会計期間末日の市場価格等に基づく時価法

（評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定）

時価のないもの

移動平均法による原価法

## 2．固定資産の減価償却の方法

## (1)有形固定資産

定率法によっております。但し、建物（建物附属設備を除く）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中間会計期間の負担額を計上しております。

## (2)退職給付引当金

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

退職給付見込額の期間帰属方法

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

数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法

過去勤務費用については、その発生時において一時に費用処理しております。

数理計算上の差異については、その発生時において一時に費用処理しております。

#### 4. その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項

##### 消費税等の会計処理

消費税等の会計処理は税抜方式によっております。

##### （中間貸借対照表関係）

第33期中間会計期間 (平成29年9月30日)	
1. 有形固定資産の減価償却累計額	1,008,543千円
2. 消費税等の取扱い	仮払消費税等及び仮受消費税等は、相殺のうえ、金額的重要性が乏しいため、流動負債のその他に含めて表示しております。
3. 当社は、運転資金の効率的な調達を行うため取引銀行1行と当座借越契約を締結しております。当中間会計期間末における当座借越契約に係る借入金未実行残高等は次のとおりであります。	
当座借越極度額の総額	10,000,000千円
借入実行残高	-
差引額	10,000,000千円
4. 当社は、子会社であるSumitomo Mitsui Asset Management(New York) Inc.における賃貸借契約に係る賃借料に対し、平成35年6月までの賃借料総額237,363千円の支払保証を行っております。	

##### （中間損益計算書関係）

第33期中間会計期間 (自平成29年4月1日 至平成29年9月30日)	
1. 減価償却実施額	
有形固定資産	64,918千円
無形固定資産	99,520千円
2. 営業外収益のうち主要なもの	
受取配当金	42,925千円
雑益	6,025千円
3. 営業外費用のうち主要なもの	
為替差損	8,278千円
4. 特別利益のうち主要なもの	
投資有価証券売却益	30,103千円
5. 特別損失のうち主要なもの	
投資有価証券償還損	106,200千円

（中間株主資本等変動計算書関係）

第33期中間会計期間（自 平成29年4月1日 至 平成29年9月30日）

## 1．発行済株式数に関する事項

	当事業年度期首 株式数	当中間会計期間 増加株式数	当中間会計期間 減少株式数	当中間会計期間末 株式数
普通株式	17,640株	-	-	17,640株

## 2．剰余金の配当に関する事項

決議	株式の種類	配当金の総額 (千円)	一株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
平成29年6月27日 定時株主総会	普通株式	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）

第33期中間会計期間 (自 平成29年4月1日 至 平成29年9月30日)	
1．オペレーティング・リース取引 (借主側)	
未経過リース料（解約不能のもの）	
1年以内	477,255千円
1年超	28,771千円
合計	506,027千円

（金融商品関係）

## 1．金融商品の時価等に関する事項

第33期中間会計期間（平成29年9月30日）

平成29年9月30日における中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次の通りです。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含まれておりません（（注2）参照）。

（単位：千円）

区分	中間貸借対照表計上額	時価	差額
(1)現金及び預金	14,667,306	14,667,306	-
(2)顧客分別金信託	20,009	20,009	-
(3)未収委託者報酬	5,467,704	5,467,704	-
(4)未収運用受託報酬	1,390,552	1,390,552	-
(5)未収投資助言報酬	331,978	331,978	-
(6)投資有価証券 その他有価証券	11,923,736	11,923,736	-
(7)投資その他の資産 長期差入保証金	656,670	656,670	-
資産計	34,457,958	34,457,958	-
(1)顧客からの預り金	243	243	-
(2)未払金 未払手数料	2,365,135	2,365,135	-
負債計	2,365,378	2,365,378	-

## (注1) 金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

## 資 産

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

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

- (6) 投資有価証券

## その他有価証券

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。

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

- (7) 投資その他の資産

## 長期差入保証金

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

## 負 債

- (1) 顧客からの預り金、及び(2) 未払金 未払手数料

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

## (注2) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

(単位：千円)

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

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

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

（有価証券関係）

第33期中間会計期間（平成29年9月30日）

1．満期保有目的の債券

該当事項はありません。

2．子会社株式及び関連会社株式

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

3．その他有価証券

（単位：千円）

区分	中間貸借対照表計上額	取得原価	差額
(1)中間貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの 投資信託等	8,658,097	7,538,725	1,119,372
小計	8,658,097	7,538,725	1,119,372
(2)中間貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの 投資信託等	3,265,638	3,335,995	70,356
小計	3,265,638	3,335,995	70,356
合計	11,923,736	10,874,721	1,049,015

（注）非上場株式等（中間貸借対照表計上額 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、記載していません。

（デリバティブ取引関係）

当社は、デリバティブ取引を全く行っていませんので、該当事項はありません。

（資産除去債務等）

該当事項はありません。

（セグメント情報等）

第33期中間会計期間（自 平成29年4月1日 至 平成29年9月30日）

1．セグメント情報

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

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

## 2. 関連情報

## (1) 製品及びサービスごとの情報

(単位：千円)

	委託者報酬	運用受託報酬	投資助言報酬	その他	合計
外部顧客への営業収益	17,308,525	2,835,650	727,606	74,834	20,946,618

## (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中間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中間貸借対照表の有形固定資産の金額の90%を超えるため、地域ごとの有形固定資産の記載を省略しております。

## (3) 主要な顧客ごとの情報

外部顧客への営業収益のうち、中間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。

## （1株当たり情報）

第33期中間会計期間 (自 平成29年4月1日 至 平成29年9月30日)	
1株当たり純資産額	2,070,280円85銭
1株当たり中間純利益	98,421円97銭
なお、潜在株式調整後1株当たり中間純利益については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。	
(注) 1株当たり純資産額の算定上の基礎	
中間貸借対照表の純資産の部の合計額	36,519,754千円
普通株式に係る純資産額	36,519,754千円
普通株式の発行済株式数	17,640株
1株当たり純資産額の算定に用いられた普通株式の数	17,640株
1株当たり中間純利益の算定上の基礎	
中間損益計算書上の中間純利益	1,736,163千円
普通株式に係る中間純利益	1,736,163千円
普通株主に帰属しない金額の主要な内訳	
該当事項はありません。	
普通株式の期中平均株式数	17,640株

## （重要な後発事象）

該当事項はありません。



#### 4【利害関係人との取引制限】

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

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

#### 5【その他】

- イ 定款の変更、その他の重要事項  
2017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2018年2月1日付効力発生の日付の変更
- 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（2017年9月末現在）  
 (ハ) 事業の内容 銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

## 〔参考情報：再信託受託会社の概要〕

- ・ 名称 日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社
- ・ 資本金の額 51,000百万円（2017年9月末現在）
- ・ 事業の内容 銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

## ロ 販売会社

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

資本金の額は、2017年9月末現在。

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

## 2【関係業務の概要】

## イ 受託会社

信託契約の受託会社であり、信託財産の保管・管理・計算等を行います。

## ロ 販売会社

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

## 3【資本関係】

該当ありません。

## 第3【その他】

- 1．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。
- 2．目論見書は、目論見書の別称として「投資信託説明書（交付目論見書）」または「投資信託説明書（請求目論見書）」と称して使用することがあります。
- 3．目論見書に当ファンドの信託約款を掲載すること、および投資信託の財産は受託会社において信託法に基づき分別管理されている旨を記載することがあります。
- 4．目論見書は、電子媒体等として使用されるほか、インターネット等に掲載されることがあります。
- 5．有価証券届出書の表紙記載情報を抜粋して、目論見書に記載することがあります。
- 6．目論見書の冒頭または巻末に届出書記載内容に関連する用語集を掲載することがあります。
- 7．評価機関等から当ファンドに対する評価を取得し、使用することがあります。
- 8．有価証券届出書を個別に提出している複数のファンドの実質的な投資対象資産に共通性がある場合には、当該複数のファンドを一つの投資信託説明書（交付目論見書）で説明することがあります。このため、有価証券届出書に他のファンドの情報を合わせて記載することがあります。
- 9．当ファンドとスイッチング対象ファンドにかかる投資信託説明書（交付目論見書）を一体のものとして使用することがあります。

**独立監査人の監査報告書**

平成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 公認会計士 小 澤 陽 一 印  
業 務 執 行 社 員指定有限責任社員 公認会計士 池ヶ谷 正 印  
業 務 執 行 社 員

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. 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30年 1月30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 公認会計士 小 澤 陽 一 印  
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 菅 野 雅 子 印  
業務執行社員

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29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. XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

**独立監査人の監査報告書**

平成30年 1月30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 公認会計士 小 澤 陽 一 印  
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 菅 野 雅 子 印  
業務執行社員

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29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30年 1月30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 公認会計士 小 澤 陽 一 印  
業 務 執 行 社 員指定有限責任社員 公認会計士 菅 野 雅 子 印  
業 務 執 行 社 員

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29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. XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

**独立監査人の監査報告書**

平成30年 1月30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 公認会計士 小 澤 陽 一 印  
業 務 執 行 社 員指定有限責任社員 公認会計士 菅 野 雅 子 印  
業 務 執 行 社 員

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29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．XBRLデータは監査の対象には含まれていません。



**独立監査人の中間監査報告書**

平成29年11月24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 公認会計士 小 澤 陽 一 印  
業 務 執 行 社 員指定有限責任社員 公認会計士 池ヶ谷 正 印  
業 務 執 行 社 員

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29年4月1日から平成30年3月31日までの第33期事業年度の中間会計期間（平成29年4月1日から平成29年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

**中間財務諸表に対する経営者の責任**

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

**監査人の責任**

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した中間監査に基づいて、独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得るために、中間監査に係る監査計画を策定し、これに基づき中間監査を実施することを求めている。

中間監査においては、中間財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するために年度監査と比べて監査手続の一部を省略した中間監査手続が実施される。中間監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要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、三井住友アセットマネジメント株式会社の平成29年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（平成29年4月1日から平成29年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

**利害関係**

会社と当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

(注) 1. 上記は中間監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。2. X B R L データは中間監査の対象には含まれていません。