

## 【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	平成28年5月12日提出
【発行者名】	三井住友アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 横山 邦男
【本店の所在の場所】	東京都港区愛宕二丁目5番1号
【事務連絡者氏名】	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年金バランス30（債券重点型） 三井住友・DC年金バランス50（標準型） 三井住友・DC年金バランス70（株式重点型）
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券の金額】	継続募集額(平成28年5月13日から平成29年5月18日まで) 三井住友・DC年金バランス30（債券重点型） 2兆5,000億円を上限とします。 三井住友・DC年金バランス50（標準型） 2兆5,000億円を上限とします。 三井住友・DC年金バランス70（株式重点型） 2兆5,000億円を上限とします。
【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年金バランス30（債券重点型）

三井住友・DC年金バランス50（標準型）

三井住友・DC年金バランス70（株式重点型）

上記3ファンドの愛称として「マイパッケージ」という名称を用いることがあります。

以下3ファンドを総称して、あるいはそれぞれを「当ファンド」または「各ファンド」ということがあります。また、「三井住友・DC年金バランス30（債券重点型）」、「三井住友・DC年金バランス50（標準型）」、「三井住友・DC年金バランス70（株式重点型）」をそれぞれ「マイパッケージ30」「マイパッケージ50」「マイパッケージ70」ということがあります。

### （２）【内国投資信託受益証券の形態等】

追加型証券投資信託の受益権です。

\*ファンドの受益権は、社債、株式等の振替に関する法律（以下「社振法」といいます。）の規定の適用を受け、受益権の帰属は、後述の「（11）振替機関に関する事項」に記載の振替機関および当該振替機関の下位の口座管理機関（社振法第2条に規定する「口座管理機関」をいい、振替機関を含め、以下「振替機関等」といいます。）の振替口座簿に記載または記録されることにより定まります（以下、振替口座簿に記載または記録されることにより定まる受益権を「振替受益権」といいます。）。委託会社である三井住友アセットマネジメント株式会社は、やむを得ない事情等がある場合を除き、当該振替受益権を表示する受益証券を発行しません。

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

### （３）【発行（売出）価額の総額】

各ファンド2兆5,000億円を上限とします。

### （４）【発行（売出）価格】

取得申込受付日の翌営業日の基準価額となります。

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

「基準価額」とは、信託財産の純資産総額を計算日における受益権口数で除した価額をいいます（基準価額は、便宜上1万口単位で表示される場合があります。）。

基準価額は、組入有価証券の値動き等により日々変動します。

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

委託会社に対する照会は下記においてできます。

照会先の名称	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】

1 円以上 1 円単位

## ( 7 ) 【申込期間】

平成28年 5月13日から平成29年 5月18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。

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

## ( 9 ) 【払込期日】

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

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

## ( 10 ) 【払込取扱場所】

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

## ( 11 ) 【振替機関に関する事項】

当ファンドの振替機関は下記の通りです。

株式会社証券保管振替機構

## ( 12 ) 【その他】

イ 申込証拠金  
ありません。

ロ わが国以外の地域における募集  
ありません。

ハ クーリング・オフ制度（金融商品取引法第37条の6）の適用  
ありません。

ニ 振替受益権について

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

(参考：投資信託振替制度)

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

## 第二部【ファンド情報】

### 第1【ファンドの状況】

#### 1【ファンドの性格】

##### （1）【ファンドの目的及び基本的性格】

- イ 当ファンドは、「国内株式インデックス・マザーファンド（B号）」、「国内債券パッシブ・マザーファンド」、「外国株式インデックス・マザーファンド」、「外国債券パッシブ・マザーファンド」（以下「マザーファンド」といいます。）の受益証券の組入れを通じて、わが国を含む世界各国の株式、公社債に分散投資することにより、信託財産の着実な成長を目指した運用を行います。
- ロ 各ファンドの運用にあたっては、株式、債券、短期金融資産を各ファンド毎の基本資産配分の比率により独自に作成した合成指数をベンチマークとして、中長期的にベンチマークに連動する投資成果を目指します。詳細については、後述の「2 投資方針」をご参照ください。
- ハ 委託会社は、受託会社と合意の上、各ファンドそれぞれ金5,000億円を限度として信託金を追加することができます。この限度額は、委託会社、受託会社の合意により変更できます。
- ニ 当ファンドが該当する商品分類、属性区分は次の通りです。

##### （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
単体型・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。
---------------	------	--

補足 分類	イン デッ クス 型	目論見書または信託約款において、各種指数に連動する運用成果を目指す旨の記載があるものをいいます。
----------	---------------------	--

## (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）資産配分固定型））	目論見書または信託約款において、主として投資信託証券に投資する旨の記載があるものをいいます。「投資信託証券」以下のカッコ内は投資信託証券の先の実質投資対象について記載していません。なお、組み入れる資産そのものは投資信託証券ですが、投資信託証券の先の実質投資対象は株式および債券であり、ファンドの収益は株式市場、債券市場の動向に左右されるものであるため、商品分類上の投資対象資産（収益の源泉）は「資産複合」となります。
決算頻度	年1回	目論見書または信託約款において、年1回決算する旨の記載があるものをいいます。
投資対象地域	グローバル（日本を含む）	目論見書または信託約款において、組入資産による投資収益が日本を含む世界の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
投資形態	ファミリーファンド	目論見書または信託約款において、親投資信託（ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除く。）を投資対象として投資するものをいいます。
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。
対象インデックス	その他の指数（合成指数）	目論見書または信託約款において、委託会社が定める合成指数に連動する運用成果を目指す旨の記載があるものをいいます。

## 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)	補足分類
---------	--------	-------------------	------



単位型  <b>追加型</b>	国内	株式  債券	<b>インデックス型</b>
	海外	不動産投信  その他資産 ( ) <b>資産複合</b>	
	<b>内外</b>		特殊型

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

#### 属性区分表

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	為替ヘッジ	対象インデックス
株式 一般 大型株 中小型株	<b>年1回</b>	<b>グローバル</b> <b>(日本を含む)</b>			日経225
	年2回	日本			
	年4回	北米			
債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット属性 ( )	年6回(隔月)	欧州	<b>ファミリーファンド</b>	あり	
	年12回(毎月)	アジア			
	日々	オセアニア			TOPIX
	その他	中南米			
不動産投信	( )	アフリカ	ファンド・オブ・ファンズ	<b>なし</b>	
<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>分固定型))</b>		中近東(中東)			<b>その他</b> <b>(合成指数)</b>
資産複合 ( ) 資産配分固 定型 資産配分変 更型		エマージング			

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

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

## (2) 【ファンドの沿革】

平成17年9月30日 信託契約締結、設定、運用開始。

## (3) 【ファンドの仕組み】

イ 当ファンドの関係法人とその役割

(イ) 委託会社 「三井住友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。

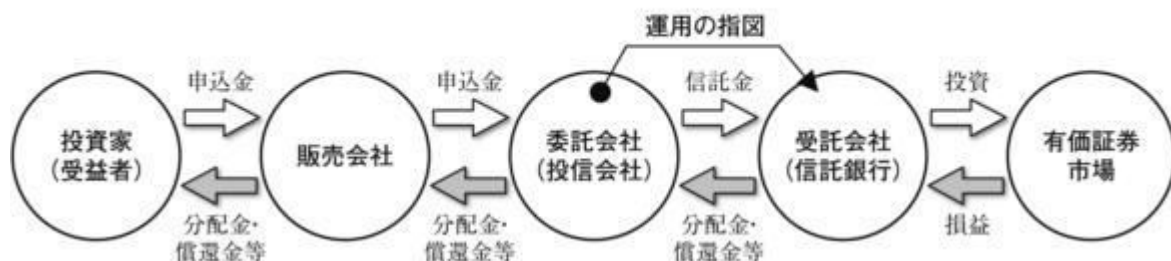
(ロ) 受託会社 「三井住友信託銀行株式会社」

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

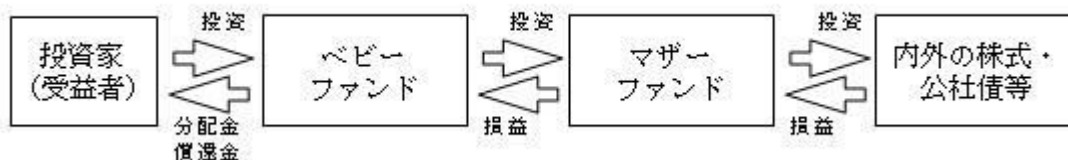
委託会社との間で締結される販売契約（名称の如何を問いません。）に基づき、当ファンドの募集・販売の取扱い、投資信託説明書（目論見書）の提供、受益者からの一部解約実行請求の受付け、受益者への収益分配金、一部解約金および償還金の支払事務等を行います。

### 運営の仕組み



当ファンドの運用は、「ファミリーファンド方式」で行われます。

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



ロ 委託会社の概況

(イ) 資本金の額

2,000百万円（平成28年3月31日現在）

(ロ) 会社の沿革

昭和60年7月15日 三生投資顧問株式会社設立

昭和62年2月20日 証券投資顧問業の登録

昭和62年6月10日 投資一任契約にかかる業務の認可

平成11年1月1日	三井生命保険相互会社の特別勘定運用部門と統合
平成11年2月5日	三生投資顧問株式会社から三井生命グローバルアセットマネジメント株式会社へ商号変更
平成12年1月27日	証券投資信託委託業の認可取得
平成14年12月1日	住友ライフ・インベストメント株式会社、スミセイ グローバル投信株式会社、三井住友海上アセットマネジメント株式会社およびさくら投信投資顧問株式会社と合併し、三井住友アセットマネジメント株式会社に商号変更
平成25年4月1日	トヨタアセットマネジメント株式会社と合併

## (八) 大株主の状況

(平成28年 3月31日現在)

名称	住所	所有 株式数	比率 (%)
株式会社三井住友銀行	東京都千代田区丸の内一丁目1番2号	7,056	40.0
住友生命保険相互会社	大阪府大阪市中央区城見一丁目4番35号	4,851	27.5
三井住友海上火災保険株式会社	東京都千代田区神田駿河台三丁目9番地	4,851	27.5
三井生命保険株式会社	東京都千代田区大手町二丁目1番1号	882	5.0

## 2【投資方針】

## (1)【投資方針】

## イ 基本方針

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

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

## ロ 投資態度

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

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

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

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

	マイパッケージ 30	マイパッケージ 50	マイパッケージ 70
TOPIX(東証株価指数、配当込み)	20%	35%	50%
NOMURA-BPI(総合)	55%	35%	15%

M S C I コクサイインデックス（配当込み、円ベース）	10%	15%	20%
シティ世界国債インデックス（除く日本、円ベース）	10%	10%	10%
有担保コール翌日物	5%	5%	5%

(八) 実質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ことを基本とします。

(二) 非株式割合に関する制限

a. マイパッケージ30

制限はありません。

b. マイパッケージ50

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

c. マイパッケージ70

株式以外の資産（他の投資信託受益証券を通じて投資する場合は、当該他の投資信託の信託財産に属する株式以外の資産のうち、この投資信託の信託財産に属するとみなした部分を含みます。）への投資割合は、原則として信託財産総額の50%以下とします。

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

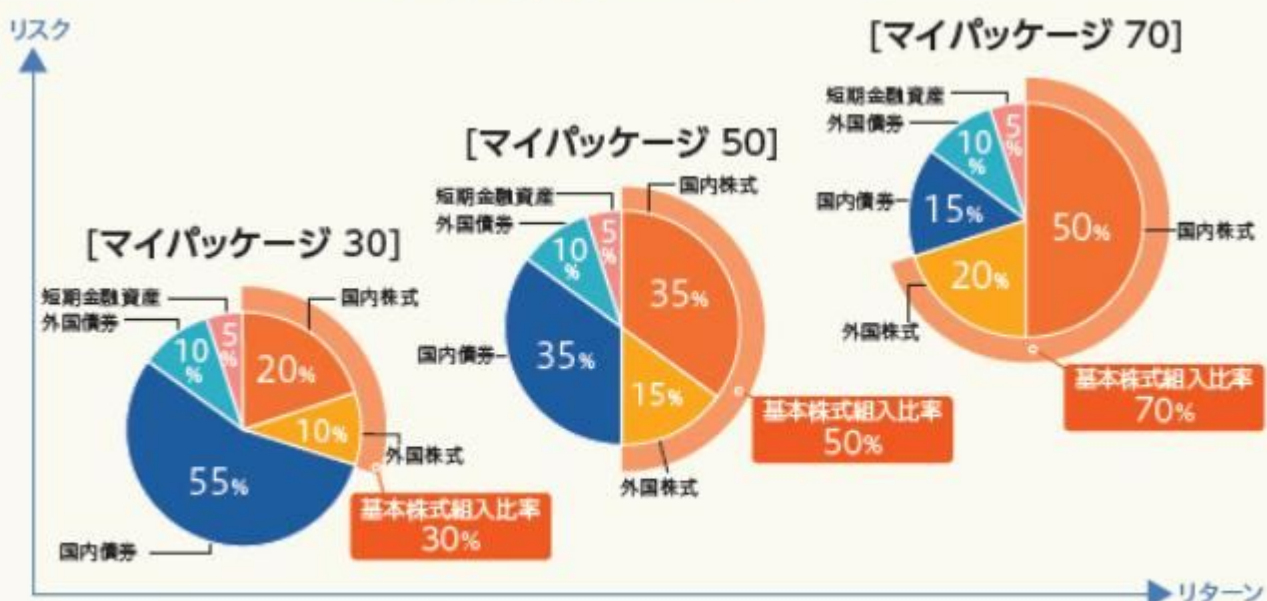
## ファンドの特色

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

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

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

### 〔各ファンドの基本資産配分イメージ〕



※上図はイメージであり、実際とは異なる場合があります。

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

〔各ファンドのベンチマークの資産別合成比率〕

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

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

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

ファンドのしくみ

- ファミリーファンド方式で運用を行います。
- 各マザーファンドは、ベンチマークに連動する投資成果を目指して運用を行います。



TOPIX(東証株価指数、配当込み)、NOMURA-BPI(総合)、MSCIコクサイインデックス、シティ世界国債インデックスは、それぞれ東京証券取引所、野村證券株式会社、MSCI Inc.、Citigroup Index LLCが公表している指数で各社の知的財産です。TOPIX(東証株価指数、配当込み)、NOMURA-BPI(総合)、MSCIコクサイインデックス、シティ世界国債インデックスは、それぞれ国内株式、国内債券、外国株式、外国債券の代表的な指数であり、当ファンドの合成指数を構成するものです。なお、外国株式および外国債券のベンチマークは、前日の指数を当日の対顧客電売相場相場との仲値により委託会社が円換算したものです。

※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。

## 各マザーファンドの投資方針等

### ▶ 国内株式インデックス・マザーファンド(B号)

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

### ▶ 国内債券パッシブ・マザーファンド

- わが国の公社債および短期金融資産を主要投資対象とし、NOMURA-BPI(総合)と連動する投資成果を目指して運用を行います。
- ポートフォリオの作成にあたっては、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、層化抽出法により、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NOMURA-BPI(総合)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。

### ▶ 外国株式インデックス・マザーファンド

- 主として日本を除く世界各国の株式に投資し、MSCIコクサイインデックス（円ベース）と連動する投資成果を目指して運用を行います。
- ポートフォリオの作成にあたっては、原則として投資不適格銘柄および低流動性銘柄を除外した上で、マルチファクターモデルを活用した最適化法により推定トラッキングエラーの低減のみならず、制約条件を加えることで実績トラッキングエラーを抑えることを目指してポートフォリオを構築します。
- MSCIコクサイインデックス（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。

### ▶ 外国債券パッシブ・マザーファンド

- 主として日本を除く世界各国の債券に投資し、シティ世界国債インデックス（除く日本、円ベース）と連動する投資成果を目指した運用を行います。
- ポートフォリオの作成にあたっては、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、層化抽出法により、通貨配分、国別配分、デュレーション、満期構成等を可能な限りシティ世界国債インデックス（除く日本、円ベース）に近づけたポートフォリオを構築します。
- シティ世界国債インデックス（除く日本、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。



#### 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。

#### 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乖離のことをいいます。

#### 層化抽出法とは

指数を構成する銘柄をいくつかのグループ（層）に分け、それぞれのグループから代表銘柄を抽出して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。

## 合成指数の推移

- ・以下のグラフは、合成指数の推移です。
- ・ファンドの値動きのイメージをつかんでいただくため、過去の合成指数の推移と国内外の主要な出来事を含めて記載したものであり、ファンドの運用実績ではありません。
- ・ファンドの実際の運用実績は、後掲「基準価額・純資産の推移」をご覧ください。
- ・ファンドの将来の運用成果等を示唆あるいは保証するものではありません。



(注1) 上記の合成指数は各ファンドの基本資産配分で組み合わせたデータを用いて、三井住友アセットマネジメントが計算したものです。なお、外国株式および外国債券の指数の円換算にあたり、使用している為替データの基準日がベンチマークのものとは異なります。また、投資にかかるコストは考慮されておりません。

(注2) 有価証券売買時のコストや信託報酬等の費用負担、組入有価証券の売買のタイミング差等の影響から、当ファンドの値動きは上記推移とは異なります。

(出所) FactSetのデータを基に三井住友アセットマネジメント作成

## (2) 【投資対象】

### イ 投資対象とする資産の種類

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

1. 有価証券
2. デリバティブ取引にかかる権利
3. 金銭債権
4. 約束手形



(口) 特定資産以外の資産で、以下に掲げる資産

1. 為替手形

ロ 投資対象とする有価証券

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

1. 株券または新株引受権証書

2. 国債証券

3. 地方債証券

4. 特別の法律により法人の発行する債券

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

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

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

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

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

10. コマーシャル・ペーパー

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

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

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

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

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

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

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

18. 外国法人が発行する譲渡性預金証書

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

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

21. 外国の者に対する権利で前号の有価証券の性質を有するもの

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

ハ 投資対象とする金融商品

委託会社は、信託金を、上記ロに掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することを指図することができます。

- 1．預金
- 2．指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
- 3．コール・ローン
- 4．手形割引市場において売買される手形
- 5．貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
- 6．外国の者に対する権利で前号の権利の性質を有するもの

### （3）【運用体制】

#### イ 運用体制

当ファンドの運用は、次のプロセスに基づいて行われます。

##### （イ）計画（Plan）

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

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

##### （ロ）実行（Do）

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

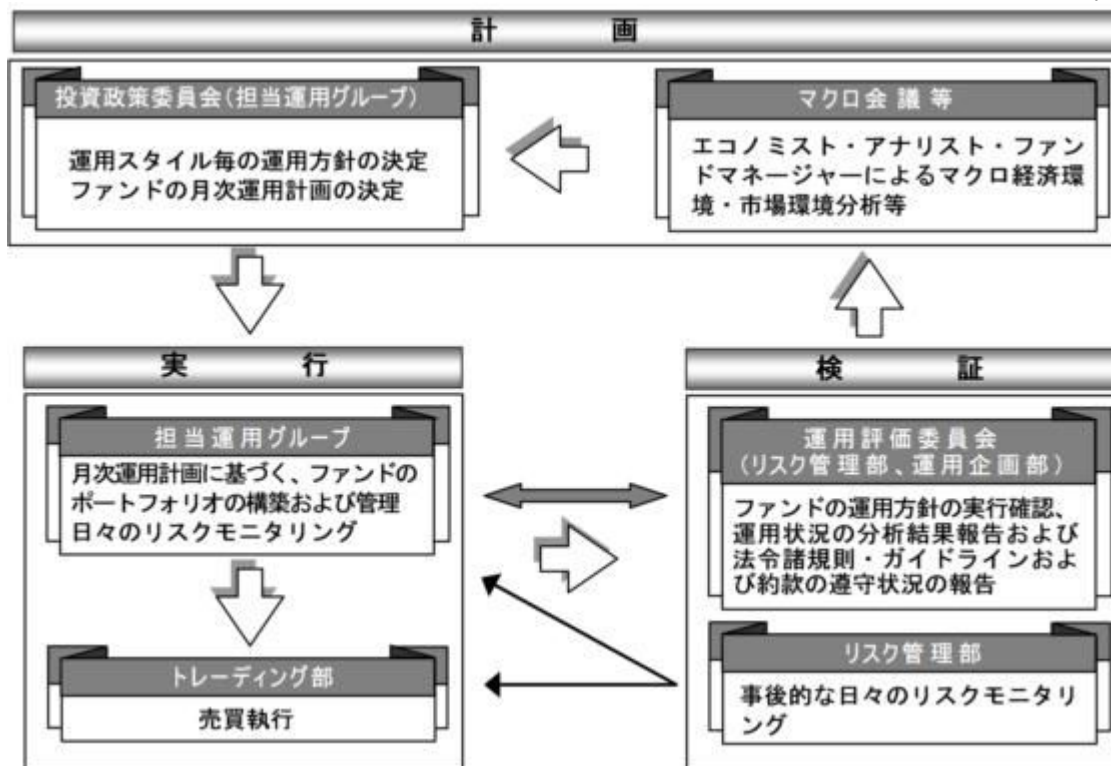
売買執行については、組織的に分離されたトレーディング部が、最良と思われる手法をもって売買を執行します。

##### （ハ）検証（Check）

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

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

### 【ファンドの運用体制】



リスク管理部は9名程度、運用企画部は11名程度で構成されています。

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

ロ 委託会社によるファンドの関係法人（販売会社を除く）に対する管理体制

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

（４）【分配方針】

毎決算時（原則として毎年2月18日、ただし決算応当日が休業日の場合は翌営業日）に、原則として以下の方針に基づき分配金額を決定します。

- イ 分配対象額の範囲は、繰越分を含めた利子、配当収益と売買益（評価損益を含みます。）等の全額とします。
- ロ 収益分配金額は、委託会社が基準価額水準等を勘案して決定します。ただし、分配対象収益が少額の場合等には委託会社の判断により収益分配を行わない場合もあるため、将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。
- ハ 留保益の運用については特に制限を定めず、委託会社の判断に基づき、前記「（１）投資方針」と同一の運用を行います。

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

（５）【投資制限】

ファンドの信託約款に基づく主要な投資制限

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

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

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

- 新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。
- ハ 投資信託証券(マザーファンド受益証券を除きます。)への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。
- ニ 外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の50%以下とします。
- ホ 同一銘柄の株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。
- ヘ 同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の5%以内とします。
- ト 同一銘柄の転換社債および転換社債型新株予約権付社債への実質投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の10%以内とします。

#### ファンドの信託約款に基づくその他の投資制限

##### イ 投資する株式等の範囲

- (イ) 委託会社が投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、取引所に上場している株式の発行会社の発行するもの、取引所に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。
- (ロ) 上記(イ)にかかわらず、上場予定または登録予定の株式、新株引受権証券および新株予約権証券で目論見書等において上場または登録することが確認できるものについては委託会社が投資することを指図することができるものとします。

##### □ 信用取引の指図

- (イ) 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売り付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、株券の引渡しまたは買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。
- (ロ) 信用取引の指図は、当該売付けにかかる建玉の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- (ハ) 信託財産の一部解約等の事由により、信用取引の売付けにかかる建玉の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する売付けの一部を決済するための指図をするものとします。

##### ハ 先物取引等の指図

- (イ) 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクを回避するため、わが国の取引所における有価証券先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。以下同じ。)、有価証券指数等先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。以下同じ。)および有価証券オプション取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。以下同じ。)ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めて取り扱うものとします(以下同じ。)
- (ロ) 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに為替変動リスクを回避するために、わが国の取引所における通貨にかかる先物取引および通貨にかかるオプション取引ならびに外国の取引所における通貨にかかる先物取引およびオプション取引を行うことの指図をすることができます。
- (ハ) 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクを回避するために、わが国の取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。

##### ニ スワップ取引の指図

- (イ) 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するために、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引(以下「スワップ取引」といいます。)を行うことの指図をすることができます。
- (ロ) スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこのかぎりではありません。
- (ハ) スワップ取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の合計額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記純資産総額が減少して、スワップ取引の想定元本の合計額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は、速やかに、その超える額に相当するスワップ取引の一部の解約を指図するものとします。
- (ニ) スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額により行うものとします。
- (ホ) 委託会社は、スワップ取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めたときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

#### ホ 金利先渡取引および為替先渡取引の指図

- (イ) 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するために、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことの指図をすることができます。
- (ロ) 金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- (ハ) 金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかる金利先渡取引および為替先渡取引の想定元本の合計額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記純資産総額が減少して、金利先渡取引および為替先渡取引の想定元本の合計額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は、速やかに、その超える額に相当する金利先渡取引および為替先渡取引の一部の解約を指図するものとします。
- (ニ) 金利先渡取引および為替先渡取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額により行うものとします。
- (ホ) 委託会社は、金利先渡取引および為替先渡取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めたときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。
- (ヘ) 「金利先渡取引」とは、当事者間において、あらかじめ将来の特定の日(以下「決済日」といいます。)における決済日から一定の期間を経過した日(以下「満期日」といいます。)までの期間にかかる国内または海外において代表的利率として公表される預金契約または金銭の貸借契約に基づく債権の利率(以下「指標利率」といいます。)の数値を取り決め、その取決めにかかる数値と決済日における当該指標利率の現実の数値との差にあらかじめ元本として定めた金額および当事者間で約定した日数を基準とした数値を乗じた額を決済日における当該指標利率の現実の数値で決済日における現在価値に割り引いた額の金銭の授受を約する取引をいいます。
- (ト) 「為替先渡取引」とは、当事者間において、あらかじめ決済日から満期日までの期間にかかる為替スワップ取引(同一の相手方との間で直物外国為替取引および当該直物外国為替取引と反対売買の関係に立つ先物外国為替取引を同時に約定する取引をいいます。以下同じ。)のスワップ幅(当該直物外国為替取引にかかる外国為替相場と当該先物外国為替取引にかかる外国為替相場との差を示す数値をいいます。以下同じ。)を取り決め、その取決めにかかるスワップ幅から決済日における当該為替スワップ取引の現実のスワップ幅を差し引いた値にあらかじめ元本として定めた金額を乗じた額を決済日における指標利率の数値で決済日における現在価値に割り引いた額の金銭またはその取決めにかかるスワップ幅から決済日における当該為替ス

ワップ取引の現実のスワップ幅を差し引いた値にあらかじめ元本として定めた金額を乗じた金額とあらかじめ元本として定めた金額について決済日を受渡日として行った先物外国為替取引を決済日における直物外国為替取引で反対売買したときの差金にかかる決済日から満期日までの利息とを合算した額を決済日における指標利率の数値で決済日における現在価値に割り引いた額の金銭の授受を約する取引をいいます。

#### へ 有価証券の貸付けの指図

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

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

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

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

#### ト 有価証券の空売りの指図

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

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

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

#### チ 有価証券の借入れの指図

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

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

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

(ニ) 有価証券の借入れにかかる品借料は、信託財産中から支弁します。

#### リ 特別の場合の外貨建有価証券への投資制限

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

#### ヌ 外国為替予約取引の指図

(イ) 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。

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

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

#### ル 資金の借入れ

- (イ) 委託会社は、信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定に資するため、信託財産において一部解約金の支払資金の不足額が生じるときは、資金借入れ(コール市場を通じる場合を含みます。)の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。
- (ロ) 上記(イ)の資金借入れ額は、次の各号に掲げる要件を満たす範囲内の額とします。
1. 一部解約金の支払資金の手当てのために行った有価証券等の売却等による受取りの確定している資金の額の範囲内
  2. 一部解約金支払日の前営業日において確定した当該支払日における支払資金の不足額の範囲内
  3. 借入れ指図を行う日における信託財産の純資産総額の10%以内
- (ハ) 上記(ロ)の借入期間は、有価証券等の売却代金または償還金の入金日までに限るものとします。
- (ニ) 借入金の利息は、信託財産中から支弁します。

#### ヲ デリバティブ取引等にかかる投資制限

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

#### 法令に基づく投資制限

- イ 同一法人の発行する株式への投資制限(投資信託及び投資法人に関する法律第9条)
- 委託会社は、同一の法人の発行する株式を、その運用の指図を行うすべての委託者指図型投資信託につき、信託財産として有する当該株式にかかる議決権の総数(株主総会において決議をすることができる事項の全部につき議決権を行使することができない株式についての議決権を除き、会社法第879条第3項の規定により議決権を有するものとみなされる株式についての議決権を含みます。)が、当該株式にかかる議決権の総数に100分の50を乗じて得た数を超えることとなる場合においては、信託財産をもって当該株式を取得することを受託会社に指図することが禁じられています。
- ロ デリバティブ取引にかかる投資制限(金融商品取引業等に関する内閣府令第130条第1項第8号)
- 委託会社は、信託財産に関し、金利、通貨の価格、金融商品市場における相場その他の指標にかかる変動その他の理由により発生し得る危険に対応する額としてあらかじめ委託会社が定めた合理的な方法により算出した額が当該信託財産の純資産額を超えることとなる場合において、デリバティブ取引(新株予約権証券またはオプションを表示する証券もしくは証書にかかる取引および選択権付債券売買を含みます。)を行い、または継続することを受託会社に指図しないものとします。

(参考情報: マザーファンドの投資方針等)

(国内株式インデックス・マザーファンド(B号))

#### (1) 投資方針等

##### イ 基本方針

主としてわが国の株式に投資し、TOPIX(東証株価指数、配当込み)と連動する投資成果を目指して運用を行います。

##### ロ 投資態度

- (イ) 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)と連動する投資成果を目指して運用を行います。
- (ロ) 株価指数先物取引等を含む株式の実質組入比率は、原則として高位を保ちます。ただし、資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。
- (ハ) 株式以外の資産への投資割合は、原則として信託財産総額の50%以下とします。

## (2) 投資対象

## イ 投資対象とする資産の種類

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

## ロ 投資対象とする有価証券

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

## ハ 投資対象とする金融商品

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

## (3) 投資制限

## イ ファンドの信託約款に基づく主要な投資制限

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

## (国内債券パッシブ・マザーファンド)

## (1) 投資方針等

## イ 基本方針

わが国の公社債および短期金融資産を主要投資対象とし、NOMURA - 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。

## ロ 投資態度

- (イ) NOMURA - B P I (総合)をベンチマークとし、ベンチマークと連動する投資成果を目指します。
- (ロ) 公社債の組入比率は原則として高位を保ちます。
- (ハ) 資金動向、市況動向等の急変により上記の運用が困難となった場合、暫定的に上記と異なる運用を行う場合があります。

## (2) 投資対象

## イ 投資対象とする資産の種類

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

## ロ 投資対象とする有価証券

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

## ハ 投資対象とする金融商品

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

## (3) 投資制限

## イ ファンドの信託約款に基づく主要な投資制限

- (イ) 株式(新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。)への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。
- (ロ) 新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とし



ます。

- (八) 投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。
- (二) 外貨建資産への投資は行いません。
- (ホ) 同一銘柄の転換社債および転換社債型新株予約権付社債への投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の10%以内とします。

#### (外国株式インデックス・マザーファンド)

##### (1) 投資方針等

###### イ 基本方針

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

###### ロ 投資態度

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

##### (2) 投資対象

###### イ 投資対象とする資産の種類

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

###### ロ 投資対象とする有価証券

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

###### ハ 投資対象とする金融商品

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

##### (3) 投資制限

###### イ ファンドの信託約款に基づく主要な投資制限

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

#### (外国債券パッシブ・マザーファンド)

##### (1) 投資方針等

###### イ 基本方針

シティ世界国債インデックス(除く日本、円ベース)をベンチマークとし、ベンチマークと連動する投資成果を目指した運用を行います。

###### ロ 投資態度

- (イ) シティ世界国債インデックス(除く日本、円ベース)をベンチマークとし、ベンチマークと連動する投資成果を目指します。
- (ロ) ポートフォリオ構築にあたっては、取引コストを極力抑えながら、推定トラッキングエラーを最小化します。

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

## (2) 投資対象

### イ 投資対象とする資産の種類

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

### ロ 投資対象とする有価証券

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

### ハ 投資対象とする金融商品

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

## (3) 投資制限

### イ ファンドの信託約款に基づく主要な投資制限

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

## 3【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、主に内外の株式や債券を投資対象としています(マザーファンドを通じて間接的に投資する場合を含みます。 )。当ファンドの基準価額は、組み入れた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。基準価額の下落により損失を被り、投資元本を割り込むことがあります。

運用の結果としてファンドに生じた利益および損失は、すべて受益者に帰属します。したがって、当ファンドは預貯金とは異なり、投資元本が保証されているものではなく、一定の投資成果を保証するものでもありません。また、当ファンドは、預貯金や保険契約と異なり、預金保険、貯金保険、保険契約者保護機構の保護の対象ではありません。登録金融機関は、投資者保護基金には加入していません。

当ファンドが有するリスク等(当ファンドが主要投資対象とするマザーファンドへの投資を通じて間接的に受ける実質的なリスク等を含みます。 )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) 指数と連動しない要因・留意点

ファンドは、委託会社が独自に作成した合成指数に連動する投資成果を目指して運用を行います。ただし、有価証券売買時のコストおよび信託報酬その他のファンド運営にかかる費用、追加設定・解約に伴う組入る有価証券の売買のタイミング差、インデックス構成銘柄と組入る有価証券との誤差の影響等から、上記合成指数に連動しないことがあります。

(チ) ファミリーファンド方式にかかる留意点

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

(リ) 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。

(ヌ) 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。

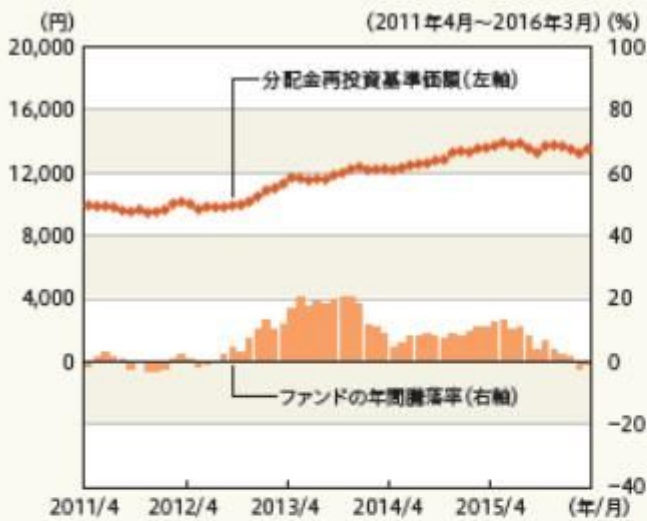
#### □ 投資リスクの管理体制

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。

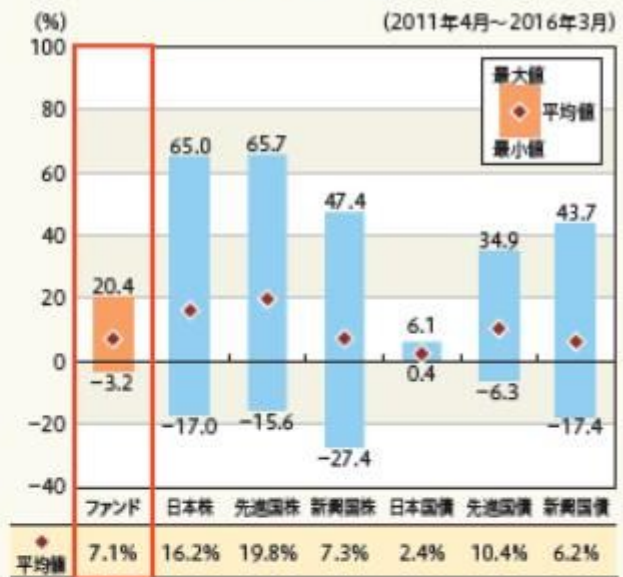
(参考情報) 投資リスクの定量的比較

## ■マイパッケージ30

〔 ファンドの年間騰落率および  
分配金再投資基準価額の推移 〕



〔 ファンドと他の代表的な  
資産クラスとの騰落率の比較 〕

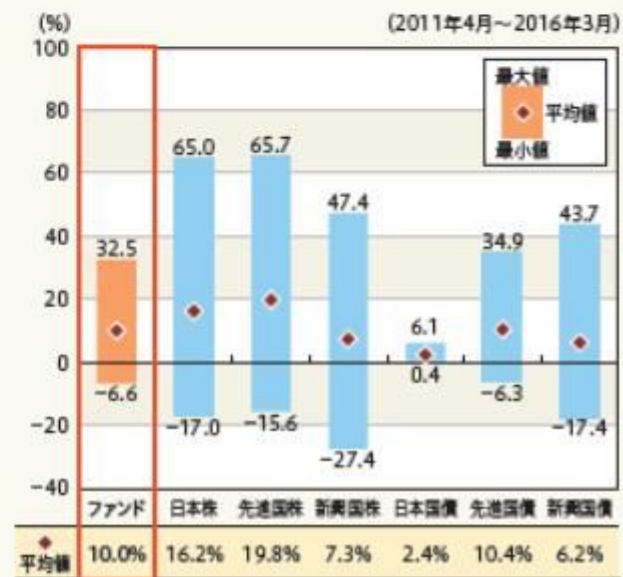


## ■マイパッケージ50

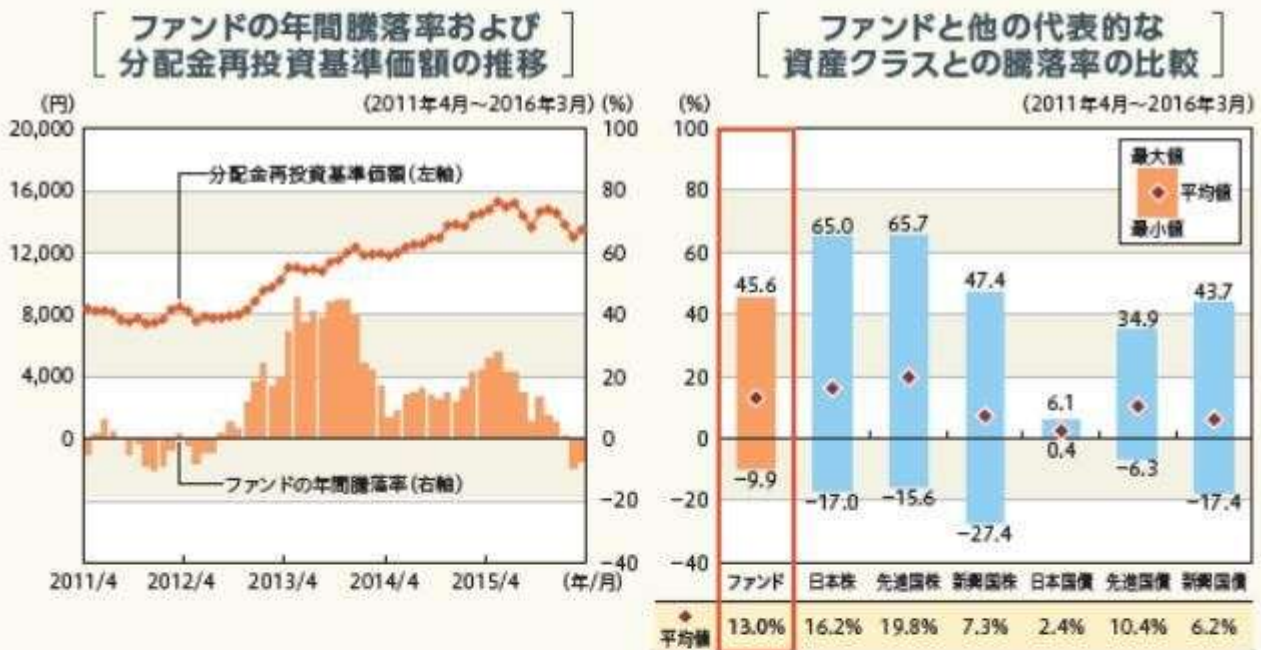
〔 ファンドの年間騰落率および  
分配金再投資基準価額の推移 〕



〔 ファンドと他の代表的な  
資産クラスとの騰落率の比較 〕



## ■マイパッケージ70



※左グラフは2011年4月～2016年3月の各月末におけるファンドの直近1年間の騰落率および分配金再投資基準価額の推移を表示したものです。右グラフは同期間の各月末における直近1年間の騰落率の平均・最大・最小を、ファンドおよび他の代表的な資産クラスについて表示したものです。

※ファンドの分配金再投資基準価額は、分配金(税引前)を分配時に再投資したものと仮定して計算しており、実際の基準価額とは異なります。分配実績がない場合は、分配金再投資基準価額は基準価額と同じです。

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

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

### <各資産クラスの指数>

日本株…TOPIX(配当込み)

先進国株…MSCIコクサイインデックス(グロス配当込み、円ベース)

新興国株…MSCIエマージング・マーケット・インデックス(グロス配当込み、円ベース)

日本国債…NOMURA-BPI(国債)

先進国債…シティ世界国債インデックス(除く日本、円ベース)

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

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

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

「MSCIコクサイインデックス(グロス配当込み、円ベース)」は、MSCI Inc.が開発した指数で、日本を除く世界の主要先進国の株式を対象としています。

「MSCIエマージング・マーケット・インデックス(グロス配当込み、円ベース)」は、MSCI Inc.が開発した指数で、新興国の株式を対象としています。

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

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

「JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ダイバーシファイド(円ベース)」は、J.P. Morganが算出、公表する指数で、新興国が発行する現地通貨建て国債を対象としています。

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

## 4【手数料等及び税金】

### (1)【申込手数料】

無手数料です。

(2) 【換金（解約）手数料】

解約手数料はありません。

(3) 【信託報酬等】

純資産総額に以下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。

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

各ファンドの信託報酬率および実質的配分は以下の通りです。

< 信託報酬率およびその配分 >

	信託報酬率	配分（税抜き）		
		委託会社	販売会社	受託会社
マイパッケージ 30	年0.2376% （税抜き0.22%）	年0.09%	年0.1%	年0.03%
マイパッケージ 50	年0.2484% （税抜き0.23%）	年0.10%	年0.1%	年0.03%
マイパッケージ 70	年0.2592% （税抜き0.24%）	年0.11%	年0.1%	年0.03%

上記の配分には別途消費税等相当額がかかります。

支払先	役務の内容
委託会社	ファンド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

(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0.0054%（税抜き0.005%）以内の率を乗じて得た金額が信託財産の費用として計上され、毎計算期間の最初の6ヵ月終了日と各計算期末または信託終了のときに、信託財産中から支弁するものとします。監査費用は、将来、監査法人との契約等により変更となることがあります。
- ロ 信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用および受託会社の立て替えた立替金の利息は、信託財産中から支弁します。
- ハ 有価証券の売買時の手数料、デリバティブ取引等に要する費用、および外国における資産の保管等に要する費用等（それらにかかる消費税等相当額を含みます。）は、信託財産中から支弁するものとします。

上記ロ、ハ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。

上記(1)～(4)にかかる手数料等の合計額、その上限額、計算方法等は、手数料等に保有期間に応じて異なるものが含まれていたり、発生時・請求時に初めて具体的金額を認識するものがあつたりすることから、あらかじめ具体的に記載することはできません。

## (5)【課税上の取扱い】

### イ 個別元本について

- (イ) 追加型株式投資信託について、受益者毎の信託時の受益権の価額等(申込手数料および当該申込手数料にかかる消費税等相当額は含まれません。)が当該受益者の元本(個別元本)にあたります。
- (ロ) 受益者が同一ファンドの受益権を複数回取得した場合、個別元本は、当該受益者が追加信託を行うつど当該受益者の受益権口数で加重平均することにより算出されます。ただし、同一ファンドを複数の販売会社で取得する場合には、各販売会社毎に個別元本の算出が行われます。また、同一販売会社であっても同一受益者の顧客口座が複数存在する場合や、「分配金受取りコース」と「分配金自動再投資コース」を併用するファンドの場合には、別々に個別元本の算出が行われることがあります。
- (ハ) 受益者が元本払戻金(特別分配金)を受け取った場合、収益分配金発生時にその個別元本から当該元本払戻金(特別分配金)を控除した額が、その後の当該受益者の個別元本となります。(「元本払戻金(特別分配金)」については、下記の(収益分配金の課税について)を参照。)

### ロ 一部解約時および償還時の課税について

個人の受益者については、一部解約時および償還時の譲渡益が課税対象となり、法人の受益者については、一部解約時および償還時の個別元本超過額が課税対象となります。

### ハ 収益分配金の課税について

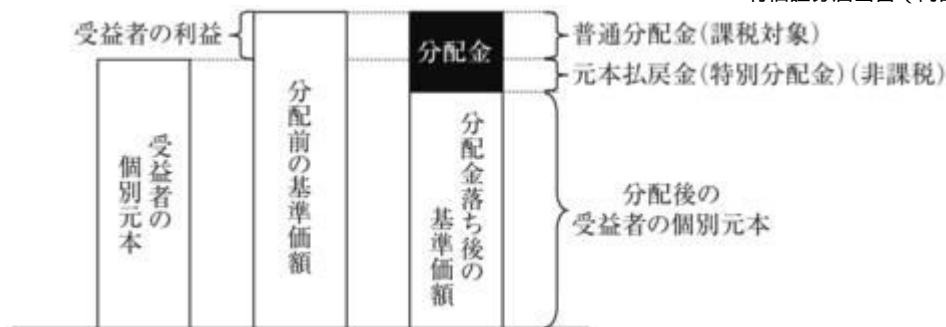
追加型株式投資信託の収益分配金には、課税扱いとなる「普通分配金」と、非課税扱いとなる「元本払戻金(特別分配金)」(受益者毎の元本の一部払戻しに相当する部分)の区分があります。

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。

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。

### < 受取配当にかかる益金不算入制度、配当控除の適用の可否 >

#### a. マイパッケージ30

配当控除の適用はありません。

外貨建資産割合および非株式割合

外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の50%以下とします。

非株式割合に関する制限はありません（約款規定なし）。

#### b. マイパッケージ50

配当控除の適用が可能です。

## 外貨建資産割合および非株式割合

外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の50%以下とします。

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

## c. マイパッケージ70

配当控除の適用が可能です。

## 外貨建資産割合および非株式割合

外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の50%以下とします。

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。

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

上記「(5)課税上の取扱い」ほか税制に関する本書の記載は、平成28年3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年金バランス30（債券重点型）

平成28年 3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	4,895,131,147	94.59
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		280,154,357	5.41
合計(純資産総額)		5,175,285,504	100.00

(注) 投資比率とは、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。以下同じ。

## 三井住友・DC年金バランス50（標準型）

平成28年 3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	14,104,773,220	95.99
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		588,630,990	4.01
合計(純資産総額)		14,693,404,210	100.00

## 三井住友・DC年金バランス70（株式重点型）

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	7,142,889,775	96.25
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		278,138,185	3.75
合計(純資産総額)		7,421,027,960	100.00

## (2) 【投資資産】

## 【投資有価証券の主要銘柄】

三井住友・DC年金バランス30（債券重点型）

## イ 主要投資銘柄

平成28年 3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	国内債券パッシブ・マザーファンド	2,235,166,983	1.2419	2,776,043,252	1.2646	2,826,592,166	54.62
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）	523,674,362	1.9113	1,000,898,809	1.9832	1,038,550,994	20.07
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	200,831,501	2.4715	496,355,055	2.6218	526,540,029	10.17
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	288,409,692	1.7295	498,823,585	1.7456	503,447,958	9.73

以上が、当ファンドが保有する有価証券のすべてです。

## ロ 種類別の投資比率

平成28年 3月31日現在

種類	投資比率 (%)
親投資信託受益証券	94.59
合計	94.59

三井住友・DC年金バランス50（標準型）

## イ 主要投資銘柄

平成28年 3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	国内債券パッシブ・マザーファンド	4,078,592,431	1.2422	5,066,472,882	1.2646	5,157,787,988	35.10
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）	2,599,887,862	1.9108	4,967,865,727	1.9832	5,156,097,607	35.09

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	875,014,488	2.4713	2,162,423,305	2.6218	2,294,112,984	15.61
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	857,455,684	1.7291	1,482,709,271	1.7456	1,496,774,641	10.19

以上が、当ファンドが保有する有価証券のすべてです。

#### ロ 種類別の投資比率

平成28年 3月31日現在

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	95.99
合計	95.99

#### 三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)

##### イ 主要投資銘柄

平成28年 3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	国内株式インデックス・マザーファンド(B号)	1,865,847,758	1.9113	3,566,326,829	1.9832	3,700,349,273	49.86
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	585,035,431	2.4713	1,445,798,061	2.6218	1,533,845,892	20.67
日本	親投資信託受益証券	国内債券パッシブ・マザーファンド	898,609,379	1.2426	1,116,689,861	1.2646	1,136,381,420	15.31
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	442,434,229	1.7287	764,862,279	1.7456	772,313,190	10.41

以上が、当ファンドが保有する有価証券のすべてです。

#### ロ 種類別の投資比率

平成28年 3月31日現在

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	96.25
合計	96.25

#### 【投資不動産物件】

##### 三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)

該当事項はありません。

##### 三井住友・DC年金バランス50(標準型)

該当事項はありません。

##### 三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

三井住友・DC年金バランス30（債券重点型）

該当事項はありません。

三井住友・DC年金バランス50（標準型）

該当事項はありません。

三井住友・DC年金バランス70（株式重点型）

該当事項はありません。

（3）【運用実績】

【純資産の推移】

三井住友・DC年金バランス30（債券重点型）

年月日	純資産総額 (円)		1万口当たりの 純資産額(円)	
	(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第2期 (平成19年 2月19日)	284,591,517	284,591,517	10,992	10,992
第3期 (平成20年 2月18日)	709,939,713	709,939,713	10,504	10,504
第4期 (平成21年 2月18日)	925,997,054	925,997,054	8,783	8,783
第5期 (平成22年 2月18日)	1,428,892,994	1,428,892,994	9,699	9,699
第6期 (平成23年 2月18日)	1,960,814,211	1,960,814,211	10,043	10,043
第7期 (平成24年 2月20日)	2,456,937,455	2,456,937,455	9,914	9,914
第8期 (平成25年 2月18日)	3,050,834,550	3,050,834,550	10,966	10,966
第9期 (平成26年 2月18日)	3,743,242,037	3,743,242,037	12,196	12,196
第10期 (平成27年 2月18日)	4,426,547,408	4,426,547,408	13,381	13,381
第11期 (平成28年 2月18日)	4,963,496,383	4,963,496,383	13,158	13,158
平成27年 3月末日	4,599,336,858		13,558	
4月末日	4,660,605,461		13,680	
5月末日	4,813,541,642		13,873	
6月末日	4,787,901,415		13,717	
7月末日	4,943,217,587		13,843	
8月末日	4,862,389,545		13,524	
9月末日	4,808,047,334		13,242	

10月末日	4,998,336,530		13,676	
11月末日	5,078,737,565		13,727	
12月末日	5,107,635,727		13,663	
平成28年 1月末日	5,087,211,963		13,460	
2月末日	4,985,821,312		13,198	
3月末日	5,175,285,504		13,479	

## 三井住友・DC年金バランス50（標準型）

年月日	純資産総額 （円）		1万口当たりの 純資産額（円）	
	（分配落）	（分配付）	（分配落）	（分配付）
第2期（平成19年 2月19日）	1,249,567,567	1,249,567,567	11,564	11,564
第3期（平成20年 2月18日）	2,650,595,109	2,650,595,109	10,467	10,467
第4期（平成21年 2月18日）	2,892,759,889	2,892,759,889	7,758	7,758
第5期（平成22年 2月18日）	4,608,495,307	4,608,495,307	8,983	8,983
第6期（平成23年 2月18日）	6,082,088,735	6,082,088,735	9,470	9,470
第7期（平成24年 2月20日）	6,937,357,284	6,937,357,284	9,064	9,064
第8期（平成25年 2月18日）	8,682,766,317	8,682,766,317	10,415	10,415
第9期（平成26年 2月18日）	10,955,496,410	10,955,496,410	12,155	12,155
第10期（平成27年 2月18日）	13,231,559,031	13,231,559,031	13,865	13,865
第11期（平成28年 2月18日）	14,015,482,569	14,015,482,569	13,215	13,215
平成27年 3月末日	14,144,303,723		14,138	
4月末日	14,343,670,498		14,332	
5月末日	14,843,831,133		14,687	
6月末日	14,676,123,236		14,444	
7月末日	15,010,282,924		14,624	
8月末日	14,472,768,653		14,065	
9月末日	13,995,000,661		13,550	
10月末日	14,838,531,240		14,274	
11月末日	14,970,130,287		14,367	
12月末日	14,959,562,360		14,221	
平成28年 1月末日	14,570,340,471		13,750	
2月末日	14,033,814,394		13,211	
3月末日	14,693,404,210		13,610	

## 三井住友・DC年金バランス70（株式重点型）

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

第2期	(平成19年 2月19日)	591,109,514	591,109,514	12,141	12,141
第3期	(平成20年 2月18日)	1,189,426,390	1,189,426,390	10,410	10,410
第4期	(平成21年 2月18日)	1,169,406,901	1,169,406,901	6,771	6,771
第5期	(平成22年 2月18日)	2,060,345,540	2,060,345,540	8,216	8,216
第6期	(平成23年 2月18日)	2,906,265,010	2,906,265,010	8,802	8,802
第7期	(平成24年 2月20日)	3,235,878,337	3,235,878,337	8,153	8,153
第8期	(平成25年 2月18日)	4,273,161,707	4,273,161,707	9,718	9,718
第9期	(平成26年 2月18日)	5,675,436,056	5,675,436,056	11,894	11,894
第10期	(平成27年 2月18日)	7,091,879,077	7,091,879,077	14,104	14,104
第11期	(平成28年 2月18日)	7,026,639,080	7,026,639,080	13,019	13,019
	平成27年 3月末日	7,362,383,988		14,479	
	4月末日	7,525,559,968		14,743	
	5月末日	7,876,344,834		15,266	
	6月末日	7,742,144,554		14,927	
	7月末日	7,877,835,300		15,166	
	8月末日	7,457,919,504		14,351	
	9月末日	7,126,669,530		13,606	
	10月末日	7,707,886,886		14,614	
	11月末日	7,793,601,336		14,750	
	12月末日	7,742,862,766		14,520	
	平成28年 1月末日	7,413,000,717		13,771	
	2月末日	7,011,140,687		12,969	
	3月末日	7,421,027,960		13,472	

## 【分配の推移】

## 三井住友・DC年金バランス30（債券重点型）

	計算期間	1万口当たり分配金（円）
第2期	平成18年 2月21日～平成19年 2月19日	0
第3期	平成19年 2月20日～平成20年 2月18日	0
第4期	平成20年 2月19日～平成21年 2月18日	0
第5期	平成21年 2月19日～平成22年 2月18日	0
第6期	平成22年 2月19日～平成23年 2月18日	0
第7期	平成23年 2月19日～平成24年 2月20日	0
第8期	平成24年 2月21日～平成25年 2月18日	0
第9期	平成25年 2月19日～平成26年 2月18日	0
第10期	平成26年 2月19日～平成27年 2月18日	0
第11期	平成27年 2月19日～平成28年 2月18日	0

## 三井住友・DC年金バランス50（標準型）

	計算期間	1万口当たり分配金（円）
第2期	平成18年 2月21日～平成19年 2月19日	0
第3期	平成19年 2月20日～平成20年 2月18日	0
第4期	平成20年 2月19日～平成21年 2月18日	0
第5期	平成21年 2月19日～平成22年 2月18日	0
第6期	平成22年 2月19日～平成23年 2月18日	0
第7期	平成23年 2月19日～平成24年 2月20日	0
第8期	平成24年 2月21日～平成25年 2月18日	0
第9期	平成25年 2月19日～平成26年 2月18日	0
第10期	平成26年 2月19日～平成27年 2月18日	0
第11期	平成27年 2月19日～平成28年 2月18日	0

## 三井住友・DC年金バランス70（株式重点型）

	計算期間	1万口当たり分配金（円）
第2期	平成18年 2月21日～平成19年 2月19日	0
第3期	平成19年 2月20日～平成20年 2月18日	0
第4期	平成20年 2月19日～平成21年 2月18日	0
第5期	平成21年 2月19日～平成22年 2月18日	0
第6期	平成22年 2月19日～平成23年 2月18日	0
第7期	平成23年 2月19日～平成24年 2月20日	0
第8期	平成24年 2月21日～平成25年 2月18日	0
第9期	平成25年 2月19日～平成26年 2月18日	0
第10期	平成26年 2月19日～平成27年 2月18日	0
第11期	平成27年 2月19日～平成28年 2月18日	0

## 【収益率の推移】

## 三井住友・DC年金バランス30（債券重点型）

	収益率（％）
第2期	6.1
第3期	4.4
第4期	16.4
第5期	10.4
第6期	3.5
第7期	1.3
第8期	10.6
第9期	11.2



第10期	9.7
第11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年金バランス50(標準型)

	収益率(%)
第2期	9.4
第3期	9.5
第4期	25.9
第5期	15.8
第6期	5.4
第7期	4.3
第8期	14.9
第9期	16.7
第10期	14.1
第11期	4.7

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

#### 三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)

	収益率(%)
第2期	12.5
第3期	14.3
第4期	35.0
第5期	21.3
第6期	7.1
第7期	7.4
第8期	19.2
第9期	22.4
第10期	18.6
第11期	7.7

(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。

#### (4)【設定及び解約の実績】

#### 三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)

	設定口数(口)	解約口数(口)
第2期	261,744,830	3,829,999
第3期	470,245,880	53,277,789
第4期	469,037,816	90,606,169
第5期	495,358,440	76,369,973
第6期	638,803,489	159,741,067
第7期	624,991,852	99,146,353
第8期	506,925,623	202,932,959
第9期	608,587,945	321,655,472
第10期	556,143,284	317,096,474
第11期	866,745,890	402,710,540

(注) 本邦外における設定および解約の実績はありません。

#### 三井住友・DC年金バランス50(標準型)

	設定口数(口)	解約口数(口)
第2期	1,089,719,269	10,113,718
第3期	1,551,597,287	99,933,573
第4期	1,456,057,755	259,818,063
第5期	1,554,846,560	153,223,574
第6期	1,758,746,053	466,119,658
第7期	1,598,782,670	367,412,865
第8期	1,152,916,388	470,633,628
第9期	1,302,773,482	626,264,800
第10期	1,157,116,236	626,892,999
第11期	2,020,562,533	958,102,870

(注) 本邦外における設定および解約の実績はありません。

#### 三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)

	設定口数(口)	解約口数(口)
第2期	501,029,827	15,165,803
第3期	723,490,810	67,743,433
第4期	726,637,191	142,246,748
第5期	884,174,334	103,452,149
第6期	1,002,632,701	208,523,447
第7期	823,696,243	156,788,011
第8期	707,190,254	278,967,034
第9期	956,256,090	581,638,142
第10期	858,360,534	601,602,705
第11期	1,106,054,113	737,015,945

（注）本邦外における設定および解約の実績はありません。

（参考）

（１）投資状況

国内株式インデックス・マザーファンド（Ｂ号）

平成28年 3月31日現在

資産の種類	国／地域	時価合計 （円）	投資比率 （％）
株式	日本	194,895,305,430	98.41
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		3,145,692,051	1.59
合計(純資産総額)		198,040,997,481	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	5,726,875,000	2.89
合計	買建		5,726,875,000	2.89

国内債券パッシブ・マザーファンド

平成28年 3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	日本	188,225,165,120	75.12
地方債証券	日本	19,665,015,992	7.85
特殊債券	日本	26,946,041,213	10.75
社債券	日本	12,161,509,000	4.85
	オランダ	905,966,000	0.36
	オーストラリア	902,002,000	0.36
	アメリカ	603,570,000	0.24
	小計	14,573,047,000	5.82
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1,147,828,729	0.46

合計(純資産総額)	250,557,098,054	100.00
-----------	-----------------	--------

## 外国株式インデックス・マザーファンド

平成28年 3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	91,647,586,715	58.08
	イギリス	11,600,949,328	7.35
	スイス	6,147,710,577	3.90
	ドイツ	5,754,605,134	3.65
	フランス	5,727,461,223	3.63
	カナダ	5,710,520,634	3.62
	オーストラリア	3,716,660,940	2.36
	アイルランド	2,676,615,696	1.70
	オランダ	2,670,882,491	1.69
	スペイン	1,996,795,100	1.27
	スウェーデン	1,830,826,176	1.16
	香港	1,443,906,530	0.92
	デンマーク	1,246,793,535	0.79
	イタリア	1,243,270,123	0.79
	シンガポール	1,085,575,775	0.69
	ベルギー	914,989,362	0.58
	ジャージー	809,830,592	0.51
	フィンランド	636,167,474	0.40
	バミューダ	557,742,262	0.35
	キュラソー	493,101,935	0.31
	イスラエル	427,162,304	0.27
	ケイマン諸島	389,830,345	0.25
	ノルウェー	367,265,463	0.23
	ルクセンブルグ	155,503,636	0.10
オーストリア	115,096,294	0.07	
ニュージーランド	108,951,025	0.07	
ポルトガル	107,411,379	0.07	
リベリア	71,317,082	0.05	

	英ヴァージン諸島	55,763,387	0.04
	パプアニューギニア	36,794,167	0.02
	マン島	18,176,492	0.01
	モーリシャス	12,519,827	0.01
	小計	149,777,783,003	94.92
投資証券	アメリカ	2,742,530,332	1.74
	オーストラリア	615,174,266	0.39
	フランス	257,192,938	0.16
	イギリス	191,731,954	0.12
	シンガポール	90,785,386	0.06
	香港	88,253,767	0.06
	カナダ	30,381,677	0.02
	小計	4,016,050,320	2.55
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		4,004,535,881	2.53
合計(純資産総額)		157,798,369,204	100.00

その他以下の取引を行っております。

種類	買建/ 売建	国/地域	時価合計(円)	投資 比率 (%)
株価指数先物取引	買建	アメリカ	2,732,643,244	1.73
	買建	ドイツ	750,446,928	0.47
	買建	イギリス	308,574,992	0.19
	買建	オーストラリア	96,895,406	0.06
合計	買建		3,888,560,570	2.45

種類	買建/ 売建	国/地域	時価合計(円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	買建		168,609,700	0.10
	売建		1,320,411,700	0.83

外国債券パッシブ・マザーファンド

平成28年 3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	77,219,885,165	41.96
	イタリア	17,975,747,198	9.77
	フランス	17,835,201,537	9.69
	イギリス	14,265,138,738	7.75
	ドイツ	13,810,882,321	7.51
	スペイン	9,980,283,167	5.42
	ベルギー	4,900,141,841	2.66
	オランダ	4,528,763,526	2.46
	カナダ	3,758,542,928	2.04
	オーストラリア	3,205,791,318	1.74
	オーストリア	2,802,936,464	1.52
	メキシコ	1,694,166,773	0.92
	アイルランド	1,588,051,595	0.86
	デンマーク	1,145,902,687	0.62
	フィンランド	1,106,289,490	0.60
	ポーランド	1,007,982,189	0.55
	マレーシア	907,091,837	0.49
	スウェーデン	894,024,840	0.49
	南アフリカ	779,590,609	0.42
	シンガポール	675,621,039	0.37
スイス	576,582,362	0.31	
ノルウェー	557,403,055	0.30	
	小計	181,216,020,679	98.48
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		2,805,432,240	1.52
合計(純資産総額)		184,021,452,919	100.00

## (2) 投資資産

## 投資有価証券の主要銘柄

## 国内株式インデックス・マザーファンド(B号)

## イ 主要投資銘柄(上位30銘柄)

平成28年 3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 (%)
日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	1,217,400	7,558.02	9,201,133,548	5,952.00	7,245,964,800	3.66
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	7,750,200	770.90	5,974,629,180	521.50	4,041,729,300	2.04
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	746,800	4,585.49	3,424,443,932	4,848.00	3,620,486,400	1.83
日本	株式	日本たばこ産業	食料品	648,600	4,416.14	2,864,308,404	4,690.00	3,041,934,000	1.54

日本	株式	KDDI	情報・通信業	981,300	3,048.46	2,991,453,798	3,006.00	2,949,787,800	1.49
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	547,400	6,441.47	3,526,060,678	5,366.00	2,937,348,400	1.48
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	880,900	3,930.80	3,462,641,720	3,086.00	2,718,457,400	1.37
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	773,600	4,606.72	3,563,758,592	3,412.00	2,639,523,200	1.33
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	13,642,700	243.28	3,319,059,171	168.10	2,293,337,870	1.16
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	408,200	5,948.34	2,428,112,388	5,136.00	2,096,515,200	1.06
日本	株式	ソニー	電気機器	690,200	3,120.37	2,153,679,374	2,893.00	1,996,748,600	1.01
日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	403,800	5,459.46	2,204,529,948	4,792.00	1,935,009,600	0.98
日本	株式	NTTドコモ	情報・通信業	744,600	2,345.11	1,746,168,906	2,552.50	1,900,591,500	0.96
日本	株式	キヤノン	電気機器	527,200	3,685.58	1,943,037,776	3,355.00	1,768,756,000	0.89
日本	株式	ファナック	電気機器	100,100	21,594.79	2,161,638,479	17,485.00	1,750,248,500	0.88
日本	株式	東海旅客鉄道	陸運業	87,600	21,914.67	1,919,725,092	19,905.00	1,743,678,000	0.88
日本	株式	東日本旅客鉄道	陸運業	178,800	11,510.15	2,058,014,820	9,713.00	1,736,684,400	0.88
日本	株式	アステラス製薬	医薬品	1,146,600	1,724.25	1,977,025,050	1,496.50	1,715,886,900	0.87
日本	株式	花王	化学	275,500	6,287.11	1,732,098,805	6,003.00	1,653,826,500	0.84
日本	株式	三菱地所	不動産業	718,000	2,554.54	1,834,159,720	2,090.50	1,500,979,000	0.76
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	391,200	4,497.15	1,759,285,080	3,800.00	1,486,560,000	0.75
日本	株式	ブリヂストン	ゴム製品	345,500	4,355.41	1,504,794,155	4,205.00	1,452,827,500	0.73
日本	株式	三井不動産	不動産業	512,000	3,066.59	1,570,094,080	2,808.00	1,437,696,000	0.73
日本	株式	日産自動車	輸送用機器	1,373,700	1,293.53	1,776,922,161	1,041.50	1,430,708,550	0.72
日本	株式	村田製作所	電気機器	102,600	18,674.32	1,915,985,232	13,570.00	1,392,282,000	0.70
日本	株式	三菱商事	卸売業	724,500	2,057.84	1,490,905,080	1,906.00	1,380,897,000	0.70
日本	株式	キーエンス	電気機器	22,200	66,087.09	1,467,133,398	61,390.00	1,362,858,000	0.69
日本	株式	日立製作所	電気機器	2,495,000	710.58	1,772,897,100	526.60	1,313,867,000	0.66
日本	株式	三菱電機	電気機器	1,043,000	1,345.69	1,403,554,670	1,179.50	1,230,218,500	0.62
日本	株式	富士重工業	輸送用機器	309,000	5,007.95	1,547,456,550	3,975.00	1,228,275,000	0.62

## □ 種類別・業種別の投資比率

平成28年 3月31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	0.29
		建設業	3.13
		食料品	4.98
		繊維製品	0.74
		パルプ・紙	0.26
		化学	6.03
		医薬品	5.56
		石油・石炭製品	0.49
		ゴム製品	0.98

	ガラス・土石製品	0.86
	鉄鋼	1.18
	非鉄金属	0.81
	金属製品	0.65
	機械	4.56
	電気機器	11.44
	輸送用機器	9.67
	精密機器	1.59
	その他製品	1.55
	電気・ガス業	2.10
	陸運業	4.55
	海運業	0.22
	空運業	0.68
	倉庫・運輸関連業	0.21
	情報・通信業	8.03
	卸売業	4.15
	小売業	5.00
	銀行業	7.28
	証券、商品先物取引業	1.08
	保険業	2.28
	その他金融業	1.38
	不動産業	2.82
	サービス業	3.78
合計		98.41

## 国内債券パッシブ・マザーファンド

## イ 主要投資銘柄（上位30銘柄）

平成28年 3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 (%)
日本	国債証券	第296回利付国債(10年)	3,543,000,000	104.88	3,715,898,400	104.29	3,695,278,140	1.500	2018/9/20	1.47
日本	国債証券	第303回利付国債(10年)	3,495,000,000	105.67	3,693,166,500	105.61	3,691,279,200	1.400	2019/9/20	1.47
日本	国債証券	第293回利付国債(10年)	3,260,000,000	105.46	3,437,996,000	104.48	3,406,276,200	1.800	2018/6/20	1.36
日本	国債証券	第310回利付国債(10年)	3,080,000,000	104.64	3,222,912,000	105.35	3,244,964,800	1.000	2020/9/20	1.30
日本	国債証券	第305回利付国債(10年)	2,970,000,000	105.53	3,134,241,000	105.64	3,137,775,300	1.300	2019/12/20	1.25
日本	国債証券	第329回利付国債(10年)	2,585,000,000	104.44	2,699,901,100	107.08	2,768,043,850	0.800	2023/6/20	1.10
日本	国債証券	第341回利付国債(10年)	2,485,000,000	102.69	2,551,867,900	103.56	2,573,639,950	0.300	2025/12/20	1.03
日本	国債証券	第298回利付国債(10年)	2,470,000,000	104.52	2,581,644,000	104.16	2,572,776,700	1.300	2018/12/20	1.03



日本	国債証券	第339回利付国債（10年）	2,385,000,000	100.12	2,387,988,500	104.55	2,493,541,350	0.400	2025/6/20	1.00
日本	国債証券	第125回利付国債（5年）	2,450,000,000	100.25	2,456,270,900	101.32	2,482,536,000	0.100	2020/9/20	0.99
日本	国債証券	第124回利付国債（5年）	2,410,000,000	100.15	2,413,791,000	101.27	2,440,703,400	0.100	2020/6/20	0.97
日本	国債証券	第123回利付国債（5年）	2,410,000,000	100.00	2,410,000,000	101.21	2,439,329,700	0.100	2020/3/20	0.97
日本	国債証券	第301回利付国債（10年）	2,285,000,000	105.86	2,418,901,000	105.56	2,412,091,700	1.500	2019/6/20	0.96
日本	国債証券	第299回利付国債（10年）	2,245,000,000	104.77	2,352,086,500	104.54	2,346,967,900	1.300	2019/3/20	0.94
日本	国債証券	第312回利付国債（10年）	2,145,000,000	105.91	2,271,769,500	106.60	2,286,763,050	1.200	2020/12/20	0.91
日本	国債証券	第340回利付国債（10年）	2,165,000,000	100.88	2,184,144,050	104.57	2,264,070,400	0.400	2025/9/20	0.90
日本	国債証券	第313回利付国債（10年）	2,105,000,000	106.72	2,246,456,000	107.43	2,261,443,600	1.300	2021/3/20	0.90
日本	国債証券	第315回利付国債（10年）	2,090,000,000	106.35	2,222,829,400	107.34	2,243,468,700	1.200	2021/6/20	0.90
日本	国債証券	第333回利付国債（10年）	2,105,000,000	102.22	2,151,817,900	105.99	2,231,257,900	0.600	2024/3/20	0.89
日本	国債証券	第335回利付国債（10年）	1,975,000,000	101.03	1,995,342,500	105.34	2,080,563,750	0.500	2024/9/20	0.83
日本	国債証券	第297回利付国債（10年）	1,943,000,000	104.88	2,037,818,400	104.43	2,029,152,620	1.400	2018/12/20	0.81
日本	国債証券	第338回利付国債（10年）	1,915,000,000	99.99	1,914,808,500	104.56	2,002,458,050	0.400	2025/3/20	0.80
日本	国債証券	第332回利付国債（10年）	1,840,000,000	102.93	1,893,979,750	105.89	1,948,431,200	0.600	2023/12/20	0.78
日本	国債証券	第306回利付国債（10年）	1,720,000,000	106.22	1,826,984,000	106.40	1,830,183,200	1.400	2020/3/20	0.73
日本	国債証券	第325回利付国債（10年）	1,690,000,000	104.10	1,759,290,000	106.47	1,799,461,300	0.800	2022/9/20	0.72
日本	国債証券	第330回利付国債（10年）	1,610,000,000	103.93	1,673,273,000	107.29	1,727,385,100	0.800	2023/9/20	0.69
日本	国債証券	第324回利付国債（10年）	1,615,000,000	104.14	1,681,861,000	106.25	1,716,018,250	0.800	2022/6/20	0.68
日本	国債証券	第334回利付国債（10年）	1,610,000,000	102.09	1,643,795,800	106.10	1,708,242,200	0.600	2024/6/20	0.68
日本	国債証券	第321回利付国債（10年）	1,545,000,000	105.73	1,633,539,300	107.20	1,656,301,800	1.000	2022/3/20	0.66
日本	国債証券	第59回利付国債（20年）	1,455,000,000	110.76	1,611,674,400	112.77	1,640,847,150	1.700	2022/12/20	0.65

## □ 種類別の投資比率

平成28年 3月31日現在

種類	投資比率（%）
国債証券	75.12
地方債証券	7.85
特殊債券	10.75
社債券	5.82
合計	99.54

外国株式インデックス・マザーファンド

## イ 主要投資銘柄（上位30銘柄）

平成28年 3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	259,887	13,197.08	3,429,749,946	12,345.22	3,208,362,398	2.03
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	353,569	6,068.94	2,145,790,744	6,203.03	2,193,200,528	1.39
アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORPORATION	エネルギー	194,136	9,139.47	1,774,301,079	9,523.71	1,848,895,663	1.17
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	129,035	11,528.29	1,487,553,003	12,279.86	1,584,532,561	1.00
アメリカ	株式	GENERAL ELECTRIC CO	資本財	440,130	3,414.20	1,502,693,607	3,586.60	1,578,572,195	1.00
アメリカ	株式	FACEBOOK INC-A	ソフトウェア・サービス	105,794	11,871.96	1,255,982,644	12,924.39	1,367,323,550	0.87
アメリカ	株式	AT&T INC	電気通信サービス	286,226	3,792.80	1,085,600,491	4,436.21	1,269,759,101	0.80
アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	小売	18,581	75,367.14	1,400,396,918	67,460.38	1,253,481,492	0.79
スイス	株式	NESTLE SA-REGISTERED	食品・飲料・タバコ	148,594	8,894.42	1,321,657,534	8,434.46	1,253,310,892	0.79
アメリカ	株式	WELLS FARGO & COMPANY	銀行	226,382	6,212.04	1,406,295,941	5,481.88	1,240,999,411	0.79
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	ソフトウェア・サービス	14,503	84,326.33	1,222,984,787	84,569.72	1,226,514,655	0.78
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	126,872	8,546.77	1,084,346,819	9,316.38	1,181,988,068	0.75
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	ソフトウェア・サービス	13,579	86,752.33	1,178,009,916	86,576.55	1,175,622,989	0.75
アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS INC	電気通信サービス	189,750	5,112.29	970,057,331	6,089.22	1,155,430,861	0.73
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	171,581	7,530.40	1,292,074,317	6,728.12	1,154,418,038	0.73
アメリカ	株式	COCA-COLA CO/THE	食品・飲料・タバコ	192,672	4,858.76	936,147,315	5,248.63	1,011,264,887	0.64
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	287,423	3,680.12	1,057,753,660	3,388.28	973,871,787	0.62
アメリカ	株式	CHEVRON CORPORATION	エネルギー	87,768	10,152.46	891,061,811	10,732.76	941,993,757	0.60
スイス	株式	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	32,764	32,097.66	1,051,647,830	27,655.70	906,111,551	0.57
アメリカ	株式	HOME DEPOT INC	小売	59,127	15,130.67	894,631,149	15,033.76	888,901,459	0.56
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	各種金融	55,208	15,140.81	835,893,927	16,052.39	886,220,502	0.56
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	106,192	10,303.47	1,094,146,341	8,177.63	868,399,628	0.55
アメリカ	株式	THE WALT DISNEY CO.	メディア	73,240	12,892.84	944,272,011	11,145.17	816,272,895	0.52
アメリカ	株式	INTEL CORP	半導体・半導体製造装置	219,427	3,866.05	848,315,929	3,685.76	808,755,874	0.51

アメリカ	株式	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL INC.	食品・飲料・タバコ	71,976	9,856.11	709,404,064	11,120.38	800,401,133	0.51
アメリカ	株式	COMCAST CORP-CL A	メディア	115,793	6,915.17	800,728,465	6,850.94	793,291,359	0.50
アメリカ	株式	PEPSICO INC	食品・飲料・タバコ	67,729	11,341.24	768,130,979	11,571.10	783,699,655	0.50
アメリカ	株式	VISA INC	ソフトウェア・サービス	90,433	8,963.69	810,613,740	8,651.57	782,387,466	0.50
アメリカ	株式	MERCK & CO. INC.	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	129,767	6,065.56	787,110,096	5,996.82	778,190,587	0.49
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	235,855	3,067.14	723,402,569	3,206.87	756,356,984	0.48

□ 種類別・業種別の投資比率

平成28年 3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	6.67
		素材	4.42
		資本財	6.99
		商業・専門サービス	0.99
		運輸	1.80
		自動車・自動車部品	1.63
		耐久消費財・アパレル	1.84
		消費者サービス	1.83
		メディア	2.90
		小売	3.90
		食品・生活必需品小売り	2.21
		食品・飲料・タバコ	6.86
		家庭用品・パーソナル用品	1.88
		ヘルスケア機器・サービス	3.75
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	9.03
		銀行	7.91
		各種金融	4.05
		保険	4.14
		不動産	0.75
		ソフトウェア・サービス	8.63
テクノロジー・ハードウェアおよび機器	4.15		
電気通信サービス	3.43		
公益事業	3.48		
半導体・半導体製造装置	1.70		
投資証券			2.55
合計			97.46

## 外国債券パッシブ・マザーファンド

## イ 主要投資銘柄（上位30銘柄）

平成28年 3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 2.75	11,000,000	10,769.74	1,184,671,744	11,537.37	1,269,111,319	2.750	2042/11/15	0.69
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.5	7,000,000	11,496.88	804,781,688	11,937.91	835,654,251	2.500	2024/5/15	0.45
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.375	7,000,000	11,375.39	796,277,869	11,822.59	827,581,781	2.375	2024/8/15	0.45
イタリア	国債証券	BTPS 6	4,100,000	19,165.47	785,784,327	19,962.44	818,460,331	6.000	2031/5/1	0.44
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 3.625	6,000,000	12,740.76	764,445,772	13,599.06	815,944,050	3.625	2043/8/15	0.44
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.125	7,000,000	11,103.38	777,236,713	11,569.06	809,834,681	2.125	2025/5/15	0.44
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2	7,000,000	10,995.98	769,718,844	11,463.42	802,440,056	2.000	2025/2/15	0.44
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2	7,000,000	11,049.59	773,471,965	11,435.25	800,468,156	2.000	2025/8/15	0.43
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.25	6,500,000	11,333.68	736,689,412	11,679.10	759,141,890	2.250	2025/11/15	0.41
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.75	6,200,000	11,753.93	728,743,815	12,161.51	754,014,068	2.750	2023/11/15	0.41
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 3.625	6,000,000	12,177.36	730,641,772	12,353.42	741,205,522	3.625	2020/2/15	0.40
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 3.5	5,000,000	14,699.93	734,996,505	14,738.75	736,937,545	3.500	2020/4/25	0.40
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 3.75	5,000,000	14,643.35	732,167,950	14,633.14	731,657,150	3.750	2019/10/25	0.40
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 3.875	6,000,000	11,999.53	719,972,385	12,017.14	721,028,760	3.875	2018/5/15	0.39
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 5.5	3,500,000	19,258.18	674,036,357	20,391.77	713,712,108	5.500	2029/4/25	0.39
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 5.75	3,200,000	20,677.82	661,690,320	22,226.56	711,250,179	5.750	2032/10/25	0.39
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.25	6,000,000	11,243.21	674,592,625	11,702.87	702,172,463	2.250	2024/11/15	0.38
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 1.875	6,000,000	11,442.30	686,538,113	11,470.47	688,228,313	1.875	2017/10/31	0.37
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 1.875	6,000,000	11,437.02	686,221,201	11,459.90	687,594,488	1.875	2017/9/30	0.37
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 1	6,000,000	11,010.06	660,604,110	11,245.99	674,759,535	1.000	2019/11/30	0.37
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 4.25	4,000,000	16,334.10	653,364,280	16,802.12	672,085,100	4.250	2023/10/25	0.37
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 3.5	4,000,000	15,856.12	634,245,036	16,626.79	665,071,816	3.500	2026/4/25	0.36
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.625	5,500,000	11,711.67	644,142,262	11,962.56	657,941,163	2.625	2020/11/15	0.36
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 2.5	4,500,000	14,241.10	640,849,680	14,364.71	646,412,292	2.500	2020/10/25	0.35
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 4.25	4,400,000	14,649.74	644,588,736	14,581.16	641,571,440	4.250	2019/4/25	0.35
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2	5,500,000	11,185.25	615,188,784	11,573.46	636,540,767	2.000	2023/2/15	0.35
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 3.625	5,000,000	12,260.99	613,049,625	12,513.64	625,682,112	3.625	2021/2/15	0.34
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 4.25	4,500,000	13,846.51	623,092,996	13,712.80	617,076,410	4.250	2017/10/25	0.34
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 3.125	5,000,000	11,991.61	599,580,844	12,277.71	613,885,925	3.125	2021/5/15	0.33
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 3.625	5,000,000	12,114.86	605,743,031	12,246.90	612,345,375	3.625	2019/8/15	0.33

## □ 種類別の投資比率

平成28年 3月31日現在

種類	投資比率（％）
国債証券	98.48
合計	98.48

## 投資不動産物件

## 国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

該当事項はありません。

## 国内債券パッシブ・マザーファンド

該当事項はありません。

## 外国株式インデックス・マザーファンド

該当事項はありません。

## 外国債券パッシブ・マザーファンド

該当事項はありません。

## その他投資資産の主要なもの

## 国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

平成28年 3月31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	425	日本円	5,750,780,440	5,726,875,000	2.89

（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。

## 国内債券パッシブ・マザーファンド

該当事項はありません。

## 外国株式インデックス・マザーファンド

平成28年 3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 1606	買建	236	米ドル	23,855,547.5	2,688,043,091	24,251,360	2,732,643,244	1.73
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	DJ EUR 1606	買建	198	ユーロ	5,900,116	753,444,813	5,876,640	750,446,928	0.47
	オーストラリア	シドニー先物取引所	SP1200 1606	買建	9	オーストラリアドル	1,157,165.5	99,805,524	1,123,425	96,895,406	0.06
	イギリス	ロンドン国際金融先物オプション取引所	FTSE 1606	買建	31	英ポンド	1,894,592	306,772,337	1,905,725	308,574,992	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。

平成28年 3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	買建	660,000.00	74,316,000	74,355,600	0.04
	カナダドル	買建	320,000.00	27,756,800	27,769,600	0.01
	スイスフラン	買建	250,000.00	29,170,000	29,185,000	0.01
	スウェーデンクローナ	買建	180,000.00	2,491,200	2,493,000	0.00
	ノルウェークローネ	買建	80,000.00	1,084,000	1,084,000	0.00
	デンマーククローネ	買建	440,000.00	7,532,800	7,541,600	0.00
	ニュージーランドドル	買建	10,000.00	778,300	778,500	0.00
	香港ドル	買建	1,520,000.00	22,070,400	22,070,400	0.01
	シンガポールドドル	買建	40,000.00	3,332,400	3,332,000	0.00
	米ドル	売建	6,939,000.00	788,954,585	781,747,740	0.49
	カナダドル	売建	800,000.00	69,012,800	69,424,000	0.04
	ユーロ	売建	949,000.00	121,003,051	121,177,810	0.07
	英ポンド	売建	639,000.00	103,370,598	103,454,100	0.06
	スイスフラン	売建	800,000.00	93,374,960	93,392,000	0.05
	スウェーデンクローナ	売建	1,550,000.00	21,288,786	21,467,500	0.01
	ノルウェークローネ	売建	240,000.00	3,221,133	3,252,000	0.00
	デンマーククローネ	売建	1,000,000.00	17,060,480	17,140,000	0.01
	オーストラリアドル	売建	745,000.00	64,197,027	64,233,900	0.04
	ニュージーランドドル	売建	17,000.00	1,301,785	1,323,450	0.00
	香港ドル	売建	2,000,000.00	29,317,168	29,040,000	0.01
シンガポールドドル	売建	120,000.00	9,969,168	9,996,000	0.00	
イスラエルシェケル	売建	160,000.00	4,748,586	4,763,200	0.00	

(注) わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しております。

#### 外国債券パッシブ・マザーファンド

該当事項はありません。

## 参考情報

基準日:2016年3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

## ■マイパッケージ30



## 分配の推移

決算期	分配金
2016年2月	0円
2015年2月	0円
2014年2月	0円
2013年2月	0円
2012年2月	0円
設定来累計	0円

※分配金は1万口当たり、税引前です。  
 ※最近5計算期間を記載しています。

## ■マイパッケージ50



決算期	分配金
2016年2月	0円
2015年2月	0円
2014年2月	0円
2013年2月	0円
2012年2月	0円
設定来累計	0円

※分配金は1万口当たり、税引前です。  
 ※最近5計算期間を記載しています。

## ■マイパッケージ70



決算期	分配金
2016年2月	0円
2015年2月	0円
2014年2月	0円
2013年2月	0円
2012年2月	0円
設定来累計	0円

※分配金は1万口当たり、税引前です。  
 ※最近5計算期間を記載しています。

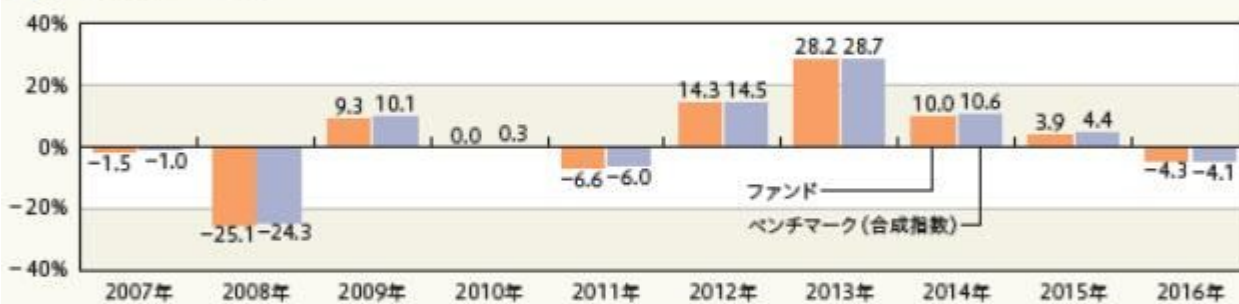
※基準価額は、1万口当たり、信託報酬控除後です。

## 年間収益率の推移(暦年ベース)

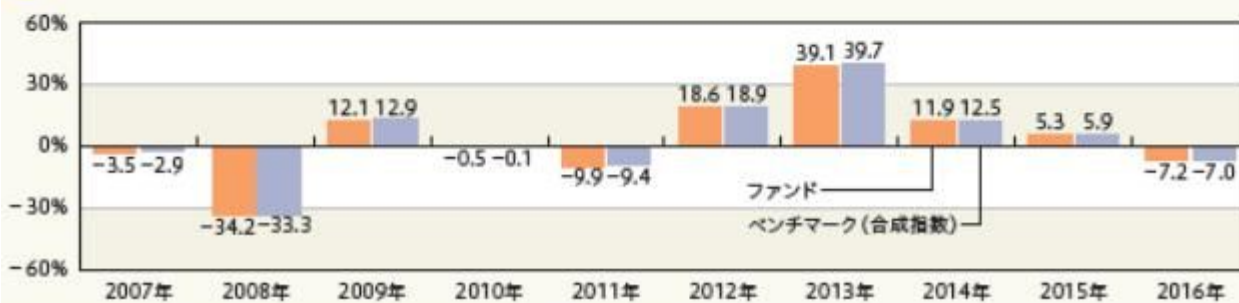
### ■マイパッケージ30



### ■マイパッケージ50



### ■マイパッケージ70



※2016年の収益率は、年初から2016年3月31日までの騰落率を表示しています。

※ベンチマークの情報はあくまで参考情報として記載しており、ファンドの運用実績ではありません。

## 第2【管理及び運営】

### 1【申込（販売）手続等】

#### イ 申込方法

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

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

1円以上1円単位

ホ 照会先

手続き等のご不明な点についての委託会社に対する照会は下記においてできます。

照会先の名称	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。

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5営業日目からお支払いします。

一部解約価額は、解約請求受付日の翌営業日の基準価額となります。

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の請求を取り消すことがあります。この場合、受益者は当該受付中止以前に行った当日の一部解約の実行の請求を撤回できます。受益者がその一部解約の実行の請求を撤回しない場合には、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に一部解約の実行の請求を受け付けたものとして、上記に準じた取扱いとなります。

## 3【資産管理等の概要】

**（１）【資産の評価】****イ 基準価額の算出方法**

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

**ロ 基準価額の算出頻度・照会方法**

基準価額は、委託会社の営業日において日々算出されます。

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

委託会社に対する照会は下記においてできます。

照会先の名称	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】**

平成17年9月30日から下記「（５）その他 イ 信託の終了」に記載された各事由が生じた場合における信託終了の日までとなります。

**（４）【計算期間】**

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

**（５）【その他】****イ 信託の終了****（イ）信託契約の解約**

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

- b. 委託会社は、上記aの事項について、あらかじめ、解約しようとする旨を公告し、かつ、その旨を記載した書面を当ファンドの知られたる受益者に対して交付します。ただし、当ファンドのすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として公告を行いません。
  - c. 上記bの公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託会社に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。
  - d. 上記cの一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の2分の1を超えるときは、信託契約の解約をしません。
  - e. 委託会社は、当ファンドの信託契約の解約をしないこととしたときは、解約しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を知られたる受益者に対して交付します。ただし、すべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
  - f. 上記c～eまでの取扱いは、信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、上記cの一定の期間が一月を下らずにその公告および書面の交付を行うことが困難な場合には適用しません。
- (ロ) 信託契約に関する監督官庁の命令
- 委託会社は、監督官庁より当ファンドの信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令に従い信託契約を解約し、信託を終了させます。
- (ハ) 委託会社の登録取消等に伴う取扱い
- 委託会社が、監督官庁より登録の取消しを受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託会社は当ファンドの信託契約を解約し、信託を終了させます。ただし、監督官庁が当ファンドに関する委託会社の業務を他の委託会社に引継ぐことを命じたときは、当ファンドは、その委託会社と受託会社との間において存続します。
- (二) 受託会社の辞任および解任に伴う取扱い
- a. 受託会社は、委託会社の承諾を受けてその任務を辞任することができます。また、受託会社はその任務に背いた場合、その他重要な事由が生じたときは、委託会社または受益者は、裁判所に受託会社の解任を請求することができます。
  - b. 上記により受託会社が辞任し、または解任された場合は、委託会社は新受託会社を選任します。
  - c. 委託会社が新受託会社を選任できないとき、委託会社は当ファンドの信託契約を解約し、信託を終了させます。
- ロ 収益分配金、償還金の支払い
- (イ) 収益分配金
- a. 分配金額は、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。分配対象額が少額の場合等には委託会社の判断により分配を行わない場合もあるため、将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。
  - b. 分配金は、原則として、税金を差し引いた後、毎計算期間終了日後1ヵ月以内の委託会社の指定する日(原則として決算日から起算して5営業日目まで)から、販売会社において、決算日の振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者(当該収益分配金にかかる決算日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該収益分配金にかかる決算日以前に設定された受益権で取得申込代金支払い前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者として)に支払われます。
- ただし、分配金自動再投資コースにかかる収益分配金は、原則として、税金を差し引いた後、累積投資契約に基づいて、毎計算期間終了日の翌営業日に再投資され、再投資により増加した受益権は、振替口座簿に記載または記録されます。
- (ロ) 償還金
- 償還金は、信託終了後1ヵ月以内の委託会社の指定する日(原則として償還日から起算して5営業日目まで)から、販売会社において、原則として、償還日の振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者(償還日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益

者を除きます。また、当該償還日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者とし、)に支払われます。

#### 八 信託約款の変更

- (イ) 委託会社は、当ファンドの信託約款を変更することが受益者の利益のため必要と認めるとき、監督官庁より変更の命令を受けたとき、その他やむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意の上、当ファンドの信託約款を変更することができるものとし、あらかじめ、変更しようとする旨および内容を監督官庁に届け出ます。
- (ロ) 委託会社は、上記(イ)の変更事項のうち、その内容が重大なものについては、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を当ファンドの知られたる受益者に交付します。ただし、当ファンドのすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として公告を行いません。
- (ハ) 上記(ロ)の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託会社に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。
- (ニ) 上記(ハ)の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の2分の1を超えるときは、(イ)の信託約款の変更をしません。
- (ホ) 委託会社は、信託約款の変更をしないこととしたときは、変更しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を知られたる受益者に対して交付します。ただし、すべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。

#### 二 反対者の買取請求権

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

#### ホ 販売会社との契約の更改等

委託会社と販売会社との間で締結される販売契約(名称の如何を問わず、ファンドの募集・販売の取扱い、受益者からの一部解約実行請求の受付け、受益者への収益分配金、一部解約金および償還金の支払事務等を規定するもの)は、期間満了の3ヵ月前に当事者のいずれから、何らの意思表示もない場合は、自動的に1年間更新されます。販売契約の内容は、必要に応じて、委託会社と販売会社との合意により変更されることがあります。

#### へ 委託会社の事業の譲渡および承継に伴う取扱い

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

#### ト 公告

委託会社が受益者に対してする公告は、日本経済新聞に掲載します。

#### チ 運用にかかる報告書の開示方法

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

## 4【受益者の権利等】

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

#### イ 分配金請求権

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

収益分配金は、原則として、税金を差し引いた後、毎計算期間終了日後1ヵ月以内の委託会社の

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

ただし、分配金自動再投資コースをお申込みの場合の収益分配金は、原則として、税金を差し引いた後、累積投資契約に基づき、毎計算期間終了日の翌営業日に再投資され、再投資により増加した受益権は、振替口座簿に記載または記録されます。

収益分配金は、受益者が、その支払開始日から5年間その支払いを請求しないときは、受益者はその権利を失い、当該金銭は、委託会社に帰属します。

#### ロ 償還金請求権

受益者は、持分に応じて償還金を請求する権利を有します。

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

#### 二 信託約款変更等に対する異議申立権および受益権の買取請求権

委託会社が、当ファンドの解約（監督官庁の命令による解約等の場合を除きます。）または重大な信託約款の変更を行おうとする場合において、当該解約または信託約款変更に関する異議のある受益者は、それぞれの手続きにおいて設けられる異議申立期間中に異議を申し立てることができます。異議を申し立てた受益者の受益権の口数が、受益権の総口数の過半数となる場合は、当該解約または信託約款変更は行われません。

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

#### ホ 帳簿閲覧・謄写請求権

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

### 第3【ファンドの経理状況】

1. 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和38年大蔵省令第59号)ならびに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)に基づいて作成しております。  
なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
2. 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第11期(平成27年 2月19日から平成28年 2月18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年金バランス30（債券重点型）】

## （１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第10期 （平成27年 2月18日現在）	第11期 （平成28年 2月18日現在）
<b>資産の部</b>		
流動資産		
金銭信託	-	214,252,743
コール・ローン	225,653,923	-
親投資信託受益証券	4,206,496,619	4,678,020,871
未収入金	1,660,000	80,690,000
未収利息	61	-
流動資産合計	4,433,810,603	4,972,963,614
<b>資産合計</b>		
4,433,810,603		
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	2,098,490	3,389,711
未払受託者報酬	688,642	810,350
未払委託者報酬	4,361,348	5,132,174
その他未払費用	114,715	134,996
流動負債合計	7,263,195	9,467,231
<b>負債合計</b>		
7,263,195		
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	3,308,182,904	3,772,218,254
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	1,118,364,504	1,191,278,129
元本等合計	4,426,547,408	4,963,496,383
<b>純資産合計</b>		
4,426,547,408		
<b>負債純資産合計</b>		
4,433,810,603		
4,972,963,614		

## ( 2 ) 【損益及び剰余金計算書】

( 単位：円 )

	第10期		第11期	
	自	平成26年 2月19日 至 平成27年 2月18日	自	平成27年 2月19日 至 平成28年 2月18日
営業収益				
受取利息		32,919		23,767
有価証券売買等損益		391,185,023		83,035,748
営業収益合計		391,217,942		83,011,981
営業費用				
受託者報酬		1,301,720		1,568,667
委託者報酬		8,244,097		9,934,760
その他費用		216,832		261,320
営業費用合計		9,762,649		11,764,747
営業利益又は営業損失 ( )		381,455,293		94,776,728
経常利益又は経常損失 ( )		381,455,293		94,776,728
当期純利益又は当期純損失 ( )		381,455,293		94,776,728
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 ( )		16,346,810		6,075,285
期首剰余金又は期首欠損金 ( )		674,105,943		1,118,364,504
剰余金増加額又は欠損金減少額		149,531,242		310,966,470
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		149,531,242		310,966,470
剰余金減少額又は欠損金増加額		70,381,164		137,200,832
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		70,381,164		137,200,832
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 ( )		1,118,364,504		1,191,278,129



## ( 3 ) 【注記表】

## ( 重要な会計方針の注記 )

項 目	第11期
	自 平成27年 2月19日 至 平成28年 2月18日
有価証券の評価基準及び評価方法	<p>親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>

## ( 貸借対照表に関する注記 )

項 目	第10期	第11期
	( 平成27年 2月18日現在 )	( 平成28年 2月18日現在 )
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	3,308,182,904口	3,772,218,254口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.3381円 (10,000口当たりの純資産額 13,381円)	1口当たり純資産額 1.3158円 (10,000口当たりの純資産額 13,158円)

## ( 損益及び剰余金計算書に関する注記 )

項目	第10期	第11期
	自 平成26年 2月19日 至 平成27年 2月18日	自 平成27年 2月19日 至 平成28年 2月18日
分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益（68,579,057円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（296,529,426円）、収益調整金（588,735,569円）、および分配準備積立金（524,078,381円）より、分配対象収益は1,477,922,433円（1万口当たり4,467.45円）であります。分配を行っておりません。	計算期間末における費用控除後の配当等収益（66,925,578円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（0円）、収益調整金（893,066,524円）、および分配準備積立金（793,449,940円）より、分配対象収益は1,753,442,042円（1万口当たり4,648.29円）であります。分配を行っておりません。

## （金融商品に関する注記）

## ．金融商品の状況に関する事項

項目	第11期
	自 平成27年 2月19日 至 平成28年 2月18日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、親投資信託受益証券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>

項目	第11期 自 平成27年 2月19日 至 平成28年 2月18日
3.金融商品に係るリスク管理体制	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する委員会をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用グループに是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用グループは、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。その後、当該関連運用グループの対処の実施や対処方針の決定等に関し、必要に応じてリスク管理を行う部署が当該部署の担当役員、当該関連運用グループの担当役員およびリスク管理委員会へ報告を行う体制となっております。</p> <p>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する部会にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。</p>
4.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって認める評価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。</p>

#### ・金融商品の時価等に関する事項

項目	第11期 (平成28年 2月18日現在)
1.貸借対照表計上額、時価及び差額	<p>金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p>
2.時価の算定方法	<p>(1) 有価証券（親投資信託受益証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

第10期（自 平成26年 2月19日 至 平成27年 2月18日）

種 類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	368,040,061円
合計	368,040,061円

第11期（自 平成27年 2月19日 至 平成28年 2月18日）

種 類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	98,801,714円
合計	98,801,714円

## （デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

## （関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

## （その他の注記）

項 目	第10期 （平成27年 2月18日現在）	第11期 （平成28年 2月18日現在）
期首元本額	3,069,136,094円	3,308,182,904円
期中追加設定元本額	556,143,284円	866,745,890円
期中一部解約元本額	317,096,474円	402,710,540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
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）	528,488,199	1,010,099,494	
	外国株式インデックス・マザーファンド	198,225,937	489,875,758	
	外国債券パッシブ・マザーファンド	283,155,221	489,773,585	
	国内債券パッシブ・マザーファンド	2,165,516,380	2,688,272,034	
合計		3,175,385,737	4,678,020,871	

## 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年金バランス50（標準型）】

## （1）【貸借対照表】

（単位：円）

	第10期 （平成27年 2月18日現在）	第11期 （平成28年 2月18日現在）
<b>資産の部</b>		
流動資産		
金銭信託	-	631,429,482
コール・ローン	712,330,032	-
親投資信託受益証券	12,542,247,504	13,116,540,879
未収入金	-	301,970,000
未収利息	195	-
流動資産合計	13,254,577,731	14,049,940,361
資産合計	13,254,577,731	14,049,940,361
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	7,086,398	15,884,435
未払受託者報酬	2,033,924	2,371,081
未払委託者報酬	13,559,453	15,807,160
その他未払費用	338,925	395,116
流動負債合計	23,018,700	34,457,792
負債合計	23,018,700	34,457,792
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	9,543,142,822	10,605,602,485
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	3,688,416,209	3,409,880,084
元本等合計	13,231,559,031	14,015,482,569
純資産合計	13,231,559,031	14,015,482,569
負債純資産合計	13,254,577,731	14,049,940,361

## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第10期		第11期	
	自	平成26年 2月19日 至 平成27年 2月18日	自	平成27年 2月19日 至 平成28年 2月18日
営業収益				
受取利息		98,310		69,251
有価証券売買等損益		1,635,876,494		677,396,625
営業収益合計		1,635,974,804		677,327,374
営業費用				
受託者報酬		3,829,541		4,699,186
委託者報酬		25,530,173		31,327,800
その他費用		638,135		783,073
営業費用合計		29,997,849		36,810,059
営業利益又は営業損失（ ）		1,605,976,955		714,137,433
経常利益又は経常損失（ ）		1,605,976,955		714,137,433
当期純利益又は当期純損失（ ）		1,605,976,955		714,137,433
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（ ）		44,879,736		26,061,359
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		1,942,576,825		3,688,416,209
剰余金増加額又は欠損金減少額		321,078,942		835,057,347
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		321,078,942		835,057,347
剰余金減少額又は欠損金増加額		136,336,777		373,394,680
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		136,336,777		373,394,680
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（ ）		3,688,416,209		3,409,880,084

## ( 3 ) 【注記表】

## ( 重要な会計方針の注記 )

項 目	第11期
	自 平成27年 2月19日 至 平成28年 2月18日
有価証券の評価基準及び評価方法	<p>親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>

## ( 貸借対照表に関する注記 )

項 目	第10期	第11期
	( 平成27年 2月18日現在 )	( 平成28年 2月18日現在 )
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	9,543,142,822口	10,605,602,485口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.3865円 (10,000口当たりの純資産額 13,865円)	1口当たり純資産額 1.3215円 (10,000口当たりの純資産額 13,215円)

## ( 損益及び剰余金計算書に関する注記 )



項目	第10期	第11期
	自 平成26年 2月19日 至 平成27年 2月18日	自 平成27年 2月19日 至 平成28年 2月18日
分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益（215,144,392円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（1,345,952,827円）、収益調整金（2,021,513,188円）、および分配準備積立金（1,976,870,208円）より、分配対象収益は5,559,480,615円（1万口当たり5,825.60円）であります。分配を行っておりません。	計算期間末における費用控除後の配当等収益（216,028,005円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（0円）、収益調整金（2,960,075,293円）、および分配準備積立金（3,221,036,966円）より、分配対象収益は6,397,140,264円（1万口当たり6,031.83円）であります。分配を行っておりません。

## （金融商品に関する注記）

## ．金融商品の状況に関する事項

項目	第11期
	自 平成27年 2月19日 至 平成28年 2月18日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、親投資信託受益証券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>

項目	第11期 自 平成27年 2月19日 至 平成28年 2月18日
3.金融商品に係るリスク管理体制	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する委員会をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用グループに是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用グループは、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。その後、当該関連運用グループの対処の実施や対処方針の決定等に関し、必要に応じてリスク管理を行う部署が当該部署の担当役員、当該関連運用グループの担当役員およびリスク管理委員会へ報告を行う体制となっております。</p> <p>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する部会にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。</p>
4.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって認める評価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。</p>

#### ・金融商品の時価等に関する事項

項目	第11期 (平成28年 2月18日現在)
1.貸借対照表計上額、時価及び差額	<p>金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p>
2.時価の算定方法	<p>(1) 有価証券（親投資信託受益証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

## （有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

第10期（自 平成26年 2月19日 至 平成27年 2月18日）

種 類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	1,567,233,369円
合計	1,567,233,369円

第11期（自 平成27年 2月19日 至 平成28年 2月18日）

種 類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	729,014,459円
合計	729,014,459円

## （デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

## （関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

## （その他の注記）

項 目	第10期 （平成27年 2月18日現在）	第11期 （平成28年 2月18日現在）
期首元本額	9,012,919,585円	9,543,142,822円
期中追加設定元本額	1,157,116,236円	2,020,562,533円
期中一部解約元本額	626,892,999円	958,102,870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
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）	2,550,585,967	4,874,934,958	
	外国株式インデックス・マザーファンド	847,976,275	2,095,603,768	
	外国債券パッシブ・マザーファンド	816,152,669	1,411,699,271	
	国内債券パッシブ・マザーファンド	3,813,680,427	4,734,302,882	
合計		8,028,395,338	13,116,540,879	

## 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年金バランス70（株式重点型）】

## （1）【貸借対照表】

（単位：円）

	第10期 （平成27年 2月18日現在）	第11期 （平成28年 2月18日現在）
<b>資産の部</b>		
流動資産		
金銭信託	-	289,491,939
コール・ローン	373,990,152	-
親投資信託受益証券	6,728,728,432	6,647,834,471
未収入金	1,080,000	110,000,000
未収利息	102	-
流動資産合計	7,103,798,686	7,047,326,410
<b>資産合計</b>		
7,103,798,686		
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	3,183,144	10,738,488
未払受託者報酬	1,069,781	1,218,245
未払委託者報酬	7,488,448	8,527,617
その他未払費用	178,236	202,980
流動負債合計	11,919,609	20,687,330
<b>負債合計</b>		
11,919,609		
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	5,028,340,512	5,397,378,680
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	2,063,538,565	1,629,260,400
元本等合計	7,091,879,077	7,026,639,080
<b>純資産合計</b>		
7,091,879,077		
<b>負債純資産合計</b>		
7,103,798,686		
7,047,326,410		

## ( 2 ) 【損益及び剰余金計算書】

( 単位：円 )

	第10期		第11期	
	自	平成26年 2月19日 至 平成27年 2月18日	自	平成27年 2月19日 至 平成28年 2月18日
営業収益				
受取利息		50,756		34,879
有価証券売買等損益		1,108,968,958		575,803,961
営業収益合計		1,109,019,714		575,769,082
営業費用				
受託者報酬		1,995,848		2,441,894
委託者報酬		13,970,863		17,093,097
その他費用		332,518		406,862
営業費用合計		16,299,229		19,941,853
営業利益又は営業損失 ( )		1,092,720,485		595,710,935
経常利益又は経常損失 ( )		1,092,720,485		595,710,935
当期純利益又は当期純損失 ( )		1,092,720,485		595,710,935
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 ( )		49,844,127		26,989,982
期首剰余金又は期首欠損金 ( )		903,853,373		2,063,538,565
剰余金増加額又は欠損金減少額		232,805,813		494,791,687
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		232,805,813		494,791,687
剰余金減少額又は欠損金増加額		115,996,979		306,368,935
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		115,996,979		306,368,935
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 ( )		2,063,538,565		1,629,260,400

## （ 3 ）【注記表】

## （ 重要な会計方針の注記 ）

項 目	第11期
	自 平成27年 2月19日 至 平成28年 2月18日
有価証券の評価基準及び評価方法	<p>親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>

## （ 貸借対照表に関する注記 ）

項 目	第10期	第11期
	(平成27年 2月18日現在)	(平成28年 2月18日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	5,028,340,512口	5,397,378,680口
2. 1単位当たり純資産の額	1.4104円	1.3019円
(10,000口当たりの純資産額)	14,104円	13,019円

## （ 損益及び剰余金計算書に関する注記 ）

項目	第10期	第11期
	自 平成26年 2月19日 至 平成27年 2月18日	自 平成27年 2月19日 至 平成28年 2月18日
分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益（118,499,033円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（924,377,325円）、収益調整金（1,422,051,815円）、および分配準備積立金（1,088,733,414円）より、分配対象収益は3,553,661,587円（1万口当たり7,067.24円）であります。分配を行っておりません。	計算期間末における費用控除後の配当等収益（119,999,493円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（0円）、収益調整金（1,966,884,361円）、および分配準備積立金（1,849,385,868円）より、分配対象収益は3,936,269,722円（1万口当たり7,292.90円）であります。分配を行っておりません。

## （金融商品に関する注記）

## ．金融商品の状況に関する事項

項目	第11期
	自 平成27年 2月19日 至 平成28年 2月18日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、親投資信託受益証券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>



項目	第11期 自 平成27年 2月19日 至 平成28年 2月18日
3.金融商品に係るリスク管理体制	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する委員会をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用グループに是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用グループは、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。その後、当該関連運用グループの対処の実施や対処方針の決定等に関し、必要に応じてリスク管理を行う部署が当該部署の担当役員、当該関連運用グループの担当役員およびリスク管理委員会へ報告を行う体制となっております。</p> <p>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する部会にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。</p>
4.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって認める評価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。</p>

#### ・金融商品の時価等に関する事項

項目	第11期 (平成28年 2月18日現在)
1.貸借対照表計上額、時価及び差額	<p>金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p>
2.時価の算定方法	<p>(1) 有価証券（親投資信託受益証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

第10期（自 平成26年 2月19日 至 平成27年 2月18日）

種 類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	1,066,004,129円
合計	1,066,004,129円

第11期（自 平成27年 2月19日 至 平成28年 2月18日）

種 類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	597,465,427円
合計	597,465,427円

## （デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

## （関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

## （その他の注記）

項 目	第10期 （平成27年 2月18日現在）	第11期 （平成28年 2月18日現在）
期首元本額	4,771,582,683円	5,028,340,512円
期中追加設定元本額	858,360,534円	1,106,054,113円
期中一部解約元本額	601,602,705円	737,015,945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
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）	1,853,087,382	3,541,805,913	
	外国株式インデックス・マザーファンド	572,353,182	1,414,456,418	
	外国債券パッシブ・マザーファンド	391,479,609	677,142,279	
	国内債券パッシブ・マザーファンド	817,165,991	1,014,429,861	
合計		3,634,086,164	6,647,834,471	

## デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## (参考)

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

なお、以下に記載した状況は、監査の対象外です。

## 国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

## 貸借対照表

(単位：円)

	(平成27年 2月18日現在)	(平成28年 2月18日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	-	7,844,132,164
コール・ローン	3,157,878,102	-
株式	272,212,313,110	185,765,171,350
派生商品評価勘定	36,380,000	82,636,960
未収入金	17,363,840	-
未収配当金	327,159,091	282,860,425
未収利息	865	-
差入委託証拠金	14,120,000	240,120,000
流動資産合計	275,765,215,008	194,214,920,899
資産合計	275,765,215,008	194,214,920,899
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	-	49,992,360
前受金	36,380,000	32,812,000
未払解約金	1,079,180,430	51,727,492
流動負債合計	1,115,560,430	134,531,852
負債合計	1,115,560,430	134,531,852

（平成27年 2月18日現在）

（平成28年 2月18日現在）

純資産の部		
元本等		
元本	129,450,841,303	101,544,937,447
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	145,198,813,275	92,535,451,600
元本等合計	274,649,654,578	194,080,389,047
純資産合計	274,649,654,578	194,080,389,047
負債純資産合計	275,765,215,008	194,214,920,899

## 注記表

（重要な会計方針の注記）

項 目	自 平成27年 2月19日 至 平成28年 2月18日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>先物取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場によっております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金の計上基準</p> <p>受取配当金は原則として、配当落ち日において、確定配当金額または予想配当金額を計上しております。なお、配当金額が未確定の場合は、入金日基準で計上しております。</p>

（貸借対照表に関する注記）

項 目	（平成27年 2月18日現在）	（平成28年 2月18日現在）
1. 担保資産	<p>代用として、担保に供している資産は次の通りであります。</p> <p>株式 3,979,500,000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 3,090,000,000円</p>
2. 当計算期間の末日における受益権の総数	129,450,841,303口	101,544,937,447口
3.	1口当たり純資産額 2.1217円	1口当たり純資産額 1.9113円

1単位当たり純資産の額	(10,000口当たりの純資産額	21,217円)	(10,000口当たりの純資産額	19,113円)
-------------	------------------	----------	------------------	----------

## (金融商品に関する注記)

## . 金融商品の状況に関する事項

項目	自 平成27年 2月19日 至 平成28年 2月18日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、株式を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。当計算期間については、先物取引を行っております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>

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

#### ・金融商品の時価等に関する事項

項目	(平成28年 2月18日現在)
1.貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	<p>(1) 有価証券（株式） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

(デリバティブ取引に関する注記)

(平成27年 2月18日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

（単位：円）

区 分	種 類	契 約 額 等		時 価	評 価 損 益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	1,551,500,000	-	1,587,880,000	36,380,000
	東証株価指数先物	1,551,500,000	-	1,587,880,000	36,380,000
合計		1,551,500,000	-	1,587,880,000	36,380,000

（平成28年 2月18日現在）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

（単位：円）

区 分	種 類	契 約 額 等		時 価	評 価 損 益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	9,013,925,400	-	9,046,570,000	32,644,600
	東証株価指数先物	9,013,925,400	-	9,046,570,000	32,644,600
合計		9,013,925,400	-	9,046,570,000	32,644,600

（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）

該当事項はありません。

（その他の注記）

（平成27年 2月18日現在）	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	174,636,121,306円
同期中における追加設定元本額	6,571,256,808円
同期中における一部解約元本額	51,756,536,811円

平成27年 2月18日現在における元本の内訳	
三井住友・日本株式インデックス年金ファンド	9,442,947,073円
三井住友・DC年金バランス30（債券重点型）	432,202,895円
三井住友・DC年金バランス50（標準型）	2,242,786,137円
三井住友・DC年金バランス70（株式重点型）	1,694,288,474円
スミセイ・DCバランスファンド（機動的資産配分型）	91,899,054円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2020	6,883,173円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2025	12,251,701円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2030	12,984,997円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2035	19,870,648円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2040	10,403,290円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2045	22,964,021円
国内株式指数ファンド（TOPIX）	1,565,195,514円
三井住友・DC日本株式インデックスファンドS	622,527,312円
SMAM・国内株式パッシブ・ファンド（適格機関投資家専用）	23,521,322,979円
バランスファンドVA（安定運用型）＜適格機関投資家限定＞	278,111,120円
SMAM・バランスファンドVA安定成長型＜適格機関投資家限定＞	29,661,253,330円
SMAM・バランスファンドVA25＜適格機関投資家専用＞	10,037,097,652円
SMAM・バランスファンドVA37.5＜適格機関投資家専用＞	4,565,346,166円
SMAM・バランスファンドVA50＜適格機関投資家専用＞	17,024,931,656円
SMAM・バランスファンドVL30＜適格機関投資家限定＞	100,511,686円
SMAM・バランスファンドVL50＜適格機関投資家限定＞	396,918,991円
世界6資産バランスファンドVA＜適格機関投資家限定＞	42,994,995円
SMAM・バランスファンドVA75＜適格機関投資家専用＞	1,928,185,970円
SMAM・バランスファンドVL国際分散型＜適格機関投資家限定＞	96,939,284円
SMAM・インデックス・バランスVA25＜適格機関投資家専用＞	630,726,896円
SMAM・インデックス・バランスVA50＜適格機関投資家専用＞	2,020,682,014円
SMAM・バランスファンドVA40＜適格機関投資家専用＞	3,429,052,562円
SMAM・バランスファンドVA35＜適格機関投資家専用＞	5,878,970,037円
SMAM・バランスVA株40T＜適格機関投資家限定＞	448,414,724円
三井住友・5資産バランスファンド・VAS（適格機関投資家専用）	4,829,139,556円
SMAM・グローバルバランス40VA＜適格機関投資家限定＞	118,546,865円
SMAM・バランスファンドVA20＜適格機関投資家専用＞	222,395,040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）	3,816,094,846円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A＜適格機関投資家専用＞	170,650,033円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A＜適格機関投資家専用＞	85,955,777円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A＜適格機関投資家専用＞	38,644,735円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L＜適格機関投資家専用＞	406,365,437円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L＜適格機関投資家専用＞	699,058,182円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T＜適格機関投資家専用＞	282,831,882円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A2＜適格機関投資家専用＞	191,166,214円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A2＜適格機関投資家専用＞	102,539,216円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A2＜適格機関投資家専用＞	13,787,833円
SMAM・アセットバランスファンドVA30L2＜適格機関投資家専用＞	149,114,652円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L2＜適格機関投資家専用＞	1,714,608,133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）	313,592,194円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T2＜適格機関投資家専用＞	52,711,362円
SMAM・FG新興国重視型バランス20VA＜適格機関投資家限定＞	557,913円



S M A M ・ F G グローバルバランス 2 5 V A < 適格機関投資家限定 >	3,518,095円
S M A M ・ グローバル・マルチアセット・グロース・ファンド(安定成長型) < 適格機関投資家限定 >	898,987円
合計	129,450,841,303円

(平成28年 2月18日現在)

開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	129,450,841,303円
同期中における追加設定元本額	18,497,133,768円
同期中における一部解約元本額	46,403,037,624円
平成28年 2月18日現在における元本の内訳	
三井住友・日本株式インデックス年金ファンド	9,719,513,451円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	528,488,199円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	2,550,585,967円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	1,853,087,382円
S M A M ・ グローバルバランスファンド(機動的資産配分型)	106,374,788円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2020	8,337,773円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2025	18,289,996円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2030	59,491,911円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2035	45,900,235円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2040	26,571,812円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2045	58,216,829円
国内株式指数ファンド(T O P I X)	2,634,283,309円
三井住友・DC日本株式インデックスファンドS	859,397,493円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	358,933,329円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	586,726,552円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	730,841,061円
S M A M ・ 国内株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	15,960,268,567円
バランスファンドVA(安定運用型) < 適格機関投資家限定 >	134,243,352円
S M A M ・ バランスファンドVA安定成長型 < 適格機関投資家限定 >	16,260,742,191円
S M A M ・ バランスファンドVA25 < 適格機関投資家専用 >	7,255,774,516円
S M A M ・ バランスファンドVA37.5 < 適格機関投資家専用 >	3,922,850,063円
S M A M ・ バランスファンドVA50 < 適格機関投資家専用 >	14,543,666,735円
S M A M ・ バランスファンドVL30 < 適格機関投資家限定 >	83,669,680円
S M A M ・ バランスファンドVL50 < 適格機関投資家限定 >	346,809,807円
世界6資産バランスファンドVA < 適格機関投資家限定 >	24,299,004円
S M A M ・ バランスファンドVA75 < 適格機関投資家専用 >	1,530,636,481円
S M A M ・ バランスファンドVL国際分散型 < 適格機関投資家限定 >	85,688,096円
S M A M ・ インデックス・バランスVA25 < 適格機関投資家専用 >	550,816,665円
S M A M ・ インデックス・バランスVA50 < 適格機関投資家専用 >	1,683,109,840円
S M A M ・ バランスファンドVA40 < 適格機関投資家専用 >	2,823,066,693円
S M A M ・ バランスファンドVA35 < 適格機関投資家専用 >	5,209,959,767円
S M A M ・ バランスVA株40T < 適格機関投資家限定 >	128,378,984円
三井住友・5資産バランスファンド・VAS(適格機関投資家専用)	3,437,323,595円

SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	99,843,434円
SMAM・バランスファンドVA20<適格機関投資家専用>	177,048,156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）	3,198,902,555円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>	167,008,929円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>	81,299,034円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用>	36,023,030円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>	363,434,103円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	634,643,331円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T<適格機関投資家専用>	255,801,583円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A2<適格機関投資家専用>	186,320,432円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A2<適格機関投資家専用>	82,918,566円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A2<適格機関投資家専用>	13,585,306円
SMAM・アセットバランスファンドVA30L2<適格機関投資家専用>	135,871,591円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L2<適格機関投資家専用>	1,584,063,361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）	281,122,402円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T2<適格機関投資家専用>	30,877,449円
SMAM・FG新興国重視型バランス20VA<適格機関投資家限定>	305,920円
SMAM・FGグローバルバランス25VA<適格機関投資家限定>	2,407,964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>	54,756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>	110,935円
SMAM・マルチアセットストラテジーファンド2016-01<適格機関投資家限定>	86,950,487円
合計	101,544,937,447円

## 附属明細表

## 有価証券明細表

## (a) 株式

(単位：円)

銘柄	株数	評価額		備考
		単価	金額	
極洋	51,000	258.00	13,158,000	
日本水産	123,700	533.00	65,932,100	
マルハニチロ	21,800	2,137.00	46,586,600	
サカタのタネ	15,600	2,740.00	42,744,000	
ホクト	10,700	2,053.00	21,967,100	
日鉄鉱業	31,000	425.00	13,175,000	
三井松島産業	82,000	117.00	9,594,000	
国際石油開発帝石	565,600	956.60	541,052,960	
日本海洋掘削	3,600	2,158.00	7,768,800	
石油資源開発	17,200	2,768.00	47,609,600	
K&Oエナジーグループ	7,400	1,250.00	9,250,000	
ショーボンドホールディングス	10,800	3,870.00	41,796,000	

ミライト・ホールディングス	32,600	814.00	26,536,400
ダイセキ環境ソリューション	3,400	1,035.00	3,519,000
安藤・間	70,900	531.00	37,647,900
東急建設	34,700	814.00	28,245,800
コムシスホールディングス	46,300	1,638.00	75,839,400
ミサワホーム	13,800	640.00	8,832,000
高松コンストラクショングループ	7,700	2,129.00	16,393,300
東建コーポレーション	4,300	8,250.00	35,475,000
大成建設	555,000	698.00	387,390,000
大林組	321,300	984.00	316,159,200
清水建設	327,000	864.00	282,528,000
飛鳥建設	83,600	149.00	12,456,400
長谷工コーポレーション	125,400	1,005.00	126,027,000
松井建設	14,200	679.00	9,641,800
銭高組	18,000	453.00	8,154,000
鹿島建設	502,000	651.00	326,802,000
不動テトラ	82,500	114.00	9,405,000
鉄建建設	67,000	259.00	17,353,000
西松建設	126,000	428.00	53,928,000
三井住友建設	421,000	92.00	38,732,000
大豊建設	42,000	445.00	18,690,000
前田建設工業	67,000	766.00	51,322,000
ナカノフドー建設	9,800	547.00	5,360,600
奥村組	103,000	564.00	58,092,000
東鉄工業	12,700	3,155.00	40,068,500
イチケン	14,000	283.00	3,962,000
戸田建設	126,000	476.00	59,976,000
熊谷組	156,000	317.00	49,452,000
青木あすなろ建設	9,100	668.00	6,078,800
北野建設	28,000	275.00	7,700,000
三井ホーム	16,000	508.00	8,128,000
矢作建設工業	16,500	738.00	12,177,000
ピーエス三菱	16,900	431.00	7,283,900
日本ハウスホールディングス	24,400	402.00	9,808,800
大東建託	40,000	14,780.00	591,200,000
新日本建設	14,600	528.00	7,708,800
N I P P O	24,000	1,702.00	40,848,000
東亜道路工業	23,000	352.00	8,096,000
前田道路	34,000	1,742.00	59,228,000
日本道路	32,000	556.00	17,792,000
東亜建設工業	94,000	247.00	23,218,000
若築建設	73,000	115.00	8,395,000

東洋建設	34,400	433.00	14,895,200
五洋建設	120,700	483.00	58,298,100
大林道路	13,800	753.00	10,391,400
世紀東急工業	19,000	468.00	8,892,000
福田組	18,000	988.00	17,784,000
住友林業	73,700	1,290.00	95,073,000
日本基礎技術	14,600	431.00	6,292,600
日成ビルド工業	31,000	363.00	11,253,000
ヤマダ・エスバイエルホーム	77,000	67.00	5,159,000
巴コーポレーション	19,600	373.00	7,310,800
パナホーム	39,000	820.00	31,980,000
大和ハウス工業	317,000	3,038.00	963,046,000
ライト工業	20,700	1,092.00	22,604,400
積水ハウス	359,000	1,773.00	636,507,000
日特建設	14,700	403.00	5,924,100
ユアテック	17,000	817.00	13,889,000
中電工	15,100	2,360.00	35,636,000
関電工	42,000	829.00	34,818,000
きんでん	64,700	1,486.00	96,144,200
東京エネシス	13,000	913.00	11,869,000
トーエネック	16,000	697.00	11,152,000
住友電設	9,000	1,427.00	12,843,000
日本電設工業	17,300	2,136.00	36,952,800
協和エクシオ	42,600	1,225.00	52,185,000
新日本空調	10,800	958.00	10,346,400
N D S	23,000	289.00	6,647,000
九電工	20,000	2,250.00	45,000,000
三機工業	24,000	946.00	22,704,000
日揮	108,000	1,792.00	193,536,000
中外炉工業	40,000	182.00	7,280,000
ヤマト	13,000	436.00	5,668,000
太平電業	16,000	920.00	14,720,000
高砂熱学工業	31,700	1,517.00	48,088,900
朝日工業社	17,000	437.00	7,429,000
明星工業	22,000	423.00	9,306,000
大気社	13,400	2,687.00	36,005,800
ダイダン	16,000	756.00	12,096,000
日比谷総合設備	13,000	1,643.00	21,359,000
東芝プラントシステム	17,400	1,314.00	22,863,600
O S J Bホールディングス	26,700	224.00	5,980,800
東洋エンジニアリング	60,000	260.00	15,600,000
千代田化工建設	78,000	830.00	64,740,000

新興プランテック	22,600	896.00	20,249,600
日本製粉	70,000	807.00	56,490,000
日清製粉グループ本社	117,000	1,834.00	214,578,000
日東富士製粉	15,000	347.00	5,205,000
昭和産業	43,000	451.00	19,393,000
鳥越製粉	11,300	641.00	7,243,300
中部飼料	11,100	798.00	8,857,800
フィード・ワン	73,500	117.00	8,599,500
日本甜菜製糖	61,000	189.00	11,529,000
三井製糖	41,000	482.00	19,762,000
日新製糖	1,700	4,255.00	7,233,500
森永製菓	96,000	598.00	57,408,000
中村屋	29,000	455.00	13,195,000
江崎グリコ	24,800	5,610.00	139,128,000
名糖産業	6,800	1,284.00	8,731,200
不二家	71,000	187.00	13,277,000
山崎製パン	79,000	2,129.00	168,191,000
モロゾフ	17,000	415.00	7,055,000
亀田製菓	6,000	4,395.00	26,370,000
寿スピリッツ	2,700	5,580.00	15,066,000
カルビー	39,700	4,495.00	178,451,500
森永乳業	98,000	522.00	51,156,000
六甲バター	5,500	1,750.00	9,625,000
ヤクルト本社	57,500	5,510.00	316,825,000
明治ホールディングス	63,400	9,060.00	574,404,000
雪印メグミルク	25,500	2,679.00	68,314,500
プリマハム	66,000	279.00	18,414,000
日本ハム	79,000	2,506.00	197,974,000
伊藤ハム	51,000	688.00	35,088,000
林兼産業	43,000	95.00	4,085,000
丸大食品	54,000	420.00	22,680,000
米久	3,700	2,522.00	9,331,400
S Foods	6,700	2,214.00	14,833,800
サッポロホールディングス	164,000	527.00	86,428,000
アサヒグループホールディングス	201,500	3,386.00	682,279,000
キリンホールディングス	434,900	1,489.00	647,566,100
宝ホールディングス	78,100	807.00	63,026,700
オエノンホールディングス	39,000	205.00	7,995,000
養命酒製造	4,200	1,917.00	8,051,400
コカ・コーラウエスト	36,200	2,579.00	93,359,800
コカ・コーライーストジャパン	38,100	1,998.00	76,123,800
サントリー食品インターナショナル	73,300	4,700.00	344,510,000

ダイドードリンコ	5,300	5,120.00	27,136,000
伊藤園	32,000	3,210.00	102,720,000
キーコーヒー	8,800	1,793.00	15,778,400
日清オイリオグループ	55,000	456.00	25,080,000
不二製油グループ本社	28,900	1,904.00	55,025,600
J・オイルミルズ	43,000	337.00	14,491,000
キッコーマン	81,000	3,765.00	304,965,000
味の素	230,000	2,801.50	644,345,000
キューピー	54,600	2,497.00	136,336,200
ハウス食品グループ本社	36,600	2,170.00	79,422,000
カゴメ	38,600	2,099.00	81,021,400
焼津水産化学工業	6,300	999.00	6,293,700
アリアケジャパン	8,700	6,370.00	55,419,000
ニチレイ	115,000	872.00	100,280,000
東洋水産	52,600	4,115.00	216,449,000
日清食品ホールディングス	45,300	5,370.00	243,261,000
永谷園ホールディングス	12,000	1,041.00	12,492,000
一正蒲鉾	5,000	866.00	4,330,000
フジッコ	10,500	2,212.00	23,226,000
ロック・フィールド	5,500	3,030.00	16,665,000
日本たばこ産業	634,400	4,543.00	2,882,079,200
ケンコーマヨネーズ	3,900	2,305.00	8,989,500
わらべや日洋	5,800	2,285.00	13,253,000
なとり	6,400	1,618.00	10,355,200
ユーグレナ	36,400	1,517.00	55,218,800
ミヨシ油脂	49,000	119.00	5,831,000
理研ビタミン	3,500	3,660.00	12,810,000
片倉工業	13,500	1,164.00	15,714,000
ゲンゼ	80,000	285.00	22,800,000
東洋紡	402,000	159.00	63,918,000
ユニチカ	298,000	51.00	15,198,000
富士紡ホールディングス	56,000	211.00	11,816,000
倉敷紡績	103,000	178.00	18,334,000
シキボウ	78,000	107.00	8,346,000
日本毛織	31,000	775.00	24,025,000
ダイドーリミテッド	14,900	463.00	6,898,700
帝国繊維	11,000	1,474.00	16,214,000
帝人	410,000	387.00	158,670,000
東レ	728,000	918.70	668,813,600
サカイオーベックス	38,000	169.00	6,422,000
住江織物	29,000	289.00	8,381,000
芦森工業	32,000	148.00	4,736,000

アツギ	96,000	111.00	10,656,000
ダイニック	35,000	151.00	5,285,000
セーレン	25,000	1,093.00	27,325,000
小松精練	18,100	580.00	10,498,000
ワコールホールディングス	60,000	1,339.00	80,340,000
ホギメディカル	6,200	5,570.00	34,534,000
レナウン	39,700	104.00	4,128,800
T S Iホールディングス	45,800	725.00	33,205,000
三陽商会	58,000	253.00	14,674,000
オンワードホールディングス	68,000	703.00	47,804,000
ゴールドウイン	4,400	4,690.00	20,636,000
デサント	22,800	1,703.00	38,828,400
特種東海製紙	59,000	368.00	21,712,000
王子ホールディングス	407,000	440.00	179,080,000
日本製紙	51,200	1,831.00	93,747,200
三菱製紙	159,000	80.00	12,720,000
北越紀州製紙	62,100	627.00	38,936,700
中越パルプ工業	43,000	162.00	6,966,000
巴川製紙所	22,000	185.00	4,070,000
大王製紙	44,000	910.00	40,040,000
レンゴー	89,000	543.00	48,327,000
トモク	35,000	256.00	8,960,000
ザ・パック	7,100	2,652.00	18,829,200
クラレ	157,200	1,269.00	199,486,800
旭化成	627,000	697.00	437,019,000
共和レザー	8,000	852.00	6,816,000
昭和電工	666,000	116.00	77,256,000
住友化学	737,000	507.00	373,659,000
住友精化	21,000	598.00	12,558,000
日産化学工業	60,300	2,660.00	160,398,000
ラサ工業	50,000	101.00	5,050,000
クレハ	75,000	377.00	28,275,000
テイカ	19,000	541.00	10,279,000
石原産業	186,000	78.00	14,508,000
日東エフシー	7,300	832.00	6,073,600
日本曹達	65,000	523.00	33,995,000
東ソー	270,000	446.00	120,420,000
トクヤマ	166,000	150.00	24,900,000
セントラル硝子	110,000	559.00	61,490,000
東亜合成	63,300	903.00	57,159,900
大阪ソーダ	43,000	415.00	17,845,000
関東電化工業	24,000	883.00	21,192,000

デンカ	208,000	403.00	83,824,000
信越化学工業	179,700	5,820.00	1,045,854,000
日本カーバイド工業	43,000	117.00	5,031,000
堺化学工業	41,000	304.00	12,464,000
エア・ウォーター	82,000	1,597.00	130,954,000
大陽日酸	77,500	1,031.00	79,902,500
日本化学工業	41,000	196.00	8,036,000
日本パーカラライジング	50,600	1,014.00	51,308,400
高压ガス工業	17,000	591.00	10,047,000
四国化成工業	15,000	905.00	13,575,000
戸田工業	24,000	312.00	7,488,000
ステラ ケミファ	5,700	2,218.00	12,642,600
保土谷化学工業	34,000	178.00	6,052,000
日本触媒	14,600	7,140.00	104,244,000
大日精化工業	38,000	447.00	16,986,000
カネカ	135,000	893.00	120,555,000
三菱瓦斯化学	173,000	585.00	101,205,000
三井化学	425,000	405.00	172,125,000
J S R	93,900	1,617.00	151,836,300
東京応化工業	20,300	2,953.00	59,945,900
大阪有機化学工業	9,100	624.00	5,678,400
三菱ケミカルホールディングス	672,300	628.90	422,809,470
日本合成化学工業	24,000	684.00	16,416,000
ダイセル	140,700	1,579.00	222,165,300
住友ベークライト	95,000	485.00	46,075,000
積水化学工業	226,900	1,279.00	290,205,100
日本ゼオン	87,000	731.00	63,597,000
アイカ工業	30,400	2,165.00	65,816,000
宇部興産	536,000	202.00	108,272,000
積水樹脂	15,200	1,380.00	20,976,000
タキロン	24,000	553.00	13,272,000
旭有機材工業	41,000	200.00	8,200,000
日立化成	49,500	1,936.00	95,832,000
ニチバン	12,000	620.00	7,440,000
リケンテクノス	18,500	354.00	6,549,000
大倉工業	29,000	275.00	7,975,000
積水化成成品工業	28,000	359.00	10,052,000
群栄化学工業	30,000	275.00	8,250,000
ミライアル	5,700	838.00	4,776,600
ダイキョーニシカワ	13,100	1,612.00	21,117,200
日本化薬	65,000	1,152.00	74,880,000
カーリットホールディングス	11,600	485.00	5,626,000



日本精化	10,000	733.00	7,330,000
扶桑化学工業	6,700	1,402.00	9,393,400
A D E K A	49,400	1,503.00	74,248,200
日油	77,000	809.00	62,293,000
花王	269,800	5,706.00	1,539,478,800
第一工業製薬	26,000	314.00	8,164,000
三洋化成工業	30,000	783.00	23,490,000
大日本塗料	62,000	202.00	12,524,000
日本ペイントホールディングス	77,400	2,437.00	188,623,800
関西ペイント	113,200	1,703.00	192,779,600
中国塗料	29,000	713.00	20,677,000
日本特殊塗料	8,200	1,005.00	8,241,000
藤倉化成	16,600	528.00	8,764,800
太陽ホールディングス	7,300	3,760.00	27,448,000
D I C	401,000	252.00	101,052,000
サカティクス	20,400	1,167.00	23,806,800
東洋インキＳＣホールディングス	96,000	453.00	43,488,000
T & K T O K A	8,000	915.00	7,320,000
富士フィルムホールディングス	229,400	4,320.00	991,008,000
資生堂	190,700	2,371.50	452,245,050
ライオン	116,000	1,179.00	136,764,000
高砂香料工業	6,700	2,326.00	15,584,200
マンダム	9,200	4,550.00	41,860,000
ミルボン	5,900	4,215.00	24,868,500
ファンケル	23,300	1,332.00	31,035,600
コーセー	16,200	9,050.00	146,610,000
シーズ・ホールディングス	12,700	1,789.00	22,720,300
ポーラ・オルビスホールディングス	10,200	7,980.00	81,396,000
ノエビアホールディングス	6,300	2,972.00	18,723,600
エステー	8,500	1,094.00	9,299,000
コニシ	8,000	2,479.00	19,832,000
長谷川香料	12,100	1,464.00	17,714,400
星光P M C	6,200	922.00	5,716,400
小林製薬	15,200	9,420.00	143,184,000
荒川化学工業	9,600	939.00	9,014,400
メック	8,600	843.00	7,249,800
日本高純度化学	3,800	2,024.00	7,691,200
J C U	3,200	3,410.00	10,912,000
新田ゼラチン	8,300	701.00	5,818,300
デクセリアルズ	22,700	1,053.00	23,903,100
アース製薬	7,000	4,130.00	28,910,000
イハラケミカル工業	15,500	1,225.00	18,987,500

北興化学工業	16,000	303.00	4,848,000
大成ラミック	3,500	3,005.00	10,517,500
クミアイ化学工業	20,700	1,154.00	23,887,800
日本農薬	23,100	588.00	13,582,800
アキレス	93,000	143.00	13,299,000
有沢製作所	15,900	575.00	9,142,500
日東電工	77,600	6,080.00	471,808,000
きもと	23,000	170.00	3,910,000
藤森工業	8,600	2,584.00	22,222,400
前澤化成工業	8,000	1,006.00	8,048,000
J S P	6,600	2,309.00	15,239,400
エフピコ	8,800	4,525.00	39,820,000
天馬	7,600	1,974.00	15,002,400
信越ポリマー	20,300	600.00	12,180,000
東リ	31,000	295.00	9,145,000
ニフコ	19,200	5,170.00	99,264,000
日本バルカー工業	45,000	274.00	12,330,000
ユニ・チャーム	203,400	2,385.50	485,210,700
協和発酵キリン	119,900	1,582.00	189,681,800
武田薬品工業	399,600	5,458.00	2,181,016,800
アステラス製薬	1,123,200	1,585.00	1,780,272,000
大日本住友製薬	71,000	1,229.00	87,259,000
塩野義製薬	146,300	4,618.00	675,613,400
田辺三菱製薬	116,400	2,010.00	233,964,000
あすか製薬	13,100	1,159.00	15,182,900
日本新薬	23,100	3,910.00	90,321,000
中外製薬	99,600	3,320.00	330,672,000
科研製薬	17,400	7,130.00	124,062,000
エーザイ	123,600	6,975.00	862,110,000
ロート製薬	49,300	2,009.00	99,043,700
小野薬品工業	45,600	19,260.00	878,256,000
久光製薬	31,200	4,835.00	150,852,000
持田製薬	7,000	8,510.00	59,570,000
参天製薬	184,600	1,687.00	311,420,200
扶桑薬品工業	42,000	251.00	10,542,000
日本ケミファ	17,000	484.00	8,228,000
ツムラ	31,800	2,762.00	87,831,600
日医工	23,800	2,662.00	63,355,600
キッセイ薬品工業	18,000	2,697.00	48,546,000
生化学工業	19,400	1,355.00	26,287,000
栄研化学	8,600	2,127.00	18,292,200
鳥居薬品	6,700	2,390.00	16,013,000

JCRファーマ	8,000	1,878.00	15,024,000
東和薬品	4,600	5,310.00	24,426,000
富士製薬工業	3,500	1,981.00	6,933,500
沢井製薬	17,100	7,380.00	126,198,000
ゼリア新薬工業	20,800	1,403.00	29,182,400
第一三共	337,500	2,247.00	758,362,500
キョーリン製薬ホールディングス	27,000	2,140.00	57,780,000
大幸薬品	5,700	1,332.00	7,592,400
ダイト	4,500	2,578.00	11,601,000
大塚ホールディングス	215,700	4,075.00	878,977,500
大正製薬ホールディングス	24,000	8,690.00	208,560,000
ペプチドリーム	12,500	3,840.00	48,000,000
日本コークス工業	92,600	77.00	7,130,200
昭和シェル石油	100,000	982.00	98,200,000
ニチレキ	13,000	764.00	9,932,000
東燃ゼネラル石油	150,000	963.00	144,450,000
ユシロ化学工業	6,400	1,248.00	7,987,200
ビーピー・カストロール	4,900	1,233.00	6,041,700
富士石油	26,400	293.00	7,735,200
MORESCO	3,900	1,491.00	5,814,900
出光興産	52,000	1,909.00	99,268,000
JXホールディングス	1,185,000	462.00	547,470,000
コスモエネルギーホールディングス	29,000	1,236.00	35,844,000
横浜ゴム	60,600	1,859.00	112,655,400
東洋ゴム工業	45,600	1,803.00	82,216,800
ブリヂストン	338,300	3,909.00	1,322,414,700
住友ゴム工業	93,900	1,637.00	153,714,300
藤倉ゴム工業	11,700	460.00	5,382,000
オカモト	32,000	920.00	29,440,000
ニッタ	10,900	3,000.00	32,700,000
住友理工	21,600	1,000.00	21,600,000
三ツ星ベルト	25,000	871.00	21,775,000
バンドー化学	37,000	441.00	16,317,000
日東紡績	67,000	361.00	24,187,000
旭硝子	528,000	562.00	296,736,000
日本板硝子	492,000	73.00	35,916,000
日本山村硝子	53,000	166.00	8,798,000
日本電気硝子	208,000	547.00	113,776,000
住友大阪セメント	200,000	419.00	83,800,000
太平洋セメント	626,000	232.00	145,232,000
日本ヒューム	12,000	540.00	6,480,000
日本コンクリート工業	23,500	251.00	5,898,500

三谷セキサン	5,700	1,432.00	8,162,400
アジアパイルホールディングス	14,300	358.00	5,119,400
東海カーボン	86,000	284.00	24,424,000
日本カーボン	54,000	203.00	10,962,000
東洋炭素	6,300	1,475.00	9,292,500
ノリタケカンパニーリミテド	59,000	247.00	14,573,000
TOTO	73,600	3,230.00	237,728,000
日本碍子	127,000	2,160.00	274,320,000
日本特殊陶業	86,300	2,274.00	196,246,200
MARUWA	4,100	2,599.00	10,655,900
品川リフラクトリーズ	32,000	207.00	6,624,000
黒崎播磨	26,000	237.00	6,162,000
ニッカトー	8,900	367.00	3,266,300
フジインコーポレーテッド	9,100	1,187.00	10,801,700
ニチアス	51,000	650.00	33,150,000
ニチハ	13,600	1,558.00	21,188,800
新日鐵住金	452,200	1,993.50	901,460,700
神戸製鋼所	1,836,000	90.00	165,240,000
中山製鋼所	125,000	65.00	8,125,000
合同製鐵	60,000	196.00	11,760,000
ジェイ エフ イー ホールディングス	274,200	1,429.00	391,831,800
日新製鋼	46,000	1,194.00	54,924,000
東京製鐵	55,400	787.00	43,599,800
共英製鋼	10,700	1,787.00	19,120,900
大和工業	22,200	2,316.00	51,415,200
東京鐵鋼	23,000	398.00	9,154,000
大阪製鐵	6,500	1,840.00	11,960,000
淀川製鋼所	14,900	2,483.00	36,996,700
東洋鋼鈹	26,000	312.00	8,112,000
丸一鋼管	33,400	3,145.00	105,043,000
モリ工業	22,000	308.00	6,776,000
大同特殊鋼	169,000	433.00	73,177,000
日本冶金工業	79,500	117.00	9,301,500
山陽特殊製鋼	59,000	541.00	31,919,000
愛知製鋼	59,000	431.00	25,429,000
日立金属	114,800	1,222.00	140,285,600
日本金属	42,000	100.00	4,200,000
大平洋金属	70,000	305.00	21,350,000
新日本電工	63,400	170.00	10,778,000
栗本鐵工所	53,000	162.00	8,586,000
三菱製鋼	71,000	184.00	13,064,000
日亜鋼業	19,700	253.00	4,984,100

シンニッタン	11,100	590.00	6,549,000
大紀アルミニウム工業所	21,000	257.00	5,397,000
日本軽金属ホールディングス	230,500	173.00	39,876,500
三井金属鉱業	261,000	167.00	43,587,000
東邦亜鉛	54,000	283.00	15,282,000
三菱マテリアル	627,000	312.00	195,624,000
住友金属鉱山	277,000	1,162.50	322,012,500
DOWAホールディングス	130,000	628.00	81,640,000
古河機械金属	157,000	165.00	25,905,000
大阪チタニウムテクノロジーズ	10,300	1,692.00	17,427,600
東邦チタニウム	17,800	920.00	16,376,000
UACJ	139,000	213.00	29,607,000
古河電気工業	317,000	247.00	78,299,000
住友電気工業	402,000	1,384.00	556,368,000
フジクラ	141,000	502.00	70,782,000
昭和電線ホールディングス	143,000	56.00	8,008,000
タツタ電線	23,500	345.00	8,107,500
リョービ	62,000	418.00	25,916,000
アーレスティ	13,100	680.00	8,908,000
アサヒホールディングス	15,200	1,548.00	23,529,600
稲葉製作所	6,700	1,136.00	7,611,200
宮地エンジニアリンググループ	38,000	140.00	5,320,000
トーカロ	7,500	1,904.00	14,280,000
SUMCO	79,400	772.00	61,296,800
川田テクノロジーズ	2,300	3,125.00	7,187,500
東洋製罐グループホールディングス	71,400	1,967.00	140,443,800
ホッカインホールディングス	32,000	296.00	9,472,000
コロナ	6,900	969.00	6,686,100
横河ブリッジホールディングス	19,500	1,111.00	21,664,500
駒井ハルテック	26,000	219.00	5,694,000
三和ホールディングス	102,400	723.00	74,035,200
文化シャッター	28,100	925.00	25,992,500
三協立山	13,000	1,285.00	16,705,000
アルインコ	7,300	1,000.00	7,300,000
LIXILグループ	139,500	2,412.00	336,474,000
日本ファイルコン	13,500	427.00	5,764,500
ノーリツ	19,600	1,904.00	37,318,400
長府製作所	10,600	2,511.00	26,616,600
リンナイ	18,600	9,670.00	179,862,000
日東精工	21,000	312.00	6,552,000
岡部	21,500	700.00	15,050,000
ジーテクト	10,600	1,173.00	12,433,800

東プレ	19,100	2,094.00	39,995,400
高周波熱錬	19,200	842.00	16,166,400
東京製綱	80,000	146.00	11,680,000
パイオラックス	5,100	5,360.00	27,336,000
日本発條	94,600	1,036.00	98,005,600
アドバネクス	2,900	1,285.00	3,726,500
三益半導体工業	8,700	1,013.00	8,813,100
日本製鋼所	167,000	392.00	65,464,000
三浦工業	45,000	1,854.00	83,430,000
タクマ	37,000	910.00	33,670,000
ツガミ	30,000	422.00	12,660,000
オークマ	66,000	897.00	59,202,000
東芝機械	54,000	383.00	20,682,000
アマダホールディングス	145,300	1,116.00	162,154,800
アイダエンジニアリング	26,300	880.00	23,144,000
滝澤鉄工所	42,000	127.00	5,334,000
富士機械製造	32,400	1,075.00	34,830,000
牧野フライス製作所	49,000	749.00	36,701,000
オーエスジー	45,800	1,958.00	89,676,400
旭ダイヤモンド工業	27,000	999.00	26,973,000
D M G 森精機	55,800	991.00	55,297,800
ソディック	19,700	753.00	14,834,100
ディスコ	12,800	10,690.00	136,832,000
日東工器	6,000	2,113.00	12,678,000
O K K	52,000	111.00	5,772,000
島精機製作所	14,000	1,752.00	24,528,000
フリー	1,600	3,175.00	5,080,000
日阪製作所	14,100	803.00	11,322,300
やまびこ	18,700	804.00	15,034,800
ペガサスミシン製造	12,500	502.00	6,275,000
ナプテスコ	52,100	2,381.00	124,050,100
三井海洋開発	11,500	1,512.00	17,388,000
レオン自動機	9,500	609.00	5,785,500
S M C	30,000	28,370.00	851,100,000
新川	5,800	402.00	2,331,600
ホソカワミクロン	19,000	556.00	10,564,000
ユニオンツール	4,400	2,393.00	10,529,200
オイレス工業	13,000	1,814.00	23,582,000
日精エー・エス・ビー機械	4,100	1,924.00	7,888,400
サトーホールディングス	13,500	2,546.00	34,371,000
日精樹脂工業	8,500	675.00	5,737,500
ワイエイシイ	5,700	594.00	3,385,800

小松製作所	491,600	1,815.00	892,254,000
住友重機械工業	292,000	479.00	139,868,000
日立建機	44,700	1,693.00	75,677,100
日工	19,000	326.00	6,194,000
巴工業	5,200	1,431.00	7,441,200
井関農機	105,000	166.00	17,430,000
TOWA	11,200	657.00	7,358,400
丸山製作所	31,000	165.00	5,115,000
北川鉄工所	51,000	205.00	10,455,000
クボタ	481,300	1,466.50	705,826,450
三菱化工機	37,000	229.00	8,473,000
月島機械	18,400	1,028.00	18,915,200
帝国電機製作所	8,500	685.00	5,822,500
新東工業	22,500	899.00	20,227,500
澁谷工業	9,000	1,335.00	12,015,000
アイチ コーポレーション	15,300	743.00	11,367,900
小森コーポレーション	24,200	1,254.00	30,346,800
鶴見製作所	8,000	1,730.00	13,840,000
住友精密工業	20,000	347.00	6,940,000
荏原製作所	222,000	434.00	96,348,000
西島製作所	12,300	943.00	11,598,900
北越工業	12,200	663.00	8,088,600
ダイキン工業	139,500	7,750.00	1,081,125,000
オルガノ	21,000	418.00	8,778,000
トーヨーカネツ	57,000	243.00	13,851,000
栗田工業	60,200	2,549.00	153,449,800
椿本チエイン	56,000	641.00	35,896,000
大同工業	29,000	185.00	5,365,000
日本コンベヤ	39,000	118.00	4,602,000
木村化工機	12,200	362.00	4,416,400
アネスト岩田	16,400	890.00	14,596,000
ダイフク	51,600	1,817.00	93,757,200
加藤製作所	25,000	387.00	9,675,000
油研工業	27,000	192.00	5,184,000
タダノ	47,000	1,004.00	47,188,000
フジテック	27,900	1,204.00	33,591,600
C K D	26,700	793.00	21,173,100
キトー	13,400	743.00	9,956,200
平和	29,200	2,371.00	69,233,200
理想科学工業	10,500	1,776.00	18,648,000
SANKYO	26,600	4,220.00	112,252,000
日本金銭機械	9,600	961.00	9,225,600

マースエンジニアリング	5,800	1,969.00	11,420,200
福島工業	5,900	2,271.00	13,398,900
ダイコク電機	4,500	1,199.00	5,395,500
竹内製作所	14,400	1,489.00	21,441,600
アマノ	29,400	1,588.00	46,687,200
J U K I	15,000	905.00	13,575,000
サンデンホールディングス	59,000	301.00	17,759,000
蛇の目ミシン工業	10,700	555.00	5,938,500
マックス	14,000	1,170.00	16,380,000
グローリー	32,700	3,740.00	122,298,000
新晃工業	7,300	1,639.00	11,964,700
大和冷機工業	15,100	955.00	14,420,500
セガサミーホールディングス	102,800	1,187.00	122,023,600
日本ピストンリング	4,800	1,554.00	7,459,200
リケン	45,000	360.00	16,200,000
T P R	11,700	2,636.00	30,841,200
ツバキ・ナカシマ	9,000	1,417.00	12,753,000
ホシザキ電機	21,000	8,140.00	170,940,000
大豊工業	8,300	1,165.00	9,669,500
日本精工	196,200	1,075.00	210,915,000
N T N	237,000	373.00	88,401,000
ジェイテクト	101,800	1,584.00	161,251,200
不二越	91,000	388.00	35,308,000
日本トムソン	33,000	419.00	13,827,000
T H K	63,900	2,029.00	129,653,100
ユーシン精機	4,100	1,683.00	6,900,300
前澤給装工業	5,200	1,384.00	7,196,800
イーグル工業	11,800	1,436.00	16,944,800
日本ピラー工業	10,700	930.00	9,951,000
キッツ	46,400	477.00	22,132,800
日立工機	24,000	771.00	18,504,000
マキタ	62,300	6,700.00	417,410,000
日立造船	76,700	533.00	40,881,100
三菱重工業	1,705,000	419.40	715,077,000
I H I	736,000	196.00	144,256,000
日清紡ホールディングス	53,400	1,136.00	60,662,400
イビデン	58,700	1,355.00	79,538,500
コニカミノルタ	238,900	943.00	225,282,700
ブラザー工業	123,300	1,225.00	151,042,500
ミネベア	155,000	811.00	125,705,000
日立製作所	2,443,000	490.00	1,197,070,000
東芝	2,018,000	172.50	348,105,000



三菱電機	1,021,000	1,144.00	1,168,024,000
富士電機	289,000	386.00	111,554,000
東洋電機製造	23,000	318.00	7,314,000
安川電機	118,800	1,307.00	155,271,600
シンフォニアテクノロジー	68,000	147.00	9,996,000
明電舎	87,000	475.00	41,325,000
オリジン電気	19,000	261.00	4,959,000
山洋電気	26,000	525.00	13,650,000
デンヨー	9,400	1,197.00	11,251,800
東芝テック	69,000	360.00	24,840,000
マブチモーター	27,400	4,865.00	133,301,000
日本電産	115,300	7,614.00	877,894,200
東光高岳	6,000	1,358.00	8,148,000
ダブル・スコープ	3,000	4,030.00	12,090,000
ダイヘン	57,000	461.00	26,277,000
田淵電機	11,700	453.00	5,300,100
JVCケンウッド	71,200	294.00	20,932,800
第一精工	4,700	1,356.00	6,373,200
日新電機	22,800	954.00	21,751,200
大崎電気工業	18,000	714.00	12,852,000
オムロン	109,600	3,270.00	358,392,000
日東工業	15,200	1,858.00	28,241,600
I D E C	12,900	997.00	12,861,300
ジーエス・ユアサ コーポレーション	186,000	444.00	82,584,000
サクサホールディングス	27,000	180.00	4,860,000
メルコホールディングス	5,600	2,160.00	12,096,000
テクノメディカ	2,600	2,159.00	5,613,400
日本電気	1,316,000	282.00	371,112,000
富士通	925,000	421.10	389,517,500
沖電気工業	417,000	152.00	63,384,000
電気興業	26,000	537.00	13,962,000
サンケン電気	53,000	311.00	16,483,000
アイホン	5,900	1,850.00	10,915,000
ルネサスエレクトロニクス	49,500	682.00	33,759,000
セイコーエプソン	142,400	1,851.00	263,582,400
ワコム	75,700	472.00	35,730,400
アルバック	17,700	3,135.00	55,489,500
アクセル	5,300	870.00	4,611,000
E I Z O	9,500	3,010.00	28,595,000
ジャパンディスプレイ	180,400	221.00	39,868,400
日本信号	26,200	818.00	21,431,600
京三製作所	28,000	323.00	9,044,000

能美防災	10,800	1,369.00	14,785,200
ホーチキ	8,200	1,099.00	9,011,800
エレコム	8,800	1,438.00	12,654,400
日本無線	26,000	266.00	6,916,000
パナソニック	1,094,000	878.00	960,532,000
シャープ	747,000	166.00	124,002,000
アンリツ	59,000	644.00	37,996,000
富士通ゼネラル	29,000	1,510.00	43,790,000
日立国際電気	22,000	1,303.00	28,666,000
ソニー	675,700	2,569.00	1,735,873,300
T D K	57,700	5,990.00	345,623,000
帝国通信工業	29,000	164.00	4,756,000
ミツミ電機	36,800	496.00	18,252,800
タムラ製作所	40,000	281.00	11,240,000
アルプス電気	81,200	1,948.00	158,177,600
池上通信機	37,000	129.00	4,773,000
パイオニア	155,600	247.00	38,433,200
日本電波工業	11,500	687.00	7,900,500
日本トリム	2,700	4,235.00	11,434,500
ローランド ディー . ジー .	5,100	2,376.00	12,117,600
フォスター電機	12,100	2,268.00	27,442,800
クラリオン	51,000	351.00	17,901,000
S M K	29,000	525.00	15,225,000
東光	22,000	374.00	8,228,000
ホシデン	29,400	649.00	19,080,600
ヒロセ電機	15,400	12,910.00	198,814,000
日本航空電子工業	27,000	1,202.00	32,454,000
T O A	12,000	1,000.00	12,000,000
日立マクセル	15,800	1,575.00	24,885,000
古野電気	12,500	698.00	8,725,000
ユニデンホールディングス	39,000	114.00	4,446,000
アルパイン	22,700	1,304.00	29,600,800
スミダコーポレーション	10,000	716.00	7,160,000
アイコム	5,800	2,255.00	13,079,000
リオン	4,300	1,522.00	6,544,600
船井電機	10,600	961.00	10,186,600
横河電機	95,900	1,144.00	109,709,600
新電元工業	35,000	377.00	13,195,000
アズビル	31,300	2,901.00	90,801,300
日本光電工業	40,100	2,740.00	109,874,000
チノー	5,500	1,028.00	5,654,000
共和電業	17,200	364.00	6,260,800

堀場製作所	17,900	3,655.00	65,424,500
アドバンテスト	65,800	1,041.00	68,497,800
エスベック	10,100	1,392.00	14,059,200
パナソニック デバイスSUNX	10,100	548.00	5,534,800
キーエンス	21,700	58,180.00	1,262,506,000
日置電機	5,500	2,226.00	12,243,000
シスメックス	74,200	6,480.00	480,816,000
日本マイクロニクス	12,900	913.00	11,777,700
メガチップス	10,900	1,056.00	11,510,400
OBARA GROUP	6,300	4,385.00	27,625,500
コーセル	12,900	983.00	12,680,700
新日本無線	8,500	378.00	3,213,000
オブテックス	7,300	2,759.00	20,140,700
千代田インテグレ	5,200	2,571.00	13,369,200
レーザーテック	11,400	1,338.00	15,253,200
スタンレー電気	68,700	2,543.00	174,704,100
岩崎電気	38,000	186.00	7,068,000
ウシオ電機	58,300	1,588.00	92,580,400
ハリオス テクノ ホールディング	10,800	381.00	4,114,800
日本セラミック	6,000	1,847.00	11,082,000
遠藤照明	6,000	1,048.00	6,288,000
日本デジタル研究所	8,300	1,565.00	12,989,500
古河電池	8,000	621.00	4,968,000
山一電機	9,300	587.00	5,459,100
図研	7,800	1,170.00	9,126,000
日本電子	39,000	543.00	21,177,000
カシオ計算機	96,000	2,115.00	203,040,000
ファナック	98,000	16,900.00	1,656,200,000
日本シイエムケイ	23,600	346.00	8,165,600
エンプラス	5,000	3,870.00	19,350,000
大真空	27,000	205.00	5,535,000
ローム	47,100	4,825.00	227,257,500
浜松ホトニクス	74,500	2,796.00	208,302,000
三井ハイテック	14,900	560.00	8,344,000
新光電気工業	35,500	658.00	23,359,000
京セラ	157,100	5,036.00	791,155,600
太陽誘電	46,700	1,152.00	53,798,400
村田製作所	100,400	14,095.00	1,415,138,000
ユーシン	13,900	660.00	9,174,000
双葉電子工業	16,300	1,499.00	24,433,700
北陸電気工業	44,000	127.00	5,588,000
ニチコン	29,700	766.00	22,750,200

日本ケミコン	81,000	151.00	12,231,000	
K O A	13,300	901.00	11,983,300	
市光工業	28,000	186.00	5,208,000	
小糸製作所	57,300	4,845.00	277,618,500	
ミツバ	16,300	1,518.00	24,743,400	
スター精密	18,200	1,290.00	23,478,000	
S C R E E Nホールディングス	99,000	845.00	83,655,000	
キャノン電子	8,300	1,682.00	13,960,600	
キャノン	515,100	3,325.00	1,712,707,500	
リコー	309,400	1,167.00	361,069,800	
東京エレクトロン	86,100	6,964.00	599,600,400	
トヨタ紡織	33,600	1,784.00	59,942,400	
鬼怒川ゴム工業	24,000	536.00	12,864,000	
ユニプレス	20,700	1,806.00	37,384,200	
豊田自動織機	86,800	4,900.00	425,320,000	
モリタホールディングス	16,500	1,225.00	20,212,500	
三櫻工業	15,600	581.00	9,063,600	
デンソー	236,400	4,307.00	1,018,174,800	
東海理化電機製作所	28,200	2,457.00	69,287,400	
三井造船	379,000	145.00	54,955,000	
川崎重工業	744,000	314.00	233,616,000	
名村造船所	29,200	681.00	19,885,200	
日本車輛製造	46,000	241.00	11,086,000	
ニチユ三菱フォークリフト	13,500	460.00	6,210,000	
近畿車輛	20,000	289.00	5,780,000	
日産自動車	1,344,100	990.60	1,331,465,460	
いすゞ自動車	277,300	1,140.00	316,122,000	
トヨタ自動車	1,191,300	6,180.00	7,362,234,000	代用有価証券 500,000株
日野自動車	136,200	1,181.00	160,852,200	
三菱自動車工業	380,000	834.00	316,920,000	
エフテック	6,400	1,030.00	6,592,000	
武蔵精密工業	10,300	2,145.00	22,093,500	
日産車体	46,900	1,190.00	55,811,000	
新明和工業	42,000	802.00	33,684,000	
極東開発工業	19,300	1,077.00	20,786,100	
日信工業	21,100	1,430.00	30,173,000	
トピー工業	80,000	221.00	17,680,000	
ティラド	49,000	164.00	8,036,000	
曙ブレーキ工業	56,000	242.00	13,552,000	
タチエス	15,300	1,522.00	23,286,600	
N O K	46,600	1,938.00	90,310,800	
フタバ産業	29,800	501.00	14,929,800	

K Y B	107,000	301.00	32,207,000
シロキ工業	26,000	334.00	8,684,000
大同メタル工業	14,900	779.00	11,607,100
プレス工業	51,800	400.00	20,720,000
ミクニ	13,200	329.00	4,342,800
カルソニックカンセイ	72,000	769.00	55,368,000
太平洋工業	20,700	1,009.00	20,886,300
ケーヒン	21,900	1,602.00	35,083,800
河西工業	12,000	1,256.00	15,072,000
アイシン精機	96,000	4,530.00	434,880,000
富士機工	13,900	425.00	5,907,500
マツダ	303,600	1,676.00	508,833,600
ダイハツ工業	114,400	1,642.00	187,844,800
今仙電機製作所	10,000	1,048.00	10,480,000
本田技研工業	862,000	3,033.00	2,614,446,000
スズキ	200,300	2,916.00	584,074,800
富士重工業	302,500	3,740.00	1,131,350,000
ヤマハ発動機	135,200	1,890.00	255,528,000
ショーワ	24,900	924.00	23,007,600
T B K	17,100	372.00	6,361,200
エクセディ	12,600	2,312.00	29,131,200
豊田合成	34,900	2,265.00	79,048,500
愛三工業	17,200	927.00	15,944,400
ヨロズ	9,000	2,235.00	20,115,000
エフ・シー・シー	15,600	1,901.00	29,655,600
シマノ	38,600	17,980.00	694,028,000
テイ・エス テック	22,400	2,598.00	58,195,200
ジャムコ	4,500	2,558.00	11,511,000
テルモ	146,400	3,815.00	558,516,000
日機装	35,400	820.00	29,028,000
島津製作所	123,000	1,793.00	220,539,000
J M S	23,000	296.00	6,808,000
長野計器	8,600	595.00	5,117,000
ブイ・テクノロジー	2,500	3,685.00	9,212,500
東京計器	34,000	160.00	5,440,000
愛知時計電機	18,000	303.00	5,454,000
東京精密	18,200	2,150.00	39,130,000
マニー	8,800	1,645.00	14,476,000
ニコン	178,200	1,700.00	302,940,000
トプコン	31,900	1,171.00	37,354,900
オリンパス	142,500	4,115.00	586,387,500
理研計器	8,800	1,071.00	9,424,800

タムロン	7,700	1,759.00	13,544,300
HOYA	222,800	4,181.00	931,526,800
ノーリツ鋼機	11,100	411.00	4,562,100
エー・アンド・デイ	12,400	383.00	4,749,200
シチズンホールディングス	117,800	655.00	77,159,000
リズム時計工業	50,000	139.00	6,950,000
大研医器	8,200	893.00	7,322,600
メニコン	4,800	3,095.00	14,856,000
松風	5,500	1,291.00	7,100,500
セイコーホールディングス	61,000	435.00	26,535,000
ニプロ	71,500	1,074.00	76,791,000
スノーピーク	900	3,525.00	3,172,500
パラマウントベッドホールディングス	10,000	3,660.00	36,600,000
ニホンフラッシュ	3,500	999.00	3,496,500
前田工織	11,200	970.00	10,864,000
永大産業	16,000	398.00	6,368,000
アートネイチャー	8,700	942.00	8,195,400
ダンロップスポーツ	7,300	950.00	6,935,000
バンダイナムコホールディングス	98,900	2,267.00	224,206,300
共立印刷	21,400	286.00	6,120,400
SHOEI	5,200	1,843.00	9,583,600
フランスベッドホールディングス	12,700	961.00	12,204,700
パイロットコーポレーション	16,500	3,820.00	63,030,000
萩原工業	2,500	2,077.00	5,192,500
トッパン・フォームズ	16,100	1,361.00	21,912,100
フジシールインターナショナル	11,600	3,700.00	42,920,000
タカラトミー	31,300	765.00	23,944,500
廣濟堂	11,900	317.00	3,772,300
アーク	46,900	84.00	3,939,600
プロネクサス	9,800	1,119.00	10,966,200
ウッドワン	20,000	235.00	4,700,000
大建工業	41,000	243.00	9,963,000
凸版印刷	270,000	982.00	265,140,000
大日本印刷	283,000	993.00	281,019,000
図書印刷	19,000	467.00	8,873,000
共同印刷	34,000	336.00	11,424,000
日本写真印刷	16,100	2,064.00	33,230,400
宝印刷	5,600	1,260.00	7,056,000
アシックス	89,200	2,032.00	181,254,400
ツツミ	4,800	2,339.00	11,227,200
小松ウオール工業	3,700	1,734.00	6,415,800
ヤマハ	70,000	3,085.00	215,950,000

河合楽器製作所	4,200	1,922.00	8,072,400
クリナップ	12,200	720.00	8,784,000
ピジョン	53,900	2,533.00	136,528,700
キングジム	8,400	749.00	6,291,600
リンテック	22,600	2,145.00	48,477,000
T A S A K I	2,200	1,330.00	2,926,000
イトーキ	20,500	728.00	14,924,000
任天堂	59,000	16,540.00	975,860,000
三菱鉛筆	7,000	4,395.00	30,765,000
タカラスタANDARD	38,000	954.00	36,252,000
コクヨ	49,800	1,118.00	55,676,400
ナカバヤシ	26,000	259.00	6,734,000
グローブライド	5,300	1,438.00	7,621,400
岡村製作所	32,900	1,002.00	32,965,800
美津濃	50,000	512.00	25,600,000
アデランス	17,800	565.00	10,057,000
東京電力	811,700	572.00	464,292,400
中部電力	293,300	1,458.50	427,778,050
関西電力	391,100	1,279.00	500,216,900
中国電力	131,300	1,547.00	203,121,100
北陸電力	93,600	1,674.00	156,686,400
東北電力	238,600	1,476.00	352,173,600
四国電力	86,100	1,634.00	140,687,400
九州電力	211,000	1,133.00	239,063,000
北海道電力	89,200	1,002.00	89,378,400
沖縄電力	10,200	2,870.00	29,274,000
電源開発	81,600	3,385.00	276,216,000
イーレックス	2,100	1,657.00	3,479,700
東京瓦斯	1,070,000	536.30	573,841,000
大阪瓦斯	993,000	436.10	433,047,300
東邦瓦斯	241,000	771.00	185,811,000
北海道瓦斯	31,000	275.00	8,525,000
広島ガス	19,800	407.00	8,058,600
西部瓦斯	108,000	249.00	26,892,000
静岡ガス	27,600	748.00	20,644,800
メタウォーター	6,200	2,439.00	15,121,800
S B S ホールディングス	10,200	708.00	7,221,600
東武鉄道	508,000	581.00	295,148,000
相鉄ホールディングス	164,000	683.00	112,012,000
東京急行電鉄	557,000	905.00	504,085,000
京浜急行電鉄	262,000	994.00	260,428,000
小田急電鉄	306,000	1,295.00	396,270,000

京王電鉄	266,000	1,046.00	278,236,000
京成電鉄	143,000	1,596.00	228,228,000
富士急行	27,000	1,217.00	32,859,000
新京成電鉄	19,000	417.00	7,923,000
東日本旅客鉄道	175,000	9,654.00	1,689,450,000
西日本旅客鉄道	92,300	6,476.00	597,734,800
東海旅客鉄道	85,700	20,380.00	1,746,566,000
西武ホールディングス	76,300	2,242.00	171,064,600
鴻池運輸	13,700	1,255.00	17,193,500
西日本鉄道	124,000	816.00	101,184,000
ハマキョウレックス	7,600	1,803.00	13,702,800
サカイ引越センター	4,100	2,632.00	10,791,200
近鉄グループホールディングス	960,000	476.00	456,960,000
阪急阪神ホールディングス	641,000	704.00	451,264,000
南海電気鉄道	216,000	653.00	141,048,000
京阪電気鉄道	215,000	758.00	162,970,000
神戸電鉄	30,000	356.00	10,680,000
名古屋鉄道	348,000	537.00	186,876,000
山陽電気鉄道	37,000	454.00	16,798,000
日本通運	369,000	508.00	187,452,000
ヤマトホールディングス	177,100	2,292.50	406,001,750
山九	127,000	528.00	67,056,000
丸全昭和運輸	32,000	407.00	13,024,000
センコー	43,000	712.00	30,616,000
トナミホールディングス	23,000	260.00	5,980,000
ニッコンホールディングス	31,500	1,973.00	62,149,500
福山通運	60,000	531.00	31,860,000
セイノーホールディングス	68,100	1,214.00	82,673,400
神奈川中央交通	14,000	672.00	9,408,000
日立物流	19,300	1,701.00	32,829,300
丸和運輸機関	2,500	2,042.00	5,105,000
C & F ロジホールディングス	10,900	843.00	9,188,700
日本郵船	857,000	211.00	180,827,000
商船三井	466,000	210.00	97,860,000
川崎汽船	421,000	190.00	79,990,000
N S ユナイテッド海運	51,000	153.00	7,803,000
飯野海運	51,400	442.00	22,718,800
乾汽船	9,700	738.00	7,158,600
日本航空	183,500	3,939.00	722,806,500
A N A ホールディングス	1,778,000	310.00	551,180,000
パスコ	9,000	387.00	3,483,000
トランコム	2,800	6,520.00	18,256,000



日新	41,000	291.00	11,931,000
三菱倉庫	68,000	1,472.00	100,096,000
三井倉庫ホールディングス	57,000	269.00	15,333,000
住友倉庫	72,000	553.00	39,816,000
澁澤倉庫	31,000	273.00	8,463,000
東陽倉庫	28,000	234.00	6,552,000
日本トランスシティ	26,000	352.00	9,152,000
安田倉庫	10,100	705.00	7,120,500
東洋埠頭	36,000	145.00	5,220,000
上組	114,000	1,033.00	117,762,000
キューソー流通システム	3,200	2,157.00	6,902,400
郵船ロジスティクス	8,600	1,236.00	10,629,600
近鉄エクスプレス	16,700	1,536.00	25,651,200
東海運	15,300	270.00	4,131,000
エーアイティー	6,000	997.00	5,982,000
NEC ネットエスアイ	11,700	1,758.00	20,568,600
システナ	9,700	1,535.00	14,889,500
デジタルアーツ	5,100	1,979.00	10,092,900
新日鉄住金ソリューションズ	15,800	1,985.00	31,363,000
コア	4,500	1,219.00	5,485,500
ITホールディングス	31,600	2,524.00	79,758,400
電算システム	4,200	1,506.00	6,325,200
グリー	57,000	560.00	31,920,000
コーエーテクモホールディングス	22,400	1,641.00	36,758,400
三菱総合研究所	4,100	3,285.00	13,468,500
ファインデックス	6,800	898.00	6,106,400
K L a b	15,600	524.00	8,174,400
ポルトゥウィン・ピットクルーホールディングス	7,500	949.00	7,117,500
ネクソン	90,800	1,637.00	148,639,600
アイスタイル	15,000	762.00	11,430,000
エイチーム	3,900	1,449.00	5,651,100
テクノスジャパン	1,300	2,597.00	3,376,100
コロプラ	26,300	2,037.00	53,573,100
モバイルクリエイト	8,700	388.00	3,375,600
ブロードリーフ	11,000	1,232.00	13,552,000
ハーツユナイテッドグループ	3,200	1,915.00	6,128,000
ブイキューブ	5,400	1,066.00	5,756,400
VOYAGE GROUP	2,700	1,056.00	2,851,200
オブティム	700	4,095.00	2,866,500
ティーガイア	10,000	1,158.00	11,580,000
日本アジアグループ	10,300	497.00	5,119,100
豆蔵ホールディングス	8,800	618.00	5,438,400

テクマトリックス	5,200	1,485.00	7,722,000
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	165,600	284.00	47,030,400
GMOペイメントゲートウェイ	8,300	5,620.00	46,646,000
インターネットイニシアティブ	15,500	2,140.00	33,170,000
さくらインターネット	4,900	1,814.00	8,888,600
SRAホールディングス	5,800	2,279.00	13,218,200
朝日ネット	12,500	482.00	6,025,000
コムチュア	2,200	1,950.00	4,290,000
gumi	10,300	534.00	5,500,200
フェイス	4,100	1,158.00	4,747,800
野村総合研究所	66,200	3,850.00	254,870,000
サイバネットシステム	8,900	662.00	5,891,800
インテージホールディングス	6,100	1,441.00	8,790,100
クレスコ	3,000	1,755.00	5,265,000
フジ・メディア・ホールディングス	98,600	1,303.00	128,475,800
オービック	32,700	5,520.00	180,504,000
ジャストシステム	17,800	853.00	15,183,400
ヤフー	677,800	439.00	297,554,200
トレンドマイクロ	45,900	4,180.00	191,862,000
日本オラクル	15,200	5,180.00	78,736,000
アルファシステムズ	4,000	1,675.00	6,700,000
フューチャーアーキテクト	14,300	773.00	11,053,900
CAC Holdings	9,300	729.00	6,779,700
オービックビジネスコンサルタント	4,900	4,625.00	22,662,500
伊藤忠テクノソリューションズ	21,800	2,219.00	48,374,200
アイティフォー	15,700	461.00	7,237,700
大塚商会	25,400	5,470.00	138,938,000
サイボウズ	19,300	294.00	5,674,200
電通国際情報サービス	6,100	2,098.00	12,797,800
EMシステムズ	2,200	2,617.00	5,757,400
ウェザーニューズ	3,500	3,560.00	12,460,000
CIJ	12,900	435.00	5,611,500
WOWOW	4,800	2,539.00	12,187,200
フュージョンパートナー	7,800	502.00	3,915,600
イマジカ・ロボットホールディングス	10,600	374.00	3,964,400
ネットワンシステムズ	41,200	596.00	24,555,200
アルゴグラフィックス	5,500	1,753.00	9,641,500
マーベラス	16,700	832.00	13,894,400
エイベックス・グループ・ホールディングス	17,800	1,287.00	22,908,600
日本ユニシス	26,100	1,355.00	35,365,500
兼松エレクトロニクス	7,000	1,860.00	13,020,000
東京放送ホールディングス	56,900	1,736.00	98,778,400

日本テレビホールディングス	86,400	1,970.00	170,208,000
朝日放送	11,400	690.00	7,866,000
テレビ朝日ホールディングス	26,200	2,014.00	52,766,800
スカパーJ S A Tホールディングス	71,400	654.00	46,695,600
テレビ東京ホールディングス	8,800	1,855.00	16,324,000
U - N E X T	2,700	926.00	2,500,200
コネクシオ	9,500	1,100.00	10,450,000
日本通信	54,500	174.00	9,483,000
日本電信電話	730,700	4,844.00	3,539,510,800
K D D I	960,200	2,974.50	2,856,114,900
光通信	11,400	7,780.00	88,692,000
N T T ドコモ	729,000	2,608.50	1,901,596,500
エムティーアイ	13,300	729.00	9,695,700
G M O インターネット	35,200	1,227.00	43,190,400
カドカワ	29,500	1,801.00	53,129,500
学研ホールディングス	38,000	240.00	9,120,000
ゼンリン	12,800	1,829.00	23,411,200
アイネット	7,400	1,086.00	8,036,400
松竹	63,000	1,009.00	63,567,000
東宝	67,400	2,775.00	187,035,000
東映	35,000	895.00	31,325,000
エヌ・ティ・ティ・データ	58,500	5,620.00	328,770,000
D T S	10,600	2,133.00	22,609,800
スクウェア・エニックス・ホールディングス	40,200	2,833.00	113,886,600
シーイーシー	7,500	1,101.00	8,257,500
カプコン	24,700	2,301.00	56,834,700
ジャステック	8,000	901.00	7,208,000
S C S K	22,600	4,395.00	99,327,000
アイネス	13,900	1,084.00	15,067,600
T K C	8,900	3,205.00	28,524,500
富士ソフト	14,100	2,315.00	32,641,500
N S D	19,900	1,606.00	31,959,400
コナミホールディングス	42,900	2,756.00	118,232,400
J B C C ホールディングス	11,000	662.00	7,282,000
ミロク情報サービス	9,200	919.00	8,454,800
ソフトバンクグループ	535,600	5,297.00	2,837,073,200
伊藤忠食品	2,600	4,165.00	10,829,000
エレマテック	4,900	2,176.00	10,662,400
J A L U X	3,600	2,067.00	7,441,200
あらた	4,700	2,182.00	10,255,400
東京エレクトロン デバイス	4,200	1,520.00	6,384,000
フィールズ	6,600	1,770.00	11,682,000

双日	594,300	229.00	136,094,700
アルフレッサ ホールディングス	118,400	1,982.00	234,668,800
横浜冷凍	23,300	1,013.00	23,602,900
アルコニックス	6,700	1,295.00	8,676,500
神戸物産	6,300	2,333.00	14,697,900
あい ホールディングス	16,900	2,792.00	47,184,800
ダイワボウホールディングス	85,000	203.00	17,255,000
マクニカ・富士エレホールディングス	16,600	1,356.00	22,509,600
バイタルケーエスケー・ホールディングス	16,000	958.00	15,328,000
U K Cホールディングス	6,100	2,114.00	12,895,400
T O K A Iホールディングス	41,900	571.00	23,924,900
三洋貿易	5,900	1,304.00	7,693,600
ウイン・パートナーズ	3,700	1,452.00	5,372,400
シップヘルスケアホールディングス	19,200	2,670.00	51,264,000
小野建	9,500	987.00	9,376,500
佐島電機	9,800	690.00	6,762,000
伯東	8,500	969.00	8,236,500
コンドーテック	9,900	765.00	7,573,500
ナガイレーベン	13,800	1,954.00	26,965,200
三菱食品	10,000	3,020.00	30,200,000
松田産業	7,800	1,252.00	9,765,600
第一興商	16,800	4,520.00	75,936,000
メディカルホールディングス	94,300	1,681.00	158,518,300
アドヴァン	10,900	1,008.00	10,987,200
S P K	3,200	1,919.00	6,140,800
萩原電気	3,100	1,877.00	5,818,700
アズワン	7,500	3,970.00	29,775,000
尾家産業	4,600	835.00	3,841,000
シモジマ	7,700	1,082.00	8,331,400
ドウシシャ	11,100	2,140.00	23,754,000
小津産業	2,900	2,145.00	6,220,500
高速	7,600	885.00	6,726,000
黒田電気	17,600	1,608.00	28,300,800
丸文	10,300	704.00	7,251,200
ハピネット	9,700	937.00	9,088,900
エクセル	5,200	1,309.00	6,806,800
マルカキカイ	4,200	1,398.00	5,871,600
ガリバーインターナショナル	25,600	1,114.00	28,518,400
日本エム・ディ・エム	9,500	558.00	5,301,000
進和	6,800	1,398.00	9,506,400
シークス	6,100	2,889.00	17,622,900
オーハシテクニカ	6,600	1,284.00	8,474,400

白銅	4,600	1,013.00	4,659,800
伊藤忠商事	741,800	1,401.00	1,039,261,800
丸紅	931,600	589.00	548,712,400
高島	25,000	160.00	4,000,000
長瀬産業	56,900	1,200.00	68,280,000
蝶理	6,800	1,416.00	9,628,800
豊田通商	104,600	2,386.00	249,575,600
三共生興	19,200	399.00	7,660,800
兼松	198,000	158.00	31,284,000
三井物産	854,800	1,358.00	1,160,818,400
日本紙パルプ商事	47,000	314.00	14,758,000
日立ハイテクノロジーズ	32,800	3,005.00	98,564,000
カメイ	12,500	978.00	12,225,000
スターゼン	3,800	3,115.00	11,837,000
山善	36,100	917.00	33,103,700
住友商事	595,600	1,144.50	681,664,200
内田洋行	27,000	377.00	10,179,000
三菱商事	709,200	1,886.00	1,337,551,200
第一実業	24,000	468.00	11,232,000
キャノンマーケティングジャパン	27,100	1,948.00	52,790,800
西華産業	38,000	222.00	8,436,000
佐藤商事	11,400	640.00	7,296,000
菱洋エレクトロ	11,900	1,097.00	13,054,300
東京産業	13,200	403.00	5,319,600
ユアサ商事	8,800	2,436.00	21,436,800
神鋼商事	28,000	201.00	5,628,000
阪和興業	96,000	454.00	43,584,000
カナデン	10,900	862.00	9,395,800
菱電商事	17,000	634.00	10,778,000
フルサト工業	5,800	1,574.00	9,129,200
岩谷産業	114,000	615.00	70,110,000
すてきナイスグループ	50,000	134.00	6,700,000
極東貿易	20,000	227.00	4,540,000
三愛石油	24,000	955.00	22,920,000
稲畑産業	22,300	1,211.00	27,005,300
G S I クレオス	29,000	117.00	3,393,000
ワキタ	20,300	817.00	16,585,100
東邦ホールディングス	30,500	2,342.00	71,431,000
サンゲツ	34,700	1,934.00	67,109,800
ミツウロコグループホールディングス	17,500	562.00	9,835,000
シナネンホールディングス	24,000	453.00	10,872,000
伊藤忠エネクス	24,200	859.00	20,787,800

サンリオ	29,500	2,168.00	63,956,000
サンワテクノス	8,200	678.00	5,559,600
リョーサン	15,300	2,902.00	44,400,600
新光商事	11,700	1,064.00	12,448,800
トーホー	5,100	2,214.00	11,291,400
三信電気	13,600	851.00	11,573,600
東陽テクニカ	14,300	1,062.00	15,186,600
モスフードサービス	12,200	3,080.00	37,576,000
加賀電子	9,400	1,294.00	12,163,600
ソーダニッカ	15,400	451.00	6,945,400
立花エレテック	7,900	1,098.00	8,674,200
PALTA C	15,000	1,770.00	26,550,000
三谷産業	14,100	309.00	4,356,900
ヤマタネ	54,000	162.00	8,748,000
日鉄住金物産	60,000	332.00	19,920,000
トラスコ中山	10,700	3,960.00	42,372,000
オートバックスセブン	36,600	1,916.00	70,125,600
加藤産業	14,500	2,715.00	39,367,500
イノテック	12,700	433.00	5,499,100
イエローハット	9,100	1,900.00	17,290,000
J Kホールディングス	13,200	456.00	6,019,200
日伝	4,400	2,744.00	12,073,600
杉本商事	6,900	1,137.00	7,845,300
因幡電機産業	13,000	3,455.00	44,915,000
バイテックホールディングス	4,200	961.00	4,036,200
ミスミグループ本社	106,300	1,550.00	164,765,000
タキヒヨー	21,000	453.00	9,513,000
スズケン	43,000	3,695.00	158,885,000
ジェコス	7,600	922.00	7,007,200
ローソン	35,800	9,200.00	329,360,000
サンエー	6,400	4,645.00	29,728,000
カワチ薬品	7,500	1,908.00	14,310,000
エービーシー・マート	12,100	6,630.00	80,223,000
ハードオフコーポレーション	5,600	1,627.00	9,111,200
アスクル	11,600	3,390.00	39,324,000
ゲオホールディングス	18,200	1,685.00	30,667,000
アダストリア	8,800	6,030.00	53,064,000
ジーフット	6,900	838.00	5,782,200
くらコーポレーション	5,600	5,080.00	28,448,000
キャンドゥ	6,600	1,423.00	9,391,800
パル	5,700	2,430.00	13,851,000
エディオン	39,500	883.00	34,878,500

サーラコーポレーション	10,900	584.00	6,365,600
ハローズ	3,100	2,696.00	8,357,600
あみやき亭	2,200	4,365.00	9,603,000
ひらまつ	16,100	612.00	9,853,200
ゲンキー	2,200	2,670.00	5,874,000
大黒天物産	2,600	4,740.00	12,324,000
ハニーズ	9,600	1,203.00	11,548,800
アルペン	8,300	1,773.00	14,715,900
クオール	9,900	1,408.00	13,939,200
ジェイアイエヌ	6,500	4,800.00	31,200,000
ビックカメラ	48,400	899.00	43,511,600
D C Mホールディングス	46,600	871.00	40,588,600
MonotaRO	33,700	2,433.00	81,992,100
アークランドサービス	3,400	2,698.00	9,173,200
J.フロント リテイリング	119,300	1,358.00	162,009,400
ドトール・日レスホールディングス	16,500	1,765.00	29,122,500
マツモトキヨシホールディングス	19,600	5,150.00	100,940,000
ブロンコビリー	4,100	2,654.00	10,881,400
スタートトゥデイ	29,000	3,445.00	99,905,000
トレジャー・ファクトリー	3,400	1,204.00	4,093,600
物語コーポレーション	2,900	5,010.00	14,529,000
ココカラファイン	9,800	4,305.00	42,189,000
三越伊勢丹ホールディングス	187,500	1,321.00	247,687,500
ウエルシアホールディングス	8,100	5,570.00	45,117,000
クリエイティブSDホールディングス	13,900	2,336.00	32,470,400
チムニー	2,700	2,697.00	7,281,900
シュッピン	4,100	961.00	3,940,100
ジョイフル本田	15,400	2,232.00	34,372,800
ホットランド	3,100	1,036.00	3,211,600
すかいらーく	28,900	1,517.00	43,841,300
綿半ホールディングス	3,200	1,329.00	4,252,800
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホール	31,000	972.00	30,132,000
ブックオフコーポレーション	7,900	894.00	7,062,600
あさひ	8,200	1,258.00	10,315,600
日本調剤	2,600	3,530.00	9,178,000
コスモス薬品	4,800	16,930.00	81,264,000
セブン&アイ・ホールディングス	395,600	4,687.00	1,854,177,200
薬王堂	1,600	2,574.00	4,118,400
クリエイティブ・レストランツ・ホールディング	8,600	2,907.00	25,000,200
ツルハホールディングス	21,700	9,250.00	200,725,000
サンマルクホールディングス	7,300	2,856.00	20,848,800
トリドール	11,700	2,256.00	26,395,200

クスリのアオキ	8,400	4,880.00	40,992,000
メディカルシステムネットワーク	12,400	442.00	5,480,800
総合メディカル	4,700	3,495.00	16,426,500
カッパ・クリエイト	14,000	1,125.00	15,750,000
ライトオン	7,600	1,469.00	11,164,400
良品計画	10,900	23,150.00	252,335,000
三城ホールディングス	17,200	441.00	7,585,200
アルビス	3,400	1,913.00	6,504,200
コナカ	13,300	546.00	7,261,800
G - 7ホールディングス	3,700	1,135.00	4,199,500
コジマ	20,100	227.00	4,562,700
コーナン商事	13,600	1,588.00	21,596,800
エコス	4,600	1,189.00	5,469,400
ドンキホーテホールディングス	61,100	3,710.00	226,681,000
西松屋チェーン	18,800	952.00	17,897,600
ゼンショーホールディングス	49,300	1,386.00	68,329,800
幸楽苑ホールディングス	6,700	1,556.00	10,425,200
サイゼリヤ	15,500	2,256.00	34,968,000
V Tホールディングス	32,700	544.00	17,788,800
魚力	4,400	1,278.00	5,623,200
ユナイテッドアローズ	13,500	4,810.00	64,935,000
ハイデイ日高	7,300	3,450.00	25,185,000
京都きもの友禅	7,800	846.00	6,598,800
コロワイド	31,100	1,705.00	53,025,500
ピーシーデポコーポレーション	8,800	1,009.00	8,879,200
壱番屋	4,300	5,800.00	24,940,000
スギホールディングス	17,000	5,490.00	93,330,000
スクロール	18,500	408.00	7,548,000
ヨンドシーホールディングス	7,400	2,436.00	18,026,400
ファミリーマート	28,900	5,710.00	165,019,000
木曽路	11,700	2,192.00	25,646,400
サトレストランシステムズ	14,200	787.00	11,175,400
千趣会	19,200	706.00	13,555,200
ケーヨー	19,600	499.00	9,780,400
上新電機	23,000	878.00	20,194,000
日本瓦斯	11,000	2,201.00	24,211,000
ベスト電器	37,800	115.00	4,347,000
ロイヤルホールディングス	15,500	2,010.00	31,155,000
いなげや	10,700	1,244.00	13,310,800
島忠	24,600	2,537.00	62,410,200
チヨダ	11,100	2,821.00	31,313,100
ライフコーポレーション	6,100	2,423.00	14,780,300



リンガーハット	8,800	2,351.00	20,688,800
AOKIホールディングス	21,600	1,256.00	27,129,600
オークワ	15,000	989.00	14,835,000
コメリ	15,000	2,223.00	33,345,000
青山商事	18,200	4,110.00	74,802,000
しまむら	11,000	11,970.00	131,670,000
高島屋	137,000	903.00	123,711,000
松屋	19,500	896.00	17,472,000
エイチ・ツー・オー リテイリング	48,700	1,863.00	90,728,100
近鉄百貨店	41,000	300.00	12,300,000
パルコ	10,700	891.00	9,533,700
丸井グループ	116,100	1,486.00	172,524,600
アクシアル リテイリング	7,400	3,455.00	25,567,000
イオン	389,200	1,391.00	541,377,200
ユニーグループ・ホールディングス	92,200	770.00	70,994,000
イズミ	18,800	4,320.00	81,216,000
平和堂	19,000	2,115.00	40,185,000
フジ	10,700	2,064.00	22,084,800
ヤオコー	10,600	4,340.00	46,004,000
ゼビオホールディングス	12,700	1,743.00	22,136,100
ケーズホールディングス	20,100	3,575.00	71,857,500
Olympicグループ	9,300	572.00	5,319,600
日産東京販売ホールディングス	19,300	287.00	5,539,100
アインホールディングス	11,400	4,820.00	54,948,000
元気寿司	3,800	2,192.00	8,329,600
ヤマダ電機	287,400	520.00	149,448,000
アークランドサカモト	16,600	1,056.00	17,529,600
ニトリホールディングス	40,800	8,320.00	339,456,000
グルメ杵屋	8,000	998.00	7,984,000
愛眼	17,200	206.00	3,543,200
吉野家ホールディングス	36,200	1,411.00	51,078,200
松屋フーズ	4,800	2,761.00	13,252,800
サガミチェーン	14,000	1,233.00	17,262,000
王将フードサービス	7,000	3,900.00	27,300,000
プレナス	10,300	1,931.00	19,889,300
ミニストップ	7,000	1,983.00	13,881,000
アークス	17,400	2,190.00	38,106,000
バローホールディングス	20,800	2,411.00	50,148,800
ベルク	4,700	3,830.00	18,001,000
大庄	6,200	1,455.00	9,021,000
ファーストリテイリング	18,900	31,960.00	604,044,000
サンドラッグ	20,000	7,560.00	151,200,000

サクスパー ホールディングス	9,000	1,472.00	13,248,000
ヤマザワ	3,500	1,663.00	5,820,500
やまや	2,500	1,920.00	4,800,000
ペルーナ	24,200	509.00	12,317,800
じもとホールディングス	73,400	150.00	11,010,000
足利ホールディングス	72,500	328.00	23,780,000
東京ＴＹフィナンシャルグループ	13,300	2,642.00	35,138,600
九州フィナンシャルグループ	144,300	677.00	97,691,100
ゆうちょ銀行	180,600	1,302.00	235,141,200
新生銀行	814,000	144.00	117,216,000
あおぞら銀行	597,000	365.00	217,905,000
三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	7,585,400	503.00	3,815,456,200
りそなホールディングス	1,101,900	412.80	454,864,320
三井住友トラスト・ホールディングス	1,966,000	336.40	661,362,400
三井住友フィナンシャルグループ	757,200	3,218.00	2,436,669,600
第四銀行	118,000	378.00	44,604,000
北越銀行	107,000	189.00	20,223,000
西日本シティ銀行	307,000	205.00	62,935,000
千葉銀行	361,000	553.00	199,633,000
横浜銀行	630,000	507.20	319,536,000
常陽銀行	340,000	399.00	135,660,000
群馬銀行	208,000	505.00	105,040,000
武蔵野銀行	15,000	2,984.00	44,760,000
千葉興業銀行	27,600	473.00	13,054,800
筑波銀行	40,300	299.00	12,049,700
七十七銀行	147,000	427.00	62,769,000
青森銀行	72,000	301.00	21,672,000
秋田銀行	65,000	279.00	18,135,000
山形銀行	55,000	393.00	21,615,000
岩手銀行	6,800	3,780.00	25,704,000
東邦銀行	85,000	330.00	28,050,000
東北銀行	56,000	142.00	7,952,000
みちのく銀行	51,000	170.00	8,670,000
ふくおかフィナンシャルグループ	406,000	375.00	152,250,000
静岡銀行	274,000	855.00	234,270,000
十六銀行	118,000	367.00	43,306,000
スルガ銀行	89,300	1,884.00	168,241,200
八十二銀行	167,000	517.00	86,339,000
山梨中央銀行	60,000	402.00	24,120,000
大垣共立銀行	126,000	356.00	44,856,000
福井銀行	86,000	189.00	16,254,000
北國銀行	108,000	285.00	30,780,000

清水銀行	3,200	2,182.00	6,982,400
富山銀行	1,300	3,025.00	3,932,500
滋賀銀行	89,000	469.00	41,741,000
南都銀行	93,000	318.00	29,574,000
百五銀行	85,000	408.00	34,680,000
京都銀行	180,000	755.00	135,900,000
紀陽銀行	37,600	1,231.00	46,285,600
三重銀行	41,000	194.00	7,954,000
ほくほくフィナンシャルグループ	632,000	171.00	108,072,000
広島銀行	277,000	429.00	118,833,000
山陰合同銀行	57,900	669.00	38,735,100
中国銀行	65,500	1,228.00	80,434,000
鳥取銀行	34,000	170.00	5,780,000
伊予銀行	99,100	805.00	79,775,500
百十四銀行	105,000	331.00	34,755,000
四国銀行	74,000	215.00	15,910,000
阿波銀行	78,000	521.00	40,638,000
大分銀行	57,000	344.00	19,608,000
宮崎銀行	66,000	274.00	18,084,000
佐賀銀行	60,000	203.00	12,180,000
十八銀行	62,000	230.00	14,260,000
沖縄銀行	7,800	3,555.00	27,729,000
琉球銀行	20,300	1,201.00	24,380,300
セブン銀行	353,600	484.00	171,142,400
みずほフィナンシャルグループ	13,315,700	173.00	2,303,616,100
高知銀行	41,000	110.00	4,510,000
山口フィナンシャルグループ	87,000	1,077.00	93,699,000
長野銀行	35,000	179.00	6,265,000
名古屋銀行	81,000	374.00	30,294,000
北洋銀行	142,100	291.00	41,351,100
愛知銀行	3,200	4,565.00	14,608,000
第三銀行	55,000	145.00	7,975,000
中京銀行	37,000	194.00	7,178,000
東日本銀行	48,000	271.00	13,008,000
大光銀行	35,000	194.00	6,790,000
愛媛銀行	57,000	220.00	12,540,000
トマト銀行	39,000	149.00	5,811,000
みなと銀行	90,000	157.00	14,130,000
京葉銀行	78,000	438.00	34,164,000
関西アーバン銀行	13,900	1,060.00	14,734,000
栃木銀行	53,000	425.00	22,525,000
北日本銀行	3,200	2,683.00	8,585,600

東和銀行	141,000	83.00	11,703,000
福島銀行	129,000	73.00	9,417,000
大東銀行	63,000	181.00	11,403,000
トモニホールディングス	74,800	342.00	25,581,600
フィデアホールディングス	61,600	181.00	11,149,600
池田泉州ホールディングス	100,500	393.00	39,496,500
F P G	28,800	922.00	26,553,600
S B I ホールディングス	113,200	1,029.00	116,482,800
ジャフコ	15,900	3,255.00	51,754,500
大和証券グループ本社	884,000	675.10	596,788,400
野村ホールディングス	1,817,600	508.90	924,976,640
岡三証券グループ	81,000	551.00	44,631,000
丸三証券	27,700	1,202.00	33,295,400
東洋証券	37,000	293.00	10,841,000
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	109,900	538.00	59,126,200
光世証券	23,000	142.00	3,266,000
水戸証券	28,900	326.00	9,421,400
いちよし証券	21,300	1,089.00	23,195,700
松井証券	48,600	963.00	46,801,800
だいこう証券ビジネス	3,900	782.00	3,049,800
マネックスグループ	110,200	283.00	31,186,600
カブドットコム証券	85,700	336.00	28,795,200
極東証券	13,000	1,338.00	17,394,000
岩井コスモホールディングス	8,800	1,070.00	9,416,000
藍澤証券	12,700	570.00	7,239,000
マネースクウェアHD	3,800	1,000.00	3,800,000
マネーパートナーズグループ	11,200	307.00	3,438,400
かんぽ生命保険	29,300	2,421.00	70,935,300
損保ジャパン日本興亜ホールディングス	209,800	3,090.00	648,282,000
アニコム ホールディングス	6,900	2,476.00	17,084,400
M S & A D インシュアランスグループホールディングス	282,400	2,933.50	828,420,400
ソニーフィナンシャルホールディングス	90,800	1,530.00	138,924,000
第一生命保険	605,200	1,355.50	820,348,600
東京海上ホールディングス	382,800	3,783.00	1,448,132,400
T & D ホールディングス	344,100	1,152.00	396,403,200
全国保証	24,800	3,420.00	84,816,000
クレディセゾン	71,500	1,883.00	134,634,500
アクリーティブ	9,600	361.00	3,465,600
芙蓉総合リース	10,800	4,730.00	51,084,000
興銀リース	17,800	1,853.00	32,983,400
東京センチュリーリース	21,800	3,780.00	82,404,000
日本証券金融	44,100	482.00	21,256,200

アイフル	158,800	292.00	46,369,600
ポケットカード	12,200	452.00	5,514,400
リコーリース	7,700	3,210.00	24,717,000
イオンフィナンシャルサービス	61,900	2,485.00	153,821,500
アコム	190,100	459.00	87,255,900
ジャックス	54,000	381.00	20,574,000
オリエントコーポレーション	408,400	188.00	76,779,200
日立キャピタル	22,400	2,400.00	53,760,000
アプラスフィナンシャル	50,700	88.00	4,461,600
オリックス	667,900	1,427.50	953,427,250
三菱UFJリース	237,200	489.00	115,990,800
日本取引所グループ	277,100	1,704.00	472,178,400
イー・ギャランティ	3,600	2,178.00	7,840,800
NECキャピタルソリューション	4,400	1,554.00	6,837,600
いちごグループホールディングス	78,500	345.00	27,082,500
日本駐車場開発	112,200	112.00	12,566,400
ヒューリック	196,900	962.00	189,417,800
三栄建築設計	4,600	1,113.00	5,119,800
野村不動産ホールディングス	62,800	1,939.00	121,769,200
三重交通グループホールディングス	19,700	435.00	8,569,500
サムティ	5,800	997.00	5,782,600
エー・ディー・ワークス	81,900	42.00	3,439,800
日本商業開発	3,500	1,732.00	6,062,000
プレサンスコーポレーション	3,400	3,425.00	11,645,000
ユニゾホールディングス	6,000	3,830.00	22,980,000
日本管理センター	6,700	1,599.00	10,713,300
フージャースホールディングス	16,100	439.00	7,067,900
オープンハウス	13,800	2,007.00	27,696,600
東急不動産ホールディングス	227,700	691.00	157,340,700
飯田グループホールディングス	86,600	2,021.00	175,018,600
パーク24	47,800	2,888.00	138,046,400
パラカ	4,400	1,348.00	5,931,200
三井不動産	501,000	2,621.00	1,313,121,000
三菱地所	702,000	2,154.00	1,512,108,000
平和不動産	18,100	1,168.00	21,140,800
東京建物	102,900	1,235.00	127,081,500
ダイビル	24,400	934.00	22,789,600
京阪神ビルディング	18,800	586.00	11,016,800
住友不動産	227,000	3,027.00	687,129,000
大京	170,000	178.00	30,260,000
テーオーシー	37,000	889.00	32,893,000
東京楽天地	19,000	475.00	9,025,000

レオパレス2 1	112,000	640.00	71,680,000
スターツコーポレーション	10,700	2,294.00	24,545,800
フジ住宅	14,600	670.00	9,782,000
空港施設	14,800	519.00	7,681,200
住友不動産販売	6,600	2,083.00	13,747,800
ゴールドクレスト	7,700	1,678.00	12,920,600
日神不動産	16,600	371.00	6,158,600
タカラレーベン	42,700	585.00	24,979,500
サンヨーハウジング名古屋	7,000	1,018.00	7,126,000
イオンモール	61,200	1,578.00	96,573,600
ファースト住建	4,500	1,294.00	5,823,000
トーセイ	15,200	623.00	9,469,600
エヌ・ティ・ティ都市開発	58,900	1,058.00	62,316,200
サンフロンティア不動産	11,800	969.00	11,434,200
エフ・ジェー・ネクスト	9,700	488.00	4,733,600
日本空港ビルデング	30,200	3,980.00	120,196,000
日本工営	36,000	366.00	13,176,000
ネクスト	29,000	1,104.00	32,016,000
ジェイエイシーリクルートメント	6,200	1,036.00	6,423,200
日本M&Aセンター	15,700	4,910.00	77,087,000
アコーディア・ゴルフ	28,500	1,132.00	32,262,000
タケエイ	9,900	731.00	7,236,900
トラスト・テック	2,300	2,412.00	5,547,600
パソナグループ	9,700	657.00	6,372,900
G C A サヴィアン	9,800	882.00	8,643,600
エス・エム・エス	12,700	1,778.00	22,580,600
テンプホールディングス	70,500	1,600.00	112,800,000
リニカル	6,700	1,544.00	10,344,800
クックパッド	22,500	1,988.00	44,730,000
エスクリ	5,900	560.00	3,304,000
学情	4,900	990.00	4,851,000
スタジオアリス	5,400	2,148.00	11,599,200
シミックホールディングス	5,400	1,548.00	8,359,200
総合警備保障	33,400	5,660.00	189,044,000
カカクコム	73,100	2,062.00	150,732,200
アイロムグループ	3,500	788.00	2,758,000
ルネサンス	7,000	1,186.00	8,302,000
ディップ	11,200	2,110.00	23,632,000
オプトホールディング	8,100	553.00	4,479,300
新日本科学	12,000	360.00	4,320,000
ツクイ	12,500	1,327.00	16,587,500
キャリアデザインセンター	3,600	834.00	3,002,400

エムスリー	86,900	2,638.00	229,242,200
ツカダ・グローバルホールディング	9,900	657.00	6,504,300
アウトソーシング	4,800	2,814.00	13,507,200
ウェルネット	4,000	3,065.00	12,260,000
ディー・エヌ・エー	45,200	1,748.00	79,009,600
博報堂D Yホールディングス	138,500	1,262.00	174,787,000
ぐるなび	11,800	2,392.00	28,225,600
エスアールジータカミヤ	10,400	321.00	3,338,400
ファンコミュニケーションズ	23,700	647.00	15,333,900
ジェイコムホールディングス	2,600	1,973.00	5,129,800
WDBホールディングス	4,300	862.00	3,706,600
バリューコマース	11,400	337.00	3,841,800
インフォマート	15,000	968.00	14,520,000
J Pホールディングス	29,300	252.00	7,383,600
E P Sホールディングス	11,500	1,346.00	15,479,000
プレステージ・インターナショナル	9,500	1,135.00	10,782,500
アミューズ	2,900	3,960.00	11,484,000
ドリームインキュベータ	3,800	2,149.00	8,166,200
クイック	5,800	700.00	4,060,000
ケネディクス	134,700	434.00	58,459,800
電通	111,400	5,530.00	616,042,000
ぴあ	3,900	2,145.00	8,365,500
イオンファンタジー	3,900	2,112.00	8,236,800
ネクシィーズ	4,800	703.00	3,374,400
みらかホールディングス	25,700	4,760.00	122,332,000
アルプス技研	4,400	2,114.00	9,301,600
日本空調サービス	6,400	1,081.00	6,918,400
オリエンタルランド	108,300	8,000.00	866,400,000
ダスキン	29,000	2,118.00	61,422,000
明光ネットワークジャパン	12,200	1,120.00	13,664,000
ファルコホールディングス	5,900	1,304.00	7,693,600
ラウンドワン	32,300	644.00	20,801,200
リゾートトラスト	42,400	2,575.00	109,180,000
ビー・エム・エル	6,000	3,975.00	23,850,000
りらいあコミュニケーションズ	16,700	966.00	16,132,200
ユー・エス・エス	121,600	1,556.00	189,209,600
東京個別指導学院	6,000	667.00	4,002,000
サイバーエージェント	24,600	5,250.00	129,150,000
楽天	468,900	1,036.50	486,014,850
テー・オー・ダブリュー	8,100	586.00	4,746,600
セントラルスポーツ	4,400	2,266.00	9,970,400
フルキャストホールディングス	10,500	650.00	6,825,000

テクノプロ・ホールディングス	16,400	3,030.00	49,692,000
ジャパンマテリアル	4,600	2,178.00	10,018,800
ベクトル	3,500	2,203.00	7,710,500
I B J	8,400	388.00	3,259,200
アサンテ	4,800	1,518.00	7,286,400
N・フィールド	4,200	907.00	3,809,400
ライドオン・エクスプレス	1,900	1,772.00	3,366,800
リクルートホールディングス	201,600	3,390.00	683,424,000
日本郵政	219,000	1,428.00	312,732,000
ベルシステム24ホールディングス	15,100	974.00	14,707,400
リロ・ホールディング	3,800	12,880.00	48,944,000
東祥	3,300	3,915.00	12,919,500
エイチ・アイ・エス	16,200	3,425.00	55,485,000
共立メンテナンス	7,500	8,100.00	60,750,000
イチネンホールディングス	12,300	913.00	11,229,900
建設技術研究所	7,300	941.00	6,869,300
スペース	6,300	1,225.00	7,717,500
燦ホールディングス	3,800	1,405.00	5,339,000
東京テアトル	58,000	116.00	6,728,000
ナガワ	2,400	2,803.00	6,727,200
よみうりランド	24,000	406.00	9,744,000
東京都競馬	70,000	208.00	14,560,000
常磐興産	53,000	149.00	7,897,000
カナモト	14,100	2,485.00	35,038,500
東京ドーム	80,000	523.00	41,840,000
西尾レントオール	8,200	2,615.00	21,443,000
トランス・コスモス	11,700	2,481.00	29,027,700
乃村工藝社	21,700	1,395.00	30,271,500
藤田観光	38,000	507.00	19,266,000
KNT-CTホールディングス	53,000	173.00	9,169,000
日本管財	8,900	1,775.00	15,797,500
トーカイ	4,600	3,070.00	14,122,000
白洋舎	20,000	249.00	4,980,000
セコム	104,100	7,937.00	826,241,700
セントラル警備保障	5,800	1,997.00	11,582,600
丹青社	19,400	657.00	12,745,800
メイテック	12,700	3,920.00	49,784,000
アサツー ディ・ケイ	18,000	2,867.00	51,606,000
応用地質	11,200	1,271.00	14,235,200
船井総研ホールディングス	14,400	1,381.00	19,886,400
ベネッセホールディングス	33,800	3,435.00	116,103,000
イオンディライト	9,600	3,590.00	34,464,000



ナック	7,800	832.00	6,489,600	
ニチイ学館	18,000	803.00	14,454,000	
ダイセキ	19,100	1,736.00	33,157,600	
合 計	157,828,600		185,765,171,350	

## (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。

## 国内債券パッシブ・マザーファンド

## 貸借対照表

	(単位：円)	
	(平成27年 2月18日現在)	(平成28年 2月18日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	-	3,955,557,059
コール・ローン	735,715,908	-
国債証券	223,843,862,890	183,256,681,550
地方債証券	23,063,596,025	19,028,775,276
特殊債券	32,072,717,508	27,839,025,052
社債券	19,224,604,000	16,720,556,000
未収入金	839,906,000	4,035,431,400
未収利息	1,270,937,689	948,886,580
前払費用	30,361,446	14,892,621
流動資産合計	301,081,701,466	255,799,805,538
資産合計	301,081,701,466	255,799,805,538
負債の部		
流動負債		
未払解約金	6,953,936	7,095,653,575
流動負債合計	6,953,936	7,095,653,575
負債合計	6,953,936	7,095,653,575
純資産の部		
元本等		
元本	252,447,892,985	200,347,049,687
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	48,626,854,545	48,357,102,276
元本等合計	301,074,747,530	248,704,151,963
純資産合計	301,074,747,530	248,704,151,963
負債純資産合計	301,081,701,466	255,799,805,538

## 注記表

（重要な会計方針の注記）

項 目	自 平成27年 2月19日 至 平成28年 2月18日
有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券は個別法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>

（貸借対照表に関する注記）

項 目	（平成27年 2月18日現在）	（平成28年 2月18日現在）
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	252,447,892,985口	200,347,049,687口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.1926円 (10,000口当たりの純資産額 11,926円)	1口当たり純資産額 1.2414円 (10,000口当たりの純資産額 12,414円)

（金融商品に関する注記）

・金融商品の状況に関する事項

項 目	自 平成27年 2月19日 至 平成28年 2月18日
1. 金融商品に対する取組方針	<p>当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。</p>
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</p>

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

#### ・金融商品の時価等に関する事項

項目	(平成28年 2月18日現在)
1.貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	<p>(1) 有価証券（国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

(デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

（平成27年 2月18日現在）	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	367,391,279,751円
同期中における追加設定元本額	8,927,485,132円
同期中における一部解約元本額	123,870,871,898円
平成27年 2月18日現在における元本の内訳	
三井住友・DC年金バランス30（債券重点型）	2,006,560,467円
三井住友・DC年金バランス50（標準型）	3,765,133,351円
三井住友・DC年金バランス70（株式重点型）	862,818,586円
スミセイ・DCバランスファンド（機動的資産配分型）	235,947,572円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2020	41,844,452円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2025	52,735,645円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2030	32,154,232円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2035	29,365,278円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2040	13,170,635円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2045	24,603,355円
三井住友・DC年金バランスゼロ（債券型）	62,710円
SMAM・年金グローバル債券ファンド＜適格機関投資家限定＞	8,543,402,782円
SMAM・バランスファンドVA25＜適格機関投資家専用＞	46,322,563,079円
SMAM・バランスファンドVA37.5＜適格機関投資家専用＞	11,713,387,600円
SMAM・バランスファンドVA50＜適格機関投資家専用＞	28,586,629,341円
SMAM・バランスファンドVL30＜適格機関投資家限定＞	503,537,625円
SMAM・バランスファンドVL50＜適格機関投資家限定＞	871,533,544円
世界6資産バランスファンドVA＜適格機関投資家限定＞	129,760,099円
SMAM・バランスファンドVA75＜適格機関投資家専用＞	457,716,810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＞	160,703,477円
SMAM・インデックス・バランスVA25＜適格機関投資家専用＞	2,731,464,689円
SMAM・インデックス・バランスVA50＜適格機関投資家専用＞	3,252,254,430円
SMAM・バランスファンドVA40＜適格機関投資家専用＞	8,678,886,203円
SMAM・バランスファンドVA35＜適格機関投資家専用＞	17,490,362,156円

SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定>	755,710,084円
三井住友・国内債券インデックスファンド・VAS（適格機関投資家専用）	8,906,332,355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）	48,989,697,962円
SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	782,292,809円
SMAM・バランスファンドVA20<適格機関投資家専用>	1,498,326,114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）	29,941,747,028円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>	1,248,536,514円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>	293,180,990円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用>	63,652,548円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>	3,365,380,787円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	3,858,535,180円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T<適格機関投資家専用>	3,527,672,683円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A2<適格機関投資家専用>	1,442,354,530円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A2<適格機関投資家専用>	338,323,341円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A2<適格機関投資家専用>	22,989,215円
SMAM・アセットバランスファンドVA30L2<適格機関投資家専用>	584,649,778円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L2<適格機関投資家専用>	9,639,689,146円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T2<適格機関投資家専用>	665,736,403円
SMAM・FG新興国重視型バランス20VA<適格機関投資家限定>	926,116円
SMAM・FGグローバルバランス25VA<適格機関投資家限定>	11,596,459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>	1,739,797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>	2,225,028円
合計	252,447,892,985円

（平成28年 2月18日現在）

開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	252,447,892,985円
同期中における追加設定元本額	11,079,051,422円
同期中における一部解約元本額	63,179,894,720円
平成28年 2月18日現在における元本の内訳	
三井住友・DC年金バランス30（債券重点型）	2,165,516,380円
三井住友・DC年金バランス50（標準型）	3,813,680,427円
三井住友・DC年金バランス70（株式重点型）	817,165,991円
SMAM・グローバルバランスファンド（機動的資産配分型）	300,550,045円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2020	47,921,173円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2025	77,810,997円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2030	151,876,114円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2035	63,113,487円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2040	32,352,193円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2045	57,633,698円
三井住友・DC年金バランスゼロ（債券型）	5,294,440円
アセットアロケーション・ファンド（安定型）	921,178,055円

アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	504,257,110円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	251,867,131円
S M A M ・ 年金グローバル債券ファンド<適格機関投資家限定>	6,104,083,623円
S M A M ・ バランスファンドV A 2 5 <適格機関投資家専用>	31,642,677,939円
S M A M ・ バランスファンドV A 3 7 . 5 <適格機関投資家専用>	9,374,298,014円
S M A M ・ バランスファンドV A 5 0 <適格機関投資家専用>	22,725,074,360円
S M A M ・ バランスファンドV L 3 0 <適格機関投資家限定>	385,746,395円
S M A M ・ バランスファンドV L 5 0 <適格機関投資家限定>	710,279,607円
世界6資産バランスファンドV A <適格機関投資家限定>	66,453,100円
S M A M ・ バランスファンドV A 7 5 <適格機関投資家専用>	330,459,356円
S M A M ・ バランスファンドV L 国際分散型<適格機関投資家限定>	133,253,321円
S M A M ・ インデックス・バランスV A 2 5 <適格機関投資家専用>	2,449,351,412円
S M A M ・ インデックス・バランスV A 5 0 <適格機関投資家専用>	2,767,730,960円
S M A M ・ バランスファンドV A 4 0 <適格機関投資家専用>	6,913,724,152円
S M A M ・ バランスファンドV A 3 5 <適格機関投資家専用>	14,892,295,388円
S M A M ・ バランスV A 株 4 0 T <適格機関投資家限定>	209,261,015円
三井住友・国内債券インデックスファンド・V A S (適格機関投資家専用)	7,584,993,038円
三井住友・5資産バランスファンド・V A S (適格機関投資家専用)	35,504,244,175円
S M A M ・ グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	686,174,762円
S M A M ・ バランスファンドV A 2 0 <適格機関投資家専用>	1,210,961,907円
三井住友・7資産バランスファンド・V A S (適格機関投資家専用)	23,957,257,289円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 2 0 A <適格機関投資家専用>	1,143,922,160円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 3 5 A <適格機関投資家専用>	255,000,027円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 5 0 A <適格機関投資家専用>	53,970,912円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 2 0 L <適格機関投資家専用>	2,850,978,211円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 2 5 L <適格機関投資家専用>	3,280,304,460円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 2 0 T <適格機関投資家専用>	3,047,527,271円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 2 0 A 2 <適格機関投資家専用>	1,216,622,709円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 3 5 A 2 <適格機関投資家専用>	267,247,997円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 5 0 A 2 <適格機関投資家専用>	21,167,802円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 3 0 L 2 <適格機関投資家専用>	490,120,804円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 2 5 L 2 <適格機関投資家専用>	8,236,891,255円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 2 0 T 2 <適格機関投資家専用>	382,692,836円
S M A M ・ F G 新興国重視型バランス20VA<適格機関投資家限定>	570,934円
S M A M ・ F G グローバルバランス25VA<適格機関投資家限定>	8,180,420円
S M A M ・ グローバル・マルチアセット・グロース・ファンド(安定成長型)<適格機関投資家限定>	6,547,163円
S M A M ・ 年金マルチ・インカム・ダイナミック・アロケーション・ファンド<適格機関投資家限定>	3,333,119円
S M A M ・ 年金Wリスクリスクコントロールファンド<適格機関投資家限定>	4,325,792円
S M A M ・ マルチアセットストラテジーファンド2016-01<適格機関投資家限定>	2,219,108,761円
合計	200,347,049,687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 1 1 1 回利付国債（ 5 年）	30,000,000	30,374,100	
	第 1 1 6 回利付国債（ 5 年）	150,000,000	151,681,500	
	第 1 2 1 回利付国債（ 5 年）	100,000,000	101,007,000	
	第 1 2 2 回利付国債（ 5 年）	1,550,000,000	1,566,399,000	
	第 1 2 3 回利付国債（ 5 年）	2,410,000,000	2,436,172,600	
	第 1 2 4 回利付国債（ 5 年）	2,240,000,000	2,265,334,400	
	第 1 2 5 回利付国債（ 5 年）	2,480,000,000	2,509,140,000	
	第 1 2 6 回利付国債（ 5 年）	1,015,000,000	1,027,322,100	
	第 1 回利付国債（ 4 0 年）	40,000,000	54,190,800	
	第 2 回利付国債（ 4 0 年）	362,000,000	471,714,960	
	第 3 回利付国債（ 4 0 年）	330,000,000	431,181,300	
	第 4 回利付国債（ 4 0 年）	495,000,000	649,227,150	
	第 5 回利付国債（ 4 0 年）	455,000,000	571,070,500	
	第 6 回利付国債（ 4 0 年）	495,000,000	606,464,100	
	第 7 回利付国債（ 4 0 年）	495,000,000	575,467,200	
	第 8 回利付国債（ 4 0 年）	485,000,000	516,985,750	
	第 2 8 9 回利付国債（ 1 0 年）	49,000,000	50,506,750	
	第 2 9 0 回利付国債（ 1 0 年）	1,197,000,000	1,236,704,490	
	第 2 9 1 回利付国債（ 1 0 年）	200,000,000	206,218,000	
	第 2 9 3 回利付国債（ 1 0 年）	3,660,000,000	3,830,848,800	
第 2 9 6 回利付国債（ 1 0 年）	3,543,000,000	3,698,431,410		
第 2 9 7 回利付国債（ 1 0 年）	1,943,000,000	2,030,726,450		
第 2 9 8 回利付国債（ 1 0 年）	2,470,000,000	2,574,505,700		
第 2 9 9 回利付国債（ 1 0 年）	2,245,000,000	2,348,314,900		

第300回利付国債(10年)	1,100,000,000	1,157,244,000	
第301回利付国債(10年)	2,685,000,000	2,836,272,900	
第303回利付国債(10年)	3,495,000,000	3,693,690,750	
第305回利付国債(10年)	2,970,000,000	3,139,260,300	
第306回利付国債(10年)	1,720,000,000	1,830,699,200	
第307回利付国債(10年)	1,000,000,000	1,060,260,000	
第308回利付国債(10年)	1,160,000,000	1,233,718,000	
第309回利付国債(10年)	550,000,000	580,041,000	
第310回利付国債(10年)	3,080,000,000	3,243,178,400	
第312回利付国債(10年)	2,145,000,000	2,285,712,000	
第313回利付国債(10年)	2,105,000,000	2,260,959,450	
第315回利付国債(10年)	2,055,000,000	2,203,864,200	
第317回利付国債(10年)	950,000,000	1,016,756,500	
第318回利付国債(10年)	1,150,000,000	1,224,347,500	
第319回利付国債(10年)	980,000,000	1,051,971,200	
第320回利付国債(10年)	1,080,000,000	1,152,975,600	
第321回利付国債(10年)	1,575,000,000	1,685,974,500	
第322回利付国債(10年)	790,000,000	840,820,700	
第323回利付国債(10年)	400,000,000	426,812,000	
第324回利付国債(10年)	1,785,000,000	1,893,242,400	
第325回利付国債(10年)	1,765,000,000	1,876,336,200	
第326回利付国債(10年)	660,000,000	698,438,400	
第327回利付国債(10年)	675,000,000	718,962,750	
第328回利付国債(10年)	1,405,000,000	1,479,254,250	
第329回利付国債(10年)	2,200,000,000	2,350,392,000	
第330回利付国債(10年)	1,900,000,000	2,032,848,000	
第332回利付国債(10年)	1,590,000,000	1,679,087,700	
第333回利付国債(10年)	2,265,000,000	2,393,017,800	
第334回利付国債(10年)	1,670,000,000	1,765,139,900	
第335回利付国債(10年)	2,015,000,000	2,113,170,800	
第336回利付国債(10年)	1,010,000,000	1,059,237,500	
第337回利付国債(10年)	1,480,000,000	1,525,909,600	
第338回利付国債(10年)	2,125,000,000	2,209,107,500	
第339回利付国債(10年)	2,385,000,000	2,477,394,900	
第340回利付国債(10年)	2,165,000,000	2,247,919,500	
第341回利付国債(10年)	1,355,000,000	1,392,872,250	



第2回利付国債(30年)	510,000,000	657,813,300	
第4回利付国債(30年)	300,000,000	410,700,000	
第5回利付国債(30年)	290,000,000	368,146,300	
第7回利付国債(30年)	474,000,000	611,322,540	
第9回利付国債(30年)	100,000,000	114,500,000	
第10回利付国債(30年)	585,000,000	640,709,550	
第11回利付国債(30年)	570,000,000	680,129,700	
第12回利付国債(30年)	590,000,000	743,105,000	
第14回利付国債(30年)	860,000,000	1,125,215,400	
第16回利付国債(30年)	465,000,000	616,776,000	
第18回利付国債(30年)	510,000,000	657,803,100	
第19回利付国債(30年)	490,000,000	632,046,100	
第21回利付国債(30年)	345,000,000	444,577,350	
第22回利付国債(30年)	335,000,000	444,246,850	
第23回利付国債(30年)	329,000,000	436,303,350	
第24回利付国債(30年)	310,000,000	411,094,100	
第25回利付国債(30年)	190,000,000	244,807,400	
第26回利付国債(30年)	483,000,000	631,454,880	
第27回利付国債(30年)	395,000,000	524,828,600	
第28回利付国債(30年)	486,000,000	647,055,540	
第29回利付国債(30年)	392,000,000	514,390,240	
第30回利付国債(30年)	560,000,000	724,304,000	
第31回利付国債(30年)	610,000,000	777,072,900	
第32回利付国債(30年)	865,000,000	1,123,487,950	
第33回利付国債(30年)	865,000,000	1,068,300,950	
第34回利付国債(30年)	850,000,000	1,088,272,000	
第35回利付国債(30年)	750,000,000	927,300,000	
第36回利付国債(30年)	545,000,000	673,723,550	
第37回利付国債(30年)	850,000,000	1,032,282,500	
第38回利付国債(30年)	640,000,000	762,060,800	
第39回利付国債(30年)	565,000,000	685,893,050	
第40回利付国債(30年)	495,000,000	588,866,850	
第41回利付国債(30年)	495,000,000	576,699,750	
第42回利付国債(30年)	570,000,000	663,998,700	
第43回利付国債(30年)	480,000,000	559,094,400	
第44回利付国債(30年)	740,000,000	861,826,200	

第45回利付国債(30年)	665,000,000	741,049,400	
第46回利付国債(30年)	880,000,000	980,205,600	
第47回利付国債(30年)	480,000,000	546,537,600	
第48回利付国債(30年)	690,000,000	750,423,300	
第49回利付国債(30年)	340,000,000	369,542,600	
第39回利付国債(20年)	458,000,000	484,618,960	
第40回利付国債(20年)	390,000,000	415,182,300	
第42回利付国債(20年)	480,000,000	521,448,000	
第43回利付国債(20年)	1,120,000,000	1,243,905,600	
第46回利付国債(20年)	775,000,000	854,352,250	
第48回利付国債(20年)	955,000,000	1,078,051,750	
第50回利付国債(20年)	918,000,000	1,014,784,740	
第52回利付国債(20年)	720,000,000	810,892,800	
第54回利付国債(20年)	965,000,000	1,098,247,200	
第56回利付国債(20年)	818,000,000	929,967,840	
第59回利付国債(20年)	1,455,000,000	1,640,032,350	
第61回利付国債(20年)	1,215,000,000	1,313,913,150	
第64回利付国債(20年)	1,025,000,000	1,182,829,500	
第65回利付国債(20年)	1,020,000,000	1,181,343,600	
第69回利付国債(20年)	1,020,000,000	1,201,611,000	
第70回利付国債(20年)	800,000,000	965,832,000	
第72回利付国債(20年)	753,000,000	893,193,540	
第74回利付国債(20年)	664,000,000	790,538,480	
第75回利付国債(20年)	490,000,000	585,197,200	
第78回利付国債(20年)	590,000,000	695,810,600	
第82回利付国債(20年)	620,000,000	745,023,000	
第84回利付国債(20年)	850,000,000	1,015,019,000	
第85回利付国債(20年)	645,000,000	779,056,800	
第88回利付国債(20年)	742,000,000	913,928,820	
第89回利付国債(20年)	20,000,000	24,428,600	
第90回利付国債(20年)	580,000,000	710,430,400	
第92回利付国債(20年)	819,000,000	997,075,170	
第93回利付国債(20年)	872,000,000	1,054,570,640	
第95回利付国債(20年)	160,000,000	199,299,200	
第97回利付国債(20年)	772,000,000	955,319,120	
第99回利付国債(20年)	908,000,000	1,115,659,600	

第100回利付国債(20年)	392,000,000	487,565,680	
第101回利付国債(20年)	405,000,000	513,345,600	
第102回利付国債(20年)	507,000,000	644,635,290	
第105回利付国債(20年)	425,000,000	525,665,500	
第106回利付国債(20年)	400,000,000	499,664,000	
第107回利付国債(20年)	503,000,000	623,277,360	
第108回利付国債(20年)	280,000,000	339,729,600	
第109回利付国債(20年)	790,000,000	959,850,000	
第111回利付国債(20年)	681,000,000	855,526,680	
第113回利付国債(20年)	857,000,000	1,067,264,950	
第114回利付国債(20年)	628,000,000	783,769,120	
第116回利付国債(20年)	825,000,000	1,041,554,250	
第118回利付国債(20年)	310,000,000	383,426,600	
第119回利付国債(20年)	560,000,000	676,748,800	
第120回利付国債(20年)	645,000,000	761,719,200	
第121回利付国債(20年)	625,000,000	765,181,250	
第122回利付国債(20年)	710,000,000	858,723,700	
第123回利付国債(20年)	380,000,000	476,406,000	
第124回利付国債(20年)	430,000,000	532,993,600	
第125回利付国債(20年)	480,000,000	609,307,200	
第126回利付国債(20年)	280,000,000	347,132,800	
第127回利付国債(20年)	195,000,000	238,953,000	
第128回利付国債(20年)	520,000,000	637,681,200	
第129回利付国債(20年)	555,000,000	672,032,850	
第130回利付国債(20年)	535,000,000	648,141,800	
第131回利付国債(20年)	460,000,000	550,095,600	
第132回利付国債(20年)	490,000,000	586,108,600	
第133回利付国債(20年)	730,000,000	884,073,800	
第134回利付国債(20年)	90,000,000	109,026,000	
第135回利付国債(20年)	85,000,000	101,685,500	
第136回利付国債(20年)	250,000,000	295,077,500	
第137回利付国債(20年)	210,000,000	251,061,300	
第138回利付国債(20年)	245,000,000	285,202,050	
第139回利付国債(20年)	520,000,000	613,262,000	
第140回利付国債(20年)	1,465,000,000	1,750,162,250	
第141回利付国債(20年)	600,000,000	716,742,000	

	第142回利付国債(20年)	620,000,000	750,324,000	
	第143回利付国債(20年)	405,000,000	476,567,550	
	第144回利付国債(20年)	295,000,000	342,205,900	
	第145回利付国債(20年)	790,000,000	941,877,500	
	第146回利付国債(20年)	815,000,000	970,648,700	
	第147回利付国債(20年)	1,135,000,000	1,331,695,500	
	第148回利付国債(20年)	850,000,000	981,112,500	
	第149回利付国債(20年)	1,240,000,000	1,428,951,200	
	第150回利付国債(20年)	1,180,000,000	1,336,645,000	
	第151回利付国債(20年)	1,250,000,000	1,369,900,000	
	第152回利付国債(20年)	1,140,000,000	1,246,384,800	
	第153回利付国債(20年)	1,130,000,000	1,252,864,900	
	第154回利付国債(20年)	915,000,000	995,474,250	
	第155回利付国債(20年)	470,000,000	492,827,900	
国債証券合計		163,740,000,000	183,256,681,550	
地方債証券	第1回東京都公募公債(20年)	100,000,000	111,408,000	
	第1回東京都公募公債(30年)	100,000,000	124,018,000	
	第6回東京都公募公債(20年)	100,000,000	117,190,000	
	第7回東京都公募公債(20年)	100,000,000	119,304,000	
	第8回東京都公募公債(20年)	100,000,000	122,009,000	
	第8回東京都公募公債(30年)	400,000,000	492,064,000	
	第13回東京都公募公債(30年)	500,000,000	584,170,000	
	第634回東京都公募公債	6,000,000	6,036,960	
	第643回東京都公募公債	100,000,000	101,788,000	
	第646回東京都公募公債	100,000,000	102,607,000	
	第652回東京都公募公債	200,000,000	206,102,000	
	第653回東京都公募公債	200,000,000	205,564,000	
	第660回東京都公募公債	700,000,000	725,788,000	
	第662回東京都公募公債	100,000,000	104,304,000	
	第668回東京都公募公債	200,000,000	209,544,000	
	第674回東京都公募公債	100,100,000	105,004,900	
	平成19年度第2回北海道公募公債	100,000,000	102,282,000	
	平成19年度第7回北海道公募公債	100,000,000	102,789,000	
	平成20年度第4回北海道公募公債	100,000,000	104,540,000	
	平成20年度第12回北海道公募公債	100,000,000	104,831,000	
平成25年度第15回北海道公募公債	100,000,000	104,542,000		

第1回神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	120,529,000	
第3回神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	118,238,000	
第7回神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	121,860,000	
第57回神奈川県公募公債(5年)	200,000,000	201,566,000	
第147回神奈川県公募公債	100,000,000	102,675,000	
第149回神奈川県公募公債	200,000,000	205,932,000	
第157回神奈川県公募公債	115,600,000	120,768,476	
第167回神奈川県公募公債	100,000,000	105,525,000	
第97回大阪府公募公債(5年)	102,000,000	102,723,180	
第299回大阪府公募公債(10年)	200,000,000	203,772,000	
第303回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	102,541,000	
第306回大阪府公募公債(10年)	200,000,000	205,678,000	
第313回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	103,551,000	
第361回大阪府公募公債(10年)	200,000,000	210,824,000	
第373回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	106,099,000	
第377回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	104,831,000	
平成19年度第1回京都府公募公債	130,260,000	134,080,525	
平成20年度第3回京都府公募公債	100,000,000	104,401,000	
平成26年度第6回京都府公募公債	100,000,000	100,711,000	
平成26年度第13回京都府公募公債	100,000,000	103,229,000	
平成27年度第4回京都府公募公債	100,000,000	103,753,000	
第5回兵庫県公募公債(15年)	300,000,000	335,313,000	
平成20年度第5回兵庫県公募公債	100,000,000	104,457,000	
平成21年度第3回兵庫県公募公債	200,000,000	210,344,000	
平成21年度第11回兵庫県公募公債	200,000,000	210,848,000	
平成21年度第23回兵庫県公募公債	200,000,000	209,690,000	
第7回静岡県公募公債(30年)	100,000,000	117,931,000	
平成19年度第7回静岡県公募公債	100,000,000	103,265,000	
平成20年度第1回静岡県公募公債	200,000,000	238,424,000	
平成20年度第7回静岡県公募公債	100,000,000	104,698,000	
平成21年度第5回静岡県公募公債	300,000,000	315,066,000	
平成19年度第3回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	102,852,000	
平成20年度第3回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	104,167,000	
平成21年度第1回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	105,125,000	
平成21年度第7回愛知県公募公債(10年)	200,000,000	211,016,000	
	100,000,000	105,063,000	

平成22年度第12回愛知県公募公債(10年)			
平成23年度第18回愛知県公募公債(7年)	100,000,000	101,683,000	
平成19年度第3回広島県公募公債	200,000,000	206,212,000	
平成20年度第1回広島県公募公債	100,000,000	104,051,000	
平成18年度第7回埼玉県公募公債	100,000,000	101,918,000	
平成19年度第2回埼玉県公募公債	100,000,000	102,652,000	
平成20年度第7回埼玉県公募公債	100,000,000	104,423,000	
平成21年度第1回埼玉県公募公債	100,000,000	104,814,000	
平成21年度第4回埼玉県公募公債	200,000,000	209,930,000	
平成19年度第2回福岡県公募公債	100,000,000	102,716,000	
平成20年度第10回福岡県公募公債	100,000,000	104,494,000	
平成25年度第11回福岡県公募公債	100,000,000	105,063,000	
平成25年度第12回福岡県公募公債	100,000,000	100,453,000	
平成26年度第10回福岡県公募公債	100,000,000	103,012,000	
平成19年度第1回千葉県公募公債	100,000,000	102,267,000	
平成20年度第8回千葉県公募公債	100,000,000	104,413,000	
平成21年度第2回千葉県公募公債	345,000,000	362,467,350	
第9回群馬県公募公債(10年)	100,000,000	105,420,000	
平成19年度第1回岐阜県公募公債(10年)	200,000,000	206,376,000	
第40回共同発行市場公募地方債	50,000,000	50,457,000	
第51回共同発行市場公募地方債	100,500,000	103,089,885	
第55回共同発行市場公募地方債	200,000,000	206,262,000	
第56回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,067,000	
第57回共同発行市場公募地方債	300,000,000	309,294,000	
第62回共同発行市場公募地方債	200,000,000	207,822,000	
第64回共同発行市場公募地方債	300,000,000	312,888,000	
第65回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,040,000	
第73回共同発行市場公募地方債	300,000,000	315,438,000	
第75回共同発行市場公募地方債	900,000,000	950,193,000	
第77回共同発行市場公募地方債	200,000,000	210,918,000	
第115回共同発行市場公募地方債	600,000,000	632,286,000	
第137回共同発行市場公募地方債	200,000,000	208,132,000	
平成19年度第5回大阪市公募公債	100,000,000	102,799,000	
平成19年度第10回大阪市公募公債	100,000,000	103,195,000	
平成21年度第4回大阪市公募公債	300,000,000	316,905,000	

	第1回名古屋市公募公債(20年)	200,000,000	230,796,000	
	第3回名古屋市公募公債(20年)	100,000,000	117,501,000	
	第467回名古屋市公募公債(10年)	100,000,000	105,341,000	
	第1回京都市公募公債(30年)	100,000,000	128,794,000	
	第7回京都市公募公債(20年)	100,000,000	125,154,000	
	平成18年度第3回京都市公募公債	200,000,000	203,868,000	
	平成19年度第2回京都市公募公債	100,000,000	103,246,000	
	平成19年度第10回神戸市公募公債	100,000,000	103,301,000	
	平成26年度第17回神戸市公募公債	100,000,000	101,485,000	
	第4回横浜市公募公債(20年)	100,000,000	117,249,000	
	第9回横浜市公募公債(20年)	100,000,000	122,263,000	
	第14回横浜市公募公債(20年)	100,000,000	124,113,000	
	平成18年度第4回横浜市公募公債	300,000,000	305,733,000	
	平成20年度第6回横浜市公募公債	200,000,000	208,944,000	
	平成26年度第4回札幌市公募公債(10年)	100,000,000	103,848,000	
	第2回川崎市15年公募公債	100,000,000	107,083,000	
	第4回川崎市15年公募公債	100,000,000	112,376,000	
	平成19年度第2回北九州市公募公債	100,000,000	103,024,000	
	平成20年度第5回福岡市公募公債	100,000,000	104,166,000	
	平成25年度第5回福岡市公募公債(5年)	100,000,000	100,653,000	
	平成19年度第1回広島市公募公債	100,000,000	103,227,000	
	平成21年度第1回千葉市公募公債	200,000,000	210,028,000	
地方債証券合計		17,849,460,000	19,028,775,276	
特殊債券	第1回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	104,473,000	
	第2回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	200,000,000	208,064,000	
	第3回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	200,000,000	232,584,000	
	第5回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	104,470,000	
	第15回政府保証日本政策投資銀行債券	100,000,000	111,744,000	
	第20回政府保証日本政策投資銀行債券	100,000,000	113,695,000	
	第20回日本政策投資銀行債券	100,000,000	107,515,000	
	第23回政府保証日本政策投資銀行債券	400,000,000	416,268,000	
	第27回日本政策投資銀行債券	100,000,000	101,151,000	
	第30回日本政策投資銀行債券	100,000,000	105,909,000	
	第36回日本政策投資銀行債券	100,000,000	121,122,000	
	第51回日本政策投資銀行債券	100,000,000	104,286,000	

第2回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	217,214,000	
第5回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	158,000,000	158,052,140	
第7回道路債券	100,000,000	116,834,000	
第8回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	121,756,000	
第9回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	109,741,000	
第9回道路債券	100,000,000	134,243,000	
第17回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	102,000,000	103,091,400	
第18回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	135,423,000	
第21回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,884,000	
第22回日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	390,921,000	
第25回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,712,000	
第27回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	500,000,000	509,250,000	
第30回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	203,760,000	
第34回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,163,000	
第36回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	653,000,000	669,638,440	
第37回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	308,256,000	
第40回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	308,988,000	
第40回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,929,000	
第41回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	400,000,000	410,632,000	
第42回道路債券	200,000,000	236,658,000	
第44回日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	209,160,000	
第45回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,108,000	
第47回日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	249,924,000	
第49回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,955,000	
第52回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	206,592,000	
第56回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	206,180,000	



第58回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	500,000,000	519,650,000	
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	104,320,000	
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	104,236,000	
第67回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	208,776,000	
第69回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,513,000	
第81回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	245,706,000	
第88回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	127,201,000	
第90回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	369,414,000	
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	124,692,000	
第340回政府保証道路債券	100,000,000	107,096,000	
第1回政府保証地方公営企業等金融機構債券	300,000,000	312,966,000	
第1回政府保証地方公共団体金融機構債券	300,000,000	315,084,000	
第2回地方公営企業等金融機構債券(20年)	100,000,000	123,723,000	
第3回公営企業債券(20年)	100,000,000	106,884,000	
第3回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	105,448,000	
第5回公営企業債券(20年)	100,000,000	115,365,000	
第6回政府保証地方公営企業等金融機構債券	100,000,000	104,062,000	
第6回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	105,612,000	
第7回政府保証地方公営企業等金融機構債券	500,000,000	522,350,000	
第8回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,659,000	
第11回公営企業債券(20年)	100,000,000	117,624,000	
第11回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	105,978,000	
第16回公営企業債券(20年)	100,000,000	118,243,000	
第17回公営企業債券(20年)	100,000,000	121,433,000	
第18回公営企業債券(20年)	100,000,000	123,720,000	
第22回公営企業債券(20年)	100,000,000	122,206,000	
第24回公営企業債券(20年)	200,000,000	245,768,000	
第30回公営企業債券	100,000,000	104,589,000	
第42回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	105,071,000	
第45回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	210,308,000	

第6 1 回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	104,886,000	
第6 3 回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,980,000	
第6 5 回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,573,000	
F 7 4 回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,006,000	
第8 7 5 回政府保証公営企業債券	200,000,000	204,040,000	
第8 8 3 回政府保証公営企業債券	100,000,000	102,965,000	
第8 8 4 回政府保証公営企業債券	300,000,000	309,237,000	
第8 8 5 回政府保証公営企業債券	200,000,000	207,784,000	
第8 8 6 回政府保証公営企業債券	200,000,000	208,516,000	
第3 4 回株式会社日本政策金融公庫社債	200,000,000	201,288,000	
第2 7 回国際協力銀行債券	100,000,000	101,879,000	
第1 9 回都市再生債券	100,000,000	104,238,000	
第7 回本州四国連絡橋債券	100,000,000	118,854,000	
第3 3 2 回東京交通債券	100,000,000	109,555,000	
第3 4 2 回東京交通債券	100,000,000	114,333,000	
第1 3 回関西国際空港株式会社社債	100,000,000	104,438,000	
第1 6 回関西国際空港株式会社社債	100,000,000	105,234,000	
第5 1 回政府保証関西国際空港債券	100,000,000	113,823,000	
第1 4 回独立行政法人福祉医療機構債券	200,000,000	205,242,000	
第1 7 回独立行政法人福祉医療機構債券	100,000,000	104,636,000	
第1 9 9 回政府保証預金保険機構債	300,000,000	301,002,000	
第2 0 1 回政府保証預金保険機構債	200,000,000	200,742,000	
第2 0 3 回政府保証預金保険機構債	300,000,000	300,888,000	
第1 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	27,110,000	27,942,819	
第3 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	13,946,000	14,458,376	
第3 回貸付債権担保 S 種住宅金融公庫債券	20,289,000	21,545,091	
第4 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	14,387,000	14,897,019	
第4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	29,154,000	31,653,372	
第5 回貸付債権担保 S 種住宅金融公庫債券	20,781,000	22,028,483	
第6 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	30,996,000	32,309,920	
第7 回貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券	26,853,000	28,929,005	
第8 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	15,977,000	16,579,971	
第8 回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	102,694,000	
第9 回貸付債権担保 S 種住宅金融公庫債券	45,024,000	48,682,200	
第9 回貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券	27,204,000	29,284,561	
第1 0 回貸付債権担保 S 種住宅金融公庫債券	69,816,000	75,465,510	

第10回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	27,289,000	29,012,300	
第11回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	28,818,000	30,927,189	
第12回貸付債権担保住宅金融公庫債券	18,312,000	19,093,556	
第14回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	33,131,000	34,660,989	
第14回一般担保住宅金融支援機構債券	200,000,000	207,730,000	
第17回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	73,002,000	76,740,432	
第19回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	39,090,000	42,565,101	
第21回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	104,955,000	
第24回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	80,442,000	88,561,011	
第25回一般担保住宅金融支援機構債券	200,000,000	209,446,000	
第26回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	116,805,000	127,518,354	
第27回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	42,242,000	45,947,045	
第28回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	46,417,000	50,395,401	
第29回貸付債権担保住宅金融公庫債券	25,472,000	26,991,404	
第29回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	48,253,000	52,315,420	
第30回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	49,253,000	53,393,207	
第32回貸付債権担保住宅金融公庫債券	30,594,000	32,450,137	
第32回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	97,132,000	104,459,638	
第35回貸付債権担保住宅金融公庫債券	30,537,000	32,555,801	
第35回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	57,084,000	61,478,897	
第36回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	59,153,000	63,540,378	
第39回貸付債権担保住宅金融公庫債券	27,659,000	29,486,706	
第41回貸付債権担保住宅金融公庫債券	30,053,000	32,472,266	
第43回貸付債権担保住宅金融公庫債券	56,728,000	61,926,553	
第43回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	73,336,000	78,454,852	
第46回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	69,497,000	75,165,175	
第48回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	134,992,000	146,172,037	
第49回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	67,401,000	72,495,167	
第51回貸付債権担保住宅金融公庫債券	27,564,000	30,005,067	
第51回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	143,738,000	153,901,713	
第52回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	120,455,000	
第53回貸付債権担保住宅金融公庫債券	28,471,000	30,843,203	
第55回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	158,904,000	168,484,322	

第57回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	78,595,000	83,452,171	
第58回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	79,215,000	83,940,174	
第59回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	158,642,000	168,474,631	
第60回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	239,451,000	252,900,962	
第61回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	79,629,000	83,693,264	
第67回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	84,727,000	88,209,279	
第69回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	171,020,000	180,176,410	
第70回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	167,450,000	176,207,635	
第73回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	86,434,000	91,325,300	
第95回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	106,183,000	
第99回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	97,971,000	100,750,437	
第130回一般担保住宅金融支援機構債券	200,000,000	233,448,000	
第1回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	56,440,000	60,769,512	
第2回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	59,508,000	64,388,251	
第3回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	24,752,000	26,782,406	
第6回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	29,049,000	31,376,696	
第5回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	51,036,000	54,703,446	
第10回農林漁業金融公庫債券	100,000,000	100,744,000	
い第733号商工債	500,000,000	500,825,000	
い第756号商工債	100,000,000	100,555,000	
い第758号商工債	100,000,000	100,841,000	
い第735号農林債	400,000,000	400,744,000	
い第749号農林債	300,000,000	301,095,000	
い第752号農林債	500,000,000	502,225,000	
第281回信金中金債(5年)	100,000,000	100,427,000	
第283回信金中金債(5年)	100,000,000	100,695,000	
第291回信金中金債(5年)	100,000,000	100,570,000	
第293回信金中金債(5年)	100,000,000	100,594,000	
第297回信金中金債(5年)	200,000,000	200,880,000	
第308回信金中金債(5年)	100,000,000	100,672,000	
第165号商工債(3年)	200,000,000	200,170,000	
第171号商工債(3年)	300,000,000	300,444,000	
第175号商工債(3年)	100,000,000	100,106,000	
第177号商工債(3年)	300,000,000	300,387,000	
第181号商工債(3年)	100,000,000	100,183,000	
第183号商工債(3年)	500,000,000	501,045,000	

	第185号商工債(3年)	200,000,000	200,404,000	
	第3回政府保証中日本高速道路債券	63,000,000	63,002,520	
	第5回中日本高速道路株式会社社債	200,000,000	209,594,000	
	第6回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	104,892,000	
	第10回政府保証中日本高速道路債券	100,000,000	101,348,000	
	第12回政府保証中日本高速道路債券	103,000,000	104,721,130	
	第14回政府保証中日本高速道路債券	100,000,000	102,526,000	
	第19回政府保証中日本高速道路債券	124,000,000	127,623,280	
	第21回政府保証中日本高速道路債券	200,000,000	207,774,000	
	第25回政府保証中日本高速道路債券	200,000,000	210,092,000	
	第46回中日本高速道路株式会社社債	200,000,000	201,016,000	
	第8回政府保証西日本高速道路債券	233,000,000	237,948,920	
	第15回政府保証西日本高速道路債券	100,000,000	104,238,000	
	第19回政府保証西日本高速道路債券	100,000,000	104,474,000	
	第20回西日本高速道路株式会社社債	100,000,000	104,942,000	
	第3回東京地下鉄株式会社社債	200,000,000	202,194,000	
特殊債券合計		26,262,825,000	27,839,025,052	
社債券	第23回ゼネラル・エレクトリック・キャピタル・コーポレーション	200,000,000	200,216,000	
	第10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	100,074,000	
	第11回ジェー・ピー・モルガン・チェース・アンド・カンパニー	200,000,000	202,032,000	
	第9回ザ・ゴールドマン・サックス・グループ・インク	100,000,000	101,613,000	
	第5回オーストラリア・コモンウェルス銀行円貨社債(2011)	300,000,000	300,717,000	
	第7回オーストラリア・コモンウェルス銀行円貨社債(2013)	100,000,000	100,172,000	
	第8回ウエストパック・バンキング・コーポレーション円貨社債	300,000,000	301,272,000	
	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	200,000,000	201,224,000	
	第20回コーペラティブ・セントラル・ライフアイゼン・ボエレンリーバンク・ビー・エー	100,000,000	100,087,000	
	第21回コーペラティブ・セントラル・ライフアイゼン・ボエレンリーバンク・ビー・エー	200,000,000	202,548,000	

第10回コーペラティブ・セントラル・ライフアイゼン・ボエレンリーバンク・ピー・エー	300,000,000	300,597,000	
第18回コーペラティブ・セントラル・ライフアイゼン・ボエレンリーバンク・ピー・エー	300,000,000	303,168,000	
第18回 積水ハウス株式会社無担保社債	100,000,000	100,322,000	
第7回麒麟ホールディングス株式会社無担保社債	200,000,000	210,846,000	
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	100,849,000	
第9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	103,678,000	
第35回三菱化学株式会社無担保社債	100,000,000	101,553,000	
第8回株式会社三菱ケミカルホールディングス無担保社債	100,000,000	103,380,000	
第4回花王株式会社無担保社債	100,000,000	102,084,000	
第14回武田薬品工業株式会社無担保社債	100,000,000	101,282,000	
第64回新日本製鐵株式会社無担保社債	100,000,000	105,617,000	
第62回株式会社神戸製鋼所無担保社債	100,000,000	98,597,000	
第18回株式会社豊田自動織機無担保社債	100,000,000	106,214,000	
第13回株式会社クボタ無担保社債	100,000,000	101,418,000	
第16回株式会社日立製作所無担保社債	100,000,000	104,313,000	
第44回三菱電機株式会社無担保社債	100,000,000	100,535,000	
日本電産株式会社第1回無担保社債	100,000,000	100,410,000	
第36回富士通株式会社無担保社債	100,000,000	101,401,000	
第11回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	101,972,000	
第12回パナソニック株式会社無担保社債	200,000,000	201,438,000	
第13回パナソニック株式会社無担保社債	200,000,000	202,524,000	
第1回日本生命2011基金特定目的会社特定社債 第1回 - B	200,000,000	202,756,000	
第1回住友生命第4回基金流動化特定目的会社特定社債	100,000,000	100,395,000	
第1回日本生命2012基金特定目的会社特定社債	100,000,000	101,757,000	
第1回明治安田生命2013基金特定目的会社特定社債	100,000,000	101,594,000	
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	101,459,000	
第89回丸紅株式会社無担保社債	100,000,000	102,258,000	

第63回三井物産株式会社無担保社債	100,000,000	121,163,000	
第47回住友商事株式会社無担保社債	100,000,000	103,908,000	
第3回株式会社みずほコーポレート銀行無担保社債	100,000,000	104,156,000	
第8回株式会社みずほコーポレート銀行無担保社債	100,000,000	122,301,000	
株式会社三菱東京UFJ銀行第12回無担保社債	200,000,000	205,798,000	
第25回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	300,000,000	315,168,000	
第110回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	100,000,000	105,124,000	
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	102,279,000	
第4回株式会社りそな銀行無担保社債	100,000,000	108,434,000	
第9回三菱UFJ信託銀行株式会社無担保社債	100,000,000	107,370,000	
第7回住友信託銀行株式会社無担保社債	100,000,000	102,136,000	
第8回住友信託銀行株式会社無担保社債	100,000,000	120,163,000	
第6回株式会社セブン銀行無担保社債	200,000,000	200,858,000	
第1回株式会社みずほフィナンシャルグループ無担保社債	100,000,000	102,555,000	
第20回株式会社三井住友銀行無担保社債	200,000,000	213,988,000	
第24回株式会社三井住友銀行無担保社債	100,000,000	107,196,000	
第8回株式会社みずほ銀行無担保社債	200,000,000	204,194,000	
第9回株式会社みずほ銀行無担保社債	100,000,000	119,978,000	
第16回株式会社日産フィナンシャルサービス無担保社債	100,000,000	100,048,000	
第17回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	108,006,000	
第21回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	100,677,000	
第53回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	100,657,000	
第54回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	101,555,000	
第113回オリックス株式会社無担保社債	100,000,000	102,356,000	
第162回オリックス株式会社無担保社債	100,000,000	100,966,000	
第165回オリックス株式会社無担保社債	100,000,000	100,966,000	
第22回三菱UFJリース株式会社無担保社債	200,000,000	199,998,000	
	100,000,000	106,816,000	

第21回野村ホールディングス株式会社無担保社債			
第38回野村ホールディングス株式会社無担保社債	200,000,000	200,008,000	
第39回野村ホールディングス株式会社無担保社債	200,000,000	202,952,000	
第34回三井不動産株式会社無担保社債	100,000,000	105,930,000	
第58回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	129,957,000	
第110回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	101,519,000	
第41回小田急電鉄株式会社無担保社債	200,000,000	202,022,000	
第7回東日本旅客鉄道株式会社社債	200,000,000	209,808,000	
第9回東日本旅客鉄道株式会社社債	100,000,000	106,091,000	
第15回東日本旅客鉄道株式会社社債	100,000,000	111,337,000	
第34回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	119,328,000	
第52回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	103,388,000	
第110回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	108,534,000	
第3回西日本旅客鉄道株式会社社債	200,000,000	205,722,000	
第5回西日本旅客鉄道株式会社社債	200,000,000	211,508,000	
第3回東海旅客鉄道株式会社普通社債	100,000,000	104,696,000	
第21回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	100,125,000	
第28回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	101,541,000	
第41回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	120,997,000	
第42回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	200,000,000	245,976,000	
第45回阪急阪神ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	101,837,000	
第51回日本電信電話株式会社電信電話債券	300,000,000	302,019,000	
第53回日本電信電話株式会社電信電話債券	300,000,000	308,109,000	
第15回KDDI株式会社無担保社債	100,000,000	106,020,000	
第15回株式会社エヌ・ティ・ティ・ドコモ無担保社債	200,000,000	208,800,000	
第522回東京電力株式会社社債	300,000,000	302,766,000	
第524回東京電力株式会社社債	100,000,000	101,452,000	
第526回東京電力株式会社社債	300,000,000	305,172,000	
第528回東京電力株式会社社債	100,000,000	104,566,000	
第532回東京電力株式会社社債	100,000,000	102,035,000	
第537回東京電力株式会社社債	100,000,000	104,900,000	



第544回東京電力株式会社社債	100,000,000	103,547,000	
第547回東京電力株式会社社債	100,000,000	105,891,000	
第440回関西電力株式会社社債	100,000,000	101,397,000	
第449回関西電力株式会社社債	100,000,000	100,886,000	
第451回関西電力株式会社社債	100,000,000	101,014,000	
第453回関西電力株式会社社債	100,000,000	101,325,000	
第467回関西電力株式会社社債	100,000,000	103,810,000	
第472回関西電力株式会社社債	100,000,000	104,378,000	
第286回北陸電力株式会社社債	100,000,000	106,199,000	
第303回北陸電力株式会社社債	100,000,000	102,070,000	
第471回東北電力株式会社社債	100,000,000	106,125,000	
第472回東北電力株式会社社債	100,000,000	104,468,000	
第253回四国電力株式会社社債	100,000,000	105,065,000	
第346回九州電力株式会社社債	100,000,000	104,831,000	
第384回九州電力株式会社社債	100,000,000	101,789,000	
第394回九州電力株式会社社債	100,000,000	102,713,000	
第400回九州電力株式会社社債	100,000,000	106,311,000	
第405回九州電力株式会社社債	100,000,000	104,383,000	
第328回北海道電力株式会社社債	100,000,000	100,718,000	
第11回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	114,190,000	
第17回東京瓦斯株式会社無担保社債	200,000,000	211,856,000	
第18回大阪瓦斯株式会社無担保社債	200,000,000	218,152,000	
第22回大阪瓦斯株式会社無担保社債	100,000,000	101,470,000	
第27回東邦瓦斯株式会社無担保社債	100,000,000	106,987,000	
第30回東邦瓦斯株式会社無担保社債	100,000,000	100,680,000	
社債券合計	16,100,000,000	16,720,556,000	
合計		246,845,037,878	

### デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

### 外国株式インデックス・マザーファンド

## 貸借対照表

(単位：円)

	(平成27年 2月18日現在)	(平成28年 2月18日現在)
資産の部		
流動資産		
預金	3,236,534,357	3,308,834,984
金銭信託	-	1,287,790,120
コール・ローン	1,040,847,885	-
株式	192,851,012,849	140,920,599,322
投資証券	4,820,978,840	3,618,227,970
派生商品評価勘定	49,390,445	103,225,445
未収入金	204,438,550	123,118,123
未収配当金	301,340,244	215,527,987
未収利息	285	-
差入委託証拠金	1,216,694,740	1,181,615,316
流動資産合計	203,721,238,195	150,758,939,267
資産合計	203,721,238,195	150,758,939,267
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	400,906	29,507,628
前受金	48,989,539	75,594,517
未払金	10,494,869	7,738,430
未払解約金	923,056,407	357,147,432
流動負債合計	982,941,721	469,988,007
負債合計	982,941,721	469,988,007
純資産の部		
元本等		
元本	70,439,999,893	60,812,934,115
剰余金		
剰余金又は欠損金( )	132,298,296,581	89,476,017,145
元本等合計	202,738,296,474	150,288,951,260
純資産合計	202,738,296,474	150,288,951,260
負債純資産合計	203,721,238,195	150,758,939,267

## 注記表

(重要な会計方針の注記)

項目	自平成27年 2月19日 至平成28年 2月18日
----	------------------------------

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

## (貸借対照表に関する注記)

項目	(平成27年 2月18日現在)	(平成28年 2月18日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	70,439,999,893口	60,812,934,115口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 2.8782円 (10,000口当たりの純資産額 28,782円)	1口当たり純資産額 2.4713円 (10,000口当たりの純資産額 24,713円)

## (金融商品に関する注記)

## . 金融商品の状況に関する事項

項目	自 平成27年 2月19日 至 平成28年 2月18日
1. 金融商品に対する取組方針	<p>当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。</p>

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

・ 金融商品の時価等に関する事項

項 目	(平成28年 2月18日現在)
-----	-----------------

1.貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1) 有価証券(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27年 2月18日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位:円)

区 分	種 類	契 約 額 等		時 価	評 価 損 益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	4,994,743,610	-	5,043,733,149	48,989,539
	SPMINI 1503	3,367,973,278	-	3,399,130,620	31,157,342
	DJ EUR 1503	941,656,156	-	948,401,627	6,745,471
	FTSE 1503	434,503,955	-	438,798,307	4,294,352
	SPI200 1503	250,610,221	-	257,402,595	6,792,374
	合計	4,994,743,610	-	5,043,733,149	48,989,539

(平成28年 2月18日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位:円)

区 分	種 類	契 約 額 等		時 価	評 価 損 益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	6,297,590,768	-	6,373,185,285	75,594,517
	SPMINI 1603	4,298,301,620	-	4,371,645,874	73,344,254
	DJ EUR 1603	1,231,476,129	-	1,219,975,002	11,501,127
	FTSE 1603	510,649,956	-	525,271,359	14,621,403
	SPI200 1603	257,163,063	-	256,293,050	870,013
	為替予約取引				

市場取引以外の取引	買建	1,501,022,900	-	1,499,146,200	1,876,700
	米ドル	971,356,300	-	969,799,600	1,556,700
	カナダドル	56,352,700	-	56,671,200	318,500
	ユーロ	179,173,800	-	178,971,300	202,500
	英ポンド	122,320,700	-	122,118,800	201,900
	スイスフラン	61,090,200	-	60,865,200	225,000
	スウェーデンクローナ	19,181,700	-	19,162,000	19,700
	ノルウェークローネ	3,717,100	-	3,732,400	15,300
	デンマーククローネ	12,938,800	-	12,920,000	18,800
	オーストラリアドル	39,862,900	-	39,925,900	63,000
	ニュージーランドドル	755,900	-	755,800	100
	香港ドル	20,367,300	-	20,335,700	31,600
	シンガポールドル	8,931,500	-	8,926,000	5,500
	イスラエルシェケル	4,974,000	-	4,962,300	11,700
	合計	7,798,613,668	-	7,872,331,485	73,717,817

## (注) 1. 時価の算定方法

## (1) 株価指数先物取引の時価の算定方法について

1) 原則として計算期間末日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場で評価しています。このような時価が発表されていない場合には、計算期間末日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しています。

2) 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

## (2) 為替予約取引の時価の算定方法について

1) 計算期間末日に対顧客先物相場の仲値が発表されている外貨については、以下のように評価しています。

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

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

- ・ 計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物相場が発表されている場合には、発表されている対顧客先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの対顧客先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いています。

- ・ 計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い受渡日として、発表されている対顧客先物相場の仲値を用いています。

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

## 2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

## （関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

## （その他の注記）

（平成27年 2月18日現在）	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	101,057,611,433円
同期中における追加設定元本額	5,007,390,111円
同期中における一部解約元本額	35,625,001,651円
平成27年 2月18日現在における元本の内訳	
三井住友・DC外国株式インデックスファンドS	7,413,927,792円
三井住友・DC年金バランス30（債券重点型）	159,418,134円
三井住友・DC年金バランス50（標準型）	696,777,435円
三井住友・DC年金バランス70（株式重点型）	493,237,522円
スミセイ・DCバランスファンド（機動的資産配分型）	33,159,921円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2020	2,480,358円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2025	4,537,922円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2030	6,022,654円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2035	10,365,713円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2040	5,708,398円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2045	12,888,100円
外国株式指数ファンド	340,184,991円
三井住友・DC全海外株式インデックスファンド	49,405,262円
SMAM・外国株式パッシブ・ファンド（適格機関投資家専用）	11,202,362,321円
バランスファンドVA（安定運用型）＜適格機関投資家限定＞	100,030,020円
SMAM・バランスファンドVA安定成長型＜適格機関投資家限定＞	10,784,829,076円
SMAM・バランスファンドVA25＜適格機関投資家専用＞	4,841,327,369円
SMAM・バランスファンドVA37.5＜適格機関投資家専用＞	2,905,430,576円
SMAM・バランスファンドVA50＜適格機関投資家専用＞	12,385,264,184円
SMAM・バランスファンドVL30＜適格機関投資家限定＞	36,784,586円
SMAM・バランスファンドVL50＜適格機関投資家限定＞	191,460,113円
世界6資産バランスファンドVA＜適格機関投資家限定＞	23,432,041円
SMAM・バランスファンドVA75＜適格機関投資家専用＞	1,601,172,970円
SMAM・バランスファンドVL国際分散型＜適格機関投資家限定＞	103,098,450円
SMAM・インデックス・バランスVA25＜適格機関投資家専用＞	302,822,160円
SMAM・インデックス・バランスVA50＜適格機関投資家専用＞	1,439,580,239円
SMAM・バランスファンドVA40＜適格機関投資家専用＞	2,494,530,042円
SMAM・バランスファンドVA35＜適格機関投資家専用＞	3,202,565,359円
SMAM・バランスVA株40T＜適格機関投資家限定＞	319,525,250円
三井住友・外国株式インデックスファンド・VAS（適格機関投資家専用）	1,348,718,700円
三井住友・5資産バランスファンド・VAS（適格機関投資家専用）	3,513,080,051円
SMAM・グローバルバランス40VA＜適格機関投資家限定＞	256,806,373円
SMAM・バランスファンドVA20＜適格機関投資家専用＞	161,290,430円

三井住友・7資産バランスファンド・V A S (適格機関投資家専用)	2,776,046,640円
S M A M・アセットバランスファンドV A 2 0 A <適格機関投資家専用>	41,981,586円
S M A M・アセットバランスファンドV A 3 5 A <適格機関投資家専用>	25,845,812円
S M A M・アセットバランスファンドV A 5 0 A <適格機関投資家専用>	11,292,400円
S M A M・アセットバランスファンドV A 2 0 L <適格機関投資家専用>	100,030,538円
S M A M・アセットバランスファンドV A 2 5 L <適格機関投資家専用>	219,965,788円
S M A M・アセットバランスファンドV A 2 0 T <適格機関投資家専用>	205,718,655円
S M A M・F G新興国重視型バランス2 0 V A <適格機関投資家限定>	384,391円
S M A M・F Gグローバルバランス2 5 V A <適格機関投資家限定>	5,087,691円
S M A M・グローバル・マルチアセット・グロース・ファンド(安定成長型)<適格機関投資家限定>	104,890円
S M A M・外国株式インデックスファンドS A <適格機関投資家限定>	611,316,990円
合計	70,439,999,893円

## (平成28年 2月18日現在)

開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	70,439,999,893円
同期中における追加設定元本額	12,746,712,530円
同期中における一部解約元本額	22,373,778,308円
平成28年 2月18日現在における元本の内訳	
三井住友・D C外国株式インデックスファンドS	8,520,048,160円
三井住友・D C年金バランス3 0(債券重点型)	198,225,937円
三井住友・D C年金バランス5 0(標準型)	847,976,275円
三井住友・D C年金バランス7 0(株式重点型)	572,353,182円
S M A M・グローバルバランスファンド(機動的資産配分型)	29,916,111円
スミセイ・D Cターゲットイヤーファンド2 0 2 0	2,966,762円
スミセイ・D Cターゲットイヤーファンド2 0 2 5	6,874,650円
スミセイ・D Cターゲットイヤーファンド2 0 3 0	27,293,669円
スミセイ・D Cターゲットイヤーファンド2 0 3 5	25,355,393円
スミセイ・D Cターゲットイヤーファンド2 0 4 0	15,579,454円
スミセイ・D Cターゲットイヤーファンド2 0 4 5	34,898,099円
外国株式指数ファンド	431,467,598円
三井住友・D C全海外株式インデックスファンド	448,309,752円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	221,784,803円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	367,385,998円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	456,149,444円
S M A M・外国株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	8,208,074,122円
バランスファンドV A(安定運用型)<適格機関投資家限定>	51,917,974円
S M A M・バランスファンドV A安定成長型<適格機関投資家限定>	6,155,451,330円
S M A M・バランスファンドV A 2 5<適格機関投資家専用>	3,690,017,668円
S M A M・バランスファンドV A 3 7 . 5<適格機関投資家専用>	2,714,788,088円
S M A M・バランスファンドV A 5 0<適格機関投資家専用>	11,474,740,811円
S M A M・バランスファンドV L 3 0<適格機関投資家限定>	29,451,740円
S M A M・バランスファンドV L 5 0<適格機関投資家限定>	179,138,472円



世界6資産バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	14,389,495円
SMAM・バランスファンドVA75<適格機関投資家専用>	1,389,425,645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>	100,455,805円
SMAM・インデックス・バランスVA25<適格機関投資家専用>	276,789,122円
SMAM・インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用>	1,315,327,439円
SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用>	2,218,092,318円
SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>	3,084,006,565円
SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定>	98,842,924円
三井住友・外国株式インデックスファンド・VAS(適格機関投資家専用)	1,287,986,612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)	2,687,299,052円
SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	245,723,714円
SMAM・バランスファンドVA20<適格機関投資家専用>	141,397,142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)	2,530,233,327円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>	38,232,319円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>	23,824,479円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用>	11,369,463円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>	86,662,919円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	201,264,023円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T<適格機関投資家専用>	189,133,634円
SMAM・FG新興国重視型バランス20VA<適格機関投資家限定>	243,873円
SMAM・FGグローバルバランス25VA<適格機関投資家限定>	3,735,225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>	53,226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>	93,084,388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>	70,097円
SMAM・マルチアセットストラテジーファンド2016-01<適格機関投資家限定>	65,125,817円
合計	60,812,934,115円

## 附属明細表

## 有価証券明細表

## (a)株式

通貨	銘柄	株数	評価額		備考
			単価	金額	
米ドル	ANADARKO PETROLEUM CORP	23,121	40.50	936,400.50	
	ANTERO RESOURCES CORP	4,800	26.25	126,000.00	
	APACHE CORPORATION	17,646	40.06	706,898.76	
	BAKER HUGHES INC	20,189	42.49	857,830.61	
	CABOT OIL & GAS CORPORATION	19,520	20.49	399,964.80	
	CAMERON INTERNATIONAL CORP	8,293	66.28	549,660.04	
	CHENIERE ENERGY INC	9,802	28.37	278,082.74	
	CHEVRON CORPORATION	87,034	88.31	7,685,972.54	
	CIMAREX ENERGY CO	4,508	84.69	381,782.52	

CONCHO RESOURCES INC	5,959	95.51	569,144.09
CONOCOPHILLIPS	57,399	33.91	1,946,400.09
CONTINENTAL RESOURCES, INC.	4,214	19.55	82,383.70
CORE LABORATORIES N.V.	2,101	105.83	222,348.83
DEVON ENERGY CORPORATION	17,191	20.33	349,493.03
ENERGEN CORPORATION	3,391	24.03	81,485.73
ENSCO PLC-CL A	11,255	8.87	99,831.85
EOG RESOURCES INC	25,511	70.82	1,806,689.02
EQT CORPORATION	7,021	62.40	438,110.40
EXXON MOBIL CORPORATION	193,021	82.00	15,827,722.00
FMC TECHNOLOGIES INC	10,651	25.14	267,766.14
HALLIBURTON CO	39,703	31.40	1,246,674.20
HELMERICH & PAYNE INC	5,427	52.92	287,196.84
HESS CORPORATION	11,965	43.47	520,118.55
HOLLYFRONTIER CORP	8,311	31.07	258,222.77
KINDER MORGAN INC	85,358	17.18	1,466,450.44
MARATHON OIL CORP	30,675	7.41	227,301.75
MARATHON PETROLEUM CORPORATION	25,098	32.96	827,230.08
MURPHY OIL CORPORATION	7,419	17.98	133,393.62
NATIONAL-OILWELL VARCO INC.	17,446	29.11	507,853.06
NOBLE ENERGY INC	19,748	30.42	600,734.16
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	35,553	70.63	2,511,108.39
OCEANEERING INTL INC	4,001	26.99	107,986.99
ONEOK INC	9,311	21.73	202,328.03
PHILLIPS 66	24,957	80.59	2,011,284.63
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	7,605	124.55	947,202.75
PLAINS GP HOLDINGS LP-CL A	11,469	6.83	78,333.27
RANGE RESOURCES CORPORATION	8,475	26.84	227,469.00
SCHLUMBERGER LTD	58,501	72.93	4,266,477.93
SOUTHWESTERN ENERGY COMPANY	17,747	8.88	157,593.36
SPECTRA ENERGY CORPORATION	31,453	29.31	921,887.43
TESORO CORPORATION	5,612	70.52	395,758.24
VALERO ENERGY CORP	23,228	57.77	1,341,881.56
WEATHERFORD INTL PLC	33,009	6.72	221,820.48
WHITING PETROLEUM CORP	10,112	5.37	54,301.44
WILLIAMS COS INC	32,245	15.69	505,924.05
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	9,605	132.51	1,272,758.55
AIRGAS INC	3,207	140.85	451,705.95
ALBEMARLE CORPORATION	5,355	52.77	282,583.35
ALCOA INC	59,096	8.52	503,497.92
ASHLAND INC	3,191	94.19	300,560.29
AVERY DENNISON CORP	4,362	64.20	280,040.40

AXALTA COATING SYSTEMS LTD	5,633	25.03	140,993.99
BALL CORPORATION	6,010	67.12	403,391.20
CELANESE CORPORATION	6,817	59.46	405,338.82
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	10,460	31.70	331,582.00
CROWN HOLDINGS INC	6,079	45.82	278,539.78
DOW CHEMICAL	52,207	47.99	2,505,413.93
DU PONT (E.I.) DE NEMOURS	41,737	60.60	2,529,262.20
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	7,159	63.85	457,102.15
ECOLAB INC	12,353	109.96	1,358,335.88
FMC CORPORATION	6,226	37.86	235,716.36
FREEMONT-MCMORAN INC	47,325	7.16	338,847.00
INTERNATIONAL PAPER CO	18,567	35.58	660,613.86
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	3,872	106.08	410,741.76
LYONDELLBASELL INDU-CL A	18,161	79.10	1,436,535.10
MARTIN MARIETTA MATERIALS	2,450	138.91	340,329.50
MONSANTO CO	21,775	89.64	1,951,911.00
MOSAIC CO/THE	13,768	25.30	348,330.40
NEWMONT MINING CORP	25,587	24.84	635,581.08
NUCOR CORP	15,086	40.76	614,905.36
PACKAGING CORP OF AMERICA	4,571	47.96	219,225.16
PPG INDUSTRIES INC	12,675	95.00	1,204,125.00
PRAXAIR INC	13,188	104.50	1,378,146.00
SEALED AIR CORP	9,368	43.10	403,760.80
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	3,569	259.15	924,906.35
VULCAN MATERIALS CO	6,171	95.34	588,343.14
WESTLAKE CHEMICAL CORP	2,235	44.16	98,697.60
WESTROCK CO	12,328	32.71	403,248.88
3M COMPANY	29,100	156.62	4,557,642.00
ACUITY BRANDS INC	1,995	194.84	388,705.80
AERCAP HOLDINGS NV	4,590	30.97	142,152.30
AGCO CORP	3,447	49.25	169,764.75
AMETEK INC	11,742	46.01	540,249.42
BE AEROSPACE INC	4,300	41.36	177,848.00
BOEING CO	30,083	116.34	3,499,856.22
CATERPILLAR INC	26,190	67.26	1,761,539.40
CHICAGO BRIDGE & IRON COMPANY NV	4,593	33.74	154,967.82
CUMMINS INC	7,713	97.53	752,248.89
DANAHER CORP	28,769	87.07	2,504,916.83
DEERE & CO	14,339	81.43	1,167,624.77
DOVER CORP	6,788	61.65	418,480.20
EATON CORP PLC	21,439	56.01	1,200,798.39
EMERSON ELECTRIC CO	30,995	47.76	1,480,321.20

FASTENAL COMPANY	12,202	44.42	542,012.84
FLOWSERVE CORPORATION	6,212	43.19	268,296.28
FLUOR CORP	6,997	46.43	324,870.71
GENERAL DYNAMICS CORP	12,516	135.03	1,690,035.48
GENERAL ELECTRIC CO	437,776	29.34	12,844,347.84
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	34,636	106.13	3,675,918.68
ILLINOIS TOOL WORKS	15,554	94.93	1,476,541.22
INGERSOLL-RAND PLC	12,263	52.45	643,194.35
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	5,610	38.43	215,592.30
L-3 COMMUNICATIONS HLDGS INC	3,735	117.14	437,517.90
LOCKHEED MARTIN CORPORATION	13,055	212.74	2,777,320.70
MASCO CORP	15,275	27.23	415,938.25
NORTHROP GRUMMAN CORP	8,195	190.06	1,557,541.70
PACCAR INC	15,905	52.05	827,855.25
PARKER HANNIFIN CORPORATION	6,155	101.03	621,839.65
PENTAIR PLC-REGISTERED	8,019	47.49	380,822.31
QUANTA SERVICES INC	8,580	18.56	159,244.80
RAYTHEON COMPANY	13,915	121.68	1,693,177.20
ROCKWELL AUTOMATION INC	5,939	102.25	607,262.75
ROCKWELL COLLINS INC.	6,171	84.30	520,215.30
ROPER TECHNOLOGIES INC	4,691	169.71	796,109.61
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	8,113	34.05	276,247.65
SNAP-ON INC	2,746	143.45	393,913.70
STANLEY BLACK & DECKER INC	6,822	93.06	634,855.32
TEXTRON INC	13,079	33.30	435,530.70
TRANSDIGM GROUP INC	2,545	207.43	527,909.35
UNITED RENTALS INC	4,660	48.18	224,518.80
UNITED TECHNOLOGIES CORP	39,455	88.12	3,476,774.60
WABTEC CORP	4,643	69.49	322,642.07
WW GRAINGER INC	2,806	216.36	607,106.16
XYLEM INC	8,801	37.66	331,445.66
CINTAS CORP	4,370	83.60	365,332.00
DUN & BRADSTREET CORP	1,471	94.49	138,994.79
EQUIFAX INC	5,415	101.79	551,192.85
IHS INC-CLASS A	3,017	103.07	310,962.19
MANPOWERGROUP	3,518	75.77	266,558.86
NIELSEN HOLDINGS PLC	15,701	48.41	760,085.41
REPUBLIC SERVICES INC	10,643	45.23	481,382.89
ROBERT HALF INTL INC	6,506	37.96	246,967.76
STERICYCLE, INC.	3,750	111.41	417,787.50
THE ADT CORPORATION	8,262	39.59	327,092.58
TYCO INTERNATIONAL PLC	19,845	34.95	693,582.75

VERISK ANALYTICS INC	7,324	68.39	500,888.36
WASTE MANAGEMENT INC	21,410	54.90	1,175,409.00
AMERCO	290	344.01	99,762.90
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	7,431	39.34	292,335.54
C.H.ROBINSON WORLDWIDE, INC.	6,364	70.84	450,825.76
CSX CORPORATION	45,626	24.83	1,132,893.58
DELTA AIR LINES INC	8,821	46.10	406,648.10
EXPEDITORS INTL WASH INC	9,324	46.80	436,363.20
FEDEX CORP	12,319	133.09	1,639,535.71
HERTZ GLOBAL HOLDINGS INC	18,331	8.49	155,630.19
J.B. HUNT TRANSPORT SERVICES INC	4,585	77.09	353,457.65
KANSAS CITY SOUTHERN	5,231	82.67	432,446.77
NORFOLK SOUTHERN CORP	13,773	75.77	1,043,580.21
SOUTHWEST AIRLINES	7,984	38.51	307,463.84
UNION PACIFIC CORP	40,515	79.96	3,239,579.40
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS INC	3,971	50.61	200,972.31
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	32,610	98.30	3,205,563.00
AUTOLIV INC	3,884	107.90	419,083.60
BORGWARNER INC	10,148	33.59	340,871.32
DELPHI AUTOMOTIVE PLC	13,056	66.01	861,826.56
FORD MOTOR COMPANY	170,499	12.27	2,092,022.73
GENERAL MOTORS CO	66,829	29.27	1,956,084.83
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	12,804	30.78	394,107.12
HARLEY-DAVIDSON INC	10,085	41.37	417,216.45
JOHNSON CONTROLS INC	30,264	36.11	1,092,833.04
LEAR CORP	3,675	106.33	390,762.75
MOBILEYE NV	3,705	27.97	103,628.85
TESLA MOTORS INC	4,419	168.68	745,396.92
WABCO HOLDINGS INC	2,607	96.09	250,506.63
COACH INC	12,806	35.97	460,631.82
D.R.HORTON INC	14,816	24.75	366,696.00
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY	7,453	49.53	369,147.09
GARMIN LTD	5,408	41.06	222,052.48
HANESBRANDS INC	19,101	27.88	532,535.88
HARMAN INTERNATIONAL	3,248	76.71	249,154.08
HASBRO INC	5,206	72.05	375,092.30
JARDEN CORP	9,525	52.09	496,157.25
LEGGETT & PLATT INC	5,956	43.47	258,907.32
LENNAR CORP-CL A	7,512	40.52	304,386.24
LULULEMON ATHLETICA INC	5,461	60.51	330,445.11
MATTEL INC	15,850	31.91	505,773.50
MICHAEL KORS HOLDINGS LIMITED	9,477	52.49	497,447.73

MOHAWK INDUSTRIES INC	2,838	163.07	462,792.66
NEWELL RUBBERMAID INC	12,025	37.43	450,095.75
NIKE INC -CL B	63,174	58.17	3,674,831.58
POLARIS INDUSTRIES INC	3,113	86.81	270,239.53
PULTE GROUP INC	13,149	16.61	218,404.89
PVH CORP	4,186	75.92	317,801.12
RALPH LAUREN CORPORATION	2,738	89.24	244,339.12
TOLL BROTHERS INC	7,285	25.23	183,800.55
UNDER ARMOUR INC	8,351	82.97	692,882.47
VF CORP	15,651	61.21	957,997.71
WHIRLPOOL CORP	3,779	138.85	524,714.15
ARAMARK	10,000	30.89	308,900.00
CARNIVAL CORP	19,432	45.92	892,317.44
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	1,451	514.01	745,828.51
DARDEN RESTAURANTS INC	5,517	61.54	339,516.18
H&R BLOCK INC	10,337	34.68	358,487.16
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS INC	22,274	19.70	438,797.80
LAS VEGAS SANDS CORP	17,623	46.32	816,297.36
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	9,857	66.68	657,264.76
MCDONALD'S CORPORATION	43,809	118.64	5,197,499.76
MELCO CROWN ENTERTAINME-ADR	2,759	15.75	43,454.25
MGM MIRAGE	19,554	20.07	392,448.78
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDINGS	7,708	42.83	330,133.64
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	7,877	73.30	577,384.10
STARBUCKS CORP	69,126	57.63	3,983,731.38
STARWOOD HOTELS & RESORTS	7,550	66.95	505,472.50
WYNDHAM WORLDWIDE CORP	5,841	68.94	402,678.54
WYNN RESORTS LTD	3,642	76.21	277,556.82
YUM! BRANDS INC	19,665	71.20	1,400,148.00
CABLEVISION SYSTEMS-NY GRP-A	9,712	32.55	316,125.60
CBS CORP-CL B	20,262	46.56	943,398.72
CHARTER COMMUNICATTION-A	3,701	171.91	636,238.91
COMCAST CORP-CL A	115,400	57.70	6,658,580.00
DISCOVERY COMMUNICATIONS INC-A	5,949	26.71	158,897.79
DISCOVERY COMMUNICATIONS INC-C	13,489	26.01	350,848.89
DISH NETWORK CORP.	9,834	46.07	453,052.38
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	18,385	20.88	383,878.80
LIBERTY GLOBAL PLC-A	11,061	37.31	412,685.91
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	27,500	36.02	990,550.00
LIBERTY MEDIA CORP-A	3,927	33.64	132,104.28
LIBERTY MEDIA CORP-C	9,534	33.00	314,622.00
NEWS CORP-CLASS A	15,889	11.00	174,779.00

OMNICOM GROUP	11,397	75.46	860,017.62
SCRIPPS NETWORKS INTERACTIVE	3,392	55.91	189,646.72
SIRIUS XM HOLDINGS INC	109,137	3.56	389,073.40
TEGNA INC	10,189	24.24	246,981.36
THE WALT DISNEY CO.	74,492	95.50	7,113,986.00
TIME WARNER CABLE, INC.	12,956	187.68	2,431,582.08
TIME WARNER INC	38,111	64.69	2,465,400.59
TWENTY-FIRST CE CL-A	56,248	26.47	1,488,884.56
TWENTY-FIRST CE CL-B	20,085	26.47	531,649.95
VIACOM INC-CLASS B	16,362	35.85	586,577.70
ADVANCE AUTO PARTS	3,481	143.41	499,210.21
AMAZON.COM INC	18,447	534.10	9,852,542.70
AUTONATION INC	3,089	49.66	153,399.74
AUTOZONE INC	1,411	754.18	1,064,147.98
BED BATH & BEYOND INC	8,340	45.73	381,388.20
BEST BUY COMPANY INC	13,895	30.05	417,544.75
CARMAX INC	9,696	47.95	464,923.20
DICK'S SPORTING GOODS INC	3,694	39.82	147,095.08
DOLLAR GENERAL CORP	13,434	74.27	997,743.18
DOLLAR TREE INC	10,642	80.88	860,724.96
EXPEDIA INC	5,769	110.88	639,666.72
FOOT LOCKER INC	6,434	67.66	435,324.44
GAMESTOP CORP-CL A	5,557	28.74	159,708.18
GAP INC/THE	11,563	25.45	294,278.35
GENUINE PARTS CO	7,329	90.02	659,756.58
HOME DEPOT INC	59,651	121.21	7,230,297.71
KOHL'S CORP	9,684	43.90	425,127.60
L BRANDS INC	11,410	81.85	933,908.50
LIBERTY INTERACTIVE CORP QVC GROUP-A	21,340	24.90	531,366.00
LKQ CORPORATION	13,314	26.02	346,430.28
LOWE'S COMPANIES INC	42,512	68.00	2,890,816.00
MACY'S INC	15,680	41.10	644,448.00
NETFLIX INC	18,976	94.76	1,798,165.76
NORDSTROM INC	6,499	52.25	339,572.75
O'REILLY AUTOMOTIVE INC NEW	4,706	254.62	1,198,241.72
PRICELINE GROUP INC/THE	2,336	1,235.56	2,886,268.16
ROSS STORES INC	19,002	55.07	1,046,440.14
SIGNET JEWELERS LTD	3,437	105.37	362,156.69
STAPLES INC	31,615	9.16	289,593.40
TARGET CORP	27,175	72.10	1,959,317.50
TIFFANY & CO	6,182	65.62	405,662.84
TJX COMPANIES INC	31,582	71.79	2,267,271.78

TRACTOR SUPPLY COMPANY	6,118	86.01	526,209.18
TRIPADVISOR INC-W/I	5,824	65.35	380,598.40
ULTA SALON COSMETICS & FRAGRANCE INC	2,921	158.92	464,205.32
COSTCO WHOLESALE CORP	20,370	150.91	3,074,036.70
CVS HEALTH CORPORATION	51,643	97.69	5,045,004.67
KROGER CO	43,255	39.42	1,705,112.10
RITE AID CORP	43,701	7.87	343,926.87
SYSCO CORP	27,526	44.38	1,221,603.88
WAL-MART STORES INC	74,531	66.11	4,927,244.41
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	40,502	78.16	3,165,636.32
WHOLE FOODS MARKET INC	17,060	31.76	541,825.60
ALTRIA GROUP INC	90,711	60.40	5,478,944.40
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	28,158	33.40	940,477.20
BROWN-FORMAN CORPORATION	5,392	99.84	538,337.28
BUNGE LIMITED	6,595	50.40	332,388.00
CAMPBELL SOUP CO	9,076	60.90	552,728.40
COCA-COLA CO/THE	191,306	43.49	8,319,897.94
COCA-COLA ENTERPRISES INC	10,446	49.06	512,480.76
CONAGRA FOODS INC	20,161	41.70	840,713.70
CONSTELLATION BRANDS INC-A	7,861	142.01	1,116,340.61
DR.PEPPER SNAPPLE GROUP, INC	8,846	89.33	790,213.18
GENERAL MILLS INC	27,332	58.14	1,589,082.48
HORMEL FOODS CORPORATION	13,718	44.47	610,039.46
JM SMUCKER CO/THE-NEW COM	5,132	127.43	653,970.76
KELLOGG CO	11,879	75.75	899,834.25
KEURIG GREEN MOUNTAIN INC	5,545	90.40	501,268.00
KRAFT HEINZ COMPANY	27,702	74.24	2,056,596.48
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	5,445	91.26	496,910.70
MEAD JOHNSON NUTRITION COMPANY	9,062	74.99	679,559.38
MOLSON COORS BREWING COMPANY	7,228	86.24	623,342.72
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	74,807	39.81	2,978,066.67
MONSTER BEVERAGE CORPORATION	6,708	125.44	841,451.52
PEPSICO INC	68,007	99.55	6,770,096.85
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL INC.	71,753	91.23	6,546,026.19
REYNOLDS AMERICAN INC	40,104	48.97	1,963,892.88
THE HERSHEY COMPANY	7,097	91.61	650,156.17
TYSON FOODS INC-CL A	14,403	62.41	898,891.23
WHITEWAVE FOODS CO	7,662	38.27	293,224.74
CHURCH & DWIGHT CO INC	5,983	89.88	537,752.04
CLOROX COMPANY	5,833	129.42	754,906.86
COLGATE-PALMOLIVE COMPANY	39,634	67.06	2,657,856.04
EDGEWELL PERSONAL CARE CO	2,963	77.24	228,862.12



ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	10,328	90.07	930,242.96
KIMBERLY-CLARK CORP	16,929	130.50	2,209,234.50
PROCTER & GAMBLE CO	125,660	82.45	10,360,667.00
ABBOTT LABORATORIES	68,351	38.45	2,628,095.95
AETNA INC	15,937	105.46	1,680,716.02
AMERISOURCEBERGEN CORP	9,332	87.49	816,456.68
ANTHEM INC	12,135	127.56	1,547,940.60
BARD(C.R.) INC	3,414	188.06	642,036.84
BAXALTA INC	25,035	40.11	1,004,153.85
BAXTER INTERNATIONAL INC	24,438	38.21	933,775.98
BECTON DICKINSON & CO	9,509	144.11	1,370,341.99
BOSTON SCIENTIFIC CORP	62,550	17.57	1,099,003.50
CARDINAL HEALTH INC	14,789	80.98	1,197,613.22
CENTENE CORP	5,330	57.62	307,114.60
CERNER CORP	14,818	52.81	782,538.58
CIGNA CORP	11,728	135.85	1,593,248.80
COOPER COMPANIES INC (THE)	2,282	139.33	317,951.06
DAVITA HEALTHCARE PARTNERS INC	7,918	64.09	507,464.62
DENTSPLY INTERNATIONAL INC	6,010	55.91	336,019.10
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	10,124	86.62	876,940.88
ENVISION HEALTHCARE HOLDINGS	8,500	21.09	179,265.00
EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO	31,624	69.39	2,194,389.36
HCA HOLDINGS, INC.	15,366	67.05	1,030,290.30
HENRY SCHEIN INC	3,725	164.01	610,937.25
HOLOGIC INC	10,700	34.47	368,829.00
HUMANA INC.	6,785	168.31	1,141,983.35
IMS HEALTH HOLDINGS INC	7,700	25.41	195,657.00
INTUITIVE SURGICAL INC	1,697	541.86	919,536.42
LABORATORY CRP OF AMR HLDGS	4,739	105.80	501,386.20
MALLINCKRODT PLC	5,503	67.33	370,516.99
MCKESSON CORP	10,759	155.57	1,673,777.63
MEDNAX INC	4,300	64.81	278,683.00
MEDTRONIC PLC	65,898	75.60	4,981,888.80
PATTERSON COS INC	4,102	44.24	181,472.48
QUEST DIAGNOSTICS	6,376	64.57	411,698.32
QUINTILES TRANSNATIONAL HOLDINGS INC	4,422	63.17	279,337.74
RESMED INC	5,997	59.25	355,322.25
ST JUDE MEDICAL INC	12,789	53.15	679,735.35
STRYKER CORP	15,689	96.29	1,510,693.81
UNITEDHEALTH GROUP INC	44,144	118.30	5,222,235.20
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	4,394	107.74	473,409.56
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	4,743	78.92	374,317.56

ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	8,027	95.37	765,534.99
ABBVIE INC	76,629	55.01	4,215,361.29
AGILENT TECHNOLOGIES INC	16,003	37.87	606,033.61
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	10,499	148.60	1,560,151.40
ALKERMES PLC	6,377	34.89	222,493.53
ALLERGAN PLC	18,306	283.20	5,184,259.20
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	3,571	65.70	234,614.70
AMGEN INC	35,263	151.07	5,327,181.41
BIOGEN INC	10,981	265.63	2,916,883.03
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	7,516	77.81	584,819.96
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	77,585	63.92	4,959,233.20
CELGENE CORP	36,597	105.31	3,854,030.07
ELI LILLY & CO	46,187	74.68	3,449,245.16
ENDO INTERNATIONAL PLC	10,390	52.76	548,176.40
GILEAD SCIENCES INC	67,941	89.36	6,071,207.76
ILLUMINA INC	6,507	155.63	1,012,684.41
INCYTE CORP	7,283	74.45	542,219.35
IONIS PHARMACEUTICALS INC	5,769	38.74	223,491.06
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	2,928	122.79	359,529.12
JOHNSON & JOHNSON	128,193	102.50	13,139,782.50
MEDIVATION INC	7,392	32.28	238,613.76
MERCK & CO. INC.	130,393	50.60	6,597,885.80
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL INC	1,322	321.43	424,930.46
MYLAN NV	19,080	46.27	882,831.60
PERRIGO CO PLC	6,780	145.17	984,252.60
PFIZER INC	285,510	29.63	8,459,661.30
REGENERON PHARMACEUTICALS	3,586	397.26	1,424,574.36
TARO PHARMACEUTICAL INDUSTRIES	312	134.69	42,023.28
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	18,448	130.70	2,411,153.60
UNITED THERAPEUTICS CORP	2,212	131.62	291,143.44
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	11,194	88.25	987,870.50
WATERS CORP	4,006	122.13	489,252.78
ZOETIS INC	22,514	41.80	941,085.20
BANK OF AMERICA CORP	484,463	12.56	6,084,855.28
BB & T CORPORATION	36,027	32.92	1,186,008.84
CIT GROUP INC	8,202	28.15	230,886.30
CITIGROUP INC	139,761	39.78	5,559,692.58
CITIZENS FINANCIAL GROUP	24,353	19.65	478,536.45
COMERICA INC	8,610	33.87	291,620.70
FIFTH THIRD BANCORP	36,500	15.41	562,465.00
FIRST REPUBLIC BANK/CA	6,528	60.87	397,359.36
HUNTINGTON BANCSHARES INC	35,918	8.77	315,000.86

JPMORGAN CHASE & CO	171,402	58.77	10,073,295.54
KEYCORP	38,474	10.93	420,520.82
M & T BANK CORP	6,915	108.53	750,484.95
NEW YORK COMMUNITY BANCORP	21,566	15.52	334,704.32
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL INC	15,218	14.68	223,400.24
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	24,013	84.06	2,018,532.78
REGIONS FINANCIAL CORPORATION	60,408	7.82	472,390.56
SIGNATURE BANK	2,300	131.57	302,611.00
SUNTRUST BANKS INC	23,255	34.43	800,669.65
US BANCORP	81,934	40.12	3,287,192.08
WELLS FARGO & COMPANY	225,859	48.13	10,870,593.67
AFFILIATED MANAGERS GROUP	2,457	130.60	320,884.20
ALLY FINANCIAL INC	20,464	17.07	349,320.48
AMERICAN EXPRESS COMPANY	41,541	53.61	2,227,013.01
AMERIPRISE FINANCIAL INC	8,391	84.97	712,983.27
BANK OF NEW YORK MELLON CORP(THE)	51,766	34.91	1,807,151.06
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	54,952	130.26	7,158,047.52
BLACKROCK INC	5,725	319.88	1,831,313.00
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	25,449	65.18	1,658,765.82
CME GROUP INC.	14,570	92.15	1,342,625.50
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	20,303	46.44	942,871.32
E*TRADE FINANCIAL CORPORATION	13,758	22.28	306,528.24
EATON VANCE CORP	5,530	29.77	164,628.10
FRANKLIN RESOURCES INC	17,949	34.26	614,932.74
GOLDMAN SACHS GROUP INC	18,156	150.94	2,740,466.64
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	5,527	246.39	1,361,797.53
INVESCO LIMITED	20,708	27.45	568,434.60
LEGG MASON INC	4,006	27.66	110,805.96
LEUCADIA NATIONAL CORPORATION	15,223	15.23	231,846.29
MCGRAW HILL FINANCIAL INC	12,392	88.87	1,101,277.04
MOODY'S CORP	8,503	85.72	728,877.16
MORGAN STANLEY	67,738	24.23	1,641,291.74
NASDAQ INC	5,692	62.96	358,368.32
NAVIENT CORPORATION	15,911	9.91	157,678.01
NORTHERN TRUST CORP	10,598	59.61	631,746.78
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	5,579	43.31	241,626.49
SCHWAB (CHARLES) CORP	53,872	24.48	1,318,786.56
SEI INVESTMENTS COMPANY	7,092	37.29	264,460.68
STATE STREET CORP	19,301	56.58	1,092,050.58
SYNCHRONY FINANCIAL	37,799	26.27	992,979.73
T ROWE PRICE GROUP INC	11,704	70.26	822,323.04
TD AMERITRADE HOLDING CORPORATION	11,968	27.86	333,428.48

AFLAC INC	20,314	59.07	1,199,947.98
ALLEGHANY CORPORATION	770	465.00	358,050.00
ALLSTATE CORP	18,558	65.02	1,206,641.16
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	60,158	52.67	3,168,521.86
AON PLC	12,761	95.00	1,212,295.00
ARCH CAPITAL GROUP LTD.	5,391	68.19	367,612.29
ARTHUR J GALLAGHER & CO	8,087	39.39	318,546.93
ASSURANT INC	3,249	69.25	224,993.25
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	4,260	53.28	226,972.80
CHUBB LTD	21,468	116.91	2,509,823.88
CINCINNATI FINANCIAL CORP	6,769	62.45	422,724.05
EVEREST RE GROUP LTD	2,147	185.32	397,882.04
FNF GROUP	11,145	32.47	361,878.15
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	18,985	41.91	795,661.35
LINCOLN NATIONAL CORP	11,366	35.88	407,812.08
LOEWS CORPORATION	13,343	37.39	498,894.77
MARKEL CORP	630	844.00	531,720.00
MARSH & MCLENNAN COS	24,458	57.37	1,403,155.46
METLIFE INC	43,953	39.27	1,726,034.31
PARTNERRE LTD	2,297	140.10	321,809.70
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	13,370	37.56	502,177.20
PROGRESSIVE CORP	27,420	32.06	879,085.20
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	20,554	66.60	1,368,896.40
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	2,159	113.51	245,068.09
TORCHMARK CORPORATION	5,356	52.28	280,011.68
TRAVELERS COS INC(THE)	14,579	109.18	1,591,735.22
UNUM GROUP	11,114	27.51	305,746.14
VOYA FINANCIAL INC	10,875	29.24	317,985.00
W.R.BERKLEY CORPORATION	4,740	51.83	245,674.20
WILLIS TOWERS WATSON PLC	6,260	111.24	696,362.40
XL GROUP PLC	13,694	34.22	468,608.68
CBRE GROUP INC-A	14,256	25.84	368,375.04
CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP	15,149	84.68	1,282,817.32
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	25,000	5.77	144,250.00
JONES LANG LASALLE INC	2,108	103.26	217,672.08
REALOGY HOLDINGS CORP	6,236	31.19	194,500.84
WEYERHAEUSER CO	23,559	24.18	569,656.62
ACCENTURE PLC-CL A	29,144	99.01	2,885,547.44
ACTIVISION BLIZZARD INC	22,683	29.45	668,014.35
ADOBE SYSTEMS INC	23,011	81.85	1,883,450.35
AKAMAI TECHNOLOGIES	8,580	53.42	458,343.60
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	2,793	192.41	537,401.13

ALPHABET INC-CL A	13,454	731.97	9,847,924.38
ALPHABET INC-CL C	14,364	708.40	10,175,457.60
ANSYS INC	4,110	86.18	354,199.80
AUTODESK INC	10,253	46.67	478,507.51
AUTOMATIC DATA PROCESSING	21,592	85.33	1,842,445.36
CA INC	14,210	28.81	409,390.10
CDK GLOBAL INC	6,408	43.30	277,466.40
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES	2,916	81.39	237,333.24
CITRIX SYSTEMS INC	7,141	69.22	494,300.02
COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS CORPORATION	28,634	56.61	1,620,970.74
EBAY INC	51,558	23.22	1,197,176.76
ELECTRONIC ARTS INC	14,215	59.84	850,625.60
EQUINIX INC	3,182	290.65	924,848.30
FACEBOOK INC-A	99,643	105.20	10,482,443.60
FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES	12,749	59.54	759,075.46
FIREEYE INC	6,180	13.80	85,284.00
FISERV INC	10,686	95.86	1,024,359.96
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	3,361	127.50	428,527.50
FORTINET INC	6,500	26.18	170,170.00
GARTNER INC	3,469	82.78	287,163.82
GLOBAL PAYMENTS INC	5,600	59.19	331,464.00
INTL BUSINESS MACHINES CORP	43,279	126.10	5,457,481.90
INTUIT INC	12,142	98.36	1,194,287.12
LINKEDIN CORP-A	5,151	111.01	571,812.51
MASTERCARD INC-CL A	46,487	87.21	4,054,131.27
MICROSOFT CORP	352,232	52.42	18,464,001.44
NETSUITE INC	2,000	55.10	110,200.00
NUANCE COMMUNICATIONS INC	11,121	18.35	204,070.35
ORACLE CORPORATION	161,308	36.63	5,908,712.04
PAYCHEX INC	14,341	50.61	725,798.01
PAYPAL HOLDINGS INC	49,713	36.36	1,807,564.68
RED HAT INC	8,251	66.34	547,371.34
SABRE CORP	8,000	27.32	218,560.00
SALESFORCE.COM, INC.	28,429	63.49	1,804,957.21
SERVICENOW INC	6,961	55.26	384,664.86
SPLUNK INC	5,933	34.52	204,807.16
SYMANTEC CORPORATION	31,068	19.97	620,427.96
SYNOPSYS INC	7,563	43.61	329,822.43
TABLEAU SOFTWARE INC-CL A	2,186	42.09	92,008.74
TERADATA CORP	7,209	24.75	178,422.75
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	7,323	41.85	306,467.55
TWITTER INC	25,955	17.46	453,174.30

VANTIV INC-CL A	7,696	50.01	384,876.96
VERISIGN INC	4,574	81.45	372,552.30
VISA INC	90,549	72.03	6,522,244.47
VMWARE INC	3,826	47.91	183,303.66
WESTERN UNION COMPANY	24,601	18.49	454,872.49
WORKDAY INC-CLASS A	5,247	54.78	287,430.66
XEROX CORP	46,168	9.19	424,283.92
YAHOO! INC	42,241	29.37	1,240,618.17
ZILLOW GROUP INC-C	5,184	19.38	100,465.92
AMPHENOL CORPORATION -CL A	14,435	52.02	750,908.70
APPLE INC	264,257	98.12	25,928,896.84
ARROW ELECTRONICS INC	4,041	56.13	226,821.33
AVNET INC	6,544	40.77	266,798.88
CDW CORP/DE	6,500	37.13	241,345.00
CISCO SYSTEMS INC	236,520	26.46	6,258,319.20
CORNING INC	55,811	18.95	1,057,618.45
EMC CORP/MASS	90,129	24.98	2,251,422.42
F5 NETWORKS INC	3,338	91.52	305,493.76
FLEXTRONICS INTL LTD	27,993	10.60	296,725.80
FLIR SYSTEMS INC	7,048	30.88	217,642.24
HARRIS CORP	5,694	74.26	422,836.44
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE C	83,000	13.02	1,080,660.00
HP INC	86,101	10.08	867,898.08
JUNIPER NETWORKS INC	15,583	23.57	367,291.31
MOTOROLA SOLUTIONS INC	7,104	65.05	462,115.20
NETAPP INC	13,593	23.55	320,115.15
PALO ALTO NETWORKS INC	3,417	132.67	453,333.39
QORVO INC	6,774	41.59	281,730.66
QUALCOMM INC	73,260	48.41	3,546,516.60
SANDISK CORP	9,525	68.46	652,081.50
SEAGATE TECHNOLOGY	14,132	31.97	451,800.04
SKYWORKS SOLUTIONS INC	8,902	63.71	567,146.42
TE CONNECTIVITY LTD	19,057	56.74	1,081,294.18
TRIMBLE NAVIGATION LTD	10,452	23.11	241,545.72
WESTERN DIGITAL CORP	10,774	43.29	466,406.46
AT&T INC	285,466	36.64	10,459,474.24
CENTURYLINK INC	26,370	29.73	783,980.10
FRONTIER COMMUNICATIONS CORPORATION	55,620	4.42	245,840.40
LEVEL 3 COMMUNICATIONS INC	13,658	49.09	670,471.22
SBA COMMUNICATIONS CORP-CL A	6,014	91.66	551,243.24
SPRINT CORP	33,034	2.99	98,771.66
T-MOBILE US INC	12,915	36.85	475,917.75

VERIZON COMMUNICATIONS INC	188,384	50.32	9,479,482.88
AES CORPORATION	29,997	9.62	288,571.14
AGL RESOURCES INC	5,474	64.51	353,127.74
ALLIANT ENERGY CORP	4,948	66.42	328,646.16
AMEREN CORPORATION	11,406	45.31	516,805.86
AMERICAN ELECTRIC POWER	22,853	61.10	1,396,318.30
AMERICAN WATER WORKS CO INC	8,493	64.71	549,582.03
CALPINE CORP	16,738	13.09	219,100.42
CENTERPOINT ENERGY INC	17,741	18.34	325,369.94
CMS ENERGY CORPORATION	12,676	39.00	494,364.00
COLUMBIA PIPELINE GROUP	17,511	17.46	305,742.06
CONSOLIDATED EDISON INC	13,701	69.97	958,658.97
DOMINION RESOURCES INC/VA	27,128	69.77	1,892,720.56
DTE ENERGY COMPANY	8,619	84.22	725,892.18
DUKE ENERGY CORP	32,212	75.50	2,432,006.00
EDISON INTERNATIONAL	14,671	62.53	917,377.63
ENTERGY CORP	8,476	71.01	601,880.76
EVERSOURCE ENERGY	14,222	53.54	761,445.88
EXELON CORP	40,287	31.09	1,252,522.83
FIRSTENERGY CORP	19,917	32.27	642,721.59
NEXTERA ENERGY INC	21,164	111.43	2,358,304.52
NRG ENERGY INC	16,034	10.20	163,546.80
OGE ENERGY CORP	9,238	26.23	242,312.74
P G & E CORPORATION	22,419	55.81	1,251,204.39
PEPCO HOLDINGS INC	12,671	26.39	334,387.69
PINNACLE WEST CAPITAL CORPORATION	4,942	66.83	330,273.86
PPL CORPORATION	30,440	35.99	1,095,535.60
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	24,048	41.88	1,007,130.24
SCANA CORP	6,092	64.65	393,847.80
SEMPRA ENERGY	10,620	95.50	1,014,210.00
SOUTHERN CO	42,573	47.83	2,036,266.59
WEC ENERGY GROUP INC	14,370	55.53	797,966.10
XCEL ENERGY INC	23,635	38.94	920,346.90
ANALOG DEVICES INC	14,416	52.73	760,155.68
APPLIED MATERIALS INC	54,332	17.14	931,250.48
BROADCOM LTD	18,624	130.68	2,433,784.32
INTEL CORP	220,957	29.47	6,511,602.79
KLA-TENCOR CORPORATION	7,639	65.57	500,889.23
LAM RESEARCH CORP	6,857	69.25	474,847.25
LINEAR TECHNOLOGY CORP	10,313	43.64	450,110.88
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	18,071	9.30	168,060.30
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	13,285	33.66	447,173.10

	MICROCHIP TECHNOLOGY INC	10,156	42.66	433,254.96
	MICRON TECHNOLOGY INC	50,896	11.43	581,741.28
	NVIDIA CORP	24,340	27.66	673,244.40
	NXP SEMICONDUCTORS NV	6,231	70.35	438,350.85
	TEXAS INSTRUMENTS INC	48,009	53.69	2,577,603.21
	XILINX INC	11,585	48.82	565,579.70
	米ドル 小計	14,662,192		800,324,903.65 (91,213,029,268)
カナダドル	ALTAGAS LTD	6,948	33.13	230,187.24
	ARC RESOURCES LTD	16,083	19.04	306,220.32
	CAMECO CORP	19,538	16.64	325,112.32
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	49,141	29.80	1,464,401.80
	CANADIAN OIL SANDS LTD	24,518	9.23	226,301.14
	CENOVUS ENERGY INC	39,619	15.05	596,265.95
	CRESCENT POINT ENERGY CORP	23,425	16.25	380,656.25
	ENBRIDGE INC	40,607	45.51	1,848,024.57
	ENCANA CORP	34,842	5.33	185,707.86
	HUSKY ENERGY INC	15,674	13.24	207,523.76
	IMPERIAL OIL LTD	13,562	42.36	574,486.32
	INTER PIPELINE LTD	17,300	22.02	380,946.00
	KEYERA CORP	7,761	37.33	289,718.13
	MEG ENERGY CORPORATION	8,587	4.20	36,065.40
	PEMBINA PIPELINE CORP	16,067	32.83	527,479.61
	PEYTO EXPLORATION & DEV CORP	6,265	31.54	197,598.10
	PRAIRIESKY ROYALTY LTD	6,411	20.73	132,900.03
	SEVEN GENERATIONS ENERGY-A	6,800	16.18	110,024.00
	SUNCOR ENERGY INC	66,054	32.89	2,172,516.06
	TOURMALINE OIL CORP	8,005	26.85	214,934.25
	TRANSCANADA CORP	32,655	49.96	1,631,443.80
	VERESEN INC	13,299	7.48	99,476.52
	VERMILION ENERGY INC	5,586	34.92	195,063.12
	AGNICO EAGLE MINES LIMITED	9,597	46.46	445,876.62
	AGRIUM INC	6,576	115.96	762,552.96
	BARRICK GOLD CORP	53,489	16.26	869,731.14
	CCL INDUSTRIES INC-CL B	1,385	198.80	275,338.00
	ELDORADO GOLD CORPORATION	41,255	3.81	157,181.55
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	32,770	4.91	160,900.70
	FRANCO-NEVADA CORPORATION	7,418	72.65	538,917.70
	GOLDCORP INC	38,306	20.43	782,591.58
	KINROSS GOLD CORP	51,579	3.85	198,579.15
	METHANEX CORPORATION	3,622	40.23	145,713.06
	POTASH CORP OF SASKATCHEWAN	37,155	23.31	866,083.05



SILVER WHEATON CORPORATION	17,420	20.64	359,548.80
TECK RESOURCES LIMITED-CL B	27,750	8.42	233,655.00
TURQUOISE HILL RESOURCES LTD	45,107	2.92	131,712.44
WEST FRASER TIMBER CO LTD	2,873	40.55	116,500.15
YAMANA GOLD INC	51,365	3.41	175,154.65
BOMBARDIER INC 'B'	80,493	1.09	87,737.37
CAE INC	13,932	14.37	200,202.84
FINNING INTERNATIONAL INC	6,639	18.67	123,950.13
SNC-LAVALIN GROUP INC	6,787	41.62	282,474.94
CANADIAN NATL RAILWAY CO	37,475	78.21	2,930,919.75
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	7,056	177.67	1,253,639.52
LINAMAR CORP	2,200	57.00	125,400.00
MAGNA INTERNATIONAL INC	19,720	47.96	945,771.20
GILDAN ACTIVEWEAR INC	10,518	33.91	356,665.38
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	9,229	47.30	436,531.70
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	18,916	23.48	444,147.68
THOMSON REUTERS CORP	16,217	50.11	812,633.87
CANADIAN TIRE CORP -CL A	3,288	116.55	383,216.40
DOLLARAMA INC	5,454	76.05	414,776.70
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC-B	19,238	58.88	1,132,733.44
EMPIRE CO LTD A	7,235	25.25	182,683.75
JEAN COUTU GROUP INC A	5,801	20.27	117,586.27
LOBLAW COMPANIES LTD	10,287	64.99	668,552.13
METRO INC	11,599	41.28	478,806.72
WESTON (GEORGE) LTD	2,473	105.99	262,113.27
SAPUTO INC	11,403	38.03	433,656.09
VALEANT PHARMACEUTICALS INTERN	15,076	129.62	1,954,151.12
BANK OF MONTREAL	30,426	74.64	2,270,996.64
BANK OF NOVA SCOTIA	56,233	56.23	3,161,981.59
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	18,202	90.90	1,654,561.80
NATIONAL BANK OF CANADA	15,972	38.37	612,845.64
ROYAL BANK OF CANADA	69,086	70.95	4,901,651.70
TORONTO-DOMINION BANK	85,113	52.60	4,476,943.80
CI FINANCIAL CORP	10,961	29.80	326,637.80
ELEMENT FINANCIAL CORP	19,611	14.49	284,163.39
IGM FINANCIAL INC	5,296	34.85	184,565.60
ONEX CORPORATION	4,217	81.26	342,673.42
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	1,023	770.00	787,710.00
GREAT-WEST LIFECO INC	14,253	35.10	500,280.30
INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANCE AND FINANC	3,892	37.95	147,701.40
INTACT FINANCIAL CORPORATION	5,933	84.98	504,186.34
MANULIFE FINANCIAL CORP	90,439	17.88	1,617,049.32

	POWER CORP OF CANADA	17,850	29.00	517,650.00
	POWER FINANCIAL CORP	10,930	31.47	343,967.10
	SUN LIFE FINANCIAL INC	29,069	41.05	1,193,282.45
	BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT INC	38,895	42.67	1,659,649.65
	FIRST CAPITAL REALTY INC	4,000	19.48	77,920.00
	CGI GROUP INC - CL A	10,138	57.10	578,879.80
	CONSTELLATION SOFTWARE	897	518.95	465,498.15
	OPEN TEXT CORPORATION	5,489	69.32	380,497.48
	BLACKBERRY LIMITED	23,701	9.84	233,217.84
	BCE INC	6,388	58.10	371,142.80
	ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	16,263	48.70	792,008.10
	TELUS CORPORATION	9,642	38.44	370,638.48
	ATCO LTD-CLASS I	3,354	39.03	130,906.62
	CANADIAN UTILITIES LIMITED	5,884	35.13	206,704.92
	FORTIS INC	12,721	37.60	478,309.60
	カナダドル 小計	1,853,328		62,155,661.10 (5,180,674,352)
ユーロ	ENI SPA	116,573	12.23	1,425,687.79
	GALP ENERGIA SGPS S.A	18,115	10.91	197,634.65
	NESTE OYJ	6,068	27.66	167,840.88
	OMV AG	6,699	24.58	164,661.42
	REPSOL SA	51,336	9.25	474,858.00
	SAIPEM	15,455	0.33	5,216.06
	TECHNIP S.A.	4,653	42.19	196,310.07
	TENARIS S.A.	22,139	9.80	217,072.89
	TOTAL SA	101,015	39.34	3,974,435.17
	VOPAK	3,334	41.82	139,427.88
	AIR LIQUIDE	15,605	93.68	1,461,876.40
	AKZO NOBEL	11,711	53.90	631,222.90
	ARCELOR MITTAL	45,118	3.31	149,656.40
	ARKEMA	2,963	53.13	157,424.19
	BASF SE	42,520	59.89	2,546,522.80
	CRH PLC	39,026	23.12	902,281.12
	EVONIK INDUSTRIES AG	5,774	27.49	158,727.26
	FUCHS PETROLUB SE-PREF	2,585	36.01	93,098.77
	HEIDELBERGCEMENT AG	6,427	66.61	428,102.47
	IMERYS SA	2,030	56.23	114,146.90
	K+S AG	9,644	19.23	185,454.12
	KONINKLIJKE DSM NV	8,792	43.36	381,221.12
	LANXESS	4,066	36.96	150,299.69
	LINDE AG	8,671	121.85	1,056,561.35
	SOLVAY SA	3,467	80.36	278,608.12

STORA ENSO OYJ-R SHS	25,257	7.53	190,185.21
SYMRISE AG	5,820	57.48	334,533.60
THYSSENKRUPP AG	17,642	14.82	261,542.65
UMICORE	4,218	39.40	166,210.29
UPM-KYMMENE OYJ	23,764	15.36	365,015.04
VOESTALPINE AG	4,961	26.81	133,004.41
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	9,330	21.50	200,595.00
AIRBUS GROUP SE	27,106	55.05	1,492,185.30
ALSTOM RGPT	9,853	20.95	206,420.35
ANDRITZ AG	3,965	43.54	172,655.92
BOSKALIS WESTMINSTER NV	3,523	34.79	122,565.17
BOUYGUES SA	10,038	34.68	348,168.03
BRENTAG AG	6,928	43.91	304,243.12
CNH INDUSTRIAL NV	44,474	5.93	263,953.19
COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	22,389	35.37	791,898.93
FERROVIAL SA	20,422	18.64	380,666.08
FINMECCANICA SPA	18,294	9.31	170,317.14
GEA GROUP AG	8,548	40.24	344,014.26
KONE OYJ-B	15,772	39.56	623,940.32
KONINKLIJKE PHILIPS NV	43,022	22.13	952,291.97
LEGRAND SA	12,536	44.95	563,493.20
MAN SE	1,882	94.08	177,058.56
METSO OYJ	4,880	20.33	99,210.40
OCI NV	3,391	14.77	50,085.07
OSRAM LICHT AG	3,738	40.09	149,875.11
PRYSMIAN SPA	9,328	17.70	165,105.60
REXEL SA	13,762	9.68	133,257.44
SAFRAN SA	14,674	53.63	786,966.62
SCHNEIDER ELECTRIC SE	26,320	52.45	1,380,484.00
SIEMENS AG-REG	36,757	84.48	3,105,231.36
THALES SA	5,075	65.20	330,890.00
VINCI S.A.	22,117	63.18	1,397,352.06
WARTSILA OYJ-B SHARES	6,712	38.43	257,942.16
ZARDOYA OTIS SA	6,593	8.93	58,875.49
ZODIAC AEROSPACE	10,335	19.95	206,183.25
BIC	1,337	129.00	172,473.00
BUREAU VERITAS SA	11,223	17.56	197,131.99
EDENRED	8,942	15.34	137,170.28
PADDY POWER BETFAIR PLC	3,745	123.50	462,507.50
RANDSTAD HOLDING NV	6,118	44.57	272,709.85
ABERTIS INFRAESTRUCTURAS SA	23,172	13.32	308,651.04
AENA SA	3,179	100.10	318,217.90

AEROPORTS DE PARIS (ADP)	1,346	106.95	143,954.70
ATLANTIA SPA	19,813	23.15	458,670.95
BOLLORE	39,433	3.67	144,797.97
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	12,281	12.99	159,591.59
DEUTSCHE POST AG-REG	44,804	21.51	963,734.04
FRAPORT AG	1,856	52.01	96,530.56
GROUPE EUROTUNNEL SE	20,041	9.67	193,896.67
INTERNATIONAL CONSOLIDATED AIRLINES GROUP	41,090	6.78	278,590.20
RYANAIR HOLDINGS PLC	1,614	13.85	22,353.90
TNT EXPRESS NV	24,873	7.89	196,272.84
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	15,473	75.39	1,166,509.47
BAYERISCHE MOTOREN WERKE(BMW)AG-PFD	2,879	63.50	182,816.50
CONTINENTAL AG	5,075	187.15	949,786.25
DAIMLER AG	44,921	64.86	2,913,576.06
FERRARI NV	6,007	34.45	206,941.15
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	40,074	5.87	235,234.38
MICHELIN (CGDE)-B	8,897	84.93	755,622.21
NOKIAN RENKAAT OYJ	5,578	33.78	188,424.84
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE PEF	7,484	41.55	310,997.62
PSA PEUGEOT CITROEN	21,050	13.38	281,649.00
RENAULT SA	8,797	79.93	703,144.21
VALEO	3,548	116.90	414,761.20
VOLKSWAGEN AG	1,615	123.45	199,371.75
VOLKSWAGEN AG PFD	7,364	104.30	768,065.20
ADIDAS AG	9,937	95.33	947,294.21
CHRISTIAN DIOR SE	2,471	163.80	404,749.80
HERMES INTERNATIONAL	1,283	320.40	411,073.20
HUGO BOSS AG	3,209	69.49	222,993.41
KERING	3,490	159.05	555,084.50
LUXOTTICA GROUP SPA	7,912	51.80	409,841.60
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	12,810	155.50	1,991,955.00
ACCOR SA	9,735	34.46	335,468.10
SODEXO	4,408	90.38	398,395.04
ALTICE NV -A W/I	16,172	13.35	215,977.06
ALTICE NV -B W/I	6,847	13.56	92,845.32
AXEL SPRINGER SE	2,125	45.74	97,208.12
EUTELSAT COMMUNICATIONS	8,726	27.33	238,525.21
JC DECAUX SA	2,962	34.89	103,358.99
KABEL DEUTSCHLAND HOLDINGS AG	1,067	115.80	123,558.60
LAGARDERE S.C.A.	4,708	26.48	124,691.38
NUMERICABLE-SFR	4,599	32.58	149,835.42
PROSIEBEN SAT.1 MEDIA SE-REG	10,650	45.05	479,835.75

PUBLICIS GROUPE	9,036	57.33	518,033.88
RELX NV	45,187	14.68	663,571.09
RTL GROUP	1,967	75.50	148,508.50
SES	15,312	23.33	357,228.96
TELENET GROUP HOLDINGS NV	2,936	47.66	139,929.76
WOLTERS KLUWER-CVA	14,127	30.77	434,758.42
INDITEX	49,993	28.01	1,400,553.89
CARREFOUR SA	25,669	23.78	610,537.16
CASINO GUICHARD PERRACHON	2,725	41.40	112,815.00
COLRUYT NV	3,273	49.22	161,097.06
DELHAIZE GROUP	4,495	92.09	413,944.55
DISTRIBUIDORA INTERNACIONAL	29,663	5.04	149,620.17
JERONIMO MARTINS SGPS S.A.	11,930	12.82	152,942.60
KONINKLIJKE AHOLD NV	39,764	19.96	793,888.26
METRO AG	8,566	24.04	205,969.47
ANHEUSER-BUSCH INBEV NV	37,319	105.95	3,953,948.05
DANONE	27,196	60.75	1,652,157.00
HEINEKEN HOLDING NV	4,695	66.05	310,104.75
HEINEKEN NV	10,408	74.19	772,169.52
KERRY GROUP PLC-A	7,513	74.51	559,793.63
PERNOD-RICARD SA	9,604	96.80	929,667.20
REMY COINTREAU	1,273	62.02	78,951.46
UNILEVER NV-CVA	74,764	38.82	2,902,712.30
BEIERSDORF AG	4,749	79.13	375,788.37
HENKEL AG & CO KGAA	4,785	82.72	395,815.20
HENKEL AG & CO KGAA	8,169	96.69	789,860.61
L'OREAL	11,816	155.05	1,832,070.80
ESSILOR INTERNATIONAL	9,594	110.40	1,059,177.60
FRESENIUS MEDICAL CARE AG AND CO.KGAA	9,949	76.84	764,481.16
FRESENIUS SE & CO KGAA	17,809	55.85	994,632.65
BAYER AG	38,283	97.69	3,739,866.27
GRIFOLS S.A.	14,594	19.14	279,402.13
MERCK KGAA	6,176	76.26	470,981.76
ORION OYJ	4,336	29.68	128,692.48
QIAGEN N.V.	9,901	19.02	188,317.02
SANOFI	54,850	70.86	3,886,671.00
UCB SA	5,628	76.20	428,853.60
ZALANDO SE	4,200	28.87	121,254.00
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	293,080	5.84	1,711,587.20
BANCO COMERCIAL PORTUGUES-R	1,382,019	0.03	48,094.26
BANCO DE SABADELL SA	244,482	1.48	363,789.21
BANCO ESPIRITO SANTO,S.A(BES)	187,906	0.01	1,879.06

BANCO POPOLARE SOCIETA COOPERATIVA	19,054	8.17	155,671.18
BANCO POPULAR ESPANOL	74,910	2.20	164,802.00
BANCO SANTANDER SA	665,640	3.75	2,500,809.48
BANK OF IRELAND	1,306,054	0.26	344,798.25
BANKIA SA	203,996	0.80	163,196.80
BANKINTER,S.A.	34,025	6.14	209,015.57
BNP PARIBAS	48,398	41.76	2,021,342.47
CAIXABANK	126,628	2.68	339,363.04
COMMERZBANK AG	46,702	7.49	350,031.49
CREDIT AGRICOLE SA	48,700	9.55	465,085.00
ERSTE GROUP BANK AG	12,920	25.59	330,622.80
INTESA SANPAOLO	595,505	2.49	1,487,571.49
INTESA SANPAOLO-RSP	50,545	2.34	118,275.30
KBC GROUPE SA	11,308	49.70	562,007.60
NATIXIS	41,035	4.73	194,177.62
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG	6,210	12.00	74,520.00
SOCIETE GENERALE	33,124	31.44	1,041,418.56
UNICREDIT SPA	222,882	3.50	780,978.52
UNIONE DI BANCHE ITALIANE SCPA	43,951	3.55	156,026.05
DEUTSCHE BANK AG -REG	63,021	16.18	1,019,679.78
DEUTSCHE BOERSE AG	8,800	73.01	642,488.00
EURAZEO	1,835	51.97	95,364.95
EXOR SPA	4,723	28.16	132,999.68
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	4,000	69.06	276,240.00
ING GROEP NV-CVA	180,772	10.55	1,907,144.60
MEDIOBANCA SPA	26,522	6.20	164,569.01
WENDEL	1,155	87.26	100,785.30
AEGON NV	83,989	4.47	375,682.79
AGEAS	9,255	35.00	323,925.00
ALLIANZ SE-REG	21,271	134.60	2,863,076.60
ASSICURAZIONI GENERALI	54,245	11.91	646,057.95
AXA SA	90,323	20.83	1,881,428.09
CNP ASSURANCES	10,007	12.42	124,336.97
HANNOVER RUECKVERSICHERUNG SE	3,033	91.44	277,337.52
MAPFRE SA	43,669	1.78	77,949.16
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	7,756	172.50	1,337,910.00
NN GROUP NV	11,219	28.77	322,826.72
SAMPO OYJ-A SHS	20,443	40.43	826,510.49
SCOR SE	7,073	31.49	222,728.77
UNIPOLSAI SPA	49,963	1.85	92,831.25
DEUTSCHE WOHNEN AG-BR	16,186	24.56	397,528.16
VONOVIA SE	20,759	27.50	570,872.50

AMADEUS IT HOLDING SA-A SHS	20,344	35.66	725,568.76	
ATOS SE	4,317	64.72	279,396.24	
CAP GEMINI SA	7,368	72.65	535,285.20	
DASSAULT SYSTEMES SA	5,686	69.33	394,210.38	
GEMALTO	3,838	54.88	210,629.44	
SAP SE	45,498	68.60	3,121,162.80	
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	5,981	43.13	257,960.53	
INGENICO S.A.	2,687	103.20	277,298.40	
NOKIA OYJ	266,992	5.50	1,468,456.00	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	149,161	15.02	2,240,398.22	
ELISA OYJ	7,124	32.39	230,746.36	
ILIAD SA	1,212	221.35	268,276.20	
KONINKLIJKE KPN NV	144,663	3.39	490,552.23	
ORANGE S.A.	90,975	15.71	1,429,217.25	
PROXIMUS SA	7,775	30.65	238,342.62	
TELECOM ITALIA SPA	511,319	0.85	435,899.44	
TELECOM ITALIA-RNC	281,876	0.68	193,507.87	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	23,592	4.50	106,281.96	
TELEFONICA S.A.	208,574	9.48	1,978,115.81	
VIVENDI SA	53,416	18.24	974,574.92	
E.ON SE	90,831	8.70	791,047.17	
EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	112,522	2.84	319,562.48	
ELECTRICITE DE FRANCE(EDF)	10,011	10.91	109,220.01	
ENAGAS	9,716	25.01	243,045.74	
ENDESA S.A.	14,071	16.00	225,136.00	
ENEL GREEN POWER SPA	92,223	1.75	162,035.81	
ENEL SPA	325,368	3.64	1,185,640.99	
ENGIE	68,213	14.10	961,803.30	
FORTUM OYJ	19,645	11.88	233,382.60	
GAS NATURAL SDG SA	15,578	15.80	246,210.29	
IBERDROLA SA	261,418	5.98	1,564,325.31	
RED ELECTRICA CORPORATION S.A.	5,265	70.98	373,709.70	
RWE AG	22,761	10.33	235,234.93	
SNAM SPA	99,230	4.90	486,227.00	
SUEZ ENVIRONNEMENT SA	14,573	16.73	243,879.15	
TERNA SPA	65,557	4.74	310,740.18	
VEOLIA ENVIRONNEMENT	20,789	21.07	438,128.17	
ASML HOLDING NV	15,877	76.84	1,219,988.68	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	52,646	11.05	582,001.53	
STMICROELECTRONICS NV	28,920	4.97	143,877.00	
ユーロ 小計	11,882,911		140,526,790.49 (17,837,065,516)	

英ポンド	AMEC FOSTER WHEELER PLC	20,038	3.81	76,344.78
	BP PLC	851,697	3.49	2,979,661.95
	PETROFAC LIMITED	9,677	7.84	75,916.06
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	182,702	16.42	2,999,966.84
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	181,435	16.36	2,968,276.60
	ANGLO AMERICAN PLC	59,787	4.68	279,833.05
	ANTOFAGASTA PLC	19,439	4.78	92,996.17
	BHP BILLITON PLC	94,858	7.43	704,794.94
	CRODA INTERNATIONAL PLC	6,446	28.48	183,582.08
	FRESNILLO PLC	11,248	9.06	101,906.88
	GLENCORE PLC	562,016	1.20	674,419.20
	JOHNSON MATTHEY PLC	9,122	24.30	221,664.60
	MONDI PLC	17,394	13.15	228,731.10
	RANDGOLD RESOURCES LTD	4,386	61.20	268,423.20
	REXAM PLC	30,633	6.02	184,410.66
	RIO TINTO PLC	59,073	19.51	1,152,514.23
	ASHTREAD GROUP PLC	23,485	8.62	202,558.12
	BAE SYSTEMS PLC	145,374	4.99	725,852.38
	BUNZL PLC	15,459	19.03	294,184.77
	COBHAM PLC	52,943	2.53	133,945.79
	IMI PLC	11,445	8.40	96,138.00
	MEGGITT PLC	36,073	3.91	141,297.94
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	88,375	6.78	599,182.50
	SMITHS GROUP PLC	16,922	9.82	166,258.65
	TRAVIS PERKINS PLC	12,496	18.04	225,427.84
	WEIR GROUP PLC/THE	10,014	9.31	93,230.34
	WOLSELEY PLC	11,740	36.11	423,931.40
	AGGREKO PLC	12,848	8.77	112,676.96
	BABCOCK INTERNATIONAL GROUP PLC	11,442	9.22	105,495.24
	CAPITA PLC	31,057	11.23	348,770.11
	EXPERIAN PLC	45,981	11.62	534,299.22
	G4S PLC	66,661	2.02	134,988.52
	INTERTEK GROUP PLC	6,990	29.06	203,129.40
	MERLIN ENTERTAINMENTS PLC	33,608	4.29	144,346.36
	EASYJET PLC	7,630	15.55	118,646.50
	ROYAL MAIL PLC	42,103	4.49	189,337.19
	GKN PLC	75,574	2.76	208,886.53
	BURBERRY GROUP PLC	22,103	12.89	284,907.67
	PERSIMMON PLC	14,611	19.98	291,927.78
	TAYLOR WIMPEY PLC	151,898	1.79	272,808.80
CARNIVAL PLC	8,322	33.01	274,709.22	
COMPASS GROUP PLC	75,680	12.29	930,107.20	



INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	11,708	24.70	289,187.60
TUI AG-DI	21,671	10.59	229,495.89
WHITBREAD PLC	8,382	39.35	329,831.70
WILLIAM HILL PLC	41,877	3.83	160,388.91
ITV PLC	177,733	2.52	447,887.16
PEARSON PLC	38,947	8.05	313,718.08
RELX PLC	51,390	12.07	620,277.30
SKY PLC	48,018	10.24	491,704.32
WPP PLC	60,331	14.81	893,502.11
DIXONS CARPHONE PLC	41,564	4.44	184,627.28
KINGFISHER PLC	104,645	3.40	356,106.93
MARKS & SPENCER GROUP PLC	80,284	4.36	350,680.51
NEXT PLC	6,615	70.20	464,373.00
SPORTS DIRECT INTERNATIONAL	11,278	4.19	47,322.48
SAINSBURY (J) PLC	64,189	2.61	167,854.23
TESCO PLC	382,885	1.86	715,420.62
WILLIAM MORRISON SUPERMARKETS PLC	92,309	1.81	167,540.83
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	15,985	32.59	520,951.15
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	86,787	38.90	3,376,014.30
COCA-COLA HBC AG-CDI	8,704	13.86	120,637.44
DIAGEO PLC	115,295	18.32	2,112,204.40
IMPERIAL BRANDS PLC	43,973	37.36	1,643,051.14
SABMILLER PLC	44,506	41.75	1,858,125.50
TATE & LYLE PLC	24,535	5.60	137,518.67
UNILEVER PLC	60,021	30.50	1,830,640.50
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	47,273	5.72	270,401.56
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	29,912	65.13	1,948,168.56
SMITH & NEPHEW PLC	42,313	11.43	483,637.59
ASTRAZENECA PLC	58,913	42.79	2,521,181.83
GLAXOSMITHKLINE PLC	223,551	14.24	3,183,366.24
SHIRE PLC	27,069	39.42	1,067,059.98
BARCLAYS PLC	774,552	1.68	1,302,409.18
HSBC HOLDINGS PLC	909,285	4.56	4,154,977.80
LLOYDS BANKING GROUP PLC	2,670,236	0.62	1,676,641.18
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	157,044	2.57	404,074.21
STANDARD CHARTERED PLC	150,529	4.46	671,735.66
3I GROUP PLC	42,520	4.24	180,327.32
ABERDEEN ASSET MGMT PLC	49,855	2.45	122,294.31
HARGREAVES LANSDOWN PLC	11,178	12.54	140,172.12
ICAP PLC	27,845	4.19	116,698.39
INVESTEC PLC	24,264	4.66	113,094.50
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP PLC	14,510	23.75	344,612.50

	PROVIDENT FINANCIAL PLC	7,000	31.84	222,880.00
	SCHRODERS PLC	5,835	24.88	145,174.80
	ADMIRAL GROUP PLC	10,760	17.30	186,148.00
	AVIVA PLC	191,080	4.47	855,656.24
	DIRECT LINE INSURANCE GROUP	63,880	3.76	240,188.80
	LEGAL & GENERAL GROUP PLC	268,478	2.26	608,371.14
	OLD MUTUAL PLC	223,346	1.74	389,515.42
	PRUDENTIAL PLC	118,155	12.48	1,474,574.40
	RSA INSURANCE GROUP PLC	49,032	4.10	201,472.48
	ST JAMES'S PLACE PLC	26,198	8.99	235,520.02
	STANDARD LIFE PLC	86,953	3.46	301,118.23
	AUTO TRADER GROUP PLC	36,500	3.71	135,597.50
	SAGE GROUP PLC/THE	46,719	5.76	269,335.03
	BT GROUP PLC	387,495	4.61	1,788,289.42
	INMARSAT PLC	20,829	9.92	206,727.82
	VODAFONE GROUP PLC	1,237,050	2.17	2,688,109.65
	CENTRICA PLC	232,720	1.94	451,709.52
	NATIONAL GRID PLC	173,990	9.55	1,662,126.47
	SEVERN TRENT PLC	10,991	21.13	232,239.83
	SSE PLC	45,022	13.76	619,502.72
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	31,939	9.18	293,359.71
	ARM HOLDINGS PLC	64,682	9.30	601,542.60
	英債券 小計	13,393,920		70,789,561.55 (11,527,372,202)
スイスフラン	TRANSOCEAN LTD	17,883	9.13	163,361.20
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	421	465.25	195,870.25
	GIVAUDAN-REG	440	1,858.00	817,520.00
	LAFARGEHOLCIM LTD	19,645	38.54	757,118.30
	SIKA AG	96	3,743.00	359,328.00
	SYNGENTA AG	4,244	401.20	1,702,692.80
	ABB LTD	102,973	17.75	1,827,770.75
	GEBERIT AG-REG	1,786	359.00	641,174.00
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	819	162.30	132,923.70
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	2,055	163.80	336,609.00
	SULZER AG	478	92.10	44,023.80
	ADECCO SA-REG	7,984	56.85	453,890.40
	SGS SA	247	1,972.00	487,084.00
	KUEHNE&NAGEL INTL AG-REG	2,501	131.70	329,381.70
	CIE FINANCIERE RICHEMONT SA-REGD A	23,843	67.00	1,597,481.00
	THE SWATCH GROUP AG-B	1,413	350.30	494,973.90
	THE SWATCH GROUP AG-REG	2,516	68.55	172,471.80
	DUFREY AG-REG	2,088	102.50	214,020.00

	ARYZTA AG	4,011	45.74	183,463.14
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	75	1,077.00	80,775.00
	LINDT & SPRUENGLI AG	45	5,700.00	256,500.00
	LINDT & SPRUENGLI AG-REG	5	68,165.00	340,825.00
	NESTLE SA-REGISTERED	147,860	74.10	10,956,426.00
	SONOVA HOLDING AG	2,594	117.20	304,016.80
	ACTELION LTD	4,637	137.30	636,660.10
	GALENICA AG-REG	170	1,396.00	237,320.00
	LONZA GROUP AG-REG	2,430	146.00	354,780.00
	NOVARTIS AG-REG SHS	105,409	72.80	7,673,775.20
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	32,530	251.00	8,165,030.00
	CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	83,165	13.58	1,129,380.70
	JULIUS BAER GROUP LTD	10,048	40.66	408,551.68
	PARGESA HOLDING SA-BR	1,867	58.60	109,406.20
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	813	353.50	287,395.50
	UBS GROUP AG	168,285	15.15	2,549,517.75
	BALOISE HOLDING AG	2,242	121.30	271,954.60
	SWISS LIFE HOLDING AG	1,572	238.00	374,136.00
	SWISS RE AG	16,023	91.35	1,463,701.05
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	6,863	215.10	1,476,231.30
	SWISS PRIME SITE-REG	2,983	82.05	244,755.15
	SWISSCOM AG-REG	1,198	488.30	584,983.40
	スイスフラン 小計	786,257		48,817,279.17 (5,606,176,339)
スウェーデンク ローナ	LUNDIN PETROLEUM AB	9,278	134.40	1,246,963.20
	BOLIDEN AB	12,521	124.40	1,557,612.40
	ALFA LAVAL AB	13,757	137.30	1,888,836.10
	ASSA ABLOY AB-B	46,371	163.90	7,600,206.90
	ATLAS COPCO AB-A SHS	30,896	193.50	5,978,376.00
	ATLAS COPCO AB-B SHS	18,623	181.90	3,387,523.70
	SANDVIK AB	52,526	80.50	4,228,343.00
	SKANSKA AB-B SHS	18,229	174.50	3,180,960.50
	SKF AB-B SHARES	18,017	149.70	2,697,144.90
	VOLVO AB-B SHS	69,691	85.70	5,972,518.70
	SECURITAS AB-B SHS	12,949	123.10	1,594,021.90
	ELECTROLUX AB-SER B	11,157	190.60	2,126,524.20
	HUSQVARNA AB-B SHS	18,159	54.70	993,297.30
	HENNES & MAURITZ AB-B SHS	43,489	286.10	12,442,202.90
	ICA GRUPPEN AB	3,550	257.00	912,350.00
	SWEDISH MATCH AB	8,874	290.00	2,573,460.00
	SVENSKA CELLULOOSA AB-B SHS	27,852	254.50	7,088,334.00
	GETINGE AB-B SHS	9,231	186.30	1,719,735.30

	NORDEA BANK AB	139,849	85.85	12,006,036.65	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN AB-A	69,802	84.70	5,912,229.40	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	70,549	111.90	7,894,433.10	
	SWEDBANK AB - A SHARES	41,709	169.30	7,061,333.70	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	9,247	134.00	1,239,098.00	
	INVESTOR AB-B SHS	20,877	282.20	5,891,489.40	
	KINNEVIK INVESTMENT AB-B	11,257	212.50	2,392,112.50	
	ERICSSON LM-B SHS	143,702	77.80	11,180,015.60	
	HEXAGON AB-B SHS	11,565	290.00	3,353,850.00	
	MILLICOM INTL CELLULAR-SDR	3,357	380.00	1,275,660.00	
	TELE2 AB-B SHS	13,516	72.10	974,503.60	
	TELIASONERA AB	115,646	40.08	4,635,091.68	
	スウェーデンクローナ 小計	1,076,246		131,004,264.63 (1,755,457,146)	
ノルウェーク ローネ	STATOIL ASA	50,036	120.40	6,024,334.40	
	NORSK HYDRO ASA	67,630	32.27	2,182,420.10	
	YARA INTERNATIONAL ASA	8,259	330.10	2,726,295.90	
	SCHIBSTED ASA	3,123	240.50	751,081.50	
	SCIBSTED ASA-B SHS	4,063	225.00	914,175.00	
	ORKLA ASA	36,819	71.55	2,634,399.45	
	DNB ASA	45,573	100.50	4,580,086.50	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	9,626	135.00	1,299,510.00	
	TELENOR ASA	35,231	124.20	4,375,690.20	
	ノルウェークローネ 小計	260,360		25,487,993.05 (340,009,827)	
デンマークク ローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	4,400	410.10	1,804,440.00	
	NOVOZYMES A/S-B SHARES	11,427	294.00	3,359,538.00	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	10,326	442.00	4,564,092.00	
	ISS A/S	7,233	237.30	1,716,390.90	
	A P MOLLER-MAERSK A/S-A	153	8,475.00	1,296,675.00	
	A P MOLLER-MAERSK A/S-B	334	8,635.00	2,884,090.00	
	DSV A/S	8,652	275.70	2,385,356.40	
	PANDORA A/S	5,068	839.00	4,252,052.00	
	CARLSBERG AS-B	5,061	609.00	3,082,149.00	
	COLOPLAST-B	5,041	518.50	2,613,758.50	
	WILLIAM DEMANT HOLDING	864	569.00	491,616.00	
	NOVO NORDISK A/S-B	91,172	338.50	30,861,722.00	
	DANSKE BANK A/S	32,814	189.90	6,231,378.60	
	TRYG A/S	5,005	125.20	626,626.00	
TDC A/S	39,176	30.55	1,196,826.80		
	デンマーククローネ 小計	226,726		67,366,711.20 (1,145,234,090)	

オーストラリア ドル	CALTEX AUSTRALIA LIMITED	12,366	35.10	434,046.60
	OIL SEARCH LTD	62,482	7.05	440,498.10
	ORIGIN ENERGY LIMITED	86,346	3.89	335,885.94
	SANTOS LTD	77,838	3.29	256,087.02
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	34,805	27.49	956,789.45
	ALUMINA LTD	106,977	1.19	127,837.51
	AMCOR LIMITED	57,343	13.90	797,067.70
	BHP BILLITON LTD	146,220	15.98	2,336,595.60
	BORAL LIMITED	36,380	5.68	206,638.40
	FORTESCUE METALS GROUP LIMITED	86,762	1.87	162,678.75
	ILUKA RESOURCES LIMITED	22,902	6.54	149,779.08
	INCITEC PIVOT LTD	85,406	2.86	244,261.16
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	19,258	16.33	314,483.14
	NEWCREST MINING LIMITED	33,185	15.37	510,053.45
	ORICA LIMITED	17,233	13.31	229,371.23
	RIO TINTO LIMITED	19,122	42.11	805,227.42
	SOUTH32 LTD	251,285	1.20	302,798.42
	CIMIC GROUP LTD	4,188	29.00	121,452.00
	BRAMBLES LIMITED	73,679	10.77	793,522.83
	SEEK LIMITED	16,538	13.24	218,963.12
	ASCIANO LTD	30,546	8.87	270,943.02
	AURIZON HOLDINGS LTD	92,162	3.71	341,921.02
	QANTAS AIRWAYS LIMITED	24,631	3.92	96,553.52
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	23,911	9.70	231,936.70
	CROWN RESORTS LTD	16,142	11.78	190,152.76
	FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD	2,650	39.75	105,337.50
	TABCORP HOLDINGS LIMITED	36,322	4.16	151,099.52
	TATTS GROUP LTD	66,783	3.98	265,796.34
	REA GROUP LTD	2,708	50.96	137,999.68
	HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	23,253	4.49	104,405.97
	WESFARMERS LIMITED	51,627	43.03	2,221,509.81
	WOOLWORTHS LIMITED	57,895	22.72	1,315,374.40
	COCA-COLA AMATIL LIMITED	26,498	8.80	233,182.40
	TREASURY WINE ESTATES LTD	38,653	8.75	338,213.75
	COCHLEAR LIMITED	2,517	104.00	261,768.00
HEALTHSCOPE LTD	88,691	2.21	196,007.11	
RAMSAY HEALTH CARE LTD	6,579	59.21	389,542.59	
SONIC HEALTHCARE LTD	18,440	18.81	346,856.40	
CSL LIMITED	21,531	102.08	2,197,884.48	
AUST AND NZ BANKING GROUP LT	134,648	23.14	3,115,754.72	
BANK OF QUEENSLAND LIMITED	17,851	10.98	196,003.98	
BENDIGO AND ADELAIDE BANK	18,619	8.62	160,495.78	

	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	79,085	72.33	5,720,218.05
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	122,872	25.52	3,135,693.44
	WESTPAC BANKING CORPORATION	154,312	29.17	4,501,281.04
	ASX LTD	7,982	40.91	326,543.62
	CHALLENGER FINANCIAL SERVICE	30,000	7.46	223,800.00
	MACQUARIE GROUP LTD	13,452	62.69	843,305.88
	PLATINUM ASSET MANAGEMENT	7,772	6.14	47,720.08
	AMP LIMITED	139,602	5.18	723,138.36
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP LT	117,694	5.18	609,654.92
	MEDIBANK PRIVATE LTD	114,840	2.48	284,803.20
	QBE INSURANCE GROUP LIMITED	64,545	9.94	641,577.30
	SUNCORP GROUP LTD	57,325	11.45	656,371.25
	COMPUTERSHARE LIMITED	21,847	9.22	201,429.34
	VOCUS COMMUNICATIONS LTD	20,917	7.94	166,080.98
	TELSTRA CORPORATION LIMITED	204,508	5.37	1,098,207.96
	TPG TELECOM LTD	13,145	9.88	129,872.60
	AGL ENERGY LIMITED	29,931	18.32	548,335.92
	AUSNET SERVICES	55,812	1.48	82,601.76
	オーストラリアドル 小計	3,308,613		42,553,412.07 (3,468,103,083)
ニュージーランドドル	FLETCHER BUILDING LTD	34,160	6.68	228,188.80
	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	40,835	5.80	236,843.00
	RYMAN HEALTHCARE LIMITED	15,480	8.15	126,162.00
	SPARK NEW ZEALAND LIMITED	82,677	3.20	264,979.78
	CONTACT ENERGY LIMITED	35,357	4.46	157,692.22
	MERIDIAN ENERGY LTD	46,571	2.31	107,811.86
	MIGHTY RIVER POWER	40,157	2.73	109,628.61
	ニュージーランドドル 小計	295,237		1,231,306.27 (93,099,067)
香港ドル	NWS HOLDINGS LTD	67,500	11.00	742,500.00
	CATHAY PACIFIC AIRWAYS	48,000	11.60	556,800.00
	MTR CORPORATION	68,000	35.50	2,414,000.00
	LI & FUNG LTD	267,200	4.43	1,183,696.00
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	64,500	27.80	1,793,100.00
	YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	40,000	26.30	1,052,000.00
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LIMITED	115,000	25.00	2,875,000.00
	MGM CHINA HOLDINGS LTD	44,000	9.27	407,880.00
	SANDS CHINA LTD	112,000	26.05	2,917,600.00
	SHANGRI-LA ASIA LTD.	64,000	7.15	457,600.00
	SJM HOLDINGS LIMITED	92,000	5.41	497,720.00
	WYNN MACAU LTD	78,000	8.55	666,900.00
	WH GROUP LIMITED	257,000	4.32	1,110,240.00
	BANK OF EAST ASIA	53,020	22.75	1,206,205.00

	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	178,000	19.24	3,424,720.00	
	HANG SENG BANK LTD	35,400	126.20	4,467,480.00	
	CHEUNG KONG PROPERTY HOLDING	121,924	40.30	4,913,537.20	
	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	126,924	95.05	12,064,126.20	
	FIRST PACIFIC COMPANY	86,000	5.44	467,840.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEARING LIMITED	51,800	169.10	8,759,380.00	
	AIA GROUP LTD	562,400	38.25	21,511,800.00	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	105,000	13.48	1,415,400.00	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	56,232	40.55	2,280,207.60	
	HYSAN DEVELOPMENT CO	29,000	29.85	865,650.00	
	KERRY PROPERTIES LTD	27,500	18.18	499,950.00	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	259,333	6.08	1,576,744.64	
	SINO LAND CO	124,200	10.22	1,269,324.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	82,000	84.05	6,892,100.00	
	SWIRE PACIFIC LTD 'A'	25,000	72.55	1,813,750.00	
	SWIRE PROPERTIES LIMITED	51,400	19.52	1,003,328.00	
	WHARF HOLDINGS LTD	65,000	37.65	2,447,250.00	
	WHELOCK&COMPANY LTD	46,000	29.00	1,334,000.00	
	PCCW LIMITED	172,000	4.68	804,960.00	
	CHEUNG KONG INFRASTRUCTURE	27,000	75.30	2,033,100.00	
	CLP HOLDINGS LTD	88,600	66.60	5,900,760.00	
	HK ELECTRIC INVESTMENTS-SS	148,000	6.44	953,120.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	312,074	13.78	4,300,379.72	
	POWER ASSETS HOLDINGS LIMITED	66,500	71.80	4,774,700.00	
	ASM PACIFIC TECHNOLOGY	12,200	59.95	731,390.00	
	香港ドル 小計	4,229,707		114,386,238.36 (1,674,614,529)	
シンガポールドル	KEPPEL CORP LTD	65,600	5.20	341,120.00	
	NOBLE GROUP LTD	245,400	0.33	82,209.00	
	SEMBCORP INDUSTRIES LTD	42,020	2.53	106,310.60	
	SEMBCORP MARINE LTD	37,100	1.62	60,102.00	
	SINGAPORE TECHNOLOGIES ENG	64,300	2.74	176,182.00	
	YANGZIJANG SHIPBUILDING HOLDINGS LTD	90,000	0.93	83,700.00	
	COMFORTDELGRO CORP LTD	107,000	2.96	316,720.00	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	24,266	11.25	272,992.50	
	GENTING SINGAPORE PLC	258,200	0.70	182,031.00	
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	78,350	3.66	286,761.00	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	5,500	39.15	215,325.00	
	GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	353,600	0.36	129,064.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	85,700	3.04	260,528.00	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	81,000	13.60	1,101,600.00	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	144,200	7.78	1,121,876.00	

	UNITED OVERSEAS BANK LTD	59,700	17.20	1,026,840.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	38,700	7.10	274,770.00	
	CAPITALAND LTD	122,300	2.86	349,778.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	21,000	6.91	145,110.00	
	GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES LIMITED	165,900	1.64	272,905.50	
	UOL GROUP LIMITED	18,800	5.66	106,408.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	366,915	3.69	1,353,916.35	
	STARHUB LIMITED	24,500	3.56	87,220.00	
	シンガポールドル 小計	2,500,051		8,353,468.95 (677,967,539)	
イスラエルシュケル	DELEK GROUP LTD	213	622.00	132,486.00	
	ISRAEL CHEMICALS LIMITED	20,822	15.25	317,535.50	
	TEVA PHARMACEUTICAL IND LTD	42,697	225.00	9,606,825.00	
	BANK HAPOLIM BM	53,151	18.73	995,518.23	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	64,754	13.05	845,039.70	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	4,453	43.42	193,349.26	
	AZRIELI GROUP	1,863	140.70	262,124.10	
	NICE SYSTEMS LTD	2,554	232.30	593,294.20	
	BEZEQ ISRAELI TELECOMMUNICATION CORP LTD	96,068	8.52	818,691.49	
	イスラエルシュケル 小計	286,575		13,764,863.48 (401,796,364)	
	合 計	54,762,123		140,920,599,322 (140,920,599,322)	

(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 603銘柄	60.7%	64.7%
カナダドル	株式 91銘柄	3.4%	3.7%
ユーロ	株式 233銘柄	11.9%	12.7%
英ポンド	株式 106銘柄	7.7%	8.2%
スイスフラン	株式 40銘柄	3.7%	4.0%
スウェーデンクローナ	株式 30銘柄	1.2%	1.2%
ノルウェークローネ	株式 9銘柄	0.2%	0.2%
デンマーククローネ	株式 15銘柄	0.8%	0.8%
オーストラリアドル	株式 60銘柄	2.3%	2.5%
ニュージーランドドル	株式 7銘柄	0.1%	0.1%
香港ドル	株式 39銘柄	1.1%	1.2%
シンガポールドル	株式 23銘柄	0.5%	0.5%
イスラエルシュケル	株式 9銘柄	0.3%	0.3%

(b) 株式以外の有価証券



種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	米ドル	AMERICAN CAPITAL AGENCY CORP	15,293	272,674.19	
		AMERICAN TOWER CORP	19,734	1,700,873.46	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	45,539	450,836.10	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	6,173	1,035,582.48	
		BOSTON PROPERTIES INC	7,225	808,983.25	
		BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	7,861	182,060.76	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	4,186	307,294.26	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	5,946	474,312.42	
		DUKE REALTY CORP	16,643	333,525.72	
		EQUITY RESIDENTIAL	16,955	1,228,220.20	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	3,011	606,927.27	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	5,203	441,890.79	
		FEDERAL REALTY INVESTMENT TRUST	3,095	458,648.05	
		GENERAL GROWTH PROPERTIES	26,153	672,655.16	
		HCP, INC.	20,947	573,319.39	
		HOST HOTELS AND RESORTS INC	34,373	514,563.81	
		HUTCHISON PORT HOLDINGS TRUST	283,000	120,275.00	
		IRON MOUNTAIN INC	9,338	271,362.28	
		KIMCO REALTY CORPORATION	19,336	517,624.72	
		LIBERTY PROPERTY TRUST	7,065	201,140.55	
		MACERICH COMPANY/THE	6,260	474,445.40	
		PLUM CREEK TIMBER COMPANY	8,260	318,918.60	
		PROLOGIS INC	23,632	885,254.72	
		PUBLIC STORAGE	6,743	1,659,519.73	
		REALTY INCOME CORPORATION	11,331	677,707.11	
		REGENCY CENTERS CORP	4,147	293,441.72	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	14,381	2,690,828.91	
		SL GREEN REALTY CORP	4,370	365,725.30	
		UDR INC	12,366	416,115.90	
	VENTAS INC	15,512	783,045.76		
	VEREIT INC	41,004	313,270.56		
	VORNADO REALTY TRUST	7,967	658,233.54		
	WELLTOWER INC	16,318	922,456.54		
米ドル 小計			729,367	21,631,733.65 (2,465,368,684)	
カナダドル		H&R REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	4,711	89,980.10	
		RIOCAN REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	6,847	171,859.70	
		SMART REAL ESTATE INVESTMENT	4,057	125,361.30	
			15,615	387,201.10	

カナダドル 小計			(32,273,211)
ユーロ	FONCIERE DES REGIONS	1,550	115,506.00
	GECINA SA	1,519	169,824.20
	ICADE	1,873	117,174.88
	KLEPIERRE	10,809	410,201.55
	UNIBAIL-RODAMCO SE	4,575	1,032,577.50
ユーロ 小計		20,326	1,845,284.13 (234,221,914)
英ポンド	BRITISH LAND CO PLC	43,052	296,413.02
	HAMMERSON PLC	37,833	214,323.94
	INTU PROPERTIES PLC	38,514	111,575.05
	LAND SECURITIES GROUP PLC	35,900	372,642.00
	SEGRO PLC	36,381	156,511.06
英ポンド 小計		191,680	1,151,465.07 (187,504,571)
オーストラリアドル	APA GROUP	53,427	463,212.09
	DEXUS PROPERTY GROUP	42,722	313,152.26
	DUET GROUP	115,000	266,800.00
	GOODMAN GROUP	83,175	533,983.50
	GPT GROUP	74,297	369,999.06
	LENDLEASE GROUP	27,382	351,584.88
	MIRVAC GROUP	186,000	344,100.00
	SCENTRE GROUP	238,066	1,057,013.04
	STOCKLAND	107,141	434,992.46
	SYDNEY AIRPORT	46,494	298,491.48
	TRANSURBAN GROUP	97,263	1,055,303.55
	VICINITY CENTRES	149,882	452,643.64
	WESTFIELD CORP	91,040	876,715.20
オーストラリアドル 小計		1,311,889	6,817,991.16 (555,666,279)
香港ドル	HKT TRUST AND HKT LTD	121,000	1,272,920.00
	LINK REIT	103,000	4,429,000.00
香港ドル 小計		224,000	5,701,920.00 (83,476,108)
シンガポールドル	ASCENDAS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	109,000	255,060.00
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	79,000	109,020.00
	CAPITALAND MALL TRUST	99,500	207,955.00
	SUNTEC REIT	101,400	163,761.00
シンガポールドル 小計		388,900	735,796.00 (59,717,203)
合計			3,618,227,970 (3,618,227,970)

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

通貨	銘柄数	組入投資証券 時価比率	合計金額に対する比率
米ドル	投資証券 33銘柄	1.6%	68.1%
カナダドル	投資証券 3銘柄	0.0%	0.9%
ユーロ	投資証券 5銘柄	0.2%	6.5%
英ポンド	投資証券 5銘柄	0.1%	5.2%
オーストラリアドル	投資証券 13銘柄	0.4%	15.4%
香港ドル	投資証券 2銘柄	0.1%	2.3%
シンガポールドル	投資証券 4銘柄	0.0%	1.7%

### デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

### 外国債券パッシブ・マザーファンド

#### 貸借対照表

	（単位：円）	
	（平成27年 2月18日現在）	（平成28年 2月18日現在）
資産の部		
流動資産		
預金	945,602,092	825,340,017
金銭信託	-	352,441,486
コール・ローン	787,424,687	-
国債証券	222,812,404,210	180,251,698,471
派生商品評価勘定	-	10,541,643
未収入金	-	1,347,086,025
未収利息	2,037,983,626	1,569,916,558
前払費用	39,600,998	19,303,386
流動資産合計	226,623,015,613	184,376,327,586
資産合計	226,623,015,613	184,376,327,586
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	-	2,122,019
未払解約金	65,395,143	1,312,070,060
流動負債合計	65,395,143	1,314,192,079
負債合計	65,395,143	1,314,192,079
純資産の部		
元本等		
元本	125,008,516,287	105,835,628,786
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	101,549,104,183	77,226,506,721
元本等合計	226,557,620,470	183,062,135,507
純資産合計	226,557,620,470	183,062,135,507
負債純資産合計	226,623,015,613	184,376,327,586

#### 注記表

## （重要な会計方針の注記）

項目	自 平成27年 2月19日 至 平成28年 2月18日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券は個別法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。</p>
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建資産等の会計処理</p> <p>「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。</p>

## （貸借対照表に関する注記）

項目	（平成27年 2月18日現在）	（平成28年 2月18日現在）
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	125,008,516,287口	105,835,628,786口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.8123円 (10,000口当たりの純資産額 18,123円)	1口当たり純資産額 1.7297円 (10,000口当たりの純資産額 17,297円)

## （金融商品に関する注記）

## ・金融商品の状況に関する事項

項目	自 平成27年 2月19日 至 平成28年 2月18日
1. 金融商品に対する取組方針	<p>当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。</p>
	(1) 金融商品の内容

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

・ 金融商品の時価等に関する事項

項 目	(平成28年 2月18日現在)
-----	-----------------

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

(デリバティブ取引に関する注記)

(平成27年 2月18日現在)

該当事項はありません。

(平成28年 2月18日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	4,399,713	-	4,406,270	6,557
	米ドル	832,762	-	829,619	3,143
	メキシコペソ	1,603,836	-	1,632,701	28,865
	ユーロ	1,439,205	-	1,429,660	9,545
	英ポンド	523,910	-	514,290	9,620
	売建	2,483,293,934	-	2,474,880,867	8,413,067
	米ドル	1,080,137,579	-	1,076,484,584	3,652,995
	メキシコペソ	129,149,091	-	131,128,391	1,979,300
	ユーロ	960,195,362	-	955,596,566	4,598,796
	英ポンド	225,895,777	-	223,910,213	1,985,564
	オーストラリアドル	87,916,125	-	87,761,113	155,012
	合計	2,487,693,647	-	2,479,287,137	8,419,624

(注) 1.時価の算定方法

(1)為替予約取引の時価の算定方法について

1) 計算期間末日に対顧客先物相場の仲値が発表されている外貨については、以下のように評価しています。

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

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

- ・ 計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物相場が発表されている場合には、発表されている対顧客先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの対顧客先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いています。
- ・ 計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い受渡日として、発表されている対顧客先物相場の仲値を用いています。

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

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

( 関連当事者との取引に関する注記 )

該当事項はありません。

( その他の注記 )

( 平成27年 2月18日現在 )	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	163,831,413,793円
同期中における追加設定元本額	3,174,676,700円
同期中における一部解約元本額	41,997,574,206円
平成27年 2月18日現在における元本の内訳	
三井住友・DC外国債券インデックスファンドS	5,886,533,082円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	241,477,930円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	710,679,971円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	378,150,912円
スミセイ・DCバランスファンド(機動的資産配分型)	54,115,195円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2020	6,926,399円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2025	12,947,767円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2030	11,555,578円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2035	14,731,734円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2040	7,458,534円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2045	15,749,980円
三井住友・DC年金バランスゼロ(債券型)	10,802円
SMAM・年金外国債券パッシブ・ファンド<適格機関投資家限定>	1,662,945,892円
SMAM・バランスファンドVA安定成長型<適格機関投資家限定>	8,281,231,141円
SMAM・バランスファンドVA25<適格機関投資家専用>	26,906,591,340円
SMAM・バランスファンドVA37.5<適格機関投資家専用>	8,389,500,965円
SMAM・バランスファンドVA50<適格機関投資家専用>	19,030,319,534円
SMAM・バランスファンドVL30<適格機関投資家限定>	56,286,741円

S M A M ・ バランスファンド V L 5 0 < 適格機関投資家限定 >	146,797,016円
世界 6 資産バランスファンド V A < 適格機関投資家限定 >	23,239,767円
S M A M ・ バランスファンド V A 7 5 < 適格機関投資家専用 >	1,213,586,793円
S M A M ・ バランスファンド V L 国際分散型 < 適格機関投資家限定 >	157,427,139円
S M A M ・ インデックス・バランス V A 2 5 < 適格機関投資家専用 >	1,612,883,781円
S M A M ・ インデックス・バランス V A 5 0 < 適格機関投資家専用 >	2,198,003,467円
S M A M ・ バランスファンド V A 4 0 < 適格機関投資家専用 >	5,789,009,716円
S M A M ・ バランスファンド V A 3 5 < 適格機関投資家専用 >	9,961,740,547円
S M A M ・ バランス V A 株 4 0 T < 適格機関投資家限定 >	492,635,527円
S M A M ・ 外国債券パッシブファンド V A < 適格機関投資家限定 >	15,486,398,825円
三井住友・外国債券インデックスファンド・ V A S ( 適格機関投資家専用 )	1,417,072,342円
三井住友・ 5 資産バランスファンド・ V A S ( 適格機関投資家専用 )	5,410,649,977円
S M A M ・ グローバルバランス 4 0 V A < 適格機関投資家限定 >	260,229,467円
S M A M ・ バランスファンド V A 2 0 < 適格機関投資家専用 >	997,176,994円
三井住友・ 7 資産バランスファンド・ V A S ( 適格機関投資家専用 )	4,357,348,453円
S M A M ・ アセットバランスファンド V A 2 0 A < 適格機関投資家専用 >	190,485,869円
S M A M ・ アセットバランスファンド V A 3 5 A < 適格機関投資家専用 >	58,078,380円
S M A M ・ アセットバランスファンド V A 5 0 A < 適格機関投資家専用 >	17,987,803円
S M A M ・ アセットバランスファンド V A 2 0 L < 適格機関投資家専用 >	229,155,570円
S M A M ・ アセットバランスファンド V A 2 5 L < 適格機関投資家専用 >	777,765,012円
S M A M ・ アセットバランスファンド V A 2 0 T < 適格機関投資家専用 >	240,753,259円
S M A M ・ アセットバランスファンド V A 2 0 A 2 < 適格機関投資家専用 >	218,225,739円
S M A M ・ アセットバランスファンド V A 3 5 A 2 < 適格機関投資家専用 >	66,476,984円
S M A M ・ アセットバランスファンド V A 5 0 A 2 < 適格機関投資家専用 >	6,182,104円
S M A M ・ アセットバランスファンド V A 2 5 L 2 < 適格機関投資家専用 >	1,931,383,787円
S M A M ・ アセットバランスファンド V A 2 0 T 2 < 適格機関投資家専用 >	44,933,491円
S M A M ・ F G 新興国重視型バランス 2 0 V A < 適格機関投資家限定 >	3,552,394円
S M A M ・ F G グローバルバランス 2 5 V A < 適格機関投資家限定 >	31,283,292円
S M A M ・ グローバル・マルチアセット・グロース・ファンド(安定成長型) < 適格機関投資家限定 >	488,667円
S M A M ・ 年金マルチ・インカム・ダイナミック・アロケーション ・ ファンド < 適格機関投資家限定 >	176,286円
S M A M ・ 年金マルチ・インカム・ダイナミック・アロケーション ・ ファンド < 適格機関投資家限定 >	174,342円
合計	125,008,516,287円

(平成28年 2月18日現在)

開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	125,008,516,287円
同期中における追加設定元本額	6,350,924,533円
同期中における一部解約元本額	25,523,812,034円
平成28年 2月18日現在における元本の内訳	
三井住友・ D C 外国債券インデックスファンド S	7,156,914,733円
三井住友・ D C 年金バランス 3 0 ( 債券重点型 )	283,155,221円
三井住友・ D C 年金バランス 5 0 ( 標準型 )	816,152,669円



三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	391,479,609円
SMAM・グローバルバランスファンド(機動的資産配分型)	65,678,327円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2020	8,084,483円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2025	20,053,483円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2030	57,177,288円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2035	33,537,747円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2040	18,899,407円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2045	40,348,826円
三井住友・DC年金バランスゼロ(債券型)	935,027円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	126,172,805円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	209,579,902円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	271,019,067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>	1,486,334,046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>	4,116,106,420円
SMAM・バランスファンドVA25<適格機関投資家専用>	19,590,844,346円
SMAM・バランスファンドVA37.5<適格機関投資家専用>	7,388,321,434円
SMAM・バランスファンドVA50<適格機関投資家専用>	16,136,785,635円
SMAM・バランスファンドVL30<適格機関投資家限定>	45,968,708円
SMAM・バランスファンドVL50<適格機関投資家限定>	130,038,973円
世界6資産バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	13,725,292円
SMAM・バランスファンドVA75<適格機関投資家専用>	936,651,340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>	142,165,035円
SMAM・インデックス・バランスVA25<適格機関投資家専用>	1,513,583,466円
SMAM・インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用>	1,924,991,258円
SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用>	4,995,407,835円
SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>	9,191,592,746円
SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定>	150,974,873円
SMAM・外国債券パッシブファンドVA<適格機関投資家限定>	14,447,331,155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)	1,306,786,613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)	4,226,873,483円
SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	244,324,035円
SMAM・バランスファンドVA20<適格機関投資家専用>	861,343,324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)	3,749,286,729円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>	185,069,203円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>	54,495,867円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用>	16,602,801円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>	209,180,765円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	716,753,636円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T<適格機関投資家専用>	226,773,526円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A2<適格機関投資家専用>	203,301,882円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A2<適格機関投資家専用>	57,130,687円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A2<適格機関投資家専用>	6,416,885円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L2<適格機関投資家専用>	1,772,298,242円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T2<適格機関投資家専用>	27,895,415円
SMAM・FG新興国重視型バランス20VA<適格機関投資家限定>	2,420,864円
SMAM・FGグローバルバランス25VA<適格機関投資家限定>	21,046,912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>	323,735円

S M A M ・ 年金マルチ ・ インカム ・ ダイナミック ・ アロケーション ・ ファンド < 適格機関投資家限定 >	45,796,792円
S M A M ・ 年金Wリスクコントロールファンド < 適格機関投資家限定 >	232,242円
S M A M ・ マルチアセットストラテジーファンド 2 0 1 6 - 0 1 < 適格機関投資家限定 >	191,263,992円
合計	105,835,628,786円

## 附属明細表

## 有価証券明細表

## (a) 株式

該当事項はありません。

## (b) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	米ドル	US TREASURY N/B 0.5	4,000,000.00	3,987,500.00	
		US TREASURY N/B 0.625	5,000,000.00	4,995,703.15	
		US TREASURY N/B 0.625	4,000,000.00	3,992,187.52	
		US TREASURY N/B 0.625	3,000,000.00	2,993,437.50	
		US TREASURY N/B 0.625	5,000,000.00	4,987,500.00	
		US TREASURY N/B 0.625	3,000,000.00	2,988,281.25	
		US TREASURY N/B 0.75	4,000,000.00	4,005,000.00	
		US TREASURY N/B 0.75	5,000,000.00	5,002,929.70	
		US TREASURY N/B 0.75	2,000,000.00	1,999,531.26	
		US TREASURY N/B 0.75	5,000,000.00	4,998,437.50	
		US TREASURY N/B 0.75	3,000,000.00	2,999,062.50	
		US TREASURY N/B 0.75	4,000,000.00	3,995,625.00	
		US TREASURY N/B 0.875	3,000,000.00	3,008,203.14	
		US TREASURY N/B 0.875	3,000,000.00	3,008,437.50	
		US TREASURY N/B 0.875	4,000,000.00	4,010,937.52	
		US TREASURY N/B 0.875	6,000,000.00	6,015,468.78	
		US TREASURY N/B 0.875	3,000,000.00	3,006,562.50	
		US TREASURY N/B 0.875	3,000,000.00	3,006,328.14	
		US TREASURY N/B 0.875	4,000,000.00	4,007,500.00	
		US TREASURY N/B 0.875	4,000,000.00	4,008,125.00	
		US TREASURY N/B 0.875	3,000,000.00	3,002,343.75	
		US TREASURY N/B 0.875	2,000,000.00	2,000,000.00	
		US TREASURY N/B 1	5,000,000.00	5,020,703.15	
		US TREASURY N/B 1	4,000,000.00	4,015,312.52	
		US TREASURY N/B 1	2,000,000.00	2,008,437.50	
		US TREASURY N/B 1	4,000,000.00	4,017,187.52	

US TREASURY N/B 1	2,000,000.00	2,008,125.00	
US TREASURY N/B 1	3,000,000.00	3,009,375.00	
US TREASURY N/B 1	3,000,000.00	2,998,593.75	
US TREASURY N/B 1	4,000,000.00	3,989,687.52	
US TREASURY N/B 1	2,000,000.00	1,993,750.00	
US TREASURY N/B 1	6,000,000.00	5,974,218.78	
US TREASURY N/B 1.125	2,000,000.00	2,014,218.76	
US TREASURY N/B 1.125	2,000,000.00	2,008,281.26	
US TREASURY N/B 1.125	4,000,000.00	3,999,062.52	
US TREASURY N/B 1.125	2,800,000.00	2,794,093.76	
US TREASURY N/B 1.125	3,000,000.00	2,992,031.25	
US TREASURY N/B 1.25	4,000,000.00	4,037,187.52	
US TREASURY N/B 1.25	3,000,000.00	3,027,421.89	
US TREASURY N/B 1.25	3,000,000.00	3,028,125.00	
US TREASURY N/B 1.25	4,000,000.00	4,037,500.00	
US TREASURY N/B 1.25	2,000,000.00	2,016,406.26	
US TREASURY N/B 1.25	2,000,000.00	2,010,468.76	
US TREASURY N/B 1.25	3,000,000.00	3,009,609.39	
US TREASURY N/B 1.375	4,000,000.00	4,050,937.52	
US TREASURY N/B 1.375	4,500,000.00	4,558,007.83	
US TREASURY N/B 1.375	5,000,000.00	5,062,890.65	
US TREASURY N/B 1.375	2,000,000.00	2,025,000.00	
US TREASURY N/B 1.375	5,000,000.00	5,062,109.40	
US TREASURY N/B 1.375	4,000,000.00	4,034,687.52	
US TREASURY N/B 1.375	2,000,000.00	2,016,093.76	
US TREASURY N/B 1.375	4,000,000.00	4,029,375.00	
US TREASURY N/B 1.375	4,000,000.00	4,028,750.00	
US TREASURY N/B 1.375	3,000,000.00	3,020,859.39	
US TREASURY N/B 1.375	2,000,000.00	2,014,062.50	
US TREASURY N/B 1.375	3,000,000.00	3,017,343.75	
US TREASURY N/B 1.375	3,000,000.00	3,016,171.89	
US TREASURY N/B 1.5	5,000,000.00	5,080,078.15	
US TREASURY N/B 1.5	4,700,000.00	4,774,906.25	
US TREASURY N/B 1.5	3,000,000.00	3,047,578.14	
US TREASURY N/B 1.5	3,000,000.00	3,042,421.89	
US TREASURY N/B 1.5	2,000,000.00	2,024,843.76	
US TREASURY N/B 1.5	3,000,000.00	3,004,687.50	
US TREASURY N/B 1.625	5,000,000.00	5,097,265.65	
US TREASURY N/B 1.625	4,000,000.00	4,078,437.52	
US TREASURY N/B 1.625	3,000,000.00	3,058,828.14	
US TREASURY N/B 1.625	2,000,000.00	2,038,437.50	
US TREASURY N/B 1.625	3,000,000.00	3,058,125.00	

US TREASURY N/B 1.625	2,000,000.00	2,036,406.26
US TREASURY N/B 1.625	2,000,000.00	2,034,062.50
US TREASURY N/B 1.625	3,000,000.00	3,050,859.39
US TREASURY N/B 1.625	3,000,000.00	3,053,906.25
US TREASURY N/B 1.625	3,000,000.00	3,022,968.75
US TREASURY N/B 1.625	3,500,000.00	3,518,320.33
US TREASURY N/B 1.75	1,000,000.00	1,023,203.13
US TREASURY N/B 1.75	2,300,000.00	2,349,773.44
US TREASURY N/B 1.75	3,000,000.00	3,046,406.25
US TREASURY N/B 1.75	2,500,000.00	2,537,304.70
US TREASURY N/B 1.75	4,000,000.00	4,056,875.00
US TREASURY N/B 1.75	3,000,000.00	3,043,359.39
US TREASURY N/B 1.75	3,000,000.00	3,037,734.39
US TREASURY N/B 1.75	5,000,000.00	5,052,734.40
US TREASURY N/B 1.875	3,000,000.00	3,050,976.57
US TREASURY N/B 1.875	6,000,000.00	6,107,343.78
US TREASURY N/B 1.875	6,000,000.00	6,111,562.50
US TREASURY N/B 1.875	3,000,000.00	3,084,609.39
US TREASURY N/B 1.875	3,000,000.00	3,071,718.75
US TREASURY N/B 1.875	3,000,000.00	3,064,921.89
US TREASURY N/B 1.875	2,000,000.00	2,041,718.76
US TREASURY N/B 1.875	3,000,000.00	3,060,468.75
US TREASURY N/B 2	3,000,000.00	3,098,437.50
US TREASURY N/B 2	2,300,000.00	2,376,906.25
US TREASURY N/B 2	4,000,000.00	4,131,875.00
US TREASURY N/B 2	3,000,000.00	3,099,609.39
US TREASURY N/B 2	2,000,000.00	2,065,156.26
US TREASURY N/B 2	3,000,000.00	3,094,687.50
US TREASURY N/B 2	3,000,000.00	3,092,578.14
US TREASURY N/B 2	3,000,000.00	3,091,406.25
US TREASURY N/B 2	3,100,000.00	3,197,601.57
US TREASURY N/B 2	3,000,000.00	3,086,015.64
US TREASURY N/B 2	5,000,000.00	5,141,015.65
US TREASURY N/B 2	5,500,000.00	5,658,125.00
US TREASURY N/B 2	7,000,000.00	7,119,218.75
US TREASURY N/B 2	7,000,000.00	7,109,921.91
US TREASURY N/B 2.125	3,500,000.00	3,635,078.12
US TREASURY N/B 2.125	4,000,000.00	4,156,875.00
US TREASURY N/B 2.125	2,000,000.00	2,077,968.76
US TREASURY N/B 2.125	5,000,000.00	5,193,359.40
US TREASURY N/B 2.125	3,000,000.00	3,113,906.25
US TREASURY N/B 2.125	4,000,000.00	4,149,375.00
US TREASURY N/B 2.125	3,000,000.00	3,108,750.00

US TREASURY N/B 2.125	7,000,000.00	7,188,671.91	
US TREASURY N/B 2.25	3,000,000.00	3,078,281.25	
US TREASURY N/B 2.25	2,000,000.00	2,068,593.76	
US TREASURY N/B 2.25	4,000,000.00	4,180,937.52	
US TREASURY N/B 2.25	2,000,000.00	2,091,093.76	
US TREASURY N/B 2.25	2,000,000.00	2,090,937.50	
US TREASURY N/B 2.25	6,000,000.00	6,232,968.78	
US TREASURY N/B 2.25	6,500,000.00	6,746,289.09	
US TREASURY N/B 2.375	4,000,000.00	4,095,000.00	
US TREASURY N/B 2.375	2,000,000.00	2,074,218.76	
US TREASURY N/B 2.375	2,000,000.00	2,101,406.26	
US TREASURY N/B 2.375	7,000,000.00	7,348,359.41	
US TREASURY N/B 2.5	3,000,000.00	3,072,890.64	
US TREASURY N/B 2.5	4,000,000.00	4,252,500.00	
US TREASURY N/B 2.5	7,000,000.00	7,425,468.75	
US TREASURY N/B 2.5	3,500,000.00	3,366,835.95	
US TREASURY N/B 2.625	4,000,000.00	4,142,812.52	
US TREASURY N/B 2.625	2,000,000.00	2,079,062.50	
US TREASURY N/B 2.625	4,000,000.00	4,240,625.00	
US TREASURY N/B 2.625	5,500,000.00	5,838,164.09	
US TREASURY N/B 2.75	5,000,000.00	5,128,125.00	
US TREASURY N/B 2.75	4,000,000.00	4,145,625.00	
US TREASURY N/B 2.75	3,000,000.00	3,159,140.64	
US TREASURY N/B 2.75	6,200,000.00	6,704,718.75	
US TREASURY N/B 2.75	5,000,000.00	5,403,906.25	
US TREASURY N/B 2.75	2,000,000.00	2,050,156.26	
US TREASURY N/B 2.75	11,000,000.00	11,254,375.00	
US TREASURY N/B 2.875	3,000,000.00	3,129,375.00	
US TREASURY N/B 2.875	4,000,000.00	4,154,687.52	
US TREASURY N/B 3	4,000,000.00	4,097,500.00	
US TREASURY N/B 3	2,800,000.00	3,016,562.50	
US TREASURY N/B 3	4,000,000.00	4,268,750.00	
US TREASURY N/B 3	4,000,000.00	4,259,062.52	
US TREASURY N/B 3	3,000,000.00	3,199,218.75	
US TREASURY N/B 3.125	2,200,000.00	2,252,078.13	
US TREASURY N/B 3.125	4,000,000.00	4,116,875.00	
US TREASURY N/B 3.125	2,000,000.00	2,135,781.26	
US TREASURY N/B 3.125	5,000,000.00	5,443,359.40	
US TREASURY N/B 3.125	2,000,000.00	2,210,156.26	
US TREASURY N/B 3.125	3,000,000.00	3,313,828.14	
US TREASURY N/B 3.125	4,000,000.00	4,377,187.52	
US TREASURY N/B 3.25	4,000,000.00	4,115,937.52	

US TREASURY N/B 3.375	5,000,000.00	5,413,671.90
US TREASURY N/B 3.375	4,000,000.00	4,595,937.52
US TREASURY N/B 3.5	2,500,000.00	2,633,203.12
US TREASURY N/B 3.5	2,500,000.00	2,735,937.50
US TREASURY N/B 3.5	2,000,000.00	2,366,718.76
US TREASURY N/B 3.625	5,000,000.00	5,440,234.40
US TREASURY N/B 3.625	6,000,000.00	6,575,625.00
US TREASURY N/B 3.625	5,000,000.00	5,554,687.50
US TREASURY N/B 3.625	6,000,000.00	7,240,312.50
US TREASURY N/B 3.625	3,000,000.00	3,618,515.64
US TREASURY N/B 3.75	3,000,000.00	3,233,554.68
US TREASURY N/B 3.75	2,000,000.00	2,451,875.00
US TREASURY N/B 3.75	3,000,000.00	3,705,703.14
US TREASURY N/B 3.875	6,000,000.00	6,414,843.78
US TREASURY N/B 3.875	2,000,000.00	2,492,968.76
US TREASURY N/B 4	2,500,000.00	2,698,242.20
US TREASURY N/B 4.25	3,000,000.00	3,179,296.89
US TREASURY N/B 4.25	2,000,000.00	2,633,750.00
US TREASURY N/B 4.375	1,200,000.00	1,612,218.75
US TREASURY N/B 4.375	1,500,000.00	2,008,710.94
US TREASURY N/B 4.375	1,500,000.00	2,008,828.12
US TREASURY N/B 4.375	2,000,000.00	2,686,718.76
US TREASURY N/B 4.5	3,000,000.00	3,140,625.00
US TREASURY N/B 4.5	1,500,000.00	2,047,968.75
US TREASURY N/B 4.5	1,000,000.00	1,366,484.38
US TREASURY N/B 4.5	1,000,000.00	1,363,046.88
US TREASURY N/B 4.625	3,000,000.00	3,119,062.50
US TREASURY N/B 4.625	3,000,000.00	4,158,281.25
US TREASURY N/B 4.75	3,000,000.00	3,180,468.75
US TREASURY N/B 4.75	1,500,000.00	2,121,796.87
US TREASURY N/B 5.25	1,000,000.00	1,362,421.88
US TREASURY N/B 5.25	500,000.00	683,203.12
US TREASURY N/B 5.375	1,320,000.00	1,878,421.88
US TREASURY N/B 5.5	500,000.00	692,929.69
US TREASURY N/B 6	1,000,000.00	1,380,781.25
US TREASURY N/B 6.125	1,000,000.00	1,438,125.00
US TREASURY N/B 6.25	800,000.00	1,063,187.50
US TREASURY N/B 6.25	1,000,000.00	1,515,468.75
US TREASURY N/B 6.5	500,000.00	724,531.25
US TREASURY N/B 8	1,300,000.00	1,772,671.87
US TREASURY N/B 8.75	1,000,000.00	1,099,296.88
US TREASURY N/B 8.75	1,000,000.00	1,328,671.88
US TREASURY N/B 8.875	1,100,000.00	1,359,101.56

米ドル 小計		650,120,000.00	681,275,525.06 (77,644,971,591)
カナダドル	CANADA-GOV'T 0.25	1,000,000.00	996,750.00
	CANADA-GOV'T 0.75	1,000,000.00	1,008,750.00
	CANADA-GOV'T 0.75	1,000,000.00	1,003,870.00
	CANADA-GOV'T 1.25	2,000,000.00	2,022,040.00
	CANADA-GOV'T 1.25	2,000,000.00	2,030,840.00
	CANADA-GOV'T 1.25	1,000,000.00	1,019,230.00
	CANADA-GOV'T 1.5	1,000,000.00	1,009,670.00
	CANADA-GOV'T 1.5	2,000,000.00	2,020,880.00
	CANADA-GOV'T 1.5	1,000,000.00	1,015,450.00
	CANADA-GOV'T 1.5	2,000,000.00	2,072,860.00
	CANADA-GOV'T 1.75	1,000,000.00	1,037,700.00
	CANADA-GOV'T 1.75	1,000,000.00	1,043,170.00
	CANADA-GOV'T 2.25	1,000,000.00	1,093,000.00
	CANADA-GOV'T 2.5	2,000,000.00	2,223,200.00
	CANADA-GOV'T 2.75	1,000,000.00	1,120,700.00
	CANADA-GOV'T 3.25	1,000,000.00	1,132,070.00
	CANADA-GOV'T 3.5	2,000,000.00	2,248,660.00
	CANADA-GOV'T 3.5	1,500,000.00	2,013,000.00
	CANADA-GOV'T 3.75	2,500,000.00	2,765,750.00
	CANADA-GOV'T 4	2,000,000.00	2,089,660.00
	CANADA-GOV'T 4	3,000,000.00	4,195,920.00
	CANADA-GOV'T 4.25	1,500,000.00	1,628,850.00
	CANADA-GOV'T 5	1,500,000.00	2,292,420.00
CANADA-GOV'T 5.75	1,500,000.00	2,246,775.00	
CANADA-GOV'T 5.75	1,500,000.00	2,375,310.00	
CANADA-GOV'T 8	500,000.00	843,680.00	
カナダドル 小計		38,500,000.00	44,550,205.00 (3,713,259,586)
メキシコペソ	MEXICAN BONOS 6.5	30,000,000.00	31,373,190.00
	MEXICAN BONOS 7.25	20,000,000.00	20,558,780.00
	MEXICAN BONOS 7.75	20,000,000.00	21,332,440.00
	MEXICAN BONOS 8	50,000,000.00	55,358,450.00
	MEXICAN BONOS 8	20,000,000.00	22,632,340.00
	MEXICAN BONOS 8.5	50,000,000.00	59,466,700.00
	MEXICAN BONOS 8.5	40,000,000.00	47,881,280.00
メキシコペソ 小計		230,000,000.00	258,603,180.00 (1,608,511,779)
ユーロ	BELGIAN 0326 4	1,000,000.00	1,405,230.00
	BELGIAN 0.8	2,000,000.00	2,033,200.00
	BELGIAN 0291 5.5	2,000,000.00	3,056,860.00

BELGIAN 0300 5.5	740,000.00	810,744.00
BELGIAN 0304 5	2,500,000.00	4,038,825.00
BELGIAN 0308 4	1,500,000.00	1,864,920.00
BELGIAN 0312 4	1,000,000.00	1,093,450.00
BELGIAN 0315 4	1,500,000.00	1,703,745.00
BELGIAN 0318 3.75	2,000,000.00	2,366,160.00
BELGIAN 0320 4.25	1,500,000.00	2,349,195.00
BELGIAN 0321 4.25	1,700,000.00	2,111,791.00
BELGIAN 0323 3.5	2,000,000.00	2,106,700.00
BELGIAN 0324 4.5	1,000,000.00	1,376,650.00
BELGIAN 0325 4.25	2,000,000.00	2,547,400.00
BELGIAN 0327 3	1,000,000.00	1,119,500.00
BELGIAN 0328 2.25	1,000,000.00	1,147,750.00
BELGIAN 0329 1.25	1,000,000.00	1,039,150.00
BELGIAN 0332 2.6	2,000,000.00	2,356,460.00
BELGIAN 0333 3	500,000.00	634,550.00
BELGIAN 3.75	1,000,000.00	1,488,880.00
BTAN 1	2,500,000.00	2,551,000.00
BTPS 0.75	1,000,000.00	1,013,400.00
BTPS 1.05	1,000,000.00	1,026,430.00
BTPS 1.15	2,000,000.00	2,028,360.00
BTPS 1.35	2,000,000.00	2,053,360.00
BTPS 1.5	2,000,000.00	2,001,360.00
BTPS 2	1,000,000.00	1,036,670.00
BTPS 2.15	2,000,000.00	2,150,300.00
BTPS 2.5	1,000,000.00	1,071,950.00
BTPS 2.5	2,000,000.00	2,167,860.00
BTPS 3.25	1,500,000.00	1,667,220.00
BTPS 3.5	1,000,000.00	1,059,170.00
BTPS 3.5	3,400,000.00	3,663,432.00
BTPS 3.5	2,000,000.00	2,185,760.00
BTPS 3.5	1,000,000.00	1,181,680.00
BTPS 3.75	3,000,000.00	3,462,750.00
BTPS 3.75	2,000,000.00	2,314,360.00
BTPS 3.75	3,300,000.00	3,830,805.00
BTPS 3.75	2,000,000.00	2,368,460.00
BTPS 4	2,500,000.00	2,595,375.00
BTPS 4	3,500,000.00	4,048,625.00
BTPS 4	3,000,000.00	3,747,750.00
BTPS 4.25	2,400,000.00	2,687,952.00
BTPS 4.25	3,500,000.00	3,983,875.00
BTPS 4.25	3,300,000.00	3,808,464.00
BTPS 4.5	4,000,000.00	4,345,320.00



BTPS 4.5	3,000,000.00	3,321,390.00	
BTPS 4.5	2,700,000.00	3,050,676.00	
BTPS 4.5	2,700,000.00	3,137,400.00	
BTPS 4.5	1,800,000.00	2,217,420.00	
BTPS 4.5	2,000,000.00	2,478,560.00	
BTPS 4.5	2,000,000.00	2,532,800.00	
BTPS 4.75	1,000,000.00	1,056,800.00	
BTPS 4.75	2,000,000.00	2,121,400.00	
BTPS 4.75	2,600,000.00	3,161,418.00	
BTPS 4.75	2,500,000.00	3,136,450.00	
BTPS 4.75	2,000,000.00	2,629,000.00	
BTPS 4.75	1,000,000.00	1,408,680.00	
BTPS 5	2,000,000.00	2,482,000.00	
BTPS 5	3,000,000.00	3,883,560.00	
BTPS 5	2,470,000.00	3,463,310.50	
BTPS 5	2,000,000.00	2,862,100.00	
BTPS 5	2,500,000.00	3,565,375.00	
BTPS 5.25	3,000,000.00	3,227,850.00	
BTPS 5.25	2,700,000.00	3,747,870.00	
BTPS 5.5	2,500,000.00	3,208,700.00	
BTPS 5.5	2,500,000.00	3,215,625.00	
BTPS 5.75	2,200,000.00	3,296,986.00	
BTPS 6	4,100,000.00	6,150,328.00	
BTPS 6.5	2,960,000.00	4,395,452.00	
BTPS 7.25	1,000,000.00	1,537,430.00	
BTPS 9	1,000,000.00	1,566,650.00	
BUNDESOBL-162 0.75	2,500,000.00	2,531,325.00	
BUNDESOBL-163 0.5	2,000,000.00	2,022,360.00	
BUNDESOBL-164 0.5	2,000,000.00	2,032,900.00	
BUNDESOBL-165 0.5	2,000,000.00	2,040,700.00	
BUNDESOBL-166 0.25	2,000,000.00	2,032,460.00	
BUNDESOBL-167 1	2,000,000.00	2,079,200.00	
BUNDESOBL-168 1	1,000,000.00	1,044,330.00	
BUNDESOBL-169 0.5	1,000,000.00	1,030,400.00	
BUNDESOBL-170 0.25	1,000,000.00	1,025,650.00	
BUNDESOBL-171 0	1,000,000.00	1,016,650.00	
DEUTSCHLAND REP 0.5	2,000,000.00	2,063,860.00	
DEUTSCHLAND REP 1	2,000,000.00	2,159,860.00	
DEUTSCHLAND REP 1	3,000,000.00	3,225,240.00	
DEUTSCHLAND REP 1.5	2,500,000.00	2,776,000.00	
DEUTSCHLAND REP 1.5	1,500,000.00	1,671,945.00	
DEUTSCHLAND REP 1.5	2,000,000.00	2,234,040.00	

DEUTSCHLAND REP 1.5	2,000,000.00	2,244,540.00
DEUTSCHLAND REP 1.75	2,500,000.00	2,812,000.00
DEUTSCHLAND REP 1.75	2,000,000.00	2,282,560.00
DEUTSCHLAND REP 2	2,000,000.00	2,265,160.00
DEUTSCHLAND REP 2	1,500,000.00	1,734,720.00
DEUTSCHLAND REP 2.25	1,500,000.00	1,681,080.00
DEUTSCHLAND REP 2.25	2,000,000.00	2,282,800.00
DEUTSCHLAND REP 2.5	2,000,000.00	2,279,900.00
DEUTSCHLAND REP 2.5	2,200,000.00	3,053,666.00
DEUTSCHLAND REP 2.5	1,000,000.00	1,399,800.00
DEUTSCHLAND REP 3	3,000,000.00	3,448,740.00
DEUTSCHLAND REP 3.25	3,000,000.00	3,431,400.00
DEUTSCHLAND REP 3.25	2,000,000.00	2,383,940.00
DEUTSCHLAND REP 3.25	1,500,000.00	2,317,875.00
DEUTSCHLAND REP 3.5	4,000,000.00	4,537,320.00
DEUTSCHLAND REP 3.75	3,500,000.00	3,928,330.00
DEUTSCHLAND REP 4	3,000,000.00	3,255,150.00
DEUTSCHLAND REP 4	2,200,000.00	3,529,900.00
DEUTSCHLAND REP 4.25	2,000,000.00	2,130,560.00
DEUTSCHLAND REP 4.25	3,200,000.00	3,562,560.00
DEUTSCHLAND REP 4.25	1,500,000.00	2,566,125.00
DEUTSCHLAND REP 4.75	1,300,000.00	1,983,540.00
DEUTSCHLAND REP 4.75	2,100,000.00	3,552,045.00
DEUTSCHLAND REP 4.75	1,400,000.00	2,583,532.00
DEUTSCHLAND REP 5.5	1,800,000.00	3,060,900.00
DEUTSCHLAND REP 5.625	1,580,000.00	2,548,224.00
DEUTSCHLAND REP 6.25	1,200,000.00	1,797,600.00
DEUTSCHLAND REP 6.25	1,000,000.00	1,775,730.00
DEUTSCHLAND REP 6.5	1,000,000.00	1,691,130.00
FINNISH GOV'T 1.625	1,000,000.00	1,101,500.00
FINNISH GOV'T 2.625	500,000.00	654,875.00
FINNISH GOV'T 2.75	600,000.00	733,878.00
FINNISH GOV'T 3.375	1,200,000.00	1,380,360.00
FINNISH GOV'T 3.5	1,000,000.00	1,186,330.00
FINNISH GOV'T 3.875	1,000,000.00	1,068,730.00
FINNISH GOV'T 4	1,000,000.00	1,320,200.00
FRANCE O.A.T. 0	2,000,000.00	2,015,960.00
FRANCE O.A.T. 0.5	2,000,000.00	2,056,300.00
FRANCE O.A.T. 0.5	3,000,000.00	2,984,310.00
FRANCE O.A.T. 1	3,000,000.00	3,093,540.00
FRANCE O.A.T. 1	1,000,000.00	1,036,930.00
FRANCE O.A.T. 1	1,000,000.00	1,042,250.00
FRANCE O.A.T. 1	2,000,000.00	2,067,260.00

FRANCE O.A.T. 1.75	3,000,000.00	3,333,150.00	
FRANCE O.A.T. 1.75	4,000,000.00	4,443,600.00	
FRANCE O.A.T. 2.25	2,300,000.00	2,624,875.00	
FRANCE O.A.T. 2.25	3,000,000.00	3,459,240.00	
FRANCE O.A.T. 2.5	4,500,000.00	5,058,360.00	
FRANCE O.A.T. 2.5	3,000,000.00	3,555,300.00	
FRANCE O.A.T. 2.75	3,000,000.00	3,622,200.00	
FRANCE O.A.T. 3	4,000,000.00	4,728,800.00	
FRANCE O.A.T. 3.25	3,800,000.00	4,505,660.00	
FRANCE O.A.T. 3.25	1,700,000.00	2,330,751.00	
FRANCE O.A.T. 3.5	5,000,000.00	5,779,250.00	
FRANCE O.A.T. 3.5	4,000,000.00	5,108,000.00	
FRANCE O.A.T. 3.75	5,000,000.00	5,247,150.00	
FRANCE O.A.T. 3.75	5,000,000.00	5,741,250.00	
FRANCE O.A.T. 3.75	3,700,000.00	4,438,261.00	
FRANCE O.A.T. 4	4,000,000.00	4,384,000.00	
FRANCE O.A.T. 4	2,700,000.00	4,005,585.00	
FRANCE O.A.T. 4	1,370,000.00	2,227,935.10	
FRANCE O.A.T. 4	1,500,000.00	2,473,620.00	
FRANCE O.A.T. 4.25	4,500,000.00	4,853,835.00	
FRANCE O.A.T. 4.25	4,000,000.00	4,495,400.00	
FRANCE O.A.T. 4.25	4,400,000.00	5,040,112.00	
FRANCE O.A.T. 4.25	4,000,000.00	5,216,520.00	
FRANCE O.A.T. 4.5	2,700,000.00	4,374,135.00	
FRANCE O.A.T. 4.75	2,600,000.00	4,097,990.00	
FRANCE O.A.T. 5.5	3,500,000.00	5,458,180.00	
FRANCE O.A.T. 5.75	3,200,000.00	5,400,416.00	
FRANCE O.A.T. 6	2,500,000.00	3,790,000.00	
FRANCE O.A.T. 8.5	850,000.00	1,125,850.50	
FRANCE O.A.T. 8.5	1,200,000.00	1,915,656.00	
IRISH GOVT 2	1,000,000.00	1,018,600.00	
IRISH GOVT 3.4	1,000,000.00	1,210,800.00	
IRISH GOVT 3.9	1,000,000.00	1,238,780.00	
IRISH GOVT 4.4	1,000,000.00	1,146,700.00	
IRISH GOVT 4.5	1,000,000.00	1,122,430.00	
IRISH GOVT 4.5	1,490,000.00	1,766,961.20	
IRISH GOVT 5	1,000,000.00	1,228,220.00	
IRISH GOVT 5.4	1,500,000.00	2,085,570.00	
IRISH GOVT 5.5	500,000.00	547,725.00	
IRISH GOVT 5.9	800,000.00	972,504.00	
NETHERLANDS GOVT 0	1,000,000.00	1,009,500.00	
NETHERLANDS GOVT 0.25	1,000,000.00	1,022,900.00	

NETHERLANDS GOVT 0.25	1,000,000.00	985,900.00
NETHERLANDS GOVT 0.5	1,000,000.00	1,011,400.00
NETHERLANDS GOVT 1.25	1,500,000.00	1,549,125.00
NETHERLANDS GOVT 1.25	2,000,000.00	2,095,800.00
NETHERLANDS GOVT 1.75	2,200,000.00	2,465,430.00
NETHERLANDS GOVT 2	2,000,000.00	2,292,960.00
NETHERLANDS GOVT 2.25	2,000,000.00	2,293,360.00
NETHERLANDS GOVT 2.5	1,100,000.00	1,376,870.00
NETHERLANDS GOVT 2.75	500,000.00	710,365.00
NETHERLANDS GOVT 3.25	1,500,000.00	1,777,920.00
NETHERLANDS GOVT 3.5	2,000,000.00	2,336,000.00
NETHERLANDS GOVT 3.75	1,000,000.00	1,257,900.00
NETHERLANDS GOVT 3.75	2,000,000.00	3,229,800.00
NETHERLANDS GOVT 4	1,500,000.00	1,661,145.00
NETHERLANDS GOVT 4	1,500,000.00	1,724,445.00
NETHERLANDS GOVT 4	1,200,000.00	1,885,596.00
NETHERLANDS GOVT 4.5	2,000,000.00	2,140,300.00
NETHERLANDS GOVT 5.5	1,500,000.00	2,342,325.00
REP OF AUSTRIA 1.2	500,000.00	528,740.00
REP OF AUSTRIA 1.65	1,000,000.00	1,105,150.00
REP OF AUSTRIA 1.75	1,000,000.00	1,113,930.00
REP OF AUSTRIA 1.95	1,000,000.00	1,075,550.00
REP OF AUSTRIA 3.15	500,000.00	703,565.00
REP OF AUSTRIA 3.2	1,000,000.00	1,036,380.00
REP OF AUSTRIA 3.4	1,000,000.00	1,222,250.00
REP OF AUSTRIA 3.5	2,000,000.00	2,401,700.00
REP OF AUSTRIA 3.65	1,000,000.00	1,225,350.00
REP OF AUSTRIA 3.8	500,000.00	869,015.00
REP OF AUSTRIA 3.9	2,000,000.00	2,365,800.00
REP OF AUSTRIA 4.15	1,300,000.00	1,990,495.00
REP OF AUSTRIA 4.3	1,500,000.00	1,612,470.00
REP OF AUSTRIA 4.35	1,200,000.00	1,373,556.00
REP OF AUSTRIA 4.65	1,000,000.00	1,097,730.00
REP OF AUSTRIA 4.85	1,000,000.00	1,413,380.00
REP OF AUSTRIA 6.25	1,000,000.00	1,602,980.00
SPANISH GOV'T 0.5	1,000,000.00	1,007,700.00
SPANISH GOV'T 1.4	2,000,000.00	2,069,540.00
SPANISH GOV'T 1.6	2,000,000.00	1,992,040.00
SPANISH GOV'T 1.95	1,000,000.00	965,330.00
SPANISH GOV'T 2.1	2,000,000.00	2,049,700.00
SPANISH GOV'T 2.15	2,000,000.00	2,073,760.00
SPANISH GOV'T 2.75	1,000,000.00	1,077,200.00
SPANISH GOV'T 2.75	3,000,000.00	3,271,890.00

	SPANISH GOV'T 3.75	2,200,000.00	2,410,716.00	
	SPANISH GOV'T 3.8	2,500,000.00	2,590,375.00	
	SPANISH GOV'T 3.8	2,000,000.00	2,345,300.00	
	SPANISH GOV'T 4	3,000,000.00	3,423,750.00	
	SPANISH GOV'T 4.1	2,000,000.00	2,191,660.00	
	SPANISH GOV'T 4.2	2,050,000.00	2,546,920.00	
	SPANISH GOV'T 4.3	3,000,000.00	3,423,840.00	
	SPANISH GOV'T 4.4	1,000,000.00	1,218,980.00	
	SPANISH GOV'T 4.5	2,500,000.00	2,713,825.00	
	SPANISH GOV'T 4.6	3,500,000.00	4,006,205.00	
	SPANISH GOV'T 4.65	2,000,000.00	2,512,600.00	
	SPANISH GOV'T 4.7	1,500,000.00	2,006,850.00	
	SPANISH GOV'T 4.8	3,000,000.00	3,753,390.00	
	SPANISH GOV'T 4.85	2,000,000.00	2,383,340.00	
	SPANISH GOV'T 4.9	1,500,000.00	2,051,400.00	
	SPANISH GOV'T 5.15	1,500,000.00	2,005,545.00	
	SPANISH GOV'T 5.15	1,000,000.00	1,433,630.00	
	SPANISH GOV'T 5.4	2,000,000.00	2,555,860.00	
	SPANISH GOV'T 5.5	3,380,000.00	3,647,121.40	
	SPANISH GOV'T 5.5	2,000,000.00	2,477,700.00	
	SPANISH GOV'T 5.75	2,200,000.00	3,218,270.00	
	SPANISH GOV'T 5.85	2,500,000.00	3,204,000.00	
	SPANISH GOV'T 5.9	1,500,000.00	2,075,595.00	
	SPANISH GOV'T 6	2,400,000.00	3,451,920.00	
	ユーロ 小計	477,390,000.00	577,644,654.70 (73,320,436,021)	
英bond	TREASURY 1	3,300,000.00	3,332,010.00	
	TREASURY 1.25	1,500,000.00	1,528,200.00	
	TREASURY 1.75	1,000,000.00	1,037,500.00	
	TREASURY 1.75	3,000,000.00	3,121,500.00	
	TREASURY 2	1,000,000.00	1,051,900.00	
	TREASURY 2.25	2,700,000.00	2,892,240.00	
	TREASURY 2.75	2,000,000.00	2,218,800.00	
	TREASURY 3.25	2,000,000.00	2,366,600.00	
	TREASURY 3.5	1,500,000.00	1,860,300.00	
	TREASURY 3.5	1,000,000.00	1,404,500.00	
	TREASURY 3.75	3,000,000.00	3,335,400.00	
	TREASURY 3.75	2,800,000.00	3,178,280.00	
	TREASURY 3.75	2,400,000.00	2,767,440.00	
	TREASURY 3.75	2,300,000.00	3,152,150.00	
	TREASURY 4	1,500,000.00	1,768,050.00	
	TREASURY 4	2,000,000.00	3,016,000.00	

	TREASURY 4.25	1,300,000.00	1,661,530.00
	TREASURY 4.25	2,000,000.00	2,623,000.00
	TREASURY 4.25	2,000,000.00	2,667,600.00
	TREASURY 4.25	1,500,000.00	2,031,300.00
	TREASURY 4.25	2,000,000.00	2,735,400.00
	TREASURY 4.25	1,900,000.00	2,711,490.00
	TREASURY 4.25	1,900,000.00	2,782,550.00
	TREASURY 4.25	2,100,000.00	3,240,300.00
	TREASURY 4.5	2,700,000.00	3,029,940.00
	TREASURY 4.5	2,500,000.00	3,411,250.00
	TREASURY 4.5	2,000,000.00	2,870,200.00
	TREASURY 4.75	2,700,000.00	3,141,450.00
	TREASURY 4.75	1,800,000.00	2,466,540.00
	TREASURY 4.75	1,500,000.00	2,164,050.00
	TREASURY 5	2,500,000.00	2,740,750.00
	TREASURY 5	2,500,000.00	3,271,000.00
	TREASURY 6	1,200,000.00	1,799,880.00
	TREASURY 8	1,620,000.00	2,218,590.00
	TREASURY 8.75	800,000.00	903,600.00
	UNITED KINGDOM G 2	1,500,000.00	1,568,550.00
英ポンド 小計		71,020,000.00	88,069,840.00 (14,341,292,745)
スイスフラン	SWISS (GOVT) 2.25	900,000.00	1,025,820.00
	SWISS (GOVT) 3	500,000.00	539,250.00
	SWISS (GOVT) 3	1,000,000.00	1,130,900.00
	SWISS (GOVT) 4	500,000.00	664,050.00
	SWISS (GOVT) 4	700,000.00	1,058,120.00
	SWISS (GOVT) 4.25	500,000.00	534,100.00
スイスフラン 小計		4,100,000.00	4,952,240.00 (568,715,241)
スウェーデンクローナ	SWEDISH GOVRNMNT 1.5	8,000,000.00	8,719,920.00
	SWEDISH GOVRNMNT 2.5	5,000,000.00	5,884,000.00
	SWEDISH GOVRNMNT 3.5	11,000,000.00	13,311,980.00
	SWEDISH GOVRNMNT 3.5	6,000,000.00	8,167,140.00
	SWEDISH GOVRNMNT 3.75	8,200,000.00	8,733,820.00
	SWEDISH GOVRNMNT 4.25	12,000,000.00	13,740,000.00
	SWEDISH GOVRNMNT 5	5,000,000.00	6,227,000.00
スウェーデンクローナ 小計		55,200,000.00	64,783,860.00 (868,103,724)
ノルウェークローネ	NORWEGIAN GOV'T 2	10,000,000.00	10,601,000.00
	NORWEGIAN GOV'T 3	4,000,000.00	4,545,200.00
	NORWEGIAN GOV'T 3.75	11,000,000.00	12,616,010.00
	NORWEGIAN GOV'T 4.25	6,000,000.00	6,272,280.00

	NORWEGIAN GOV'T 4.5	6,000,000.00	6,753,000.00
ノルウェークローネ 小計		37,000,000.00	40,787,490.00 (544,105,116)
デンマーククローネ	DENMARK - BULLET 1.5	5,000,000.00	5,461,000.00
	DENMARK - BULLET 1.75	5,000,000.00	5,542,500.00
	DENMARK - BULLET 3	10,000,000.00	11,720,000.00
	DENMARK - BULLET 4	5,000,000.00	5,388,000.00
	DENMARK - BULLET 4	8,000,000.00	9,259,440.00
	DENMARK - BULLET 4.5	14,000,000.00	23,961,000.00
	DENMARK - BULLET 7	3,080,000.00	4,855,928.00
デンマーククローネ 小計		50,080,000.00	66,187,868.00 (1,125,193,756)
ポーランドズロチ	POLAND GOVT BOND 2.5	5,000,000.00	5,129,500.00
	POLAND GOVT BOND 3.25	2,000,000.00	2,061,000.00
	POLAND GOVT BOND 4	2,000,000.00	2,168,000.00
	POLAND GOVT BOND 5.25	5,000,000.00	5,319,000.00
	POLAND GOVT BOND 5.25	2,000,000.00	2,290,000.00
	POLAND GOVT BOND 5.5	4,000,000.00	4,518,000.00
	POLAND GOVT BOND 5.75	4,000,000.00	4,700,000.00
	POLAND GOVT BOND 5.75	4,200,000.00	5,033,490.00
	POLAND GOVT BOND 5.75	2,000,000.00	2,519,860.00
ポーランドズロチ 小計		30,200,000.00	33,738,850.00 (974,040,599)
オーストラリアドル	AUSTRALIAN GOVT. 2.75	1,000,000.00	1,028,800.00
	AUSTRALIAN GOVT. 2.75	3,000,000.00	3,081,963.00
	AUSTRALIAN GOVT. 2.75	1,000,000.00	942,200.00
	AUSTRALIAN GOVT. 3.25	2,000,000.00	2,068,800.00
	AUSTRALIAN GOVT. 3.25	3,000,000.00	3,198,000.00
	AUSTRALIAN GOVT. 3.25	1,500,000.00	1,572,300.00
	AUSTRALIAN GOVT. 3.75	1,000,000.00	1,096,200.00
	AUSTRALIAN GOVT. 4.25	2,000,000.00	2,062,600.00
	AUSTRALIAN GOVT. 4.25	2,000,000.00	2,295,000.00
	AUSTRALIAN GOVT. 4.5	3,000,000.00	3,309,417.00
	AUSTRALIAN GOVT. 4.5	1,500,000.00	1,798,800.00
	AUSTRALIAN GOVT. 4.75	1,200,000.00	1,449,240.00
	AUSTRALIAN GOVT. 5.25	3,000,000.00	3,304,689.00
	AUSTRALIAN GOVT. 5.5	2,000,000.00	2,133,000.00
	AUSTRALIAN GOVT. 5.5	2,500,000.00	3,004,000.00
	AUSTRALIAN GOVT. 5.75	3,000,000.00	3,537,750.00
	AUSTRALIAN GOVT. 5.75	2,000,000.00	2,405,800.00
	AUSTRALIAN GOVT. 6	1,800,000.00	1,866,600.00
	オーストラリアドル 小計		36,500,000.00

シンガポールドル	SINGAPORE GOV'T 2.25	500,000.00	510,520.00	
	SINGAPORE GOV'T 2.75	400,000.00	400,824.00	
	SINGAPORE GOV'T 2.875	400,000.00	414,040.00	
	SINGAPORE GOV'T 3.125	1,000,000.00	1,069,500.00	
	SINGAPORE GOV'T 3.25	1,000,000.00	1,070,500.00	
	SINGAPORE GOV'T 3.375	500,000.00	550,830.00	
	SINGAPORE GOV'T 3.5	1,500,000.00	1,662,750.00	
	SINGAPORE GOV'T 4	2,100,000.00	2,250,570.00	
シンガポールドル 小計		7,400,000.00	7,929,534.00	(643,560,979)
マレーシアリングgit	MALAYSIA GOVT 3.418	8,000,000.00	7,840,000.00	
	MALAYSIA GOVT 3.502	9,000,000.00	8,411,310.00	
	MALAYSIA GOVT 3.814	2,000,000.00	2,023,000.00	
	MALAYSIA GOVT 4.24	5,000,000.00	5,102,500.00	
	MALAYSIA GOVT 4.262	3,000,000.00	3,032,580.00	
	MALAYSIA GOVT 4.378	5,000,000.00	5,163,500.00	
マレーシアリングgit 小計		32,000,000.00	31,572,890.00	(862,255,625)
南アフリカランド	REP SOUTH AFRICA 6.5	40,000,000.00	26,792,000.00	
	REP SOUTH AFRICA 6.75	30,000,000.00	27,532,500.00	
	REP SOUTH AFRICA 7	40,000,000.00	31,508,000.00	
	REP SOUTH AFRICA 8	10,000,000.00	9,881,500.00	
	REP SOUTH AFRICA 8.25	8,000,000.00	8,031,760.00	
南アフリカランド 小計		128,000,000.00	103,745,760.00	(764,606,251)
合計			180,251,698,471	(180,251,698,471)

(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 196銘柄	42.4%	43.1%
カナダドル	国債証券 26銘柄	2.0%	2.1%
メキシコペソ	国債証券 7銘柄	0.9%	0.9%
ユーロ	国債証券 240銘柄	40.1%	40.7%
英ポンド	国債証券 36銘柄	7.8%	8.0%
スイスフラン	国債証券 6銘柄	0.3%	0.3%
スウェーデンクローナ	国債証券 7銘柄	0.5%	0.5%
ノルウェークローネ	国債証券 5銘柄	0.3%	0.3%
デンマーククローネ	国債証券 7銘柄	0.6%	0.6%
ポーランドズロチ	国債証券 9銘柄	0.5%	0.5%
オーストラリアドル	国債証券 18銘柄	1.8%	1.8%
シンガポールドル	国債証券 8銘柄	0.4%	0.4%



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

## デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。

## 2【ファンドの現況】

## 【純資産額計算書】

## 三井住友・DC年金バランス30（債券重点型）

平成28年 3月31日現在

資産総額	5,178,036,095円
負債総額	2,750,591円
純資産総額（ - ）	5,175,285,504円
発行済口数	3,839,623,383口
1口当たり純資産額（ / ）	1.3479円
（1万口当たり純資産額）	（13,479円）

## 三井住友・DC年金バランス50（標準型）

平成28年 3月31日現在

資産総額	14,701,721,295円
負債総額	8,317,085円
純資産総額（ - ）	14,693,404,210円
発行済口数	10,795,957,458口
1口当たり純資産額（ / ）	1.3610円
（1万口当たり純資産額）	（13,610円）

## 三井住友・DC年金バランス70（株式重点型）

平成28年 3月31日現在

資産総額	7,425,712,028円
負債総額	4,684,068円
純資産総額（ - ）	7,421,027,960円
発行済口数	5,508,302,926口
1口当たり純資産額（ / ）	1.3472円
（1万口当たり純資産額）	（13,472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します。
- ヘ 償還金  
償還金は、原則として、償還日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者に支払います。
- ト 質権口記載または記録の受益権の取扱いについて  
振替機関等の振替口座簿の質権口に記載または記録されている受益権にかかる収益分配金の支払い、一部解約の実行の請求の受付け、一部解約金および償還金の支払い等については、約款の規定によるほか、民法その他の法令等に従って取り扱われます。

### 第三部【委託会社等の情報】

#### 第1【委託会社等の概況】

##### 1【委託会社等の概況】

###### イ 資本金の額および株式数

	平成28年 3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。

##### 八 会社の機構

委託会社の取締役は7名以内とし、株主総会で選任されます。取締役の選任決議は、議決権を行使することができる株主の議決権の3分の1以上を有する株主が出席し、その議決権の過半数をもって行い、累積投票によらないものとします。

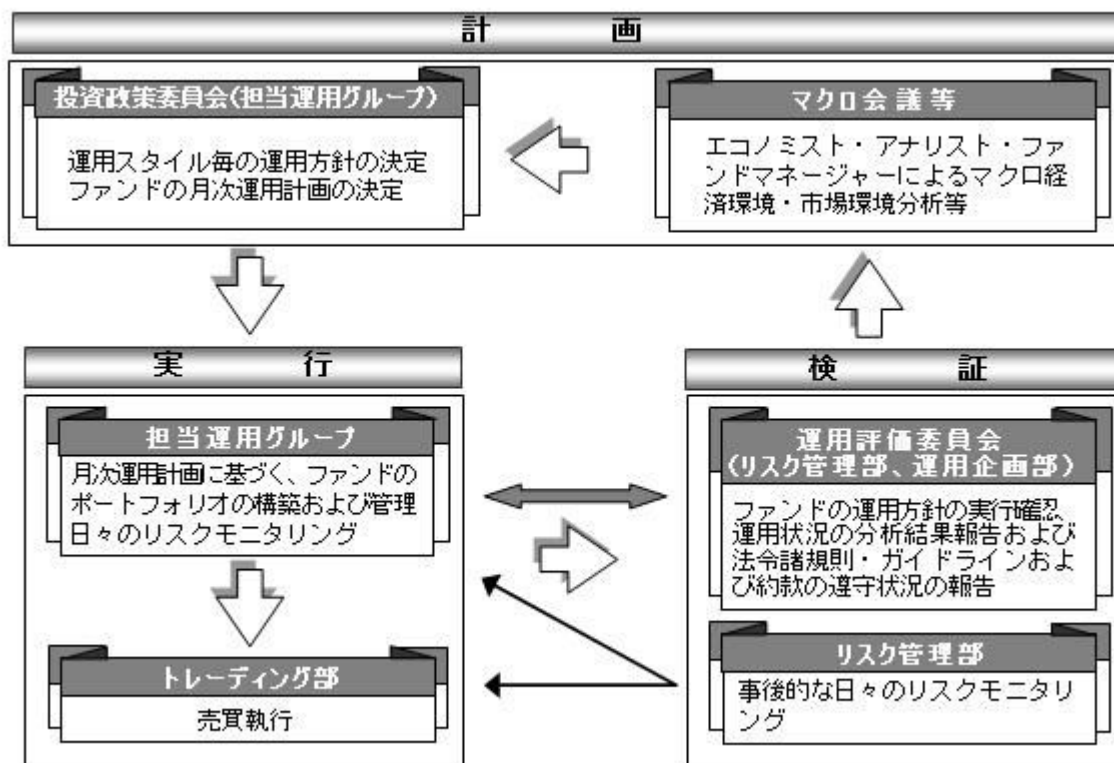
取締役の任期は、選任後1年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会の終結の時までとし、補欠または増員によって選任された取締役の任期は、他の現任取締役の任期の満了する時までとします。

委託会社の業務上重要な事項は、取締役会の決議により決定します。

取締役会は、取締役会の決議によって、代表取締役を若干名を選定します。

また、取締役会の決議によって、取締役社長を1名選定し、必要に応じて取締役会長1名のほか、取締役副社長、専務取締役、常務取締役を若干名選定することができます。

##### 二 投資信託の運用の流れ



## 2【事業の内容及び営業の概況】

「投資信託及び投資法人に関する法律」に定める投資信託委託会社である委託会社は、証券投資信託の設定を行うとともに「金融商品取引法」に定める金融商品取引業者としてその運用（投資運用業）を行っています。また「金融商品取引法」に定める投資助言業務を行っています。

平成28年3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。

（平成28年 3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	52 ( 14 )	138,975 ( 46,870 )
	追加型	471 ( 195 )	5,036,674 ( 2,749,343 )
	計	523 ( 209 )	5,175,649 ( 2,796,213 )
公社債投資信託	単位型	55 ( 55 )	263,270 ( 263,270 )
	追加型	2 ( 0 )	26,776 ( 0 )
	計	57 ( 55 )	290,046 ( 263,270 )
合 計		580 ( 264 )	5,465,695 ( 3,059,483 )

（ ）内は、私募投資信託分であり、内書き表記しております。

## 3【委託会社等の経理状況】

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

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

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

## (1)【貸借対照表】

(単位：千円)

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

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

(単位：千円)

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

負債合計	8,729,285	10,209,222
純資産の部		
株主資本		
資本金	2,000,000	2,000,000
資本剰余金		
資本準備金	8,628,984	8,628,984
資本剰余金合計	8,628,984	8,628,984
利益剰余金		
利益準備金	284,245	284,245
その他利益剰余金		
配当準備積立金	60,000	60,000
別途積立金	1,476,959	1,476,959
繰越利益剰余金	19,227,103	18,861,359
利益剰余金合計	21,048,308	20,682,564
株主資本計	31,677,292	31,311,548
評価・換算差額等		
その他有価証券		
評価差額金	657,238	634,478
評価・換算差額等合計	657,238	634,478
純資産合計	32,334,530	31,946,027
負債・純資産合計	41,063,815	42,155,249

## (2) 【損益計算書】

(単位：千円)

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

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



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

## (3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日）

（単位：千円）

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

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

当事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

（単位：千円）

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

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

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

## [注記事項]

## (重要な会計方針)

## 1. 有価証券の評価基準及び評価方法

## (1) 満期保有目的の債券

償却原価法

## (2) 子会社株式及び関連会社株式

移動平均法による原価法

## (3) その他有価証券

時価のあるもの

決算日の市場価格等に基づく時価法

(評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定)

時価のないもの

移動平均法による原価法

## 2. 固定資産の減価償却の方法

## (1) 有形固定資産

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

なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。

建物 3～50年

器具備品 3～20年

## (2) 無形固定資産

定額法によっております。

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

### 3. 引当金の計上基準

#### (1) 賞与引当金

従業員賞与の支給に充てるため、将来の支給見込額のうち、当事業年度の負担額を計上しております。

#### (2) 退職給付引当金

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

退職給付見込額の期間帰属方法

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

数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法

過去勤務費用については、その発生時において一時に費用処理しております。

数理計算上の差異については、その発生時において一時に費用処理しております。

### 4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

#### 消費税等の会計処理

消費税等の会計処理は税抜方式によっております。

#### (会計方針の変更)

##### (退職給付に関する会計基準等の適用)

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

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

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

なお、1株当たり情報に与える影響は当該箇所に記載しております。

#### (貸借対照表関係)

##### 1 有形固定資産の減価償却累計額

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

##### 2 関係会社に対する資産及び負債

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

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

	前事業年度 (平成26年3月31日)	当事業年度 (平成27年3月31日)
当座借越極度額の総額	10,000,000千円	10,000,000千円
借入実行残高	- 千円	- 千円
差引額	10,000,000千円	10,000,000千円

#### 4 保証債務

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

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

#### (損益計算書関係)

- 1 関係会社との取引に係るものが次のとおり含まれております。

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

#### 2 固定資産除却損

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

#### 3 その他の特別損失

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

#### (株主資本等変動計算書関係)

前事業年度(自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)

##### 1.発行済株式数に関する事項

	当期首株式数	当期増加株式数	当期減少株式数	当期末株式数
普通株式	17,640株	-	-	17,640株

##### 2.剰余金の配当に関する事項

###### (1)配当金支払額等

決議	株式の種類	配当金の総額 (千円)	一株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
平成25年6月24日 定時株主総会	普通株式	864,360	49,000	平成25年 3月31日	平成25年 6月25日

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

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

決議	株式の種類	配当の原資	配当金の総額(千円)	一株当たり配当額(円)	基準日	効力発生日
平成26年6月26日 定時株主総会	普通株式	利益剰余金	1,852,200	105,000	平成26年 3月31日	平成26年 6月27日

当事業年度(自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)

1.発行済株式数に関する事項

	当期首株式数	当期増加株式数	当期減少株式数	当期末株式数
普通株式	17,640株	-	-	17,640株

2.剰余金の配当に関する事項

(1)配当金支払額等

決議	株式の種類	配当金の総額(千円)	一株当たり配当額(円)	基準日	効力発生日
平成26年6月26日 定時株主総会	普通株式	1,852,200	105,000	平成26年 3月31日	平成26年 6月27日

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

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

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

(リース取引関係)

オペレーティング・リース取引

(借主側)

オペレーティング・リース取引のうち解約不能のものに係る未経過リース料

(単位：千円)

	前事業年度 (平成26年3月31日)	当事業年度 (平成27年3月31日)
1年以内	525,188	572,402
1年超	751,482	1,340,637
合計	1,276,671	1,913,040

(金融商品関係)

1.金融商品の状況に関する事項

(1)金融商品に対する取組方針

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

(2)金融商品の内容及びそのリスク

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

有価証券及び投資有価証券については、主に満期保有目的の債券及び事業推進目的のために保有する当社が設定する投資信託等であり、市場価格の変動リスク及び発行体の信用リスクに晒されています。関係会社株式については、主に全額出資の海外子会社の株式及び50%出資した海外関連会社の株式であり、発行体の信用リスクに晒されています。また、長期差入保証金は、建物等の賃借

契約に関連する敷金等であり、差入先の信用リスクに晒されています。

営業債務である未払手数料は、すべて1年以内の支払期日であります。

### (3)金融商品に係るリスク管理体制

#### 信用リスクの管理

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

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

有価証券、投資有価証券、子会社株式及び関連会社株式は発行体の信用リスクについて、資産の自己査定及び償却・引当規程に従い、定期的に管理を行い、その状況について取締役会に報告しています。

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

#### 市場リスクの管理

有価証券及び投資有価証券については、自己勘定資産の運用・管理に関する規程に従い、各所管部においては所管する有価証券について管理を、企画部においては総合的なリスク管理を行い、定期的に時価を把握しています。また、資産の自己査定及び償却・引当規程に従い、その状況について取締役会に報告しています。

なお、事業推進目的のために保有する当社が設定する投資信託等については、純資産額に対する保有制限を設けており、また、自社設定投信等の取得・処分に関する規則に従い、定期的に取締役会において報告し、投資家の資金性格、金額、および投資家数等の状況から検討した結果、目的が達成されたと判断した場合には速やかに処分することとしています。

### (4)金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

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

## 2.金融商品の時価等に関する事項

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

前事業年度（平成26年3月31日）

(単位：千円)

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

当事業年度（平成27年3月31日）

(単位：千円)

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

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

## (注1)金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

資 産

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

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

## (5)有価証券及び投資有価証券

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

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

## (6)長期差入保証金

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

負 債

## (1)未払金

## 未払手数料

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

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

(単位：千円)

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

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

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

## (注3)金銭債権及び満期がある有価証券の決算日後の償還予定額

前事業年度（平成26年3月31日）

(単位：千円)

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

当事業年度(平成27年3月31日)

(単位：千円)

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

(有価証券関係)

1. 満期保有目的の債券

前事業年度(平成26年3月31日)

(単位：千円)

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

当事業年度(平成27年3月31日)

該当事項はありません。

2. 子会社株式及び関連会社株式

前事業年度(平成26年3月31日)

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

当事業年度(平成27年3月31日)

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

3. その他有価証券

前事業年度(平成26年3月31日)



(単位:千円)

区分	貸借対照表計上額	取得原価	差額
(1)貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの 投資信託等	6,390,685	5,387,490	1,003,195
小計	6,390,685	5,387,490	1,003,195
(2)貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの 投資信託等	420,480	424,165	3,684
小計	420,480	424,165	3,684
合計	6,811,166	5,811,655	999,510

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

当事業年度(平成27年3月31日)

(単位:千円)

区分	貸借対照表計上額	取得原価	差額
(1)貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの 投資信託等	5,826,531	4,894,554	931,977
小計	5,826,531	4,894,554	931,977
(2)貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの 投資信託等	1,304,543	1,312,300	7,756
小計	1,304,543	1,312,300	7,756
合計	7,131,075	6,206,854	924,220

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

## 4.当事業年度中に売却したその他有価証券

前事業年度(自平成25年4月1日至平成26年3月31日)

(単位:千円)

売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
2,097,321	310,894	454

当事業年度(自平成26年4月1日至平成27年3月31日)

(単位:千円)

売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
3,892,685	893,251	1,091

## (退職給付関係)

## 1.採用している退職給付制度の概要

当社は、確定給付型の制度として、退職一時金制度を設けております。また、確定拠出型の制度として、確定拠出年金制度を設けております。

## 2.確定給付制度

## (1)退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

(単位:千円)

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

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

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

## (2)退職給付債務の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金の調整表

	(単位：千円)	
	前事業年度 (平成26年3月31日)	当事業年度 (平成27年3月31日)
非積立型制度の退職給付債務	1,802,340	2,633,080
未認識数理計算上の差異	-	-
未認識過去勤務費用	-	-
退職給付引当金	1,802,340	2,633,080

## (3)退職給付費用及びその内訳項目の金額

	(単位：千円)	
	前事業年度 (自平成25年4月1日 至平成26年3月31日)	当事業年度 (自平成26年4月1日 至平成27年3月31日)
勤務費用	184,549	217,881
利息費用	25,192	18,161
数理計算上の差異の費用処理額	21,670	276
過去勤務費用の費用処理額	27,157	-
その他	114,773	152,031
確定給付制度に係る 退職給付費用	330,002	387,799

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

## (4)数理計算上の計算基礎に関する事項

主要な数理計算上の計算基礎（加重平均で表わしております。）

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

## 3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、前事業年度43,539千円、当事業年度105,357千円でありませ

## (税効果会計関係)

### 1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

	(単位：千円)	
	前事業年度 (平成26年3月31日)	当事業年度 (平成27年3月31日)
流動の部		
繰延税金資産		
未払金	-	321,602

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

2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間に重要な差異があるときの、当該差異の原因となった主要な項目別の内訳

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

3. 法人税等の税率の変更による繰延税金資産及び繰延税金負債の金額の修正

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

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

## (セグメント情報等)

前事業年度(自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)

## 1. セグメント情報

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

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

## 2. 関連情報

## (1) 製品及びサービスごとの情報

(単位：千円)

	委託者報酬	運用受託報酬	投資助言報酬	その他	合計
外部顧客への売上高	30,300,842	3,773,696	2,117,669	112,914	36,305,122

## (2) 地域ごとの情報

## 売上高

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

## 有形固定資産

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

## (3) 主要な顧客ごとの情報

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

## 3. 報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

該当事項はありません。

## 4. 報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

該当事項はありません。

## 5. 報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

当社は単一セグメントのため、記載を省略しております。

当事業年度(自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)

## 1. セグメント情報

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

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

## 2. 関連情報

## (1) 製品及びサービスごとの情報

(単位：千円)

	委託者報酬	運用受託報酬	投資助言報酬	その他	合計
外部顧客への売上高	30,094,858	3,862,895	2,106,161	102,874	36,166,790

## (2)地域ごとの情報

## 売上高

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

## 有形固定資産

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

## (3)主要な顧客ごとの情報

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

## 3. 報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

該当事項はありません。

## 4. 報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

該当事項はありません。

## 5. 報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

該当事項はありません。

## (関連当事者情報)

前事業年度(自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)

## 1. 親会社及び主要株主（会社等の場合に限る。）等

(単位：千円)

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金、出資金又は基金	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額	科目	期末残高
その他の関係会社	(株)三井住友銀行	東京都千代田区	1,770,996,505	銀行業	(被所有) % 直接 40	投信の販売委託 役員の兼任	委託販売手数料	3,299,099	未払手数料	257,411
その他の関係会社	住友生命保険(相)	大阪府大阪市中央区	270,000,000	生命保険業	(被所有) % 直接27.5	当社の主要顧客	投資助言報酬	1,127,963	未収投資助言報酬	290,426

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

## 2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

(2) 投信の販売委託については、一般取引条件を基に、協議の上決定しております。

## 2. 子会社及び関連会社等

(単位：千円)

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金、出資金又は基金	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額	科目	期末残高
関連会社	UOB-SM Asset Management Pte. Ltd.	Singapore	3,000,000 (シンガポールドル)	投資運用業	(所有) % 直接50	投信の販売委託 役員の兼任	出資の引受	118,725	-	-

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

## 3. その他の関係会社の子会社等

(単位：千円)

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金、出資金又は基金	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額	科目	期末残高
その他の関係会社の子会社	SMB C日興証券(株)	東京都千代田区	10,000,000	証券業	- %	投信の販売委託 役員の兼任	委託販売手数料	4,037,816	未払手数料	403,591

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

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

(1) 投信の販売委託については、一般取引条件を基に、協議の上決定しております。

当事業年度(自 平成26年 4月 1日 至 平成27年 3月31日)

1. 親会社及び主要株主(会社等の場合に限る。)等

(単位: 千円)

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金、出資金又は基金	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額	科目	期末残高
その他の関係会社	(株)三井住友銀行	東京都千代田区	1,770,996,505	銀行業	(被所有) % 直接 40	投信の販売委託 役員の兼任	委託販売手数料	2,527,962	未払手数料	289,954
その他の関係会社	住友生命保険(相)	大阪府大阪市中央区	270,000,000	生命保険業	(被所有) % 直接27.5	当社の主要顧客	投資助言報酬	1,072,459	未収投資助言報酬	286,990

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

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

(2) 投信の販売委託については、一般取引条件を基に、協議の上決定しております。

2. 子会社及び関連会社等

(単位: 千円)

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金、出資金又は基金	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額	科目	期末残高
子会社	ソーラーエナジー投資合同会社	東京都港区	20,000	投資運用業	(所有) % 直接100	投資事業有限責任組合の運営及び管理	出資の引受	20,000	-	-
関連会社	UOB-SM Asset Management Pte. Ltd.	Singapore	6,000,000 (シンガポールドル)	投資運用業	(所有) % 直接50	投信の販売委託 役員の兼任	増資の引受	136,110	-	-

(注) 1. ソーラーエナジー投資合同会社の出資の引受は、新規法人設立のため行ったものであります。

2. UOB-SM Asset Management Pte. Ltd.の増資の引受については、当社とUOBアセットマネジメント社がそれぞれ1,500,000(シンガポールドル)出資しました。

3. その他の関係会社の子会社等

(単位: 千円)

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金、出資金又は基金	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額	科目	期末残高
その他の関係会社の子会社	SMB C日興証券(株)	東京都千代田区	10,000,000	証券業	- %	投信の販売委託 役員の兼任	委託販売手数料	4,705,879	未払手数料	697,658

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

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

(1) 投信の販売委託については、一般取引条件を基に、協議の上決定しております。

(1株当たり情報)

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

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

2. 「会計方針の変更に関する注記」に記載のとおり、退職給付会計基準等を適用し、退職給付会計基準第37項に定める経過的な取扱いに従っております。この結果、当事業年度の期首の1

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

3. 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	前事業年度 (自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)	当事業年度 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)
1株当たり当期純利益金額		
当期純利益(千円)	3,373,226	1,925,499
普通株主に帰属しない金額 (千円)	-	-
普通株式に係る当期純利益金額 (千円)	3,373,226	1,925,499
期中平均株式数(株)	17,640	17,640

(重要な後発事象)

#### 1. 日興グローバルラップ株式会社の株式の取得(子会社化)について

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

##### (1) 株式取得の目的

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

##### (2) 取得する会社の概要(平成26年3月末現在)

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

##### (3) 株式取得日

平成27年4月1日

##### (4) 取得する株式の数、取得価額及び取得後の持株比率

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

##### (5) 支払資金の調達方法

自己資金によります。

中間財務諸表

#### (1) 中間貸借対照表

(単位：千円)

第31期中間会計期間  
(平成27年9月30日)

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



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

## (2)中間損益計算書

(単位：千円)

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

## (3)中間株主資本等変動計算書

第31期中間会計期間（自 平成27年4月1日 至 平成27年9月30日）

(単位：千円)

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

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

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

## 注記事項

### （重要な会計方針）

#### 1．資産の評価基準及び評価方法

##### (1)有価証券

満期保有目的の債券

償却原価法

子会社株式及び関連会社株式

移動平均法による原価法

その他有価証券

時価のあるもの

中間会計期間末日の市場価格等に基づく時価法

（評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定）

時価のないもの

移動平均法による原価法

#### 2．固定資産の減価償却の方法

##### (1)有形固定資産

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

なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。

建物 3～50年

器具備品 3～20年

##### (2)無形固定資産

定額法によっております。

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

#### 3．引当金の計上基準

##### (1)賞与引当金

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

ます。

## (2)退職給付引当金

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

退職給付見込額の期間帰属方法

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

数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法

過去勤務費用については、その発生時において一時に費用処理しております。

数理計算上の差異については、その発生時において一時に費用処理しております。

## 4. その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項

### 消費税等の会計処理

消費税等の会計処理は税抜方式によっております。

### (中間貸借対照表関係)

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

### (中間損益計算書関係)

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

### (中間株主資本等変動計算書関係)

第31期中間会計期間(自平成27年4月1日 至 平成27年9月30日)

#### 1.発行済株式数に関する事項

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

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

## 2. 剰余金の配当に関する事項

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

## (リース取引関係)

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

## (金融商品関係)

## 1. 金融商品の時価等に関する事項

第31期中間会計期間(平成27年9月30日)

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

(単位：千円)

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

## (注1) 金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

## 資 産

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

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

- (6)投資有価証券

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

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

(7) 投資その他の資産

長期差入保証金

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

負債

(1) 顧客からの預り金、及び(2) 未払金 未払手数料

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

(注2) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

(単位：千円)

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

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

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

(有価証券関係)

第31期中間会計期間(平成27年9月30日)

1. 満期保有目的の債券

該当事項はありません。

2. 子会社株式及び関連会社株式

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

3. その他有価証券

(単位：千円)

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

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

## （デリバティブ取引関係）

当社は、デリバティブ取引を全く行っておりませんので、該当事項はありません。

## （資産除去債務等）

該当事項はありません。

## （セグメント情報等）

第31期中間会計期間（自 平成27年4月1日 至 平成27年9月30日）

## 1. セグメント情報

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

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

## 2. 関連情報

## (1) 製品及びサービスごとの情報

（単位：千円）

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

## (2) 地域ごとの情報

## 売上高

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

## 有形固定資産

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

## (3) 主要な顧客ごとの情報

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

## 3. 報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

該当事項はありません。

## 4. 報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

該当事項はありません。

## 5. 報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

該当事項はありません。

## （1株当たり情報）

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

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

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

(注) 1株当たり純資産額の算定上の基礎

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

1株当たり中間純利益の算定上の基礎

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

(重要な後発事象)

該当事項はありません。

4【利害関係人との取引制限】

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

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

5【その他】

- イ 定款の変更、その他の重要事項  
該当ありません。

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

## 第2【その他の関係法人の概況】

### 1【名称、資本金の額及び事業の内容】

#### イ 受託会社

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

#### 〔参考情報：再信託受託会社の概要〕

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

#### ロ 販売会社

(イ) 名称	(ロ) 資本金の額	(ハ) 事業の内容
S M B C 日興証券株式会社	10,000百万円	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 S B I 証券	47,937百万円	
カブドットコム証券株式会社	7,196百万円	
損保ジャパン日本興亜 D C 証券株式会社	3,000百万円	
東海東京証券株式会社	6,000百万円	
マネックス証券株式会社	12,200百万円	
楽天証券株式会社	7,495百万円	
株式会社みずほ銀行	1,404,065百万円	銀行法に基づき、銀行業を営んでいます。
株式会社三井住友銀行	1,770,996百万円	
住友生命保険相互会社	639,000百万円	保険業法に基づき、生命保険業を営んでいます。
三井生命保険株式会社	167,280百万円	

資本金の額は、平成27年9月末現在。

住友生命保険相互会社の資本金の額は、平成27年9月末現在の基金および基金償却積立金の合計額を記載しております。

### 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】

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

販売会社である住友生命保険相互会社は、委託会社株式を4,851株（持株比率27.5%）保有しています。



販売会社である三井生命保険株式会社は、委託会社株式を882株（持株比率5.0%）保有しています。

### 第3【その他】

- 1．目論見書の表紙にロゴ・マーク、図案およびキャッチコピーを採用すること、ファンドの形態および属性、申込みにかかる事項、ユニバーサルデザインフォントマーク、委託会社の金融商品取引業者登録番号、当該目論見書の使用開始日などを記載することがあります。
- 2．目論見書は、目論見書の別称として「投資信託説明書（交付目論見書）」または「投資信託説明書（請求目論見書）」と称して使用することがあります。
- 3．目論見書に当ファンドの信託約款を掲載すること、および投資信託の財産は受託会社において信託法に基づき分別管理されている旨を記載することがあります。
- 4．目論見書は、電子媒体等として使用されるほか、インターネット等に掲載されることがあります。
- 5．有価証券届出書の表紙記載情報を抜粋して、目論見書に記載することがあります。
- 6．目論見書の冒頭または巻末に届出書記載内容に関連する用語集を掲載することがあります。
- 7．評価機関等から当ファンドに対する評価を取得し、使用することがあります。
- 8．有価証券届出書を個別に提出している複数のファンドの実質的な投資対象資産に共通性がある場合には、当該複数のファンドを一つの投資信託説明書（交付目論見書）で説明することがあります。このため、有価証券届出書に他のファンドの情報を合わせて記載することがあります。
- 9．当ファンドとスイッチング対象ファンドにかかる投資信託説明書（交付目論見書）を一体のものとして使用することがあります。

**独立監査人の監査報告書**

平成27年 6月15日

三井住友アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

## 有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員

業務執行社員

公認会計士 鈴木 敏 夫 印

指定有限責任社員

業務執行社員

公認会計士 池 ヶ 谷 正 印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている三井住友アセットマネジメント株式会社の平成26年4月1日から平成27年3月31日までの第30期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

## 財務諸表に対する経営者の責任

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

## 監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。

当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

## 監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三井住友アセットマネジメント株式会社の平成27年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

## 強調事項

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

当該事項は、当監査法人の意見に影響を及ぼすものではない。

## 利害関係

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

以 上

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

## 独立監査人の監査報告書

平成28年3月29日

三井住友アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員  
業務執行社員

公認会計士

小澤 陽 一 印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている三井住友・DC年金バランス30（債券重点型）の平成27年2月19日から平成28年2月18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年金バランス30（債券重点型）の平成28年2月18日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

### 利害関係

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

以 上

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

## 独立監査人の監査報告書

平成28年3月29日

三井住友アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員  
業務執行社員

公認会計士 小澤 陽一 印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている三井住友・DC年金バランス50（標準型）の平成27年2月19日から平成28年2月18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年金バランス50（標準型）の平成28年2月18日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

### 利害関係

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

以上

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

## 独立監査人の監査報告書

平成28年3月29日

三井住友アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員  
業務執行社員

公認会計士 小澤 陽一 印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている三井住友・DC年金バランス70（株式重点型）の平成27年2月19日から平成28年2月18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年金バランス70（株式重点型）の平成28年2月18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27年11月25日

三井住友アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

## 有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員

業務執行社員

指定有限責任社員

業務執行社員

公認会計士 小澤 陽 一 印

公認会計士 池ヶ谷 正 印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている三井住友アセットマネジメント株式会社の平成27年4月1日から平成28年3月31日までの第31期事業年度の中間会計期間（平成27年4月1日から平成27年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

## 中間財務諸表に対する経営者の責任

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

## 監査人の責任

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

中間監査においては、中間財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するために年度監査と比べて監査手続の一部を省略した中間監査手続が実施される。中間監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。中間監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。また、中間監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め中間財務諸表の表示を検討することが含まれる。

当監査法人は、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

## 中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、三井住友アセットマネジメント株式会社の平成27年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（平成27年4月1日から平成27年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

## 利害関係

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

以上

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