

【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	平成29年5月18日提出
【発行者名】	三井住友アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 松下 隆史
【本店の所在の場所】	東京都港区愛宕二丁目5番1号
【事務連絡者氏名】	土田 雅央
【電話番号】	03-5405-0740
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券に係るファンドの名称】	三井住友・DC年金バランス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29年5月19日から平成29年11月16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	http://www.smam-jp.com

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

(5) 【申込手数料】

無手数料です。

(6) 【申込単位】

お申込単位の詳細は、お申込みの販売会社または前記「(4) 発行(売出) 価格」に記載の委託会社にお問い合わせください。

(7) 【申込期間】

平成29年 5月19日から平成29年11月16日まで

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

(8) 【申込取扱場所】

販売会社において申込みを取り扱います。なお、委託会社においても申込みを取り扱いますので、委託会社は販売会社としての役割も有します。

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。

二 振替受益権について

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

（参考：投資信託振替制度）

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

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

（1）【ファンドの目的及び基本的性格】

- イ 当ファンドは、「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實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す。なお、組み入れる資産そのものは投資信託証券ですが、投資信託証券の先の実質投資対象は株式および債券であり、ファンドの収益は株式市場、債券市場の動向に左右されるものであるため、商品分類上の投資対象資産（収益の源泉）は「資産複合」となります。
決算頻度	年1回	目論見書または信託約款において、年1回決算する旨の記載があるものをいいます。
投資対象地域	グローバル（日本を含む）	目論見書または信託約款において、組入資産による投資収益が日本を含む世界の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
投資形態	ファミリーファンド	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	国内	株式	インデックス型
	海外	債券	
追加型		不動産投信	特殊型
	内外	その他資産 () 資産複合	

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

属性区分表

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	為替ヘッジ	対象インデックス
株式	年1回	グローバル			
一般		(日本を含む)			
大型株	年2回	日本			日経225
中小型株	年4回	北米			
債券			ファミリーファンド	あり	
一般	年6回(隔月)	欧州			
公債					
社債	年12回(毎月)	アジア			
その他債券					
クレジット属性 ()	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	なし	
その他資産 (投資信託証券 (資産複合(株式、債券)資産配 分固定型))		中近東(中東)			その他 (合成指数)
資産複合 ()		エマージング			
資産配分固 定型					
資産配分変 更型					

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

属性区分の「為替ヘッジ」は、対円で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。

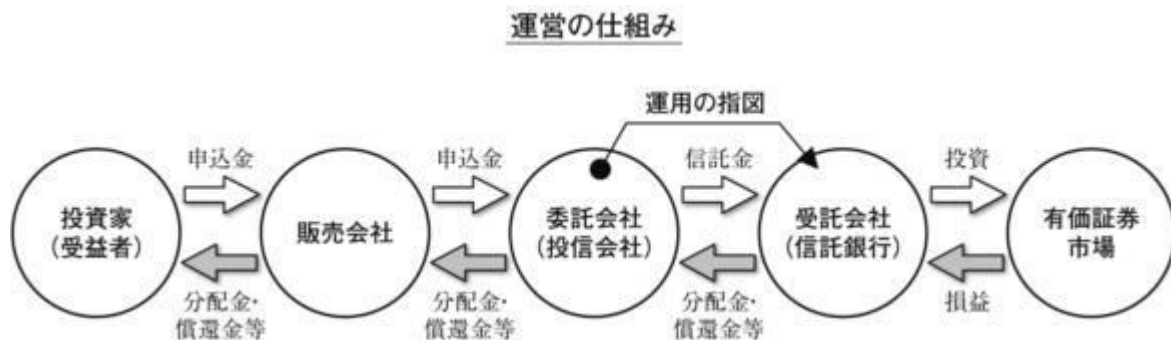
(ロ) 受託会社 「三井住友信託銀行株式会社」

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

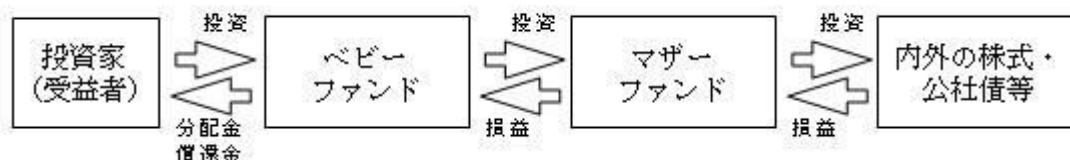
委託会社との間で締結される販売契約（名称の如何を問いません。）に基づき、当ファンドの募集・販売の取扱い、投資信託説明書（目論見書）の提供、受益者からの一部解約実行請求の受付、受益者への収益分配金、一部解約金および償還金の支払事務等を行います。

委託会社は販売会社としての役割も有します。



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29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29年 3月31日現在)

名称	住所	所有 株式数	比率 (%)
株式会社三井住友フィナンシャルグループ	東京都千代田区丸の内一丁目1番2号	10,584	60.0
住友生命保険相互会社	大阪府大阪市中央区城見一丁目4番35号	3,528	20.0
三井住友海上火災保険株式会社	東京都千代田区神田駿河台三丁目9番地	3,528	20.0

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%

(ハ) 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。

(ニ) 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

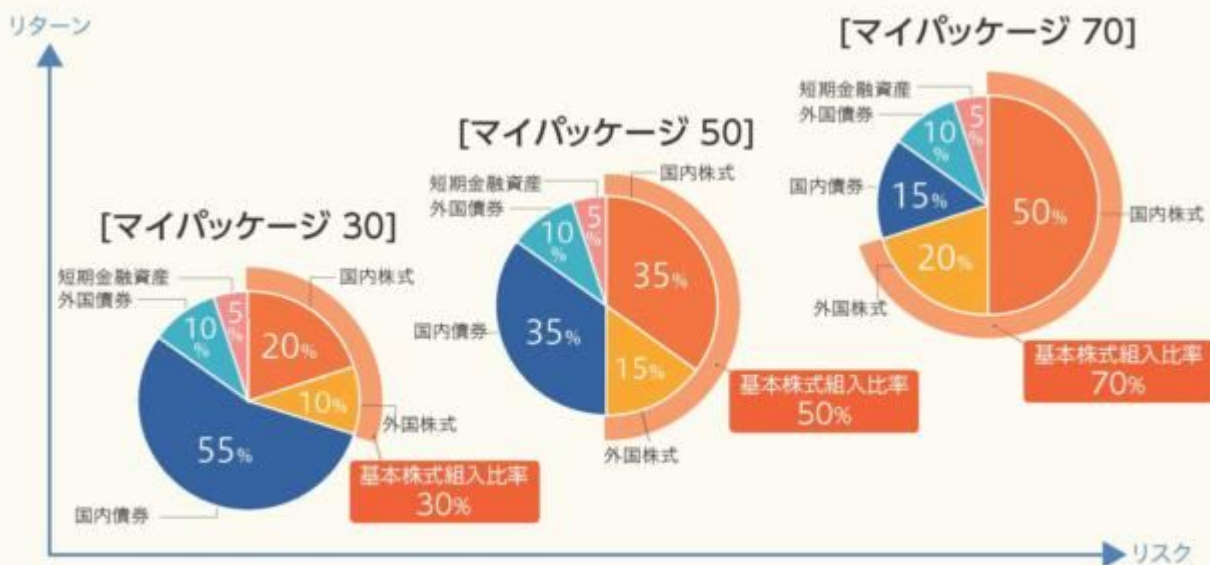
内外の株式・公社債に投資する4つのマザーファンドの組入れを通じて、わが国を含む世界各国の株式、公社債に分散投資することにより、信託財産の着実な成長を目指した運用を行います。

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。

□ 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]

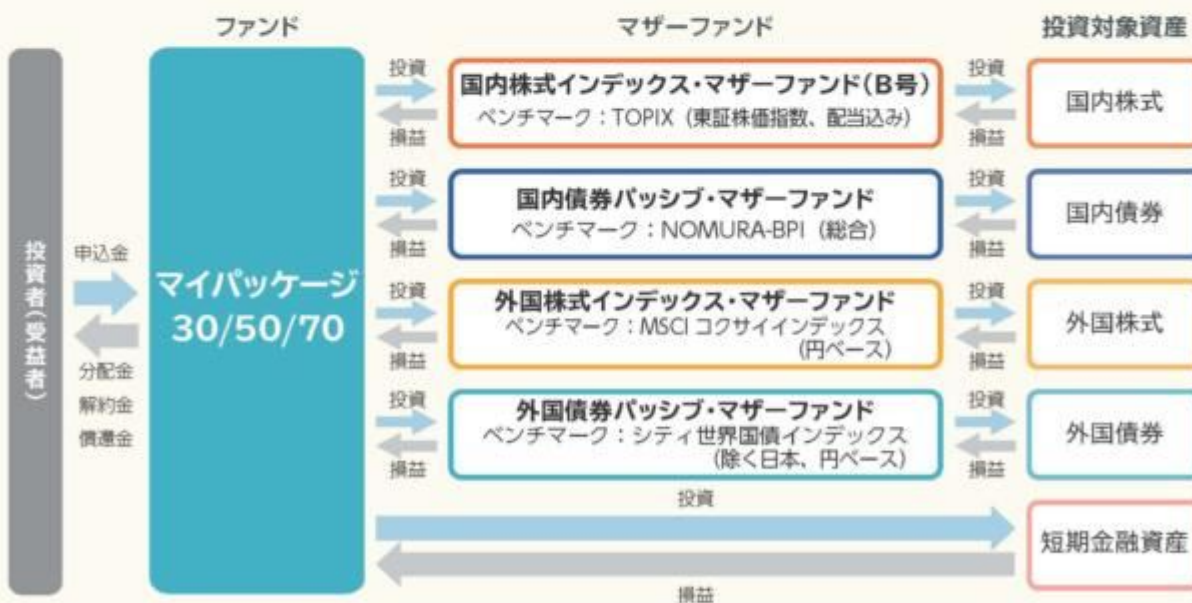
	マイパッケージ30	マイパッケージ50	マイパッケージ70
TOPIX(東証株価指数、配当込み)	20%	35%	50%
NOMURA-BPI(総合)	55%	35%	15%
MSCIコクサイインデックス(円ベース)	10%	15%	20%
シティ世界国債インデックス(除く日本、円ベース)	10%	10%	10%
有担保コール翌日物	5%	5%	5%

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信売買相場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。

ベンチマークの推移

- ・以下のグラフは、ファンドのベンチマーク(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、ベンチマークの推移と国内外の主要な出来事を合わせ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。



※データは1997年3月末～2017年3月末。1997年3月末を100として指数化。

※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。

※ベンチマークである合成指数のデータは、当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、委託会社が独自に計算したものであり、ベンチマークを構成する各指数の著作権、知的所有権、その他一切の権利は発行者、許諾者が有しています。これら発行者、許諾者は当ファンドの運営に何ら関与するものではなく、当ファンドの運用成果に対して一切の責任を負うものではありません。

ベンチマークの詳細は、前掲「ファンドの特色 3」をご覧ください。

(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

口 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。

八 投資対象とする金融商品

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

- 1．預金
- 2．指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
- 3．コール・ローン
- 4．手形割引市場において売買される手形
- 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。

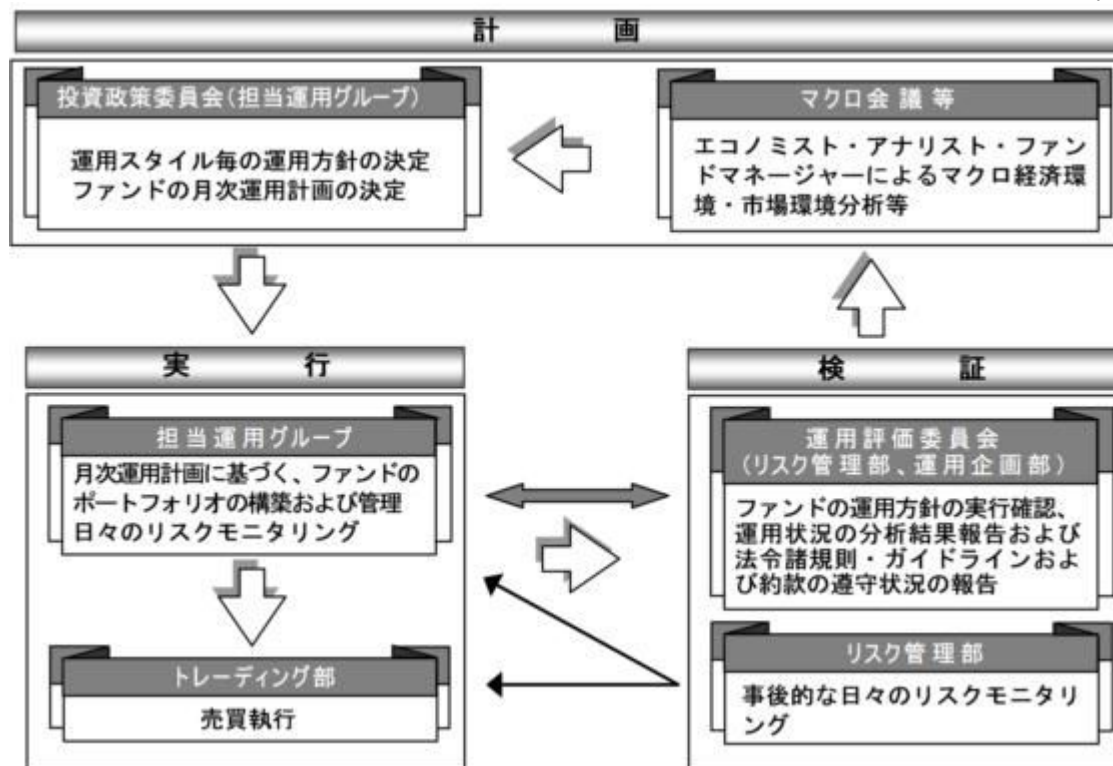
売買執行については、組織的に分離されたトレーディング部が、最良と思われる手法をもって売買を執行します。

（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12名程度、運用企画部は8名程度で構成されています。

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

ロ 委託会社によるファンドの関係法人（販売会社を除く）に対する管理体制

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

（４）【分配方針】

毎決算時（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、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。）。

- ロ 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。

ロ 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るときは、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るときは、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。

(八) 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。
- (ハ) 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。
- (ニ) 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

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

(ト) 指数と連動しない要因

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出入が生じた場合、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

「ファンドの年間騰落率および 分配金再投資基準価額の推移」

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

■マイパッケージ30



「ファンドと他の代表的な 資産クラスとの騰落率の比較」

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



■マイパッケージ50



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

※分配実績がない場合は、分配金再投資基準価額は基準価額と同じです。

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

※すべての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。

【ファンドの年間騰落率および 分配金再投資基準価額の推移】

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

■マイパッケージ70



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

※分配実績がない場合は、分配金再投資基準価額は基準価額と同じです。

【ファンドと他の代表的な 資産クラスとの騰落率の比較】

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



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

※すべての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。

日本株	TOPIX(配当込み) 株式会社東京証券取引所が算出、公表する指数で、東京証券取引所第一部に上場している内国普通株式全銘柄を対象としています。
先進国株	MSCIコクサイインデックス(グロス配当込み、円ベース) MSCI Inc.が開発した指数で、日本を除く世界の主要先進国の株式を対象としています。
新興国株	MSCIエマージング・マーケット・インデックス(グロス配当込み、円ベース) MSCI Inc.が開発した指数で、新興国の株式を対象としています。
日本国債	NOMURA-BPI(国債) 野村證券株式会社が公表する指数で、国内で発行された公募固定利付国債を対象としています。
先進国債	シティ世界国債インデックス(除く日本、円ベース) Citigroup Index LLCが開発した指数で、日本を除く世界の主要国の国債を対象としています。
新興国債	JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ダイバーシファイド(円ベース) J.P. Morganが算出、公表する指数で、新興国が発行する現地通貨建て国債を対象としています。

※海外の指数は、為替ヘッジなしによる投資を想定して、円ベースとしています。

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

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

無手数料です。

(2) 【換金（解約）手数料】

解約手数料はありません。

(3) 【信託報酬等】

純資産総額に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。

委託会社が販売会社として募集の取扱い等をした部分については、販売会社配分相当額も委託会社が収受します。

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。

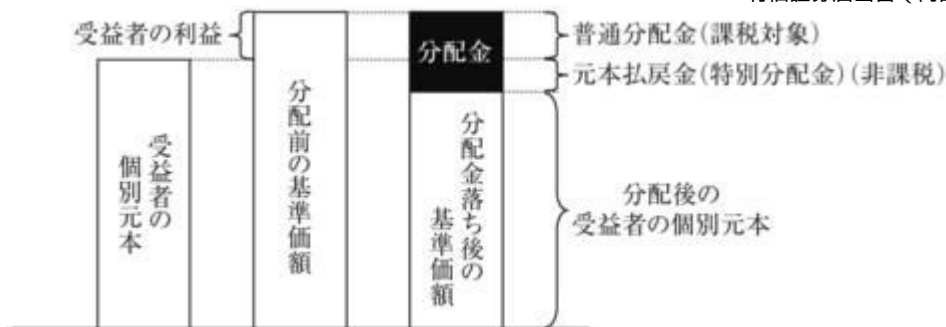
ハ 収益分配金の課税について

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。

< 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29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29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	6,411,001,560	95.04
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		334,724,141	4.96
合計(純資産総額)		6,745,725,701	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29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	17,513,191,044	95.18
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		887,832,323	4.82
合計(純資産総額)		18,401,023,367	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	8,821,333,490	95.05
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		459,146,085	4.95
合計(純資産総額)		9,280,479,575	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29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	2,959,355,862	1.2445	3,682,985,468	1.2502	3,699,786,698	54.85
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）	591,032,285	2.3060	1,362,945,337	2.2749	1,344,539,345	19.93
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	228,692,349	2.9774	680,928,702	3.0077	687,837,978	10.20
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	408,028,815	1.6618	678,090,441	1.6637	678,837,539	10.06

以上が、当ファンドが保有する有価証券のすべてです。

ロ 種類別の投資比率

平成29年 3月31日現在

種類	投資比率 (%)
親投資信託受益証券	95.04
合計	95.04

三井住友・DC年金バランス50（標準型）

イ 主要投資銘柄

平成29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	5,142,198,508	1.2446	6,400,275,411	1.2502	6,428,776,574	34.94
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）	2,820,912,158	2.3059	6,504,950,966	2.2749	6,417,293,068	34.87

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	935,783,173	2.9775	2,786,325,475	3.0077	2,814,555,049	15.30
日本	親投資信託受益証券	外国債券パッシブ・マザーファンド	1,113,521,881	1.6618	1,850,541,444	1.6637	1,852,566,353	10.07

以上が、当ファンドが保有する有価証券のすべてです。

ロ 種類別の投資比率

平成29年 3月31日現在

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	95.18
合計	95.18

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29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)	2,026,422,376	2.3058	4,672,526,430	2.2749	4,609,908,263	49.67
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	626,931,717	2.9776	1,866,781,802	3.0077	1,885,622,525	20.32
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	1,117,776,371	1.2446	1,391,222,489	1.2502	1,397,444,019	15.06
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	558,008,465	1.6619	927,378,112	1.6637	928,358,683	10.00

以上が、当ファンドが保有する有価証券のすべてです。

ロ 種類別の投資比率

平成29年 3月31日現在

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	95.05
合計	95.05

【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
第12期 (平成29年 2月20日)	6,522,850,554	6,522,850,554	13,891	13,891
平成28年 3月末日	5,175,285,504		13,479	
4月末日	5,217,232,980		13,479	
5月末日	5,371,208,239		13,610	
6月末日	5,308,916,262		13,235	
7月末日	5,446,444,973		13,429	
8月末日	5,486,436,715		13,356	
9月末日	5,570,897,957		13,310	

10月末日	5,808,677,052		13,457	
11月末日	6,006,462,720		13,735	
12月末日	6,237,442,793		13,924	
平成29年 1月末日	6,441,771,019		13,847	
2月末日	6,545,683,120		13,916	
3月末日	6,745,725,701		13,901	

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
第12期（平成29年 2月20日）	17,864,219,936	17,864,219,936	14,480	14,480
平成28年 3月末日	14,693,404,210		13,610	
4月末日	14,713,579,912		13,572	
5月末日	15,180,563,886		13,764	
6月末日	14,608,309,667		13,076	
7月末日	15,230,025,534		13,456	
8月末日	15,308,604,407		13,418	
9月末日	15,476,210,285		13,361	
10月末日	16,093,792,890		13,637	
11月末日	16,851,761,759		14,111	
12月末日	17,563,360,501		14,437	
平成29年 1月末日	17,695,406,812		14,377	
2月末日	17,875,398,066		14,473	
3月末日	18,401,023,367		14,454	

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
第12期	(平成29年 2月20日)	9,067,400,207	9,067,400,207	14,788	14,788
	平成28年 3月末日	7,421,027,960		13,472	
	4月末日	7,421,756,923		13,398	
	5月末日	7,673,256,110		13,645	
	6月末日	7,198,790,101		12,667	
	7月末日	7,626,423,796		13,217	
	8月末日	7,732,846,722		13,214	
	9月末日	7,785,661,971		13,147	
	10月末日	8,125,190,541		13,543	
	11月末日	8,539,823,211		14,207	
	12月末日	8,969,664,014		14,667	
	平成29年 1月末日	8,970,058,278		14,624	
	2月末日	9,053,442,797		14,748	
	3月末日	9,280,479,575		14,726	

【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
第12期	平成28年 2月19日～平成29年 2月20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
第12期	平成28年 2月19日～平成29年 2月20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
第12期	平成28年 2月19日～平成29年 2月20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
第12期	5.6

(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
第12期	9.6

(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
第12期	13.6

(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
第12期	1,313,785,041	390,304,402

(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
第12期	2,542,481,389	811,014,755

(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
第12期	1,323,647,752	589,291,932

（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29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	198,255,428,008	97.43
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		5,230,992,316	2.57
合計(純資産総額)		203,486,420,324	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	5,021,500,000	2.46
合計	買建		5,021,500,000	2.46

国内債券パッシブ・マザーファンド

平成29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	162,821,907,090	74.45
地方債証券	日本	17,598,565,978	8.05
特殊債券	日本	27,370,081,985	12.51
社債券	日本	8,999,370,000	4.11
	オランダ	501,887,000	0.23
	アメリカ	200,778,000	0.09
	オーストラリア	200,528,000	0.09
	小計	9,902,563,000	4.53
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1,008,133,138	0.46

合計(純資産総額)	218,701,251,191	100.00
-----------	-----------------	--------

外国株式インデックス・マザーファンド

平成29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	121,496,439,578	58.76
	イギリス	13,652,442,109	6.60
	カナダ	7,977,607,762	3.86
	スイス	7,653,951,347	3.70
	ドイツ	7,568,099,048	3.66
	フランス	7,361,553,680	3.56
	オーストラリア	5,327,419,852	2.58
	オランダ	3,755,185,946	1.82
	アイルランド	3,195,281,144	1.55
	スペイン	2,684,347,663	1.30
	スウェーデン	2,291,998,204	1.11
	香港	1,919,815,142	0.93
	シンガポール	1,529,293,827	0.74
	イタリア	1,471,523,195	0.71
	デンマーク	1,310,067,202	0.63
	ジャージー	1,235,447,974	0.60
	バミューダ	978,665,889	0.47
	ベルギー	930,280,545	0.45
	フィンランド	771,533,633	0.37
	キュラソー	665,008,020	0.32
	ノルウェー	510,405,401	0.25
	ケイマン諸島	483,602,975	0.23
	イスラエル	476,317,214	0.23
	ルクセンブルグ	277,511,951	0.13
オーストリア	164,400,173	0.08	
ニュージーランド	133,207,621	0.06	
ポルトガル	122,686,595	0.06	
リベリア	107,437,239	0.05	

	パプアニューギニア	49,250,260	0.02
	英ヴァージン諸島	41,661,540	0.02
	マン島	28,803,766	0.01
	モーリシャス	10,927,637	0.01
	小計	196,182,174,132	94.89
投資証券	アメリカ	3,561,840,135	1.72
	オーストラリア	763,384,511	0.37
	フランス	260,750,998	0.13
	イギリス	199,158,161	0.10
	香港	127,669,671	0.06
	シンガポール	98,743,251	0.05
	カナダ	44,225,611	0.02
	小計	5,055,772,338	2.45
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		5,513,642,513	2.66
合計(純資産総額)		206,751,588,983	100.00

その他以下の取引を行っております。

種類	買建/ 売建	国/地域	時価合計(円)	投資 比率 (%)
株価指数先物取引	買建	アメリカ	3,621,133,070	1.75
	買建	ドイツ	956,132,634	0.46
	買建	イギリス	378,356,080	0.18
	買建	オーストラリア	277,606,560	0.13
合計	買建		5,233,228,344	2.52

種類	買建/ 売建	国/地域	時価合計(円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	売建		241,293,800	0.11

外国債券パッシブ・マザーファンド

平成29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	92,892,072,989	44.02
	フランス	20,423,208,122	9.68
	イタリア	19,123,188,524	9.06
	イギリス	15,181,773,914	7.20
	ドイツ	14,713,545,993	6.97
	スペイン	11,261,291,393	5.34
	ベルギー	5,318,407,430	2.52
	オランダ	4,716,837,623	2.24
	オーストラリア	4,464,890,429	2.12
	カナダ	4,423,580,329	2.10
	オーストリア	2,922,205,298	1.38
	メキシコ	1,846,265,354	0.87
	アイルランド	1,678,557,962	0.80
	ポーランド	1,358,747,200	0.64
	デンマーク	1,299,015,620	0.62
	フィンランド	1,273,297,264	0.60
	南アフリカ	1,117,917,592	0.53
	スウェーデン	980,000,635	0.46
	シンガポール	806,639,370	0.38
	マレーシア	667,711,048	0.32
ノルウェー	573,427,346	0.27	
スイス	417,520,147	0.20	
	小計	207,460,101,582	98.32
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		3,543,818,347	1.68
合計(純資産総額)		211,003,919,929	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29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	1,093,300	6,657.77	7,278,939,941	6,042.00	6,605,718,600	3.25
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	6,724,500	672.94	4,525,185,030	699.70	4,705,132,650	2.31
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	712,700	4,649.69	3,313,834,063	4,752.00	3,386,750,400	1.66

日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	399,600	6,810.26	2,721,379,896	7,862.00	3,141,655,200	1.54
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	710,800	4,221.96	3,000,969,168	4,045.00	2,875,186,000	1.41
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	808,600	3,336.82	2,698,152,652	3,351.00	2,709,618,600	1.33
日本	株式	KDDI	情報・通信業	878,300	3,002.19	2,636,823,477	2,922.00	2,566,392,600	1.26
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	12,044,400	203.06	2,445,735,864	204.00	2,457,057,600	1.21
日本	株式	ソニー	電気機器	634,800	3,297.82	2,093,456,136	3,766.00	2,390,656,800	1.17
日本	株式	ファナック	電気機器	91,200	19,363.02	1,765,907,424	22,820.00	2,081,184,000	1.02
日本	株式	日本たばこ産業	食料品	558,400	3,938.50	2,199,258,400	3,618.00	2,020,291,200	0.99
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	352,800	4,696.37	1,656,879,336	5,229.00	1,844,791,200	0.91
日本	株式	キーエンス	電気機器	40,800	39,257.73	1,601,715,384	44,580.00	1,818,864,000	0.89
日本	株式	NTTドコモ	情報・通信業	663,500	2,630.15	1,745,104,525	2,592.50	1,720,123,750	0.85
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	359,500	4,889.20	1,757,667,400	4,696.00	1,688,212,000	0.83
日本	株式	東日本旅客鉄道	陸運業	173,800	9,802.42	1,703,660,596	9,694.00	1,684,817,200	0.83
日本	株式	キャノン	電気機器	483,800	3,262.91	1,578,595,858	3,471.00	1,679,269,800	0.83
日本	株式	信越化学工業	化学	168,800	8,514.34	1,437,220,592	9,644.00	1,627,907,200	0.80
日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	371,300	4,445.09	1,650,461,917	4,362.00	1,619,610,600	0.80
日本	株式	三菱商事	卸売業	666,200	2,474.29	1,648,371,998	2,405.50	1,602,544,100	0.79
日本	株式	三菱電機	電気機器	959,200	1,579.37	1,514,931,704	1,597.00	1,531,842,400	0.75
日本	株式	村田製作所	電気機器	94,300	15,392.72	1,451,533,496	15,835.00	1,493,240,500	0.73
日本	株式	花王	化学	239,200	5,276.37	1,262,107,704	6,104.00	1,460,076,800	0.72
日本	株式	任天堂	その他製品	55,400	27,540.61	1,525,749,794	25,835.00	1,431,259,000	0.70
日本	株式	ブリヂストン	ゴム製品	317,500	4,353.81	1,382,334,675	4,503.00	1,429,702,500	0.70
日本	株式	アステラス製薬	医薬品	961,600	1,581.18	1,520,462,688	1,466.00	1,409,705,600	0.69
日本	株式	ダイキン工業	機械	122,600	10,740.85	1,316,828,210	11,185.00	1,371,281,000	0.67
日本	株式	東海旅客鉄道	陸運業	74,700	18,720.25	1,398,402,675	18,140.00	1,355,058,000	0.67
日本	株式	三菱地所	不動産業	660,000	2,305.43	1,521,583,800	2,030.00	1,339,800,000	0.66
日本	株式	日立製作所	電気機器	2,159,000	611.74	1,320,746,660	602.50	1,300,797,500	0.64

□ 種別・業種別の投資比率

平成29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	0.11
		鉱業	0.33
		建設業	2.88
		食料品	4.42
		繊維製品	0.70
		パルプ・紙	0.25
		化学	6.68
		医薬品	4.63
		石油・石炭製品	0.56

ゴム製品	0.96
ガラス・土石製品	0.98
鉄鋼	1.24
非鉄金属	0.95
金属製品	0.70
機械	5.06
電気機器	12.63
輸送用機器	8.90
精密機器	1.55
その他製品	1.78
電気・ガス業	1.78
陸運業	4.01
海運業	0.24
空運業	0.56
倉庫・運輸関連業	0.19
情報・通信業	7.57
卸売業	4.37
小売業	4.53
銀行業	7.92
証券、商品先物取引業	1.17
保険業	2.57
その他金融業	1.19
不動産業	2.32
サービス業	3.67
合計	97.43

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29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310回利付国債(10年)	3,080,000,000	105.31	3,243,794,400	104.02	3,203,846,800	1.000	2020/9/20	1.46
日本	国債証券	第329回利付国債(10年)	2,675,000,000	107.16	2,866,748,000	105.52	2,822,793,750	0.800	2023/6/20	1.29
日本	国債証券	第128回利付国債(5年)	2,605,000,000	101.45	2,642,948,500	101.03	2,632,039,900	0.100	2021/6/20	1.20
日本	国債証券	第344回利付国債(10年)	2,386,000,000	101.05	2,411,053,000	100.51	2,398,359,480	0.100	2026/9/20	1.10
日本	国債証券	第305回利付国債(10年)	2,270,000,000	105.48	2,394,396,000	104.04	2,361,889,600	1.300	2019/12/20	1.08
日本	国債証券	第124回利付国債(5年)	2,340,000,000	101.27	2,369,856,000	100.87	2,360,381,400	0.100	2020/6/20	1.08
日本	国債証券	第312回利付国債(10年)	2,145,000,000	106.55	2,285,518,950	105.02	2,252,679,000	1.200	2020/12/20	1.03

日本	国債証券	第313回利付国債（10年）	2,105,000,000	107.36	2,260,117,450	105.77	2,226,542,700	1.300	2021/3/20	1.02
日本	国債証券	第123回利付国債（5年）	2,150,000,000	101.26	2,177,090,000	100.83	2,167,888,000	0.100	2020/3/20	0.99
日本	国債証券	第345回利付国債（10年）	2,118,000,000	100.39	2,126,297,640	100.43	2,127,192,120	0.100	2026/12/20	0.97
日本	国債証券	第341回利付国債（10年）	2,052,000,000	103.96	2,133,259,200	102.43	2,101,966,200	0.300	2025/12/20	0.96
日本	国債証券	第340回利付国債（10年）	1,900,000,000	104.94	1,993,860,000	103.29	1,962,643,000	0.400	2025/9/20	0.90
日本	国債証券	第339回利付国債（10年）	1,880,000,000	104.91	1,972,308,000	103.28	1,941,739,200	0.400	2025/6/20	0.89
日本	国債証券	第333回利付国債（10年）	1,855,000,000	105.76	1,962,002,850	104.61	1,940,552,600	0.600	2024/3/20	0.89
日本	国債証券	第343回利付国債（10年）	1,925,000,000	102.35	1,970,237,500	100.59	1,936,473,000	0.100	2026/6/20	0.89
日本	国債証券	第315回利付国債（10年）	1,800,000,000	107.27	1,930,860,000	105.67	1,902,168,000	1.200	2021/6/20	0.87
日本	国債証券	第342回利付国債（10年）	1,825,000,000	101.74	1,856,787,000	100.67	1,837,227,500	0.100	2026/3/20	0.84
日本	国債証券	第130回利付国債（5年）	1,800,000,000	101.17	1,821,060,000	101.13	1,820,484,000	0.100	2021/12/20	0.83
日本	国債証券	第306回利付国債（10年）	1,670,000,000	106.27	1,774,725,700	104.68	1,748,222,800	1.400	2020/3/20	0.80
日本	国債証券	第129回利付国債（5年）	1,610,000,000	101.24	1,630,006,700	101.07	1,627,339,700	0.100	2021/9/20	0.74
日本	国債証券	第59回利付国債（20年）	1,455,000,000	112.71	1,640,046,900	110.30	1,604,995,950	1.700	2022/12/20	0.73
日本	国債証券	第125回利付国債（5年）	1,520,000,000	101.41	1,541,432,000	100.90	1,533,756,000	0.100	2020/9/20	0.70
日本	国債証券	第338回利付国債（10年）	1,470,000,000	104.60	1,537,624,500	103.26	1,517,995,500	0.400	2025/3/20	0.69
日本	国債証券	第334回利付国債（10年）	1,440,000,000	105.87	1,524,576,100	104.66	1,507,190,400	0.600	2024/6/20	0.69
日本	国債証券	第335回利付国債（10年）	1,365,000,000	105.56	1,440,996,200	103.96	1,419,108,600	0.500	2024/9/20	0.65
日本	国債証券	第330回利付国債（10年）	1,335,000,000	107.27	1,432,115,950	105.68	1,410,854,700	0.800	2023/9/20	0.65
日本	国債証券	第147回利付国債（20年）	1,175,000,000	122.95	1,444,662,500	118.61	1,393,691,000	1.600	2033/12/20	0.64
日本	国債証券	第325回利付国債（10年）	1,290,000,000	106.08	1,368,523,700	104.97	1,354,138,800	0.800	2022/9/20	0.62
日本	特殊債券	第103回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1,300,000,000	104.27	1,355,592,000	103.93	1,351,142,000	1.300	2020/3/19	0.62
日本	国債証券	第127回利付国債（5年）	1,310,000,000	101.61	1,331,091,000	100.99	1,323,034,500	0.100	2021/3/20	0.60

□ 種類別の投資比率

平成29年 3月31日現在

種類	投資比率（％）
国債証券	74.45
地方債証券	8.05
特殊債券	12.51
社債券	4.53
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29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	293,337	12,707.76	3,727,656,577	16,147.50	4,736,661,173	2.29
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	406,146	6,890.70	2,798,634,222	7,372.00	2,994,110,302	1.45
アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	小売	22,196	86,718.38	1,924,801,216	98,316.58	2,182,234,912	1.06
アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORPORATION	エネルギー	228,310	9,649.46	2,203,068,646	9,390.30	2,143,900,078	1.04
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	149,506	12,668.49	1,894,015,984	13,985.60	2,090,931,921	1.01
アメリカ	株式	FACEBOOK INC-A	ソフトウェア・サービス	128,627	13,714.10	1,764,004,261	15,976.97	2,055,070,736	0.99
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	196,607	8,990.90	1,767,675,174	9,988.27	1,963,764,921	0.95
アメリカ	株式	WELLS FARGO & COMPANY	銀行	262,693	5,882.12	1,545,192,196	6,309.56	1,657,478,716	0.80
アメリカ	株式	GENERAL ELECTRIC CO	資本財	486,743	3,483.49	1,695,568,997	3,351.11	1,631,131,914	0.79
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	ソフトウェア・サービス	17,057	87,336.54	1,489,699,521	93,285.98	1,591,179,046	0.77
アメリカ	株式	AT&T INC	電気通信サービス	338,113	4,470.77	1,511,625,964	4,685.05	1,584,077,798	0.77
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	ソフトウェア・サービス	16,260	89,535.47	1,455,846,796	95,303.16	1,549,629,401	0.75
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	556,366	2,333.55	1,298,308,992	2,677.97	1,489,934,406	0.72
スイス	株式	NESTLE SA-REGISTERED	食品・飲料・タバコ	170,893	7,788.86	1,331,062,507	8,663.01	1,480,447,939	0.72
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	140,778	9,362.25	1,317,999,605	10,119.53	1,424,608,321	0.69
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	334,113	3,585.59	1,197,993,033	3,853.72	1,287,580,122	0.62
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	各種金融	67,424	17,759.67	1,197,428,462	18,776.11	1,265,961,007	0.61
アメリカ	株式	CHEVRON CORPORATION	エネルギー	103,937	12,431.77	1,292,121,284	12,091.83	1,256,789,387	0.61
アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS INC	電気通信サービス	223,737	5,758.71	1,288,437,104	5,504.04	1,231,457,711	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	38,795	25,582.21	992,462,182	28,902.85	1,121,286,182	0.54
アメリカ	株式	HOME DEPOT INC	小売	67,070	14,689.03	985,193,692	16,486.32	1,105,737,516	0.53
アメリカ	株式	COMCAST CORP-CLASS A	メディア	262,450	3,962.55	1,039,971,458	4,208.24	1,104,454,399	0.53
アメリカ	株式	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL INC.	食品・飲料・タバコ	85,415	10,213.77	872,409,814	12,735.80	1,087,829,109	0.53

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	151,803	6,973.73	1,058,633,196	7,118.45	1,080,602,900	0.52
アメリカ	株式	COCA-COLA CO/THE	食品・飲料・タバコ	225,374	4,616.61	1,040,465,778	4,779.29	1,077,128,606	0.52
アメリカ	株式	CITIGROUP INC	銀行	156,286	6,284.88	982,239,350	6,788.61	1,060,965,781	0.51
アメリカ	株式	THE WALT DISNEY CO.	メディア	82,925	11,381.67	943,825,441	12,697.66	1,052,953,804	0.51
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	276,099	3,351.11	925,239,583	3,785.29	1,045,114,949	0.51
アメリカ	株式	INTEL CORP	半導体・半導体製造装置	259,916	3,998.45	1,039,261,546	4,010.79	1,042,469,143	0.50
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	122,948	7,894.21	970,577,429	8,410.85	1,034,097,616	0.50

□ 種類別・業種別の投資比率

平成29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	6.86
		素材	4.85
		資本財	7.10
		商業・専門サービス	0.97
		運輸	1.81
		自動車・自動車部品	1.49
		耐久消費財・アパレル	1.70
		消費者サービス	1.70
		メディア	2.77
		小売	3.79
		食品・生活必需品小売り	1.86
		食品・飲料・タバコ	6.19
		家庭用品・パーソナル用品	1.74
		ヘルスケア機器・サービス	3.81
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	8.36
		銀行	9.22
		各種金融	4.34
		保険	4.12
		不動産	0.77
		ソフトウェア・サービス	8.95
テクノロジー・ハードウェアおよび機器	4.28		
電気通信サービス	2.90		
公益事業	3.21		
半導体・半導体製造装置	2.14		

投資証券		2.45
合計		97.33

外国債券パッシブ・マザーファンド

イ 主要投資銘柄（上位30銘柄）

平成29年 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 2.5	8,000,000	11,276.83	902,146,575	11,396.04	911,683,987	2.500	2024/5/15	0.43
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.375	8,000,000	11,150.02	892,002,150	11,283.85	902,708,788	2.375	2024/8/15	0.43
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.25	8,000,000	11,057.25	884,580,710	11,166.41	893,312,875	2.250	2024/11/15	0.42
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2	8,000,000	10,799.22	863,937,961	10,945.53	875,642,950	2.000	2025/2/15	0.41
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2	8,000,000	10,744.26	859,541,235	10,901.71	872,137,013	2.000	2025/8/15	0.41
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2	8,000,000	10,743.72	859,498,249	10,813.18	865,055,024	2.000	2026/11/15	0.41
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.75	8,000,000	10,357.38	828,590,465	10,666.81	853,345,188	2.750	2042/11/15	0.40
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 1.625	8,000,000	10,378.01	830,241,203	10,524.82	841,985,950	1.625	2026/2/15	0.40
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2	7,500,000	11,050.57	828,792,935	11,138.36	835,377,258	2.000	2023/2/15	0.40
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.25	7,500,000	10,972.84	822,963,013	11,099.79	832,484,859	2.250	2025/11/15	0.39
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 1.5	8,000,000	10,217.06	817,365,086	10,358.29	828,663,388	1.500	2026/8/15	0.39
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.75	7,000,000	11,514.44	806,010,897	11,588.87	811,221,348	2.750	2024/2/15	0.38
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 5.75	4,200,000	19,841.23	833,332,072	19,313.98	811,187,214	5.750	2032/10/25	0.38
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.125	7,000,000	10,906.63	763,464,169	11,026.17	771,832,141	2.125	2025/5/15	0.37
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 4.5	4,200,000	18,871.36	792,597,124	18,305.46	768,829,710	4.500	2041/4/25	0.36
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 1.75	7,000,000	10,844.88	759,141,702	10,955.17	766,862,478	1.750	2023/5/15	0.36
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 4.25	5,000,000	15,349.65	767,482,551	15,005.49	750,274,718	4.250	2023/10/25	0.36
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 3.625	6,000,000	12,174.36	730,462,078	12,476.75	748,605,308	3.625	2043/8/15	0.35
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 3.5	5,000,000	15,048.76	752,438,125	14,785.20	739,260,027	3.500	2026/4/25	0.35
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 1.625	7,000,000	10,331.91	723,234,101	10,501.15	735,081,155	1.625	2026/5/15	0.35
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.75	6,200,000	11,459.15	710,467,716	11,596.76	718,999,418	2.750	2023/11/15	0.34
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 3.625	6,000,000	11,902.65	714,159,469	11,889.51	713,370,636	3.625	2020/2/15	0.34
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 3.875	6,000,000	11,653.73	699,224,175	11,568.71	694,123,039	3.875	2018/5/15	0.33
イタリア	国債証券	BTPS 6	4,100,000	17,366.86	712,041,344	16,785.21	688,193,790	6.000	2031/5/1	0.33
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 3	5,000,000	13,962.91	698,145,703	13,752.61	687,630,537	3.000	2022/4/25	0.33
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.5	6,000,000	11,339.74	680,384,669	11,428.47	685,708,789	2.500	2023/8/15	0.32
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 3.125	6,000,000	11,207.01	672,420,862	11,419.71	685,182,899	3.125	2044/8/15	0.32
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2	6,000,000	11,233.31	673,999,096	11,256.68	675,401,334	2.000	2021/11/15	0.32

アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 3	6,000,000	10,908.14	654,488,695	11,133.98	668,038,864	3.000	2045/11/15	0.32
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 3.75	5,000,000	13,467.39	673,369,538	13,256.79	662,839,997	3.750	2019/10/25	0.31

□ 種類別の投資比率

平成29年 3月31日現在

種類	投資比率(%)
国債証券	98.32
合計	98.32

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29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	332	日本円	5,137,620,440	5,021,500,000	2.46

(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29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 1706	買建	273	米ドル	32,003,411.5	3,590,462,736	32,276,790	3,621,133,070	1.75
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	DJ EUR 1706	買建	234	ユーロ	7,891,468	945,318,951	7,981,740	956,132,634	0.46
	オーストラリア	シドニー先物取引所	SP1200 1706	買建	22	オーストラリアドル	3,136,324	269,222,052	3,234,000	277,606,560	0.13
	イギリス	ロンドン国際金融先物オプション取引所	FTSE 1706	買建	37	英ポンド	2,688,989	376,673,579	2,701,000	378,356,080	0.18

(注) 主たる取引所の発表する清算値段または最終相場で評価しております。

平成29年 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	売建	1,450,000.00	162,574,000	162,646,500	0.07
	カナダドル	売建	90,000.00	7,561,800	7,563,600	0.00
	ユーロ	売建	310,000.00	37,131,800	37,134,900	0.01
	英ポンド	売建	120,000.00	16,790,400	16,808,400	0.00
	スイスフラン	売建	80,000.00	8,961,600	8,965,600	0.00
	スウェーデンクローナ	売建	180,000.00	2,257,200	2,259,000	0.00
	ノルウェークローネ	売建	30,000.00	392,400	392,400	0.00
	デンマーククローネ	売建	80,000.00	1,288,000	1,288,000	0.00
	オーストラリアドル	売建	40,000.00	3,430,000	3,432,800	0.00
	シンガポールドル	売建	10,000.00	802,100	802,600	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:2017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

分配の推移

■マイパッケージ30



決算期	分配金
2017年2月	0円
2016年2月	0円
2015年2月	0円
2014年2月	0円
2013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。
※直近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
2017年2月	0円
2016年2月	0円
2015年2月	0円
2014年2月	0円
2013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。
※直近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
2017年2月	0円
2016年2月	0円
2015年2月	0円
2014年2月	0円
2013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。
※直近5計算期間を記載しています。

※基準価額は、1万口当たり、信託報酬控除後です。

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



※2017年の収益率は、年初から2017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に取引口座を開設の上、当ファンドの取得申込みを行っていただきます。

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

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

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

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

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

ファンドのお買付けに関しましては、クーリング・オフ制度の適用はありません。

ロ 申込価額

取得申込受付日の翌営業日の基準価額となります。

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

ハ 申込手数料

無手数料です。

ニ 申込単位

お申込単位の詳細は、取扱いの販売会社または委託会社にお問い合わせください。

ホ 照会先

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	http://www.smam-jp.com

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

ヘ 申込取扱場所・払込取扱場所

販売会社において申込み・払込みを取り扱います。

ト 払込期日

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

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

2【換金（解約）手続等】

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

お買付けの販売会社にお申し出ください。

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

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

一部解約金は、解約請求受付日から起算して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	http://www.smam-jp.com

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

(2) 【保管】

ファンドの受益権は社振法の規定の適用を受け、受益権の帰属は振替機関等の振替口座簿に記載または記録されることにより定まるため、原則として受益証券は発行されません。したがって、受益証券の保管に関する該当事項はありません。

(3) 【信託期間】

平成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。

ニ 信託約款変更等に対する異議申立権および受益権の買取請求権

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

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

ホ 帳簿閲覧・謄写請求権

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

第3【ファンドの経理状況】

1. 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）ならびに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づいて作成しております。
なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
2. 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第12期（平成28年 2月19日から平成29年 2月20日まで）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

1【財務諸表】

【三井住友・DC年金バランス30（債券重点型）】

（1）【貸借対照表】

（単位：円）

	第11期 （平成28年 2月18日現在）	第12期 （平成29年 2月20日現在）
資産の部		
流動資産		
金銭信託	214,252,743	-
コール・ローン	-	349,735,664
親投資信託受益証券	4,678,020,871	6,184,111,708
未収入金	80,690,000	-
流動資産合計	4,972,963,614	6,533,847,372
資産合計		
	4,972,963,614	6,533,847,372
負債の部		
流動負債		
未払解約金	3,389,711	3,671,378
未払受託者報酬	810,350	976,479
未払委託者報酬	5,132,174	6,184,297
未払利息	-	862
その他未払費用	134,996	163,802
流動負債合計	9,467,231	10,996,818
負債合計		
	9,467,231	10,996,818
純資産の部		
元本等		
元本	3,772,218,254	4,695,698,893
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	1,191,278,129	1,827,151,661
元本等合計	4,963,496,383	6,522,850,554
純資産合計		
	4,963,496,383	6,522,850,554
負債純資産合計		
	4,972,963,614	6,533,847,372

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第11期		第12期	
	自	平成27年 2月19日 至 平成28年 2月18日	自	平成28年 2月19日 至 平成29年 2月20日
営業収益				
受取利息		23,767		-
有価証券売買等損益		83,035,748		317,250,837
営業収益合計		83,011,981		317,250,837
営業費用				
支払利息		-		204,496
受託者報酬		1,568,667		1,820,176
委託者報酬		9,934,760		11,527,645
その他費用		261,320		354,954
営業費用合計		11,764,747		13,907,271
営業利益又は営業損失（ ）		94,776,728		303,343,566
経常利益又は経常損失（ ）		94,776,728		303,343,566
当期純利益又は当期純損失（ ）		94,776,728		303,343,566
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（ ）		6,075,285		14,086,396
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		1,118,364,504		1,191,278,129
剰余金増加額又は欠損金減少額		310,966,470		471,599,641
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		310,966,470		471,599,641
剰余金減少額又は欠損金増加額		137,200,832		124,983,279
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		137,200,832		124,983,279
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（ ）		1,191,278,129		1,827,151,661

（ 3 ）【注記表】

（ 重要な会計方針の注記 ）

項 目	第12期	
	自 平成28年 2月19日 至 平成29年 2月20日	
1. 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>	
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>計算期間の取扱い 当計算期間は当期末が休日のため、平成28年 2月19日から平成29年 2月20日までとなっております。</p>	

（ 貸借対照表に関する注記 ）

項 目	第11期		第12期	
	（平成28年 2月18日現在）		（平成29年 2月20日現在）	
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	3,772,218,254口		4,695,698,893口	
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額	1.3158円	1口当たり純資産額	1.3891円
	(10,000口当たりの純資産額)	13,158円)	(10,000口当たりの純資産額)	13,891円)

（ 損益及び剰余金計算書に関する注記 ）

項目	第11期	第12期
	自 平成27年 2月19日 至 平成28年 2月18日	自 平成28年 2月19日 至 平成29年 2月20日
分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益（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）ですが、分配を行っておりません。	計算期間末における費用控除後の配当等収益（83,835,632円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（52,539,229円）、収益調整金（1,400,217,340円）、および分配準備積立金（783,991,438円）より、分配対象収益は2,320,583,639円（1万口当たり4,941.90円）ですが、分配を行っておりません。

（金融商品に関する注記）

．金融商品の状況に関する事項

項目	第12期
	自 平成28年 2月19日 至 平成29年 2月20日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、親投資信託受益証券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>

項目	第12期 自 平成28年 2月19日 至 平成29年 2月20日
3.金融商品に係るリスク管理体制	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する委員会をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用グループに是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用グループは、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。その後、当該関連運用グループの対処の実施や対処方針の決定等に関し、必要に応じてリスク管理を行う部署が当該部署の担当役員、当該関連運用グループの担当役員およびリスク管理委員会へ報告を行う体制となっております。</p> <p>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する部会にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。</p>
4.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって認める評価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。</p>

・金融商品の時価等に関する事項

項目	第12期 (平成29年 2月20日現在)
1.貸借対照表計上額、時価及び差額	<p>金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p>
2.時価の算定方法	<p>(1) 有価証券（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

第12期（自 平成28年 2月19日 至 平成29年 2月20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	296,578,285円
合計	296,578,285円

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

第12期 自 平成28年 2月19日 至 平成29年 2月20日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。

（その他の注記）

項 目	第11期 （平成28年 2月18日現在）	第12期 （平成29年 2月20日現在）
期首元本額	3,308,182,904円	3,772,218,254円
期中追加設定元本額	866,745,890円	1,313,785,041円
期中一部解約元本額	402,710,540円	390,304,402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)	568,077,134	1,309,815,447	
	外国株式インデックス・マザーファンド	222,527,707	662,687,511	
	外国債券パッシブ・マザーファンド	389,830,570	647,820,441	
	国内債券パッシブ・マザーファンド	2,863,630,622	3,563,788,309	
合計		4,044,066,033	6,184,111,708	

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11期 （平成28年 2月18日現在）	第12期 （平成29年 2月20日現在）
資産の部		
流動資産		
金銭信託	631,429,482	-
コール・ローン	-	967,487,474
親投資信託受益証券	13,116,540,879	16,926,566,403
未収入金	301,970,000	-
流動資産合計	14,049,940,361	17,894,053,877
資産合計	14,049,940,361	17,894,053,877
負債の部		
流動負債		
未払解約金	15,884,435	8,546,584
未払受託者報酬	2,371,081	2,716,864
未払委託者報酬	15,807,160	18,112,348
未払利息	-	2,385
その他未払費用	395,116	455,760
流動負債合計	34,457,792	29,833,941
負債合計	34,457,792	29,833,941
純資産の部		
元本等		
元本	10,605,602,485	12,337,069,119
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	3,409,880,084	5,527,150,817
元本等合計	14,015,482,569	17,864,219,936
純資産合計	14,015,482,569	17,864,219,936
負債純資産合計	14,049,940,361	17,894,053,877

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第11期		第12期	
	自	平成27年 2月19日 至 平成28年 2月18日	自	平成28年 2月19日 至 平成29年 2月20日
営業収益				
受取利息		69,251		-
有価証券売買等損益		677,396,625		1,513,885,524
営業収益合計		677,327,374		1,513,885,524
営業費用				
支払利息		-		539,160
受託者報酬		4,699,186		5,081,791
委託者報酬		31,327,800		33,878,424
その他費用		783,073		976,754
営業費用合計		36,810,059		40,476,129
営業利益又は営業損失（ ）		714,137,433		1,473,409,395
経常利益又は経常損失（ ）		714,137,433		1,473,409,395
当期純利益又は当期純損失（ ）		714,137,433		1,473,409,395
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（ ）		26,061,359		41,476,291
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		3,688,416,209		3,409,880,084
剰余金増加額又は欠損金減少額		835,057,347		949,018,968
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		835,057,347		949,018,968
剰余金減少額又は欠損金増加額		373,394,680		263,681,339
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		373,394,680		263,681,339
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（ ）		3,409,880,084		5,527,150,817

(3) 【注記表】

(重要な会計方針の注記)

項 目	第12期	
	自 平成28年 2月19日 至 平成29年 2月20日	
1. 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>	
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>計算期間の取扱い</p> <p>当計算期間は当期末が休日のため、平成28年 2月19日から平成29年 2月20日までとなっております。</p>	

(貸借対照表に関する注記)

項 目	第11期		第12期	
	(平成28年 2月18日現在)		(平成29年 2月20日現在)	
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	10,605,602,485口		12,337,069,119口	
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額	1.3215円	1口当たり純資産額	1.4480円
	(10,000口当たりの純資産額)	13,215円)	(10,000口当たりの純資産額)	14,480円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第11期	第12期
	自 平成27年 2月19日 至 平成28年 2月18日	自 平成28年 2月19日 至 平成29年 2月20日
分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益(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)ですが、分配を行っておりません。	計算期間末における費用控除後の配当等収益(269,628,779円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(271,230,657円)、収益調整金(4,242,558,626円)、および分配準備積立金(3,202,878,339円)より、分配対象収益は7,986,296,401円(1万口当たり6,473.40円)ですが、分配を行っておりません。

(金融商品に関する注記)

. 金融商品の状況に関する事項

項目	第12期
	自 平成28年 2月19日 至 平成29年 2月20日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、親投資信託受益証券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>

項目	第12期 自 平成28年 2月19日 至 平成29年 2月20日
3.金融商品に係るリスク管理体制	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する委員会をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用グループに是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用グループは、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。その後、当該関連運用グループの対処の実施や対処方針の決定等に関し、必要に応じてリスク管理を行う部署が当該部署の担当役員、当該関連運用グループの担当役員およびリスク管理委員会へ報告を行う体制となっております。</p> <p>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する部会にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。</p>
4.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって認める評価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。</p>

・金融商品の時価等に関する事項

項目	第12期 (平成29年 2月20日現在)
1.貸借対照表計上額、時価及び差額	<p>金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p>
2.時価の算定方法	<p>(1) 有価証券（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

第12期（自 平成28年 2月19日 至 平成29年 2月20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	1,455,509,063円
合計	1,455,509,063円

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

第12期 自 平成28年 2月19日 至 平成29年 2月20日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。

（その他の注記）

項 目	第11期 （平成28年 2月18日現在）	第12期 （平成29年 2月20日現在）
期首元本額	9,543,142,822円	10,605,602,485円
期中追加設定元本額	2,020,562,533円	2,542,481,389円
期中一部解約元本額	958,102,870円	811,014,755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)	2,728,868,993	6,291,953,237	
	外国株式インデックス・マザーファンド	904,071,965	2,692,326,311	
	外国債券パッシブ・マザーファンド	1,052,407,898	1,748,891,444	
	国内債券パッシブ・マザーファンド	4,976,613,428	6,193,395,411	
合計		9,661,962,284	16,926,566,403	

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11期 （平成28年 2月18日現在）	第12期 （平成29年 2月20日現在）
資産の部		
流動資産		
金銭信託	289,491,939	-
コール・ローン	-	461,356,361
親投資信託受益証券	6,647,834,471	8,623,426,727
未収入金	110,000,000	3,250,000
流動資産合計	7,047,326,410	9,088,033,088
資産合計	7,047,326,410	9,088,033,088
負債の部		
流動負債		
未払解約金	10,738,488	9,385,842
未払受託者報酬	1,218,245	1,376,891
未払委託者報酬	8,527,617	9,638,144
未払利息	-	1,137
その他未払費用	202,980	230,867
流動負債合計	20,687,330	20,632,881
負債合計	20,687,330	20,632,881
純資産の部		
元本等		
元本	5,397,378,680	6,131,734,500
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	1,629,260,400	2,935,665,707
元本等合計	7,026,639,080	9,067,400,207
純資産合計	7,026,639,080	9,067,400,207
負債純資産合計	7,047,326,410	9,088,033,088

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第11期		第12期	
	自	平成27年 2月19日 至 平成28年 2月18日	自	平成28年 2月19日 至 平成29年 2月20日
営業収益				
受取利息		34,879		-
有価証券売買等損益		575,803,961		1,069,442,256
営業収益合計		575,769,082		1,069,442,256
営業費用				
支払利息		-		263,475
受託者報酬		2,441,894		2,561,889
委託者報酬		17,093,097		17,933,060
その他費用		406,862		490,692
営業費用合計		19,941,853		21,249,116
営業利益又は営業損失（ ）		595,710,935		1,048,193,140
経常利益又は経常損失（ ）		595,710,935		1,048,193,140
当期純利益又は当期純損失（ ）		595,710,935		1,048,193,140
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（ ）		26,989,982		41,182,520
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		2,063,538,565		1,629,260,400
剰余金増加額又は欠損金減少額		494,791,687		479,849,573
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		494,791,687		479,849,573
剰余金減少額又は欠損金増加額		306,368,935		180,454,886
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		306,368,935		180,454,886
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（ ）		1,629,260,400		2,935,665,707

(3) 【注記表】

(重要な会計方針の注記)

項 目	第12期	
	自 平成28年 2月19日 至 平成29年 2月20日	
1. 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>	
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>計算期間の取扱い</p> <p>当計算期間は当期末が休日のため、平成28年 2月19日から平成29年 2月20日までとなっております。</p>	

(貸借対照表に関する注記)

項 目	第11期		第12期	
	(平成28年 2月18日現在)		(平成29年 2月20日現在)	
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	5,397,378,680口		6,131,734,500口	
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額	1.3019円	1口当たり純資産額	1.4788円
	(10,000口当たりの純資産額)	13,019円)	(10,000口当たりの純資産額)	14,788円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第11期	第12期
	自 平成27年 2月19日 至 平成28年 2月18日	自 平成28年 2月19日 至 平成29年 2月20日
分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益（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。	計算期間末における費用控除後の配当等収益（151,992,371円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（183,332,119円）、収益調整金（2,693,132,581円）、および分配準備積立金（1,781,079,989円）より、分配対象収益は4,809,537,060円（1万口当たり7,843.65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12期
	自 平成28年 2月19日 至 平成29年 2月20日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、親投資信託受益証券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>

項目	第12期 自 平成28年 2月19日 至 平成29年 2月20日
3.金融商品に係るリスク管理体制	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する委員会をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用グループに是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用グループは、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。その後、当該関連運用グループの対処の実施や対処方針の決定等に関し、必要に応じてリスク管理を行う部署が当該部署の担当役員、当該関連運用グループの担当役員およびリスク管理委員会へ報告を行う体制となっております。</p> <p>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する部会にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。</p>
4.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって認める評価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。</p>

・金融商品の時価等に関する事項

項目	第12期 (平成29年 2月20日現在)
1.貸借対照表計上額、時価及び差額	<p>金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p>
2.時価の算定方法	<p>(1) 有価証券（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

第12期（自 平成28年 2月19日 至 平成29年 2月20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	1,041,831,792円
合計	1,041,831,792円

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

第12期 自 平成28年 2月19日 至 平成29年 2月20日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。

（その他の注記）

項 目	第11期 （平成28年 2月18日現在）	第12期 （平成29年 2月20日現在）
期首元本額	5,028,340,512円	5,397,378,680円
期中追加設定元本額	1,106,054,113円	1,323,647,752円
期中一部解約元本額	737,015,945円	589,291,932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）	1,972,924,916	4,548,972,978	
	外国株式インデックス・マザーファンド	612,291,185	1,823,403,148	
	外国債券パッシブ・マザーファンド	538,770,076	895,328,112	
	国内債券パッシブ・マザーファンド	1,089,371,225	1,355,722,489	
合計		4,213,357,402	8,623,426,727	

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28年 2月18日現在)	(平成29年 2月20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	-	1,348,419,802
株式	185,765,171,350	215,854,667,050
派生商品評価勘定	82,636,960	29,800,280
未収配当金	282,860,425	340,806,366
差入委託証拠金	240,120,000	3,350,000
流動資産合計	194,214,920,899	217,577,043,498
資産合計	194,214,920,899	217,577,043,498
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	49,992,360	276,480
前受金	32,812,000	29,540,000
未払解約金	51,727,492	291,326,226
未払利息	-	3,324

	（平成28年 2月18日現在）	（平成29年 2月20日現在）
その他未払費用	-	6,654
流動負債合計	134,531,852	321,152,684
負債合計	134,531,852	321,152,684
純資産の部		
元本等		
元本	101,544,937,447	94,226,159,685
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	92,535,451,600	123,029,731,129
元本等合計	194,080,389,047	217,255,890,814
純資産合計	194,080,389,047	217,255,890,814
負債純資産合計	194,214,920,899	217,577,043,498

注記表

（重要な会計方針の注記）

項目	自 平成28年 2月19日 至 平成29年 2月20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28年 2月18日現在）	（平成29年 2月20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 3,090,000,000円</p>	<p>代用として、担保に供している資産は次の通りであります。</p> <p>株式 3,216,000,000円</p>

2. 当計算期間の末日における受益権の総数	101,544,937,447口	94,226,159,685口
3. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 (10,000口当たりの純資産額) 1.9113円 19,113円)	1口当たり純資産額 (10,000口当たりの純資産額) 2.3057円 23,057円)

(金融商品に関する注記)

. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 平成28年 2月19日 至 平成29年 2月20日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、株式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29年 2月20日現在)
1.貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	<p>(1) 有価証券（株式） 「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

（平成29年 2月20日現在）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

（単位：円）

区 分	種 類	契 約 額 等		時 価	評 価 損 益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	1,393,716,200	-	1,423,240,000	29,523,800
	東証株価指数先物	1,393,716,200	-	1,423,240,000	29,523,800
合計		1,393,716,200	-	1,423,240,000	29,523,800

（注）1．時価の算定方法

(1) 株価指数先物取引の時価の算定方法について

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

2) 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

2．ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

自 平成28年 2月19日

至 平成29年 2月20日

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

（その他の注記）

（平成28年 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
SMAM・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（TOPIX）	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
SMAM・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
SMAM・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
SMAM・バランスファンドVA25＜適格機関投資家専用＞	7,255,774,516円
SMAM・バランスファンドVA37.5＜適格機関投資家専用＞	3,922,850,063円
SMAM・バランスファンドVA50＜適格機関投資家専用＞	14,543,666,735円
SMAM・バランスファンドVL30＜適格機関投資家限定＞	83,669,680円
SMAM・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
SMAM・バランスファンドVA75＜適格機関投資家専用＞	1,530,636,481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＞	85,688,096円
SMAM・インデックス・バランスVA25＜適格機関投資家専用＞	550,816,665円
SMAM・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
SMAM・バランスファンドVA40＜適格機関投資家専用＞	2,823,066,693円
SMAM・バランスファンドVA35＜適格機関投資家専用＞	5,209,959,767円
SMAM・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

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 >	13,585,306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 >	135,871,591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 >	1,584,063,361円
S M A M ・ 国内株式インデックスファンド・ V A (適格機関投資家専用)	281,122,402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 >	30,877,449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 >	305,920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 >	2,407,964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 >	54,756円
S M A M ・ 年金Wリスクコントロールファンド < 適格機関投資家限定 >	110,935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 >	86,950,487円
合計	101,544,937,447円

(平成29年 2月20日現在)

開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	101,544,937,447円
同期中における追加設定元本額	23,321,173,735円
同期中における一部解約元本額	30,639,951,497円
平成29年 2月20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	9,788,199,465円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	568,077,134円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	2,728,868,993円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	1,972,924,916円
S M A M ・ グローバルバランスファンド(機動的資産配分型)	100,195,397円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2020(4資産タイプ)	8,783,971円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2025(4資産タイプ)	23,024,768円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2030(4資産タイプ)	59,581,725円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2035(4資産タイプ)	57,415,557円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2040(4資産タイプ)	30,587,172円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2045(4資産タイプ)	76,504,919円
国内株式指数ファンド(T O P I X)	1,710,476,977円
三井住友・DC日本株式インデックスファンドS	1,621,922,775円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	2,378,283,611円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	2,512,538,249円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	2,799,989,683円
イオン・バランス戦略ファンド	11,730,534円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2050	3,718,597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)	12,733,970,871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 >	63,954,543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 >	8,881,987,117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 >	5,390,059,240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 >	3,306,906,590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 >	12,109,882,242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 >	67,744,543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 >	299,090,222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 >	12,145,832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 >	1,286,654,142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 >	77,162,633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 >	482,840,464円
S M A M ・ インデックス・バランス V A 5 0 < 適格機関投資家専用 >	1,479,479,385円
S M A M ・ バランスファンド V A 4 0 < 適格機関投資家専用 >	2,452,591,564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 >	4,235,320,573円
S M A M ・ バランス V A 株 4 0 T < 適格機関投資家限定 >	108,562,064円
三井住友 ・ 5 資産 バランスファンド ・ V A S (適格機関投資家専用)	2,003,856,736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 >	91,167,602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 >	147,184,946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)	2,256,008,563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 >	138,493,278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 >	64,390,939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 >	31,065,850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 >	291,659,181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 >	489,219,176円
S M A M ・ アセット バランスファンド V A 2 0 T < 適格機関投資家専用 >	226,065,276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 >	147,391,114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 >	70,048,588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 >	12,276,247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 >	100,871,702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 >	1,279,103,981円
S M A M ・ 国内株式 インデックスファンド ・ V A (適格機関投資家専用)	236,182,663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 >	25,237,849円
S M A M ・ グローバル バランスファンド (標準型) V A < 適格機関投資家限定 >	2,449,791,880円
S M A M ・ グローバル バランスファンド (債券重視型) V A < 適格機関投資家限定 >	413,282,149円
S M A M ・ 世界 バランスファンド V A < 適格機関投資家限定 >	2,377,503,056円
S M A M ・ 世界 バランスファンド V A 2 < 適格機関投資家限定 >	1,716,719,167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 >	24,037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 >	440,212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 >	205,577円
S M A M ・ マルチアセット ストラテジー ファンド 2 0 1 6 - 0 4 < 適格機関投資家限定 >	102,742,023円
S M A M ・ マルチアセット ストラテジー ファンド 2 0 1 6 - 0 5 < 適格機関投資家限定 >	49,195,286円
S M A M ・ マルチアセット ストラテジー ・ オープン < 適格機関投資家限定 >	64,856,139円
合計	94,226,159,685円

附属明細表

有価証券明細表

(a) 株式

(単位：円)

銘柄	株数	評価額		備考
		単価	金額	
極洋	4,800	2,851.00	13,684,800	
日本水産	138,400	562.00	77,780,800	
マルハニチロ	20,100	3,285.00	66,028,500	
カネコ種苗	4,700	1,435.00	6,744,500	
サカタのタネ	15,500	3,185.00	49,367,500	
ホクト	10,800	2,136.00	23,068,800	
日鉄鉱業	3,000	6,030.00	18,090,000	
三井松島産業	7,800	1,510.00	11,778,000	
国際石油開発帝石	565,000	1,118.50	631,952,500	
日本海洋掘削	4,200	2,413.00	10,134,600	
石油資源開発	16,700	2,705.00	45,173,500	
K&Oエナジーグループ	7,400	1,766.00	13,068,400	
ショーボンドホールディングス	10,000	5,000.00	50,000,000	
ミライト・ホールディングス	32,500	1,053.00	34,222,500	
タマホーム	12,600	555.00	6,993,000	
ダイセキ環境ソリューション	3,500	1,591.00	5,568,500	
安藤・間	76,700	850.00	65,195,000	
東急建設	37,500	835.00	31,312,500	
コムシスホールディングス	42,000	2,025.00	85,050,000	
ミサワホーム	13,500	1,054.00	14,229,000	
ピーアールホールディングス	13,200	302.00	3,986,400	
高松コンストラクショングループ	7,500	2,648.00	19,860,000	
東建コーポレーション	3,800	8,020.00	30,476,000	
大成建設	542,000	806.00	436,852,000	
大林組	319,900	1,065.00	340,693,500	
清水建設	326,000	1,042.00	339,692,000	
飛鳥建設	108,400	175.00	18,970,000	
長谷工コーポレーション	124,800	1,288.00	160,742,400	
松井建設	13,000	1,062.00	13,806,000	
銭高組	17,000	428.00	7,276,000	
鹿島建設	469,000	741.00	347,529,000	
不動テトラ	91,600	203.00	18,594,800	
鉄建建設	66,000	337.00	22,242,000	
西松建設	125,000	585.00	73,125,000	
三井住友建設	421,300	123.00	51,819,900	
大豊建設	39,000	526.00	20,514,000	
前田建設工業	67,000	1,002.00	67,134,000	
ナカノフドー建設	9,900	558.00	5,524,200	
奥村組	90,000	706.00	63,540,000	
東鉄工業	12,400	3,145.00	38,998,000	

イチケン	11,000	487.00	5,357,000
浅沼組	37,000	359.00	13,283,000
戸田建設	126,000	668.00	84,168,000
熊谷組	167,000	319.00	53,273,000
青木あすなろ建設	8,000	820.00	6,560,000
北野建設	29,000	320.00	9,280,000
三井ホーム	17,000	576.00	9,792,000
矢作建設工業	15,100	1,051.00	15,870,100
日本ハウスホールディングス	24,700	517.00	12,769,900
大東建託	39,500	15,775.00	623,112,500
新日本建設	13,300	929.00	12,355,700
N I P P O	24,000	2,176.00	52,224,000
東亜道路工業	25,000	345.00	8,625,000
前田道路	34,000	2,012.00	68,408,000
日本道路	38,000	481.00	18,278,000
東亜建設工業	9,100	1,954.00	17,781,400
若築建設	73,000	152.00	11,096,000
東洋建設	34,300	424.00	14,543,200
五洋建設	119,400	516.00	61,610,400
大林道路	12,700	686.00	8,712,200
世紀東急工業	18,600	516.00	9,597,600
福田組	18,000	1,044.00	18,792,000
住友林業	73,900	1,607.00	118,757,300
日成ビルド工業	33,000	551.00	18,183,000
ヤマダ・エスバイエルホーム	83,000	80.00	6,640,000
巴コーポレーション	21,100	358.00	7,553,800
パナホーム	40,000	1,057.00	42,280,000
大和ハウス工業	316,400	3,109.00	983,687,600
ライト工業	20,900	1,156.00	24,160,400
積水ハウス	337,300	1,798.00	606,465,400
日特建設	12,500	442.00	5,525,000
北陸電気工事	5,800	885.00	5,133,000
ユアテック	18,000	804.00	14,472,000
中電工	12,600	2,367.00	29,824,200
関電工	42,000	925.00	38,850,000
きんでん	71,100	1,485.00	105,583,500
東京エネシス	12,000	951.00	11,412,000
トーエネック	17,000	559.00	9,503,000
住友電設	7,900	1,278.00	10,096,200
日本電設工業	17,000	1,991.00	33,847,000
協和エクシオ	42,700	1,592.00	67,978,400
新日本空調	9,100	1,375.00	12,512,500

N D S	2,600	2,920.00	7,592,000
九電工	20,700	2,948.00	61,023,600
三機工業	23,500	1,002.00	23,547,000
日揮	100,000	2,053.00	205,300,000
中外炉工業	40,000	240.00	9,600,000
ヤマト	12,400	541.00	6,708,400
太平電業	15,000	1,052.00	15,780,000
高砂熱学工業	28,900	1,649.00	47,656,100
朝日工業社	3,100	3,035.00	9,408,500
明星工業	20,500	613.00	12,566,500
大気社	14,200	2,891.00	41,052,200
ダイダン	16,000	961.00	15,376,000
日比谷総合設備	11,900	1,721.00	20,479,900
東芝プラントシステム	17,500	1,611.00	28,192,500
O S J Bホールディングス	38,500	251.00	9,663,500
東洋エンジニアリング	66,000	270.00	17,820,000
千代田化工建設	78,000	720.00	56,160,000
新興プランテック	23,000	931.00	21,413,000
日本製粉	30,800	1,695.00	52,206,000
日清製粉グループ本社	116,800	1,685.00	196,808,000
日東富士製粉	1,300	3,995.00	5,193,500
昭和産業	43,000	609.00	26,187,000
鳥越製粉	11,600	809.00	9,384,400
中部飼料	12,700	1,154.00	14,655,800
フィード・ワン	77,600	180.00	13,968,000
日本甜菜製糖	6,100	2,461.00	15,012,100
三井製糖	7,400	2,658.00	19,669,200
日新製糖	4,900	1,836.00	8,996,400
森永製菓	21,000	4,710.00	98,910,000
中村屋	3,000	5,130.00	15,390,000
江崎グリコ	26,800	5,300.00	142,040,000
名糖産業	6,600	1,389.00	9,167,400
不二家	72,000	223.00	16,056,000
山崎製パン	78,600	2,224.00	174,806,400
モロゾフ	22,000	508.00	11,176,000
亀田製菓	6,000	4,965.00	29,790,000
寿スピリッツ	7,500	2,594.00	19,455,000
カルビー	43,800	3,750.00	164,250,000
森永乳業	98,000	740.00	72,520,000
六甲バター	5,000	2,451.00	12,255,000
ヤクルト本社	57,500	6,270.00	360,525,000
明治ホールディングス	63,200	8,670.00	547,944,000

雪印メグミルク	23,500	2,947.00	69,254,500
プリマハム	67,000	449.00	30,083,000
日本ハム	72,000	3,065.00	220,680,000
丸大食品	51,000	497.00	25,347,000
S Foods	5,600	3,240.00	18,144,000
伊藤ハム米久ホールディングス	60,500	1,094.00	66,187,000
サッポロホールディングス	35,400	2,851.00	100,925,400
アサヒグループホールディングス	201,300	4,110.00	827,343,000
キリンホールディングス	461,900	1,908.50	881,536,150
宝ホールディングス	78,400	1,109.00	86,945,600
オエノンホールディングス	36,000	265.00	9,540,000
養命酒製造	4,500	1,870.00	8,415,000
コカ・コーラウエスト	35,900	3,165.00	113,623,500
コカ・コーライーストジャパン	42,400	2,357.00	99,936,800
サントリー食品インターナショナル	73,200	4,650.00	340,380,000
ダイドーグループホールディングス	4,900	5,640.00	27,636,000
伊藤園	32,100	3,705.00	118,930,500
キーコーヒー	9,500	2,197.00	20,871,500
日清オイリオグループ	61,000	580.00	35,380,000
不二製油グループ本社	29,100	2,419.00	70,392,900
J・オイルミルズ	4,900	4,100.00	20,090,000
キッコーマン	75,000	3,395.00	254,625,000
味の素	221,200	2,319.50	513,073,400
キューピー	54,800	2,942.00	161,221,600
ハウス食品グループ本社	40,000	2,392.00	95,680,000
カゴメ	38,600	2,878.00	111,090,800
焼津水産化学工業	7,100	1,229.00	8,725,900
アリアケジャパン	8,600	6,240.00	53,664,000
ニチレイ	52,800	2,565.00	135,432,000
東洋水産	52,600	3,980.00	209,348,000
日清食品ホールディングス	41,800	6,140.00	256,652,000
永谷園ホールディングス	11,000	1,425.00	15,675,000
一正蒲鉾	5,300	1,182.00	6,264,600
フジッコ	10,400	2,450.00	25,480,000
ロック・フィールド	10,500	1,690.00	17,745,000
日本たばこ産業	594,000	3,774.00	2,241,756,000
ケンコーマヨネーズ	4,000	2,710.00	10,840,000
わらべや日洋ホールディングス	6,500	2,553.00	16,594,500
なとり	6,500	1,865.00	12,122,500
ユーグレナ	34,700	1,240.00	43,028,000
ミヨシ油脂	53,000	142.00	7,526,000
理研ビタミン	3,400	4,340.00	14,756,000

片倉工業	13,600	1,511.00	20,549,600
グンゼ	75,000	422.00	31,650,000
東洋紡	404,000	197.00	79,588,000
ユニチカ	283,000	90.00	25,470,000
富士紡ホールディングス	5,200	3,365.00	17,498,000
倉敷紡績	101,000	237.00	23,937,000
シキボウ	71,000	153.00	10,863,000
日本毛織	28,300	905.00	25,611,500
帝国繊維	10,800	1,699.00	18,349,200
帝人	81,600	2,159.00	176,174,400
東レ	729,000	972.50	708,952,500
サカイオーベックス	3,700	1,960.00	7,252,000
住江織物	34,000	291.00	9,894,000
アツギ	102,000	127.00	12,954,000
ダイニック	33,000	193.00	6,369,000
セーレン	24,800	1,579.00	39,159,200
小松精練	16,900	735.00	12,421,500
ワコールホールディングス	60,000	1,420.00	85,200,000
ホギメディカル	6,300	6,770.00	42,651,000
レナウン	47,600	114.00	5,426,400
T S Iホールディングス	40,900	826.00	33,783,400
三陽商会	64,000	172.00	11,008,000
ナイガイ	65,000	66.00	4,290,000
オンワードホールディングス	66,000	858.00	56,628,000
ルック	33,000	209.00	6,897,000
ゴールドウイン	4,400	5,750.00	25,300,000
デサント	22,700	1,247.00	28,306,900
特種東海製紙	5,800	4,205.00	24,389,000
王子ホールディングス	388,000	520.00	201,760,000
日本製紙	44,400	1,981.00	87,956,400
三菱製紙	16,200	760.00	12,312,000
北越紀州製紙	57,400	751.00	43,107,400
中越パルプ工業	43,000	242.00	10,406,000
巴川製紙所	21,000	251.00	5,271,000
大王製紙	39,000	1,295.00	50,505,000
レンゴー	97,700	651.00	63,602,700
トーモク	35,000	335.00	11,725,000
ザ・パック	6,900	3,075.00	21,217,500
クラレ	167,700	1,717.00	287,940,900
旭化成	625,000	1,095.00	684,375,000
共和レザー	7,900	926.00	7,315,400
昭和電工	67,000	1,982.00	132,794,000

住友化学	735,000	638.00	468,930,000	
住友精化	4,200	4,725.00	19,845,000	
日産化学工業	54,500	3,915.00	213,367,500	
ラサ工業	51,000	147.00	7,497,000	
クレハ	7,600	4,860.00	36,936,000	
テイカ	17,000	725.00	12,325,000	
石原産業	18,900	1,120.00	21,168,000	
日東エフシー	6,800	957.00	6,507,600	
日本曹達	60,000	670.00	40,200,000	
東ソー	289,000	1,004.00	290,156,000	
トクヤマ	157,000	573.00	89,961,000	
セントラル硝子	105,000	547.00	57,435,000	
東亜合成	64,100	1,272.00	81,535,200	
大阪ソーダ	44,000	495.00	21,780,000	
関東電化工業	21,000	1,159.00	24,339,000	
デンカ	209,000	610.00	127,490,000	
信越化学工業	179,800	9,865.00	1,773,727,000	
日本カーバイド工業	39,000	162.00	6,318,000	
堺化学工業	39,000	411.00	16,029,000	
エア・ウォーター	82,200	2,162.00	177,716,400	
大陽日酸	77,000	1,426.00	109,802,000	
日本化学工業	42,000	241.00	10,122,000	
日本パーカライジング	52,000	1,408.00	73,216,000	
高压ガス工業	16,200	765.00	12,393,000	
四国化成工業	15,000	1,185.00	17,775,000	
戸田工業	28,000	285.00	7,980,000	
ステラ ケミファ	5,000	3,430.00	17,150,000	
保土谷化学工業	3,800	3,650.00	13,870,000	
日本触媒	15,800	7,470.00	118,026,000	
大日精化工業	41,000	724.00	29,684,000	
カネカ	135,000	900.00	121,500,000	
三菱瓦斯化学	93,200	2,325.00	216,690,000	
三井化学	454,000	553.00	251,062,000	
J S R	100,700	2,019.00	203,313,300	
東京応化工業	19,000	3,785.00	71,915,000	
大阪有機化学工業	7,700	972.00	7,484,400	
三菱ケミカルホールディングス	675,800	859.30	580,714,940	
K Hネオケム	12,900	1,340.00	17,286,000	
ダイセル	135,500	1,401.00	189,835,500	
住友ベークライト	91,000	665.00	60,515,000	
積水化学工業	226,300	1,875.00	424,312,500	
日本ゼオン	85,000	1,298.00	110,330,000	

アイカ工業	32,500	2,898.00	94,185,000
宇部興産	506,000	285.00	144,210,000
積水樹脂	15,400	1,882.00	28,982,800
タキロン	24,000	544.00	13,056,000
旭有機材	41,000	242.00	9,922,000
日立化成	55,400	3,225.00	178,665,000
ニチバン	11,000	930.00	10,230,000
リケンテクノス	23,000	547.00	12,581,000
大倉工業	27,000	564.00	15,228,000
積水化成成品工業	15,800	830.00	13,114,000
群栄化学工業	2,600	3,785.00	9,841,000
ダイキョーニシカワ	17,600	1,454.00	25,590,400
日本化薬	65,000	1,581.00	102,765,000
カーリットホールディングス	12,100	594.00	7,187,400
日本精化	10,400	947.00	9,848,800
扶桑化学工業	7,100	3,140.00	22,294,000
A D E K A	43,600	1,562.00	68,103,200
日油	81,000	1,264.00	102,384,000
花王	254,500	5,727.00	1,457,521,500
第一工業製薬	27,000	454.00	12,258,000
三洋化成工業	6,100	4,710.00	28,731,000
大日本塗料	62,000	233.00	14,446,000
日本ペイントホールディングス	77,000	3,595.00	276,815,000
関西ペイント	105,000	2,200.00	231,000,000
中国塗料	29,300	854.00	25,022,200
日本特殊塗料	7,500	1,753.00	13,147,500
藤倉化成	16,400	682.00	11,184,800
太陽ホールディングス	8,200	4,775.00	39,155,000
D I C	39,500	3,950.00	156,025,000
サカタインクス	19,800	1,614.00	31,957,200
東洋インキ S C ホールディングス	95,000	555.00	52,725,000
T & K T O K A	8,200	1,082.00	8,872,400
富士フィルムホールディングス	198,500	4,360.00	865,460,000
資生堂	190,400	2,873.00	547,019,200
ライオン	124,000	1,874.00	232,376,000
高砂香料工業	6,800	3,605.00	24,514,000
マンダム	9,800	5,200.00	50,960,000
ミルボン	5,400	5,290.00	28,566,000
ファンケル	21,300	1,614.00	34,378,200
コーセー	16,200	9,190.00	148,878,000
シーズ・ホールディングス	13,100	3,115.00	40,806,500
ポーラ・オルビスホールディングス	10,200	10,920.00	111,384,000

ノエビアホールディングス	6,000	4,280.00	25,680,000
エステー	7,900	1,732.00	13,682,800
コニシ	15,800	1,360.00	21,488,000
長谷川香料	12,400	1,957.00	24,266,800
星光P M C	6,000	1,132.00	6,792,000
小林製薬	27,800	5,210.00	144,838,000
荒川化学工業	8,600	2,042.00	17,561,200
メック	8,600	1,238.00	10,646,800
日本高純度化学	3,800	2,480.00	9,424,000
タカラバイオ	21,400	1,544.00	33,041,600
J C U	3,200	7,500.00	24,000,000
新田ゼラチン	9,200	755.00	6,946,000
デクセリアルズ	26,100	1,288.00	33,616,800
アース製薬	7,100	5,110.00	36,281,000
イハラケミカル工業	13,200	1,055.00	13,926,000
北興化学工業	15,000	485.00	7,275,000
大成ラミック	3,200	3,145.00	10,064,000
クミアイ化学工業	22,700	673.00	15,277,100
日本農薬	24,400	700.00	17,080,000
アキレス	9,000	1,826.00	16,434,000
有沢製作所	18,500	789.00	14,596,500
日東電工	72,200	9,528.00	687,921,600
レック	3,400	4,535.00	15,419,000
きもと	23,400	249.00	5,826,600
藤森工業	7,400	3,020.00	22,348,000
前澤化成工業	8,100	1,209.00	9,792,900
J S P	4,900	2,584.00	12,661,600
エフピコ	8,800	5,150.00	45,320,000
天馬	7,000	2,145.00	15,015,000
信越ポリマー	19,400	835.00	16,199,000
東リ	27,100	413.00	11,192,300
ニフコ	17,700	5,710.00	101,067,000
日本バルカー工業	9,400	1,843.00	17,324,200
ユニ・チャーム	203,400	2,444.50	497,211,300
協和発酵キリン	119,100	1,639.00	195,204,900
武田薬品工業	375,700	5,242.00	1,969,419,400
アステラス製薬	1,024,500	1,513.00	1,550,068,500
大日本住友製薬	70,700	1,967.00	139,066,900
塩野義製薬	135,600	5,490.00	744,444,000
田辺三菱製薬	116,100	2,295.00	266,449,500
あすか製薬	11,100	1,720.00	19,092,000
日本新薬	23,000	6,110.00	140,530,000

中外製薬	99,100	3,840.00	380,544,000
科研製薬	19,000	5,890.00	111,910,000
エーザイ	123,500	6,114.00	755,079,000
ロート製薬	49,500	2,194.00	108,603,000
小野薬品工業	228,100	2,523.00	575,496,300
久光製薬	28,400	6,130.00	174,092,000
持田製薬	7,100	8,430.00	59,853,000
参天製薬	181,000	1,623.00	293,763,000
扶桑薬品工業	4,200	2,869.00	12,049,800
日本ケミファ	1,800	5,540.00	9,972,000
ツムラ	34,100	3,390.00	115,599,000
日医工	24,400	1,724.00	42,065,600
キッセイ薬品工業	18,300	2,864.00	52,411,200
生化学工業	18,900	1,727.00	32,640,300
栄研化学	8,600	3,040.00	26,144,000
鳥居薬品	6,700	2,909.00	19,490,300
JCRファーマ	7,900	2,856.00	22,562,400
東和薬品	4,800	5,260.00	25,248,000
富士製薬工業	3,900	3,085.00	12,031,500
沢井製薬	17,300	6,130.00	106,049,000
ゼリア新薬工業	20,800	1,706.00	35,484,800
第一三共	295,200	2,563.50	756,745,200
キョーリン製薬ホールディングス	24,600	2,359.00	58,031,400
大幸薬品	6,000	1,797.00	10,782,000
ダイト	6,400	2,275.00	14,560,000
大塚ホールディングス	215,400	5,155.00	1,110,387,000
大正製薬ホールディングス	21,300	9,230.00	196,599,000
ペプチドリーム	17,400	5,330.00	92,742,000
日本コークス工業	100,300	104.00	10,431,200
昭和シェル石油	89,000	1,084.00	96,476,000
ニチレキ	13,900	915.00	12,718,500
東燃ゼネラル石油	163,000	1,317.00	214,671,000
ユシロ化学工業	7,000	1,452.00	10,164,000
ビーピー・カストロール	5,600	1,651.00	9,245,600
MORESCO	4,700	1,752.00	8,234,400
出光興産	47,600	3,555.00	169,218,000
JXホールディングス	1,112,600	527.00	586,340,200
コスモエネルギーホールディングス	29,500	1,933.00	57,023,500
横浜ゴム	60,600	2,196.00	133,077,600
東洋ゴム工業	53,000	1,707.00	90,471,000
ブリヂストン	338,200	4,549.00	1,538,471,800
住友ゴム工業	93,700	1,811.00	169,690,700

藤倉ゴム工業	10,400	709.00	7,373,600	
オカモト	31,000	1,029.00	31,899,000	
ニッタ	9,000	2,990.00	26,910,000	
住友理工	18,600	1,159.00	21,557,400	
三ツ星ベルト	25,000	1,005.00	25,125,000	
バンドー化学	19,000	1,062.00	20,178,000	
日東紡績	82,000	506.00	41,492,000	
旭硝子	492,000	918.00	451,656,000	
日本板硝子	42,600	855.00	36,423,000	
日本山村硝子	52,000	204.00	10,608,000	
日本電気硝子	208,000	705.00	146,640,000	
オハラ	5,300	1,131.00	5,994,300	
住友大阪セメント	186,000	461.00	85,746,000	
太平洋セメント	605,000	409.00	247,445,000	
日本ヒューム	12,000	710.00	8,520,000	
日本コンクリート工業	26,400	343.00	9,055,200	
三谷セキサン	5,200	2,553.00	13,275,600	
アジアパイルホールディングス	14,700	579.00	8,511,300	
東海カーボン	91,500	468.00	42,822,000	
日本カーボン	53,000	299.00	15,847,000	
東洋炭素	6,200	1,953.00	12,108,600	
ノリタケカンパニーリミテド	5,900	2,925.00	17,257,500	
TOTO	73,200	4,220.00	308,904,000	
日本碍子	126,300	2,455.00	310,066,500	
日本特殊陶業	86,200	2,584.00	222,740,800	
MARUWA	4,000	3,715.00	14,860,000	
品川リフラクトリーズ	32,000	302.00	9,664,000	
黒崎播磨	26,000	464.00	12,064,000	
ニッカトー	10,200	425.00	4,335,000	
フジインコーポレーテッド	8,600	2,589.00	22,265,400	
ニチアス	52,000	1,099.00	57,148,000	
ニチハ	13,300	3,155.00	41,961,500	
新日鐵住金	452,000	2,818.00	1,273,736,000	
神戸製鋼所	172,600	1,139.00	196,591,400	
中山製鋼所	12,400	781.00	9,684,400	
合同製鐵	6,100	1,885.00	11,498,500	
ジェイ エフ イー ホールディングス	273,700	2,142.00	586,265,400	
日新製鋼	46,000	1,573.00	72,358,000	
東京製鐵	50,600	1,043.00	52,775,800	
共英製鋼	10,600	2,146.00	22,747,600	
大和工業	20,200	3,320.00	67,064,000	
東京鐵鋼	23,000	474.00	10,902,000	

大阪製鐵	6,700	2,194.00	14,699,800
淀川製鋼所	13,300	3,360.00	44,688,000
東洋鋼鈹	26,200	463.00	12,130,600
丸一鋼管	33,300	3,595.00	119,713,500
モリ工業	4,000	2,319.00	9,276,000
大同特殊鋼	169,000	570.00	96,330,000
日本冶金工業	85,000	232.00	19,720,000
山陽特殊製鋼	60,000	614.00	36,840,000
愛知製鋼	5,700	4,870.00	27,759,000
日立金属	101,700	1,677.00	170,550,900
日本金属	3,800	1,306.00	4,962,800
大平洋金属	64,000	417.00	26,688,000
新日本電工	57,100	337.00	19,242,700
栗本鐵工所	5,500	2,384.00	13,112,000
虹技	21,000	253.00	5,313,000
三菱製鋼	71,000	261.00	18,531,000
日亜鋼業	21,100	285.00	6,013,500
シンニッタン	9,700	710.00	6,887,000
大紀アルミニウム工業所	20,000	531.00	10,620,000
日本軽金属ホールディングス	234,200	286.00	66,981,200
三井金属鉱業	276,000	381.00	105,156,000
東邦亜鉛	59,000	635.00	37,465,000
三菱マテリアル	62,700	3,840.00	240,768,000
住友金属鉱山	261,000	1,618.50	422,428,500
D O W A ホールディングス	112,000	944.00	105,728,000
古河機械金属	156,000	238.00	37,128,000
大阪チタニウムテクノロジーズ	11,700	1,966.00	23,002,200
東邦チタニウム	18,700	994.00	18,587,800
U A C J	127,000	321.00	40,767,000
古河電気工業	33,800	4,105.00	138,749,000
住友電気工業	378,800	1,880.00	712,144,000
フジクラ	133,300	853.00	113,704,900
タツタ電線	22,400	461.00	10,326,400
平河ヒューテック	6,000	1,119.00	6,714,000
リョービ	63,000	511.00	32,193,000
アーレスティ	13,000	1,180.00	15,340,000
アサヒホールディングス	15,600	1,980.00	30,888,000
稲葉製作所	6,900	1,331.00	9,183,900
宮地エンジニアリンググループ	39,000	241.00	9,399,000
トーカロ	7,300	2,722.00	19,870,600
S U M C O	104,800	1,777.00	186,229,600
川田テクノロジーズ	1,900	7,830.00	14,877,000

東洋製罐グループホールディングス	71,400	2,070.00	147,798,000
ホッカンホールディングス	32,000	545.00	17,440,000
コロナ	7,300	1,164.00	8,497,200
横河ブリッジホールディングス	18,000	1,404.00	25,272,000
駒井ハルテック	3,200	2,092.00	6,694,400
三和ホールディングス	99,900	1,085.00	108,391,500
文化シャッター	28,500	861.00	24,538,500
三協立山	13,300	1,767.00	23,501,100
アルインコ	9,100	1,050.00	9,555,000
LIXILグループ	139,600	2,770.00	386,692,000
日本フィルコン	11,700	559.00	6,540,300
ノーリツ	19,700	2,177.00	42,886,900
長府製作所	10,700	2,724.00	29,146,800
リンナイ	17,100	8,730.00	149,283,000
日東精工	20,000	428.00	8,560,000
岡部	22,100	996.00	22,011,600
ジーテクト	10,500	2,151.00	22,585,500
東プレ	19,300	2,922.00	56,394,600
高周波熱錬	19,800	918.00	18,176,400
東京製網	7,800	1,819.00	14,188,200
パイオラックス	5,100	7,790.00	39,729,000
日本発條	95,300	1,290.00	122,937,000
三益半導体工業	8,700	1,760.00	15,312,000
日本製鋼所	33,700	2,026.00	68,276,200
三浦工業	41,800	1,727.00	72,188,600
タクマ	32,100	1,022.00	32,806,200
ツガミ	28,000	692.00	19,376,000
オークマ	65,000	1,215.00	78,975,000
東芝機械	59,000	491.00	28,969,000
アマダホールディングス	134,000	1,264.00	169,376,000
アイダエンジニアリング	28,000	1,013.00	28,364,000
滝澤鉄工所	43,000	187.00	8,041,000
富士機械製造	29,800	1,533.00	45,683,400
牧野フライス製作所	49,000	1,066.00	52,234,000
オーエスジー	46,200	2,397.00	110,741,400
旭ダイヤモンド工業	29,200	928.00	27,097,600
D M G 森精機	59,400	1,717.00	101,989,800
ソディック	25,800	1,085.00	27,993,000
ディスコ	11,700	17,080.00	199,836,000
日東工器	6,300	2,549.00	16,058,700
O K K	54,000	126.00	6,804,000
津田駒工業	32,000	178.00	5,696,000

島精機製作所	13,000	3,835.00	49,855,000
フリー	2,400	4,660.00	11,184,000
ヤマシンフィルタ	2,500	1,770.00	4,425,000
日阪製作所	15,100	921.00	13,907,100
やまびこ	18,000	1,450.00	26,100,000
ペガサスミシン製造	11,300	846.00	9,559,800
ナプテスコ	52,200	3,215.00	167,823,000
三井海洋開発	10,100	2,440.00	24,644,000
レオン自動機	9,100	1,086.00	9,882,600
S M C	30,000	31,700.00	951,000,000
新川	10,100	821.00	8,292,100
ホソカワミクロン	19,000	822.00	15,618,000
ユニオンツール	4,600	3,595.00	16,537,000
オイレス工業	13,100	2,059.00	26,972,900
日精エー・エス・ビー機械	3,400	2,404.00	8,173,600
サトーホールディングス	12,500	2,499.00	31,237,500
日精樹脂工業	8,900	1,125.00	10,012,500
ワイエイシイ	4,500	1,347.00	6,061,500
小松製作所	462,100	2,801.00	1,294,342,100
住友重機械工業	292,000	823.00	240,316,000
日立建機	44,600	2,663.00	118,769,800
日工	4,000	2,104.00	8,416,000
巴工業	5,500	1,877.00	10,323,500
井関農機	106,000	258.00	27,348,000
T O W A	8,800	2,080.00	18,304,000
丸山製作所	32,000	195.00	6,240,000
北川鉄工所	5,200	2,460.00	12,792,000
ローツェ	3,900	2,535.00	9,886,500
クボタ	479,100	1,850.00	886,335,000
三菱化工機	38,000	224.00	8,512,000
月島機械	18,800	1,296.00	24,364,800
帝国電機製作所	8,600	1,047.00	9,004,200
新東工業	22,800	1,037.00	23,643,600
澁谷工業	8,500	2,913.00	24,760,500
アイチ コーポレーション	15,200	886.00	13,467,200
小森コーポレーション	23,600	1,522.00	35,919,200
鶴見製作所	7,800	1,540.00	12,012,000
住友精密工業	22,000	368.00	8,096,000
酒井重工業	22,000	340.00	7,480,000
荏原製作所	44,700	3,365.00	150,415,500
西島製作所	11,200	1,145.00	12,824,000
北越工業	12,600	975.00	12,285,000

ダイキン工業	130,600	10,720.00	1,400,032,000
オルガノ	22,000	498.00	10,956,000
トーヨーカネツ	48,000	318.00	15,264,000
栗田工業	56,700	2,735.00	155,074,500
椿本チエイン	56,000	987.00	55,272,000
大同工業	28,000	283.00	7,924,000
アネスト岩田	17,900	1,094.00	19,582,600
ダイフク	47,600	2,706.00	128,805,600
加藤製作所	5,400	3,065.00	16,551,000
タダノ	50,500	1,460.00	73,730,000
フジテック	27,600	1,310.00	36,156,000
C K D	28,400	1,496.00	42,486,400
キトー	12,600	1,251.00	15,762,600
平和	28,900	2,937.00	84,879,300
理想科学工業	9,100	2,122.00	19,310,200
SANKYO	26,600	3,965.00	105,469,000
日本金銭機械	9,200	1,504.00	13,836,800
マースエンジニアリング	5,900	2,297.00	13,552,300
福島工業	5,800	3,715.00	21,547,000
オーイズミ	5,200	683.00	3,551,600
ダイコク電機	4,500	1,867.00	8,401,500
竹内製作所	17,200	2,326.00	40,007,200
アマノ	29,000	2,278.00	66,062,000
JUKI	15,500	1,283.00	19,886,500
サンデンホールディングス	59,000	387.00	22,833,000
蛇の目マシン工業	10,600	796.00	8,437,600
マックス	15,000	1,527.00	22,905,000
グローリー	30,800	3,810.00	117,348,000
新晃工業	7,300	1,461.00	10,665,300
大和冷機工業	15,300	1,026.00	15,697,800
セガサミーホールディングス	95,100	1,678.00	159,577,800
日本ピストンリング	4,600	2,361.00	10,860,600
リケン	4,500	4,285.00	19,282,500
T P R	10,700	3,660.00	39,162,000
ツバキ・ナカシマ	11,000	1,944.00	21,384,000
ホシザキ	20,900	8,710.00	182,039,000
大豊工業	8,100	1,540.00	12,474,000
日本精工	195,800	1,616.00	316,412,800
NTN	221,000	546.00	120,666,000
ジェイテクト	101,300	1,886.00	191,051,800
不二越	98,000	614.00	60,172,000
日本トムソン	30,900	560.00	17,304,000

THK	67,700	2,982.00	201,881,400
ユーシン精機	4,500	2,924.00	13,158,000
前澤給装工業	5,100	1,529.00	7,797,900
イーグル工業	10,300	1,609.00	16,572,700
日本ピラー工業	10,600	1,569.00	16,631,400
キット	45,700	744.00	34,000,800
日立工機	25,100	867.00	21,761,700
マキタ	62,200	7,740.00	481,428,000
日立造船	78,000	645.00	50,310,000
三菱重工業	1,603,000	445.10	713,495,300
IHI	736,000	339.00	249,504,000
スター精密	16,700	1,671.00	27,905,700
日清紡ホールディングス	53,700	1,156.00	62,077,200
イビデン	67,000	1,919.00	128,573,000
コニカミノルタ	222,900	1,105.00	246,304,500
ブラザー工業	123,700	2,054.00	254,079,800
ミネベアミツミ	174,400	1,411.00	246,078,400
日立製作所	2,295,000	626.70	1,438,276,500
東芝	2,096,000	186.30	390,484,800
三菱電機	1,020,100	1,681.00	1,714,788,100
富士電機	288,000	629.00	181,152,000
東洋電機製造	5,000	1,734.00	8,670,000
安川電機	110,600	2,145.00	237,237,000
シンフォニアテクノロジー	64,000	306.00	19,584,000
明電舎	89,000	381.00	33,909,000
オリジン電気	23,000	317.00	7,291,000
山洋電気	26,000	884.00	22,984,000
デンヨー	9,600	1,785.00	17,136,000
東芝テック	60,000	601.00	36,060,000
芝浦メカトロニクス	21,000	282.00	5,922,000
マブチモーター	26,900	6,230.00	167,587,000
日本電産	124,000	10,690.00	1,325,560,000
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	1,100	2,934.00	3,227,400
東光高岳	5,200	2,197.00	11,424,400
ダブル・スコープ	9,500	1,842.00	17,499,000
ダイヘン	52,000	721.00	37,492,000
田淵電機	15,800	346.00	5,466,800
ヤーマン	1,400	6,160.00	8,624,000
JVCケンウッド	71,700	304.00	21,796,800
ミマキエンジニアリング	9,700	772.00	7,488,400
第一精工	5,200	1,796.00	9,339,200
日新電機	19,400	1,373.00	26,636,200

大崎電気工業	20,000	1,091.00	21,820,000
オムロン	101,400	4,855.00	492,297,000
日東工業	14,000	1,585.00	22,190,000
I D E C	13,600	1,187.00	16,143,200
ジーエス・ユアサ コーポレーション	186,000	501.00	93,186,000
サクサホールディングス	30,000	231.00	6,930,000
メルコホールディングス	5,500	3,355.00	18,452,500
テクノメディカ	2,800	2,187.00	6,123,600
日本電気	1,314,000	276.00	362,664,000
富士通	923,000	659.80	608,995,400
沖電気工業	41,800	1,592.00	66,545,600
岩崎通信機	40,000	91.00	3,640,000
電気興業	28,000	562.00	15,736,000
サンケン電気	57,000	514.00	29,298,000
アイホン	5,700	1,858.00	10,590,600
ルネサスエレクトロニクス	48,900	1,019.00	49,829,100
セイコーエプソン	141,900	2,560.00	363,264,000
ワコム	75,800	409.00	31,002,200
アルバック	16,100	5,110.00	82,271,000
E I Z O	9,500	3,265.00	31,017,500
ジャパンディスプレイ	178,400	282.00	50,308,800
日本信号	26,400	1,063.00	28,063,200
京三製作所	28,000	409.00	11,452,000
能美防災	10,700	1,492.00	15,964,400
ホーチキ	7,700	1,416.00	10,903,200
エレコム	8,600	2,026.00	17,423,600
日本無線	6,200	1,414.00	8,766,800
パナソニック	1,093,400	1,247.00	1,363,469,800
アンリツ	70,100	870.00	60,987,000
富士通ゼネラル	32,000	2,160.00	69,120,000
日立国際電気	24,800	2,385.00	59,148,000
ソニー	675,300	3,508.00	2,368,952,400
T D K	53,800	7,840.00	421,792,000
タムラ製作所	38,000	455.00	17,290,000
アルプス電気	88,200	3,465.00	305,613,000
池上通信機	42,000	154.00	6,468,000
パイオニア	145,200	229.00	33,250,800
日本電波工業	12,100	846.00	10,236,600
日本トリム	2,500	4,040.00	10,100,000
ローランド ディー . ジー .	5,000	3,550.00	17,750,000
フォスター電機	11,300	1,919.00	21,684,700
クラリオン	51,000	436.00	22,236,000

S M K	27,000	422.00	11,394,000
ヨコオ	8,100	1,320.00	10,692,000
ホシデン	29,100	1,005.00	29,245,500
ヒロセ電機	15,400	14,800.00	227,920,000
日本航空電子工業	28,000	1,539.00	43,092,000
T O A	11,900	1,009.00	12,007,100
日立マクセル	14,100	2,247.00	31,682,700
古野電気	13,300	770.00	10,241,000
ユニデンホールディングス	40,000	168.00	6,720,000
アルパイン	23,000	1,679.00	38,617,000
スミダコーポレーション	9,200	1,299.00	11,950,800
アイコム	5,800	2,379.00	13,798,200
リオン	4,700	1,574.00	7,397,800
本多通信工業	3,700	1,304.00	4,824,800
船井電機	11,400	950.00	10,830,000
横河電機	103,500	1,727.00	178,744,500
新電元工業	39,000	480.00	18,720,000
アズビル	29,100	3,555.00	103,450,500
日本光電工業	40,200	2,483.00	99,816,600
チノー	6,000	1,219.00	7,314,000
共和電業	17,900	449.00	8,037,100
堀場製作所	19,100	6,240.00	119,184,000
アドバンテスト	65,400	1,977.00	129,295,800
エスペック	9,000	1,285.00	11,565,000
パナソニック デバイス S U N X	9,700	843.00	8,177,100
キーエンス	43,300	44,250.00	1,916,025,000
日置電機	5,600	2,228.00	12,476,800
シスメックス	74,100	6,390.00	473,499,000
日本マイクロニクス	18,300	901.00	16,488,300
メガチップス	9,100	2,744.00	24,970,400
O B A R A G R O U P	5,500	4,995.00	27,472,500
コーセル	13,600	1,396.00	18,985,600
イリソ電子工業	3,000	7,140.00	21,420,000
オブテックスグループ	7,600	3,145.00	23,902,000
千代田インテグレ	5,200	2,407.00	12,516,400
アイ・オー・データ機器	3,600	1,253.00	4,510,800
レーザーテック	10,500	2,889.00	30,334,500
スタンレー電気	68,100	3,160.00	215,196,000
岩崎電気	44,000	174.00	7,656,000
ウシオ電機	58,700	1,456.00	85,467,200
ヘリオス テクノ ホールディング	11,900	610.00	7,259,000
日本セラミック	8,000	2,429.00	19,432,000

遠藤照明	7,400	935.00	6,919,000
古河電池	8,000	759.00	6,072,000
山一電機	9,500	1,543.00	14,658,500
図研	7,300	1,293.00	9,438,900
日本電子	35,000	537.00	18,795,000
カシオ計算機	77,100	1,553.00	119,736,300
ファナック	97,000	22,345.00	2,167,465,000
日本シイエムケイ	21,800	656.00	14,300,800
エンプラス	4,500	3,525.00	15,862,500
大真空	3,900	1,496.00	5,834,400
ローム	46,100	7,440.00	342,984,000
浜松ホトニクス	74,600	3,380.00	252,148,000
三井ハイテック	13,300	890.00	11,837,000
新光電気工業	35,100	784.00	27,518,400
京セラ	156,800	6,228.00	976,550,400
太陽誘電	46,800	1,530.00	71,604,000
村田製作所	100,300	16,390.00	1,643,917,000
ユーシン	14,100	803.00	11,322,300
双葉電子工業	15,500	2,018.00	31,279,000
北陸電気工業	50,000	142.00	7,100,000
ニチコン	29,500	1,063.00	31,358,500
日本ケミコン	85,000	319.00	27,115,000
K O A	13,500	1,331.00	17,968,500
市光工業	22,000	519.00	11,418,000
小糸製作所	57,000	5,820.00	331,740,000
ミツバ	17,600	2,249.00	39,582,400
S C R E E Nホールディングス	19,700	7,640.00	150,508,000
キャノン電子	8,200	1,786.00	14,645,200
キャノン	514,700	3,289.00	1,692,848,300
リコー	286,200	1,002.00	286,772,400
東京エレクトロン	63,800	11,180.00	713,284,000
トヨタ紡織	33,600	2,452.00	82,387,200
芦森工業	33,000	170.00	5,610,000
ユニプレス	18,400	2,336.00	42,982,400
豊田自動織機	87,100	5,550.00	483,405,000
モリタホールディングス	16,300	1,540.00	25,102,000
三櫻工業	15,000	864.00	12,960,000
デンソー	235,800	5,085.00	1,199,043,000
東海理化電機製作所	25,200	2,232.00	56,246,400
三井造船	342,000	178.00	60,876,000
川崎重工業	744,000	355.00	264,120,000
名村造船所	28,900	793.00	22,917,700

日本車輛製造	40,000	304.00	12,160,000	
ニチユ三菱フォークリフト	13,300	717.00	9,536,100	
日産自動車	1,128,300	1,116.50	1,259,746,950	
いすゞ自動車	278,100	1,540.50	428,413,050	
トヨタ自動車	1,163,400	6,432.00	7,482,988,800	代用有価証券 500,000株
日野自動車	136,000	1,321.00	179,656,000	
三菱自動車工業	350,700	681.00	238,826,700	
エフテック	6,600	1,339.00	8,837,400	
武蔵精密工業	11,300	2,816.00	31,820,800	
日産車体	42,900	1,089.00	46,718,100	
新明和工業	38,000	1,178.00	44,764,000	
極東開発工業	19,300	1,785.00	34,450,500	
日信工業	20,800	1,985.00	41,288,000	
トピー工業	8,000	3,255.00	26,040,000	
ティラド	45,000	311.00	13,995,000	
曙ブレーキ工業	48,800	284.00	13,859,200	
タチエス	16,600	2,101.00	34,876,600	
N O K	46,600	2,555.00	119,063,000	
フタバ産業	27,600	793.00	21,886,800	
K Y B	107,000	628.00	67,196,000	
大同メタル工業	13,500	1,031.00	13,918,500	
プレス工業	52,200	562.00	29,336,400	
ミクニ	19,100	433.00	8,270,300	
カルソニックカンセイ	65,000	1,285.00	83,525,000	
太平洋工業	19,900	1,448.00	28,815,200	
ケーヒン	22,000	1,971.00	43,362,000	
河西工業	13,400	1,386.00	18,572,400	
アイシン精機	87,100	5,660.00	492,986,000	
富士機工	14,100	544.00	7,670,400	
マツダ	303,600	1,588.50	482,268,600	
今仙電機製作所	10,800	1,008.00	10,886,400	
本田技研工業	860,500	3,574.00	3,075,427,000	
スズキ	189,800	4,404.00	835,879,200	
富士重工業	297,200	4,282.00	1,272,610,400	
安永	4,200	1,658.00	6,963,600	
ヤマハ発動機	134,800	2,587.00	348,727,600	
ショーワ	25,300	967.00	24,465,100	
T B K	17,900	529.00	9,469,100	
エクセディ	12,800	3,190.00	40,832,000	
豊田合成	31,000	2,842.00	88,102,000	
愛三工業	15,900	977.00	15,534,300	
ヨロズ	10,000	1,756.00	17,560,000	

エフ・シー・シー	15,900	2,254.00	35,838,600
シマノ	38,500	16,570.00	637,945,000
テイ・エス テック	22,500	2,918.00	65,655,000
ジャムコ	6,100	2,624.00	16,006,400
テルモ	146,600	3,895.00	571,007,000
日機装	32,900	1,216.00	40,006,400
島津製作所	122,900	1,879.00	230,929,100
JMS	27,000	325.00	8,775,000
ブイ・テクノロジー	2,000	17,340.00	34,680,000
東京計器	39,000	240.00	9,360,000
愛知時計電機	1,900	3,725.00	7,077,500
東京精密	18,300	3,835.00	70,180,500
マニー	12,800	2,719.00	34,803,200
ニコン	166,400	1,707.00	284,044,800
トプコン	47,900	2,023.00	96,901,700
オリンパス	152,400	3,940.00	600,456,000
理研計器	9,500	1,636.00	15,542,000
タムロン	8,700	2,115.00	18,400,500
H O Y A	197,100	5,060.00	997,326,000
ノーリツ鋼機	12,000	971.00	11,652,000
シチズン時計	105,300	738.00	77,711,400
リズム時計工業	50,000	187.00	9,350,000
大研医器	10,900	800.00	8,720,000
メニコン	6,600	3,520.00	23,232,000
松風	6,500	1,369.00	8,898,500
セイコーホールディングス	66,000	464.00	30,624,000
ニプロ	67,000	1,379.00	92,393,000
スノーピーク	1,700	2,841.00	4,829,700
パラマウントベッドホールディングス	9,300	4,155.00	38,641,500
トランザクション	2,400	2,090.00	5,016,000
ニホンフラッシュ	5,400	1,283.00	6,928,200
前田工織	10,100	1,326.00	13,392,600
永大産業	17,000	533.00	9,061,000
アートネイチャー	13,000	748.00	9,724,000
ダンロップスポーツ	7,900	1,039.00	8,208,100
バンダイナムコホールディングス	105,400	3,110.00	327,794,000
S H O E I	4,800	2,556.00	12,268,800
フランスベッドホールディングス	14,100	940.00	13,254,000
パイロットコーポレーション	16,600	4,590.00	76,194,000
萩原工業	3,400	2,616.00	8,894,400
トッパン・フォームズ	15,900	1,070.00	17,013,000
フジシールインターナショナル	21,200	2,271.00	48,145,200

タカラトミー	37,500	1,198.00	44,925,000
アーク	47,100	108.00	5,086,800
プロネクサス	10,200	1,235.00	12,597,000
大建工業	7,300	2,176.00	15,884,800
凸版印刷	270,000	1,129.00	304,830,000
大日本印刷	274,000	1,186.00	324,964,000
図書印刷	15,000	482.00	7,230,000
共同印刷	32,000	384.00	12,288,000
日本写真印刷	16,100	3,325.00	53,532,500
宝印刷	5,900	1,579.00	9,316,100
アシックス	95,200	1,956.00	186,211,200
ツツミ	3,900	2,116.00	8,252,400
小松ウオール工業	4,100	1,943.00	7,966,300
ヤマハ	64,100	2,932.00	187,941,200
河合楽器製作所	4,700	2,300.00	10,810,000
クリナップ	12,600	834.00	10,508,400
ピジョン	58,000	3,125.00	181,250,000
キングジム	11,000	857.00	9,427,000
リンテック	22,500	2,475.00	55,687,500
T A S A K I	3,300	1,512.00	4,989,600
イトーキ	21,000	728.00	15,288,000
任天堂	58,900	23,095.00	1,360,295,500
三菱鉛筆	7,600	5,640.00	42,864,000
タカラスタANDARD	19,500	1,914.00	37,323,000
コクヨ	49,900	1,557.00	77,694,300
ナカバヤシ	26,000	275.00	7,150,000
グローブライド	5,300	1,801.00	9,545,300
岡村製作所	33,300	1,021.00	33,999,300
美津濃	51,000	605.00	30,855,000
東京電力ホールディングス	810,100	433.00	350,773,300
中部電力	315,600	1,483.50	468,192,600
関西電力	390,600	1,243.00	485,515,800
中国電力	130,800	1,223.00	159,968,400
北陸電力	93,900	1,117.00	104,886,300
東北電力	237,300	1,440.00	341,712,000
四国電力	86,300	1,093.00	94,325,900
九州電力	210,600	1,243.00	261,775,800
北海道電力	90,000	807.00	72,630,000
沖縄電力	13,800	2,614.00	36,073,200
電源開発	76,000	2,690.00	204,440,000
エフオン	4,900	1,001.00	4,904,900
イーレックス	4,100	3,670.00	15,047,000

東京瓦斯	1,027,000	516.20	530,137,400
大阪瓦斯	930,000	431.50	401,295,000
東邦瓦斯	240,000	794.00	190,560,000
北海道瓦斯	34,000	278.00	9,452,000
広島ガス	25,000	372.00	9,300,000
西部瓦斯	108,000	262.00	28,296,000
静岡ガス	28,200	721.00	20,332,200
メタウォーター	5,400	2,945.00	15,903,000
SBSホールディングス	10,300	833.00	8,579,900
東武鉄道	508,000	573.00	291,084,000
相鉄ホールディングス	155,000	568.00	88,040,000
東京急行電鉄	520,000	826.00	429,520,000
京浜急行電鉄	263,000	1,221.00	321,123,000
小田急電鉄	152,500	2,232.00	340,380,000
京王電鉄	265,000	883.00	233,995,000
京成電鉄	71,600	2,654.00	190,026,400
富士急行	27,000	1,011.00	27,297,000
新京成電鉄	19,000	420.00	7,980,000
東日本旅客鉄道	185,000	10,275.00	1,900,875,000
西日本旅客鉄道	92,200	7,350.00	677,670,000
東海旅客鉄道	79,500	18,620.00	1,480,290,000
西武ホールディングス	132,200	1,965.00	259,773,000
鴻池運輸	13,200	1,425.00	18,810,000
西日本鉄道	117,000	489.00	57,213,000
ハマキョウレックス	6,900	2,083.00	14,372,700
サカイ引越センター	3,600	3,100.00	11,160,000
近鉄グループホールディングス	956,000	420.00	401,520,000
阪急阪神ホールディングス	120,600	3,760.00	453,456,000
南海電気鉄道	201,000	552.00	110,952,000
京阪ホールディングス	216,000	717.00	154,872,000
神戸電鉄	30,000	381.00	11,430,000
名古屋鉄道	348,000	522.00	181,656,000
山陽電気鉄道	34,000	607.00	20,638,000
日本通運	367,000	569.00	208,823,000
ヤマトホールディングス	171,300	2,248.50	385,168,050
山九	127,000	716.00	90,932,000
丸全昭和運輸	34,000	449.00	15,266,000
センコー	43,600	720.00	31,392,000
トナミホールディングス	24,000	352.00	8,448,000
ニッコンホールディングス	32,700	2,410.00	78,807,000
福山通運	59,000	649.00	38,291,000
セイノーホールディングス	67,600	1,248.00	84,364,800

神奈川中央交通	13,000	722.00	9,386,000
日立物流	19,100	2,346.00	44,808,600
丸和運輸機関	2,800	2,571.00	7,198,800
C & F ロジホールディングス	10,800	1,577.00	17,031,600
九州旅客鉄道	71,200	3,385.00	241,012,000
日本郵船	807,000	247.00	199,329,000
商船三井	502,000	364.00	182,728,000
川崎汽船	365,000	296.00	108,040,000
N S ユナイテッド海運	49,000	230.00	11,270,000
飯野海運	52,800	510.00	26,928,000
乾汽船	9,000	993.00	8,937,000
日本航空	172,400	3,660.00	630,984,000
A N A ホールディングス	1,774,000	327.40	580,807,600
パスコ	11,000	412.00	4,532,000
トランコム	2,900	5,500.00	15,950,000
日新	43,000	364.00	15,652,000
三菱倉庫	63,000	1,582.00	99,666,000
三井倉庫ホールディングス	57,000	335.00	19,095,000
住友倉庫	72,000	634.00	45,648,000
澁澤倉庫	32,000	351.00	11,232,000
東陽倉庫	26,200	298.00	7,807,600
日本トランスシティ	28,000	461.00	12,908,000
安田倉庫	10,400	782.00	8,132,800
東洋埠頭	38,000	189.00	7,182,000
上組	114,000	1,055.00	120,270,000
キューソー流通システム	4,000	2,644.00	10,576,000
郵船ロジスティクス	10,000	1,177.00	11,770,000
近鉄エクスプレス	16,900	1,702.00	28,763,800
エーアイティー	7,600	1,095.00	8,322,000
N E C ネットエスアイ	10,400	2,124.00	22,089,600
システナ	8,200	1,630.00	13,366,000
デジタルアーツ	4,500	3,310.00	14,895,000
新日鉄住金ソリューションズ	15,800	2,285.00	36,103,000
コア	4,900	1,385.00	6,786,500
ソフトクリエイイトホールディングス	6,200	1,335.00	8,277,000
T I S	31,900	2,696.00	86,002,400
電算システム	4,100	1,705.00	6,990,500
グリー	58,200	674.00	39,226,800
コーエーテクモホールディングス	22,300	2,180.00	48,614,000
三菱総合研究所	4,000	3,185.00	12,740,000
ファインデックス	8,000	963.00	7,704,000
ヒト・コミュニケーションズ	3,000	1,675.00	5,025,000

ブレインパッド	2,000	1,189.00	2,378,000
K L a b	19,200	808.00	15,513,600
ポルトウウィン・ピットクルーホールディングス	8,400	1,097.00	9,214,800
ネクソン	103,900	1,925.00	200,007,500
アイスタイル	15,300	979.00	14,978,700
エイチーム	5,500	2,136.00	11,748,000
テクノスジャパン	7,600	1,240.00	9,424,000
コロプラ	27,100	1,025.00	27,777,500
モバイルクリエイト	9,100	407.00	3,703,700
ブロードリーフ	25,200	633.00	15,951,600
ハーツユナイテッドグループ	5,200	1,504.00	7,820,800
メディアドゥ	2,700	1,716.00	4,633,200
バイキューブ	6,800	622.00	4,229,600
ディー・エル・イー	4,200	623.00	2,616,600
フィックスターズ	1,600	3,650.00	5,840,000
VOYAGE GROUP	4,500	1,651.00	7,429,500
オブティム	1,100	5,260.00	5,786,000
ベリサーブ	1,300	2,967.00	3,857,100
ティーガイア	9,400	1,866.00	17,540,400
日本アジアグループ	15,000	413.00	6,195,000
豆蔵ホールディングス	8,100	885.00	7,168,500
テクマトリックス	3,500	2,573.00	9,005,500
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	196,800	256.00	50,380,800
GMOペイメントゲートウェイ	7,800	6,480.00	50,544,000
インターネットイニシアティブ	14,400	2,026.00	29,174,400
さくらインターネット	7,700	1,138.00	8,762,600
SRAホールディングス	5,500	2,795.00	15,372,500
フリービット	6,400	973.00	6,227,200
コムチュア	2,000	3,520.00	7,040,000
メディカル・データ・ビジョン	1,900	2,679.00	5,090,100
gumi	10,600	1,254.00	13,292,400
PCIホールディングス	1,300	2,876.00	3,738,800
LINE	16,000	3,540.00	56,640,000
AOI TYO Holdings	9,000	842.00	7,578,000
フェイス	4,600	1,349.00	6,205,400
野村総合研究所	70,500	3,895.00	274,597,500
サイバネットシステム	9,300	823.00	7,653,900
インテージホールディングス	6,300	2,172.00	13,683,600
ソースネクスト	7,000	651.00	4,557,000
クレスコ	2,800	2,493.00	6,980,400
フジ・メディア・ホールディングス	98,500	1,537.00	151,394,500
オービック	32,700	5,350.00	174,945,000

ジャストシステム	15,400	1,215.00	18,711,000
TDCソフトウェアエンジニアリング	5,000	1,246.00	6,230,000
ヤフー	676,000	527.00	356,252,000
トレンドマイクロ	50,100	4,840.00	242,484,000
日本オラクル	15,300	6,600.00	100,980,000
アルファシステムズ	4,400	1,975.00	8,690,000
フューチャー	14,700	899.00	13,215,300
CAC Holdings	9,700	1,085.00	10,524,500
ソフトバンク・テクノロジー	2,500	4,125.00	10,312,500
オービックビジネスコンサルタント	4,800	5,560.00	26,688,000
伊藤忠テクノソリューションズ	21,700	3,150.00	68,355,000
アイティフォー	14,900	655.00	9,759,500
大塚商会	25,400	5,890.00	149,606,000
サイボウズ	16,700	443.00	7,398,100
ソフトブレーン	14,800	456.00	6,748,800
電通国際情報サービス	6,400	2,219.00	14,201,600
デジタルガレージ	14,300	2,062.00	29,486,600
EMシステムズ	4,400	1,627.00	7,158,800
ウェザーニューズ	3,800	3,565.00	13,547,000
日本エンタープライズ	12,000	281.00	3,372,000
WOWOW	4,500	3,670.00	16,515,000
スカラ	6,800	857.00	5,827,600
イマジカ・ロボットホールディングス	9,100	794.00	7,225,400
ネットワンシステムズ	42,100	883.00	37,174,300
システムソフト	19,000	153.00	2,907,000
アルゴグラフィックス	5,300	2,463.00	13,053,900
マーベラス	16,800	964.00	16,195,200
エイベックス・グループ・ホールディングス	17,900	1,610.00	28,819,000
日本ユニシス	26,200	1,520.00	39,824,000
兼松エレクトロニクス	6,000	2,577.00	15,462,000
東京放送ホールディングス	62,600	2,044.00	127,954,400
日本テレビホールディングス	86,300	2,020.00	174,326,000
朝日放送	12,600	780.00	9,828,000
テレビ朝日ホールディングス	26,300	2,313.00	60,831,900
スカパーJ S A Tホールディングス	61,900	500.00	30,950,000
テレビ東京ホールディングス	7,900	2,574.00	20,334,600
ワイヤレスゲート	4,000	1,541.00	6,164,000
コネクシオ	8,700	1,569.00	13,650,300
日本通信	42,800	180.00	7,704,000
日本電信電話	758,200	4,771.00	3,617,372,200
KDDI	934,400	2,935.50	2,742,931,200
光通信	11,400	10,970.00	125,058,000

NTTドコモ	705,400	2,691.00	1,898,231,400
エムティーアイ	15,600	686.00	10,701,600
GMOインターネット	34,300	1,522.00	52,204,600
カドカワ	27,300	1,620.00	44,226,000
学研ホールディングス	36,000	308.00	11,088,000
ゼンリン	12,700	2,194.00	27,863,800
アイネット	7,000	1,228.00	8,596,000
松竹	63,000	1,319.00	83,097,000
東宝	61,800	3,260.00	201,468,000
東映	35,000	1,004.00	35,140,000
エヌ・ティ・ティ・データ	58,400	5,360.00	313,024,000
D T S	9,900	2,587.00	25,611,300
スクウェア・エニックス・ホールディングス	36,600	3,405.00	124,623,000
シーイーシー	6,000	1,839.00	11,034,000
カプコン	22,400	2,391.00	53,558,400
ジャステック	8,100	1,035.00	8,383,500
S C S K	25,800	4,165.00	107,457,000
日本システムウエア	3,900	1,614.00	6,294,600
アイネス	13,000	1,144.00	14,872,000
T K C	8,900	3,420.00	30,438,000
富士ソフト	14,100	2,824.00	39,818,400
N S D	19,800	1,751.00	34,669,800
コナミホールディングス	42,800	4,605.00	197,094,000
福井コンピュータホールディングス	3,000	2,830.00	8,490,000
J B C Cホールディングス	11,000	806.00	8,866,000
ミロク情報サービス	7,700	1,789.00	13,775,300
ソフトバンクグループ	425,200	8,789.00	3,737,082,800
伊藤忠食品	2,600	4,515.00	11,739,000
エレマテック	4,400	1,962.00	8,632,800
J A L U X	4,000	2,218.00	8,872,000
あらた	4,700	2,839.00	13,343,300
東京エレクトロン デバイス	4,200	1,599.00	6,715,800
フィールズ	8,100	1,250.00	10,125,000
双日	558,900	292.00	163,198,800
アルフレッサ ホールディングス	111,500	1,999.00	222,888,500
横浜冷凍	25,000	1,055.00	26,375,000
アルコニックス	6,700	1,779.00	11,919,300
神戸物産	5,100	3,755.00	19,150,500
あい ホールディングス	13,500	2,249.00	30,361,500
ダイワボウホールディングス	82,000	295.00	24,190,000
マクニカ・富士エレホールディングス	16,900	1,685.00	28,476,500
バイタルケーエスケー・ホールディングス	18,000	1,014.00	18,252,000

U K Cホールディングス	6,600	2,238.00	14,770,800
T O K A Iホールディングス	43,100	838.00	36,117,800
三洋貿易	5,900	1,817.00	10,720,300
ウイン・パートナーズ	8,100	988.00	8,002,800
シップヘルスケアホールディングス	18,300	2,978.00	54,497,400
コメダホールディングス	13,500	1,925.00	25,987,500
小野建	9,200	1,421.00	13,073,200
佐島電機	11,200	798.00	8,937,600
伯東	8,400	1,077.00	9,046,800
コンドーテック	10,900	874.00	9,526,600
ナガイレーベン	13,800	2,471.00	34,099,800
三菱食品	10,100	3,470.00	35,047,000
松田産業	7,700	1,596.00	12,289,200
第一興商	15,800	4,735.00	74,813,000
メディパルホールディングス	94,300	1,838.00	173,323,400
萩原電気	4,200	2,177.00	9,143,400
アズワン	7,500	5,010.00	37,575,000
尾家産業	5,400	1,164.00	6,285,600
シモジマ	7,100	1,199.00	8,512,900
ドウシシャ	11,400	2,130.00	24,282,000
小津産業	3,400	2,173.00	7,388,200
高速	8,400	1,115.00	9,366,000
黒田電気	12,600	2,285.00	28,791,000
丸文	10,900	735.00	8,011,500
ハピネット	8,800	1,458.00	12,830,400
日本ライフライン	8,200	2,040.00	16,728,000
エクセル	5,100	1,499.00	7,644,900
マルカキカイ	4,800	1,892.00	9,081,600
I D O M	26,000	750.00	19,500,000
日本エム・ディ・エム	8,300	765.00	6,349,500
進和	7,100	1,783.00	12,659,300
シークス	6,800	4,240.00	28,832,000
オーハシテクニカ	6,600	1,439.00	9,497,400
伊藤忠商事	692,300	1,629.00	1,127,756,700
丸紅	932,500	730.40	681,098,000
長瀬産業	57,500	1,649.00	94,817,500
蝶理	6,700	1,998.00	13,386,600
豊田通商	104,300	3,335.00	347,840,500
三共生興	20,300	414.00	8,404,200
兼松	199,000	195.00	38,805,000
三井物産	854,600	1,703.00	1,455,383,800
日本紙パルプ商事	51,000	372.00	18,972,000

日立ハイテクノロジーズ	32,800	4,815.00	157,932,000
カメイ	12,800	1,355.00	17,344,000
スターゼン	4,200	4,885.00	20,517,000
山善	36,100	1,064.00	38,410,400
住友商事	595,500	1,494.50	889,974,750
内田洋行	5,400	2,556.00	13,802,400
三菱商事	709,000	2,609.50	1,850,135,500
第一実業	24,000	783.00	18,792,000
キャノンマーケティングジャパン	27,200	2,280.00	62,016,000
西華産業	36,000	364.00	13,104,000
佐藤商事	11,300	880.00	9,944,000
菱洋エレクトロ	9,800	1,586.00	15,542,800
東京産業	12,500	474.00	5,925,000
ユアサ商事	8,900	3,280.00	29,192,000
阪和興業	96,000	779.00	74,784,000
カナデン	11,200	1,048.00	11,737,600
菱電商事	17,000	735.00	12,495,000
フルサト工業	6,200	1,737.00	10,769,400
岩谷産業	108,000	665.00	71,820,000
すてきナイスグループ	56,000	152.00	8,512,000
三愛石油	25,300	894.00	22,618,200
稲畑産業	22,300	1,511.00	33,695,300
G S I クレオス	34,000	151.00	5,134,000
ワキタ	21,000	1,072.00	22,512,000
東邦ホールディングス	30,600	2,479.00	75,857,400
サンゲツ	33,500	1,929.00	64,621,500
ミツウロコグループホールディングス	17,100	744.00	12,722,400
シナネンホールディングス	5,100	2,298.00	11,719,800
伊藤忠エネクス	20,700	944.00	19,540,800
サンリオ	30,200	2,190.00	66,138,000
サンワテクノス	8,500	1,081.00	9,188,500
リョーサン	14,500	3,675.00	53,287,500
新光商事	11,400	1,350.00	15,390,000
トーホー	5,400	2,535.00	13,689,000
三信電気	11,500	1,350.00	15,525,000
東陽テクニカ	14,200	1,019.00	14,469,800
モスフードサービス	12,400	3,330.00	41,292,000
加賀電子	8,700	2,042.00	17,765,400
ソーダニッカ	15,800	520.00	8,216,000
立花エレテック	7,400	1,322.00	9,782,800
P A L T A C	14,800	3,135.00	46,398,000
三谷産業	15,900	379.00	6,026,100

太平洋興発	63,000	108.00	6,804,000
ヤマタネ	6,400	1,628.00	10,419,200
日鉄住金物産	8,000	4,890.00	39,120,000
トラスコ中山	21,400	2,568.00	54,955,200
オートバックスセブン	35,900	1,802.00	64,691,800
加藤産業	14,500	2,932.00	42,514,000
イノテック	12,000	696.00	8,352,000
イエローハット	9,100	2,789.00	25,379,900
J Kホールディングス	13,900	672.00	9,340,800
日伝	4,500	3,500.00	15,750,000
杉本商事	6,700	1,558.00	10,438,600
因幡電機産業	13,100	4,000.00	52,400,000
バイテックホールディングス	5,600	1,375.00	7,700,000
ミスミグループ本社	106,400	2,075.00	220,780,000
タキヒヨー	20,000	483.00	9,660,000
スズケン	43,000	3,835.00	164,905,000
ジェコス	7,900	1,130.00	8,927,000
ローソン	32,800	8,010.00	262,728,000
サンエー	7,000	5,170.00	36,190,000
カワチ薬品	7,500	2,997.00	22,477,500
エービーシー・マート	17,300	6,710.00	116,083,000
ハードオフコーポレーション	6,200	1,171.00	7,260,200
アスクル	9,800	3,315.00	32,487,000
ゲオホールディングス	16,500	1,365.00	22,522,500
アダストリア	14,700	2,956.00	43,453,200
くらコーポレーション	6,200	4,640.00	28,768,000
キャンドゥ	6,200	1,814.00	11,246,800
パルグループホールディングス	5,100	2,779.00	14,172,900
エディオン	36,000	1,030.00	37,080,000
サーラコーポレーション	15,100	625.00	9,437,500
ハローズ	3,400	2,359.00	8,020,600
あみやき亭	2,300	4,070.00	9,361,000
ひらまつ	16,100	660.00	10,626,000
ゲンキー	2,200	6,440.00	14,168,000
大黒天物産	2,500	5,030.00	12,575,000
ハニーズ	9,500	1,113.00	10,573,500
アルペン	8,700	1,964.00	17,086,800
クオール	11,200	1,534.00	17,180,800
ジェイアイエヌ	6,500	5,970.00	38,805,000
ビックカメラ	53,400	1,074.00	57,351,600
D C Mホールディングス	57,200	993.00	56,799,600
MonotaRO	33,500	3,235.00	108,372,500

アークランドサービスホールディングス	3,500	3,205.00	11,217,500
J.フロント リテイリング	119,200	1,720.00	205,024,000
ドトール・日レスホールディングス	16,500	2,239.00	36,943,500
マツモトキヨシホールディングス	17,900	5,280.00	94,512,000
ブロンコビリー	5,300	2,804.00	14,861,200
スタートトゥデイ	86,600	2,487.00	215,374,200
物語コーポレーション	2,900	4,460.00	12,934,000
ココカラファイン	9,700	4,680.00	45,396,000
三越伊勢丹ホールディングス	187,400	1,383.00	259,174,200
ウエルシアホールディングス	9,100	6,290.00	57,239,000
クリエイティブSDホールディングス	13,700	2,572.00	35,236,400
チムニー	3,200	2,859.00	9,148,800
シュッピン	4,100	1,470.00	6,027,000
ネクステージ	2,300	2,832.00	6,513,600
ジョイフル本田	15,200	3,465.00	52,668,000
烏貴族	2,800	2,427.00	6,795,600
ホットランド	5,800	1,032.00	5,985,600
すかいらーく	40,400	1,604.00	64,801,600
綿半ホールディングス	4,600	1,621.00	7,456,600
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホール	28,200	1,010.00	28,482,000
ブックオフコーポレーション	8,300	857.00	7,113,100
ゴルフダイジェスト・オンライン	4,600	790.00	3,634,000
あさひ	8,000	1,311.00	10,488,000
日本調剤	3,700	3,730.00	13,801,000
コスモス薬品	4,800	21,210.00	101,808,000
セブン&アイ・ホールディングス	395,000	4,401.00	1,738,395,000
薬王堂	5,200	2,428.00	12,625,600
クリエイティブ・レストランツ・ホールディング	24,100	1,031.00	24,847,100
ツルハホールディングス	18,900	10,480.00	198,072,000
サンマルクホールディングス	6,200	3,490.00	21,638,000
トリドールホールディングス	11,800	2,366.00	27,918,800
パロックジャパンリミテッド	6,200	1,405.00	8,711,000
クスリのアオキホールディングス	7,400	4,775.00	35,335,000
メディカルシステムネットワーク	13,700	454.00	6,219,800
総合メディカル	4,700	3,995.00	18,776,500
ノジマ	11,800	1,406.00	16,590,800
カッパ・クリエイティブ	14,100	1,279.00	18,033,900
ライトオン	8,200	983.00	8,060,600
良品計画	12,500	22,430.00	280,375,000
三城ホールディングス	16,700	476.00	7,949,200
アドヴァン	10,400	1,159.00	12,053,600
アルビス	2,900	3,255.00	9,439,500

コナカ	15,600	600.00	9,360,000
G - 7ホールディングス	3,300	2,101.00	6,933,300
コーナン商事	13,700	2,182.00	29,893,400
エコス	5,400	1,210.00	6,534,000
ワタミ	12,900	1,144.00	14,757,600
ドンキホーテホールディングス	61,100	3,935.00	240,428,500
西松屋チェーン	16,700	1,300.00	21,710,000
ゼンショーホールディングス	49,800	1,894.00	94,321,200
幸楽苑ホールディングス	7,800	1,677.00	13,080,600
サイゼリヤ	15,400	2,640.00	40,656,000
V Tホールディングス	32,400	524.00	16,977,600
魚力	5,100	1,300.00	6,630,000
ユナイテッドアローズ	12,700	3,495.00	44,386,500
ハイデイ日高	8,600	2,890.00	24,854,000
京都きもの友禅	8,800	995.00	8,756,000
コロワイド	31,000	1,866.00	57,846,000
ピーシーデポコーポレーション	13,900	559.00	7,770,100
壱番屋	6,600	3,775.00	24,915,000
スギホールディングス	20,800	5,350.00	111,280,000
スクロール	19,700	352.00	6,934,400
ヨンドシーホールディングス	7,300	2,557.00	18,666,100
ユニー・ファミリーマートホールディングス	41,300	7,050.00	291,165,000
木曾路	12,000	2,369.00	28,428,000
サトレストランシステムズ	13,800	865.00	11,937,000
千趣会	19,200	794.00	15,244,800
ケーヨー	20,800	585.00	12,168,000
上新電機	23,000	1,089.00	25,047,000
日本瓦斯	17,400	3,345.00	58,203,000
ベスト電器	37,700	142.00	5,353,400
ロイヤルホールディングス	15,400	2,012.00	30,984,800
いなげや	10,600	1,567.00	16,610,200
島忠	24,700	2,844.00	70,246,800
チヨダ	11,000	2,747.00	30,217,000
ライフコーポレーション	7,200	3,315.00	23,868,000
リンガーハット	11,200	2,293.00	25,681,600
Mr Max	16,200	418.00	6,771,600
A O K Iホールディングス	18,700	1,421.00	26,572,700
オークワ	14,000	1,118.00	15,652,000
コメリ	15,300	2,740.00	41,922,000
青山商事	19,900	4,150.00	82,585,000
しまむら	10,900	14,520.00	158,268,000
高島屋	159,000	1,000.00	159,000,000

松屋	21,300	1,007.00	21,449,100
エイチ・ツー・オー リテイリング	48,900	1,870.00	91,443,000
近鉄百貨店	40,000	357.00	14,280,000
パルコ	9,800	1,138.00	11,152,400
丸井グループ	99,600	1,561.00	155,475,600
アクシアル リテイリング	7,300	4,500.00	32,850,000
イオン	389,000	1,703.00	662,467,000
イズミ	18,800	4,905.00	92,214,000
平和堂	18,800	2,680.00	50,384,000
フジ	10,700	2,401.00	25,690,700
ヤオコー	10,400	4,560.00	47,424,000
ゼビオホールディングス	13,000	1,795.00	23,335,000
ケーズホールディングス	44,000	2,088.00	91,872,000
Olympicグループ	9,100	637.00	5,796,700
日産東京販売ホールディングス	18,400	352.00	6,476,800
アインホールディングス	11,500	8,530.00	98,095,000
元気寿司	3,700	2,269.00	8,395,300
ヤマダ電機	315,600	577.00	182,101,200
アークランドサカモト	16,600	1,423.00	23,621,800
ニトリホールディングス	40,800	12,250.00	499,800,000
グルメ杵屋	9,000	1,041.00	9,369,000
愛眼	21,800	197.00	4,294,600
吉野家ホールディングス	34,200	1,666.00	56,977,200
松屋フーズ	4,700	4,170.00	19,599,000
サガミチェーン	13,600	1,376.00	18,713,600
関西スーパーマーケット	8,400	1,534.00	12,885,600
王将フードサービス	7,000	4,245.00	29,715,000
プレナス	10,500	2,495.00	26,197,500
ミニストップ	7,600	2,166.00	16,461,600
アークス	17,500	2,585.00	45,237,500
パローホールディングス	20,900	2,774.00	57,976,600
ベルク	4,200	4,530.00	19,026,000
大庄	6,600	1,595.00	10,527,000
ファーストリテイリング	15,800	34,990.00	552,842,000
サンドラッグ	18,000	7,440.00	133,920,000
サクスパー ホールディングス	9,600	1,255.00	12,048,000
ヤマザワ	3,600	1,859.00	6,692,400
やまや	2,900	1,721.00	4,990,900
ベルーナ	23,600	849.00	20,036,400
じもとホールディングス	72,600	196.00	14,229,600
めぶきフィナンシャルグループ	453,300	488.00	221,210,400
東京ＴＹフィナンシャルグループ	13,900	4,000.00	55,600,000

九州フィナンシャルグループ	153,900	794.00	122,196,600	
ゆうちょ銀行	265,800	1,425.00	378,765,000	
富山第一銀行	26,000	551.00	14,326,000	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	617,900	613.90	379,328,810	
西日本フィナンシャルホールディングス	64,600	1,259.00	81,331,400	
新生銀行	895,000	209.00	187,055,000	
あおぞら銀行	597,000	417.00	248,949,000	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	7,155,000	767.80	5,493,609,000	
りそなホールディングス	1,103,000	629.40	694,228,200	
三井住友トラスト・ホールディングス	196,800	4,225.00	831,480,000	
三井住友フィナンシャルグループ	756,000	4,549.00	3,439,044,000	
第四銀行	116,000	537.00	62,292,000	
北越銀行	10,400	2,744.00	28,537,600	
千葉銀行	362,000	788.00	285,256,000	
群馬銀行	210,700	670.00	141,169,000	
武蔵野銀行	15,300	3,710.00	56,763,000	
千葉興業銀行	24,800	630.00	15,624,000	
筑波銀行	37,500	353.00	13,237,500	
七十七銀行	149,000	538.00	80,162,000	
青森銀行	75,000	394.00	29,550,000	
秋田銀行	62,000	368.00	22,816,000	
山形銀行	53,000	495.00	26,235,000	
岩手銀行	6,300	4,785.00	30,145,500	
東邦銀行	85,000	441.00	37,485,000	
東北銀行	50,000	160.00	8,000,000	
みちのく銀行	50,000	191.00	9,550,000	
ふくおかフィナンシャルグループ	382,000	505.00	192,910,000	
静岡銀行	256,000	1,018.00	260,608,000	
十六銀行	127,000	413.00	52,451,000	
スルガ銀行	96,200	2,562.00	246,464,400	
八十二銀行	179,600	723.00	129,850,800	
山梨中央銀行	59,000	557.00	32,863,000	
大垣共立銀行	126,000	453.00	57,078,000	
福井銀行	83,000	284.00	23,572,000	
北國銀行	101,000	479.00	48,379,000	
清水銀行	3,500	3,780.00	13,230,000	
富山銀行	2,000	4,180.00	8,360,000	
滋賀銀行	89,000	634.00	56,426,000	
南都銀行	9,300	4,730.00	43,989,000	
百五銀行	85,000	520.00	44,200,000	
京都銀行	168,000	964.00	161,952,000	
紀陽銀行	35,100	1,923.00	67,497,300	

三重銀行	4,500	2,531.00	11,389,500
ほくほくフィナンシャルグループ	62,300	2,053.00	127,901,900
広島銀行	277,000	550.00	152,350,000
山陰合同銀行	57,300	1,029.00	58,961,700
中国銀行	65,900	1,813.00	119,476,700
鳥取銀行	3,100	1,936.00	6,001,600
伊予銀行	101,000	842.00	85,042,000
百十四銀行	106,000	401.00	42,506,000
四国銀行	70,000	315.00	22,050,000
阿波銀行	81,000	760.00	61,560,000
大分銀行	56,000	450.00	25,200,000
宮崎銀行	65,000	378.00	24,570,000
佐賀銀行	58,000	313.00	18,154,000
十八銀行	60,000	364.00	21,840,000
沖縄銀行	9,400	4,230.00	39,762,000
琉球銀行	19,900	1,663.00	33,093,700
セブン銀行	356,600	331.00	118,034,600
みずほフィナンシャルグループ	12,817,500	210.40	2,696,802,000
高知銀行	37,000	138.00	5,106,000
山口フィナンシャルグループ	89,000	1,321.00	117,569,000
長野銀行	3,500	2,022.00	7,077,000
名古屋銀行	8,100	4,365.00	35,356,500
北洋銀行	154,400	479.00	73,957,600
愛知銀行	3,200	7,120.00	22,784,000
第三銀行	5,300	1,757.00	9,312,100
中京銀行	3,600	2,305.00	8,298,000
大光銀行	36,000	252.00	9,072,000
愛媛銀行	11,600	1,419.00	16,460,400
トマト銀行	3,700	1,631.00	6,034,700
みなと銀行	8,900	2,438.00	21,698,200
京葉銀行	78,000	548.00	42,744,000
関西アーバン銀行	13,500	1,579.00	21,316,500
栃木銀行	53,700	593.00	31,844,100
北日本銀行	3,000	3,170.00	9,510,000
東和銀行	177,000	127.00	22,479,000
福島銀行	108,000	97.00	10,476,000
大東銀行	52,000	172.00	8,944,000
トモニホールディングス	77,800	654.00	50,881,200
フィデアホールディングス	95,600	217.00	20,745,200
池田泉州ホールディングス	99,600	521.00	51,891,600
F P G	34,400	1,113.00	38,287,200
S B I ホールディングス	106,800	1,547.00	165,219,600

ジャフコ	15,700	3,940.00	61,858,000
大和証券グループ本社	883,000	711.00	627,813,000
野村ホールディングス	1,930,600	750.00	1,447,950,000
岡三証券グループ	82,000	758.00	62,156,000
丸三証券	30,800	962.00	29,629,600
東洋証券	38,000	272.00	10,336,000
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	108,400	647.00	70,134,800
光世証券	25,000	191.00	4,775,000
水戸証券	30,800	312.00	9,609,600
いちよし証券	21,600	900.00	19,440,000
松井証券	54,900	933.00	51,221,700
マネックスグループ	104,700	294.00	30,781,800
カブドットコム証券	70,100	391.00	27,409,100
極東証券	12,700	1,681.00	21,348,700
岩井コスモホールディングス	10,000	1,107.00	11,070,000
藍澤証券	16,500	647.00	10,675,500
マネーパートナーズグループ	14,000	531.00	7,434,000
かんぽ生命保険	35,800	2,780.00	99,524,000
S O M P Oホールディングス	197,100	4,281.00	843,785,100
アニコム ホールディングス	7,300	2,260.00	16,498,000
M S & A D インシュアランスグループホールディングス	282,300	3,845.00	1,085,443,500
ソニーフィナンシャルホールディングス	90,900	2,017.00	183,345,300
第一生命ホールディングス	568,900	2,206.50	1,255,277,850
東京海上ホールディングス	382,500	5,089.00	1,946,542,500
T & Dホールディングス	343,600	1,808.00	621,228,800
アドバンスクリエイト	2,500	2,082.00	5,205,000
全国保証	26,800	3,620.00	97,016,000
クレディセゾン	71,400	2,175.00	155,295,000
アクリーティブ	9,300	398.00	3,701,400
芙蓉総合リース	10,900	5,300.00	57,770,000
興銀リース	17,700	2,502.00	44,285,400
東京センチュリー	18,800	3,900.00	73,320,000
日本証券金融	43,100	632.00	27,239,200
アイフル	159,000	355.00	56,445,000
ポケットカード	7,800	607.00	4,734,600
リコーリース	7,700	3,650.00	28,105,000
イオンフィナンシャルサービス	60,300	2,124.00	128,077,200
アコム	189,000	494.00	93,366,000
ジャックス	54,000	508.00	27,432,000
オリエントコーポレーション	202,200	215.00	43,473,000
日立キャピタル	22,300	2,945.00	65,673,500
アプラスフィナンシャル	48,900	119.00	5,819,100

オリックス	668,900	1,762.00	1,178,601,800
三菱UFJリース	238,200	620.00	147,684,000
日本取引所グループ	293,100	1,602.00	469,546,200
イー・ギャランティ	2,800	2,613.00	7,316,400
NECキャピタルソリューション	4,000	1,823.00	7,292,000
いちご	88,900	366.00	32,537,400
日本駐車場開発	120,400	153.00	18,421,200
ヒューリック	196,900	1,088.00	214,227,200
三栄建築設計	4,600	1,566.00	7,203,600
野村不動産ホールディングス	63,000	1,925.00	121,275,000
三重交通グループホールディングス	21,100	390.00	8,229,000
サムティ	8,600	1,195.00	10,277,000
日本商業開発	5,600	1,942.00	10,875,200
プレサンスコーポレーション	15,100	1,407.00	21,245,700
ユニゾホールディングス	8,100	3,095.00	25,069,500
日本管理センター	7,700	1,387.00	10,679,900
フージャースホールディングス	16,300	613.00	9,991,900
オープンハウス	13,800	2,716.00	37,480,800
東急不動産ホールディングス	228,900	655.00	149,929,500
飯田グループホールディングス	78,000	1,819.00	141,882,000
エコナックホールディングス	57,000	56.00	3,192,000
パーク24	48,400	3,095.00	149,798,000
パラカ	3,500	1,990.00	6,965,000
三井不動産	501,000	2,622.50	1,313,872,500
三菱地所	703,000	2,258.50	1,587,725,500
平和不動産	18,800	1,612.00	30,305,600
東京建物	109,800	1,589.00	174,472,200
ダイビル	24,900	1,067.00	26,568,300
京阪神ビルディング	20,100	655.00	13,165,500
住友不動産	227,000	3,246.00	736,842,000
大京	173,000	232.00	40,136,000
テーオーシー	37,300	964.00	35,957,200
東京楽天地	21,000	528.00	11,088,000
レオパレス21	120,500	606.00	73,023,000
スターツコーポレーション	9,400	2,433.00	22,870,200
フジ住宅	15,400	746.00	11,488,400
空港施設	15,400	593.00	9,132,200
住友不動産販売	8,600	2,847.00	24,484,200
ゴールドクレスト	8,900	2,137.00	19,019,300
日神不動産	15,100	551.00	8,320,100
日本エスコン	14,000	401.00	5,614,000
タカラレーベン	42,300	601.00	25,422,300

サンヨーハウジング名古屋	7,500	1,011.00	7,582,500
イオンモール	61,700	1,732.00	106,864,400
トーセイ	14,500	776.00	11,252,000
エヌ・ティ・ティ都市開発	60,800	1,053.00	64,022,400
サンフロンティア不動産	10,400	1,026.00	10,670,400
エフ・ジェー・ネクスト	9,700	807.00	7,827,900
日本空港ビルデング	30,300	3,955.00	119,836,500
日本工営	6,900	2,734.00	18,864,600
ネクスト	24,600	738.00	18,154,800
ジェイエシーリクルートメント	7,000	1,547.00	10,829,000
日本M&Aセンター	28,700	3,435.00	98,584,500
タケエイ	10,500	1,025.00	10,762,500
トラスト・テック	4,500	1,720.00	7,740,000
コシダカホールディングス	4,100	2,482.00	10,176,200
パソナグループ	9,900	812.00	8,038,800
リンクアンドモチベーション	25,400	436.00	11,074,400
G C A	10,500	955.00	10,027,500
エス・エム・エス	14,000	2,566.00	35,924,000
テンプホールディングス	76,800	1,937.00	148,761,600
リニカル	7,000	1,443.00	10,101,000
クックパッド	22,600	975.00	22,035,000
学情	5,100	1,204.00	6,140,400
スタジオアリス	5,200	2,249.00	11,694,800
シミックホールディングス	6,000	1,487.00	8,922,000
総合警備保障	36,200	4,330.00	156,746,000
カカクコム	70,900	1,613.00	114,361,700
アイロムグループ	3,900	1,332.00	5,194,800
ルネサンス	7,000	1,704.00	11,928,000
ディップ	12,800	2,321.00	29,708,800
オプトホールディング	9,200	931.00	8,565,200
ツクイ	24,600	683.00	16,801,800
エムスリー	86,700	2,845.00	246,661,500
ツカダ・グローバルホールディング	11,100	623.00	6,915,300
アウトソーシング	5,600	3,735.00	20,916,000
ウェルネット	8,500	1,293.00	10,990,500
ワールドホールディングス	2,700	1,930.00	5,211,000
ディー・エヌ・エー	45,100	2,463.00	111,081,300
博報堂D Yホールディングス	137,300	1,337.00	183,570,100
ぐるなび	14,400	2,217.00	31,924,800
エスアールジータカミヤ	12,400	585.00	7,254,000
ジャパンベストレスキューシステム	18,100	253.00	4,579,300
ファンコミュニケーションズ	25,100	775.00	19,452,500

ライク	2,800	2,450.00	6,860,000
WDBホールディングス	4,300	1,368.00	5,882,400
インフォーマート	42,400	593.00	25,143,200
J Pホールディングス	35,700	258.00	9,210,600
E P Sホールディングス	12,700	1,525.00	19,367,500
プレステージ・インターナショナル	15,800	890.00	14,062,000
アミューズ	6,200	2,023.00	12,542,600
ドリームインキュベータ	3,600	2,121.00	7,635,600
クイック	6,100	1,164.00	7,100,400
ケネディクス	126,000	441.00	55,566,000
電通	111,100	5,970.00	663,267,000
テイクアンドギヴ・ニーズ	6,400	957.00	6,124,800
ぴあ	3,600	2,922.00	10,519,200
イオンファンタジー	3,200	3,120.00	9,984,000
シーティーエス	3,900	1,555.00	6,064,500
ネクシィーズグループ	4,500	1,589.00	7,150,500
みらかホールディングス	25,400	5,070.00	128,778,000
アルプス技研	4,600	3,055.00	14,053,000
日本空調サービス	12,800	666.00	8,524,800
オリエンタルランド	108,100	6,317.00	682,867,700
ダスキン	25,500	2,441.00	62,245,500
明光ネットワークジャパン	13,000	1,209.00	15,717,000
ファルコホールディングス	6,800	1,495.00	10,166,000
ラウンドワン	32,100	880.00	28,248,000
リゾートトラスト	39,100	2,201.00	86,059,100
ビー・エム・エル	13,000	2,477.00	32,201,000
りらいあコミュニケーションズ	16,100	1,090.00	17,549,000
リソー教育	19,200	626.00	12,019,200
ユー・エス・エス	121,200	1,933.00	234,279,600
サイバーエージェント	52,800	3,010.00	158,928,000
楽天	511,600	1,028.00	525,924,800
クリーク・アンド・リバー社	4,800	1,085.00	5,208,000
テー・オー・ダブリュー	11,600	685.00	7,946,000
セントラルスポーツ	4,300	3,580.00	15,394,000
フルキャストホールディングス	11,200	1,074.00	12,028,800
テクノプロ・ホールディングス	16,400	3,855.00	63,222,000
インターワークス	3,200	1,128.00	3,609,600
イー・ガーディアン	4,000	1,779.00	7,116,000
リブセンス	10,000	441.00	4,410,000
ジャパンマテリアル	8,200	1,523.00	12,488,600
ベクトル	9,300	1,248.00	11,606,400
I B J	9,100	600.00	5,460,000

アサンテ	5,200	1,736.00	9,027,200
N・フィールド	5,600	1,471.00	8,237,600
M&Aキャピタルパートナーズ	1,600	4,120.00	6,592,000
アビスト	2,100	3,960.00	8,316,000
ウィルグループ	5,600	709.00	3,970,400
エスクロー・エージェント・ジャパン	2,400	1,665.00	3,996,000
リクルートホールディングス	217,900	5,330.00	1,161,407,000
日本郵政	261,200	1,474.00	385,008,800
ベルシステム24ホールディングス	15,500	1,000.00	15,500,000
ソラスト	5,600	1,509.00	8,450,400
リログループ	3,700	15,800.00	58,460,000
東祥	2,400	5,150.00	12,360,000
エイチ・アイ・エス	16,000	2,927.00	46,832,000
共立メンテナンス	8,000	6,930.00	55,440,000
イチネンホールディングス	13,000	1,196.00	15,548,000
建設技術研究所	8,500	1,094.00	9,299,000
スペース	7,200	1,285.00	9,252,000
東京テアトル	47,000	152.00	7,144,000
ナガワ	2,100	4,550.00	9,555,000
よみうりランド	25,000	462.00	11,550,000
東京都競馬	69,000	258.00	17,802,000
常磐興産	5,400	1,614.00	8,715,600
カナモト	13,900	2,885.00	40,101,500
東京ドーム	39,500	1,094.00	43,213,000
西尾レントオール	7,900	3,300.00	26,070,000
トランス・コスモス	11,300	2,617.00	29,572,100
乃村工藝社	20,700	1,912.00	39,578,400
藤田観光	37,000	370.00	13,690,000
KNT-CTホールディングス	64,000	138.00	8,832,000
日本管財	8,700	1,789.00	15,564,300
トーカイ	4,500	4,100.00	18,450,000
白洋舎	2,000	2,700.00	5,400,000
セコム	103,700	8,194.00	849,717,800
セントラル警備保障	5,200	1,898.00	9,869,600
丹青社	20,200	867.00	17,513,400
メイテック	12,000	4,350.00	52,200,000
アサツー ディ・ケイ	16,500	2,891.00	47,701,500
応用地質	10,200	1,466.00	14,953,200
船井総研ホールディングス	13,200	1,958.00	25,845,600
オオバ	11,200	482.00	5,398,400
ベネッセホールディングス	33,700	3,340.00	112,558,000
イオンディライト	10,900	3,470.00	37,823,000

ナック	9,000	991.00	8,919,000	
ニチイ学館	18,900	882.00	16,669,800	
ダイセキ	17,400	2,317.00	40,315,800	
合 計	143,672,600		215,854,667,050	

(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28年 2月18日現在)	(平成29年 2月20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	-	789,494,703
国債証券	183,256,681,550	163,526,437,680
地方債証券	19,028,775,276	17,280,211,396
特殊債券	27,839,025,052	27,407,081,968
社債券	16,720,556,000	10,096,415,000
未収入金	4,035,431,400	100,974,000
未収利息	948,886,580	727,362,319
前払費用	14,892,621	20,618,923
流動資産合計	255,799,805,538	219,948,595,989
資産合計	255,799,805,538	219,948,595,989
負債の部		
流動負債		
未払金	-	199,592,000
未払解約金	7,095,653,575	8,852,786
未払利息	-	1,946
その他未払費用	-	2,524
流動負債合計	7,095,653,575	208,449,256
負債合計	7,095,653,575	208,449,256
純資産の部		
元本等		
元本	200,347,049,687	176,575,927,018
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	48,357,102,276	43,164,219,715
元本等合計	248,704,151,963	219,740,146,733
純資産合計	248,704,151,963	219,740,146,733
負債純資産合計	255,799,805,538	219,948,595,989

注記表

(重要な会計方針の注記)

項 目	自 平成28年 2月19日 至 平成29年 2月20日
有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券は個別法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>

（貸借対照表に関する注記）

項 目	（平成28年 2月18日現在）	（平成29年 2月20日現在）
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	200,347,049,687口	176,575,927,018口
2. 1単位当たり純資産の額	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)	1口当たり純資産額 1.2445円 (10,000口当たりの純資産額 12,445円)

（金融商品に関する注記）

. 金融商品の状況に関する事項

項 目	自 平成28年 2月19日 至 平成29年 2月20日
1. 金融商品に対する取組方針	<p>当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。</p>
	(1)金融商品の内容

2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2)金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する委員会をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用グループに是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用グループは、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。その後、当該関連運用グループの対処の実施や対処方針の決定等に関し、必要に応じてリスク管理を行う部署が当該部署の担当役員、当該関連運用グループの担当役員およびリスク管理委員会へ報告を行う体制となっております。</p> <p>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する部会にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。</p>
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<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29年 2月20日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。

2.時価の算定方法	<p>(1) 有価証券（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）

自 平成28年 2月19日 至 平成29年 2月20日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。

（その他の注記）

（平成28年 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
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）	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
SMAM・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
SMAM・バランスファンドVA25<適格機関投資家専用>	31,642,677,939円
SMAM・バランスファンドVA37.5<適格機関投資家専用>	9,374,298,014円
SMAM・バランスファンドVA50<適格機関投資家専用>	22,725,074,360円
SMAM・バランスファンドVL30<適格機関投資家限定>	385,746,395円
SMAM・バランスファンドVL50<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VA<適格機関投資家限定>	66,453,100円
SMAM・バランスファンドVA75<適格機関投資家専用>	330,459,356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>	133,253,321円
SMAM・インデックス・バランスVA25<適格機関投資家専用>	2,449,351,412円
SMAM・インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用>	2,767,730,960円
SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用>	6,913,724,152円
SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>	14,892,295,388円
SMAM・バランスVA株40T<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・VAS(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・VAS(適格機関投資家専用)	35,504,244,175円
SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	686,174,762円
SMAM・バランスファンドVA20<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・VAS(適格機関投資家専用)	23,957,257,289円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>	1,143,922,160円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>	255,000,027円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用>	53,970,912円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>	2,850,978,211円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	3,280,304,460円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T<適格機関投資家専用>	3,047,527,271円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A2<適格機関投資家専用>	1,216,622,709円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A2<適格機関投資家専用>	267,247,997円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A2<適格機関投資家専用>	21,167,802円
SMAM・アセットバランスファンドVA30L2<適格機関投資家専用>	490,120,804円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L2<適格機関投資家専用>	8,236,891,255円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T2<適格機関投資家専用>	382,692,836円
SMAM・FG新興国重視型バランス20VA<適格機関投資家限定>	570,934円
SMAM・FGグローバルバランス25VA<適格機関投資家限定>	8,180,420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>	6,547,163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>	3,333,119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>	4,325,792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>	2,219,108,761円
合計	200,347,049,687円

（平成29年 2月20日現在）	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	200,347,049,687円
同期中における追加設定元本額	22,841,533,818円
同期中における一部解約元本額	46,612,656,487円
平成29年 2月20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）	2,863,630,622円
三井住友・DC年金バランス50（標準型）	4,976,613,428円
三井住友・DC年金バランス70（株式重点型）	1,089,371,225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）	384,565,306円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2020（4資産タイプ）	55,791,630円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2025（4資産タイプ）	118,592,981円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2030（4資産タイプ）	197,602,898円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2035（4資産タイプ）	109,131,079円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2040（4資産タイプ）	46,099,493円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2045（4資産タイプ）	93,999,728円
三井住友・DC年金バランスゼロ（債券型）	42,965,831円
アセットアロケーション・ファンド（安定型）	2,762,566,161円
アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）	468,392,446円
アセットアロケーション・ファンド（成長型）	19,246,606円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2050	3,627,980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＞	5,947,959,996円
S M A M ・ バランスファンドVA25＜適格機関投資家専用＞	26,518,547,564円
S M A M ・ バランスファンドVA37.5＜適格機関投資家専用＞	9,024,962,955円
S M A M ・ バランスファンドVA50＜適格機関投資家専用＞	22,153,432,312円
S M A M ・ バランスファンドVL30＜適格機関投資家限定＞	366,992,815円
S M A M ・ バランスファンドVL50＜適格機関投資家限定＞	726,765,314円
世界6資産バランスファンドVA＜適格機関投資家限定＞	39,780,411円
S M A M ・ バランスファンドVA75＜適格機関投資家専用＞	337,186,477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＞	138,667,534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＞	2,318,302,247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＞	2,648,512,195円
S M A M ・ バランスファンドVA40＜適格機関投資家専用＞	6,705,288,357円
S M A M ・ バランスファンドVA35＜適格機関投資家専用＞	13,609,804,456円
S M A M ・ バランスVA株40T＜適格機関投資家限定＞	196,730,814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）	7,215,523,917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）	22,262,433,589円
S M A M ・ グローバルバランス40VA＜適格機関投資家限定＞	663,412,031円
S M A M ・ バランスファンドVA20＜適格機関投資家専用＞	1,078,987,149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）	18,580,545,586円
S M A M ・ アセットバランスファンドVA20A＜適格機関投資家専用＞	1,072,236,500円
S M A M ・ アセットバランスファンドVA35A＜適格機関投資家専用＞	231,556,718円
S M A M ・ アセットバランスファンドVA50A＜適格機関投資家専用＞	55,827,020円
S M A M ・ アセットバランスファンドVA20L＜適格機関投資家専用＞	2,577,142,492円
S M A M ・ アセットバランスファンドVA25L＜適格機関投資家専用＞	2,973,007,979円
S M A M ・ アセットバランスファンドVA20T＜適格機関投資家専用＞	2,892,799,761円
S M A M ・ アセットバランスファンドVA20A2＜適格機関投資家専用＞	1,187,033,452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 >	260,266,079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 >	22,401,538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 >	411,209,300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 >	7,685,581,694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 >	335,011,843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 >	34,418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 >	1,517,353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 >	2,243,863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 >	2,850,704円
S M A M ・ マルチアセットストラテジーファンド 2 0 1 6 - 0 4 < 適格機関投資家限定 >	1,467,582,962円
S M A M ・ マルチアセットストラテジーファンド 2 0 1 6 - 0 5 < 適格機関投資家限定 >	703,296,109円
S M A M ・ マルチアセットストラテジー・オープン < 適格機関投資家限定 >	928,294,100円
合計	176,575,927,018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 2 1 回利付国債 (5 年)	100,000,000	100,737,000	
	第 1 2 2 回利付国債 (5 年)	1,550,000,000	1,561,873,000	
	第 1 2 3 回利付国債 (5 年)	2,220,000,000	2,237,804,400	
	第 1 2 4 回利付国債 (5 年)	2,340,000,000	2,359,141,200	
	第 1 2 5 回利付国債 (5 年)	1,520,000,000	1,533,102,400	
	第 1 2 6 回利付国債 (5 年)	910,000,000	918,044,400	
	第 1 2 7 回利付国債 (5 年)	1,310,000,000	1,322,052,000	
	第 1 2 8 回利付国債 (5 年)	2,605,000,000	2,629,330,700	
	第 1 2 9 回利付国債 (5 年)	1,270,000,000	1,281,963,400	
	第 1 3 0 回利付国債 (5 年)	100,000,000	100,969,000	

第1回利付国債(40年)	40,000,000	56,136,000	
第2回利付国債(40年)	237,000,000	321,272,460	
第3回利付国債(40年)	330,000,000	449,644,800	
第4回利付国債(40年)	440,000,000	602,505,200	
第5回利付国債(40年)	415,000,000	546,152,450	
第6回利付国債(40年)	415,000,000	535,296,050	
第7回利付国債(40年)	445,000,000	547,763,850	
第8回利付国債(40年)	525,000,000	597,733,500	
第9回利付国債(40年)	630,000,000	512,990,100	
第297回利付国債(10年)	13,000,000	13,391,950	
第298回利付国債(10年)	195,000,000	200,520,450	
第299回利付国債(10年)	345,000,000	355,908,900	
第300回利付国債(10年)	1,100,000,000	1,139,358,000	
第301回利付国債(10年)	2,285,000,000	2,375,668,800	
第303回利付国債(10年)	195,000,000	203,022,300	
第305回利付国債(10年)	2,970,000,000	3,093,908,400	
第306回利付国債(10年)	1,670,000,000	1,750,393,800	
第307回利付国債(10年)	940,000,000	982,356,400	
第308回利付国債(10年)	670,000,000	702,206,900	
第309回利付国債(10年)	550,000,000	572,770,000	
第310回利付国債(10年)	3,080,000,000	3,205,017,200	
第312回利付国債(10年)	2,145,000,000	2,254,223,400	
第313回利付国債(10年)	2,105,000,000	2,226,816,350	
第315回利付国債(10年)	1,800,000,000	1,902,420,000	
第317回利付国債(10年)	1,005,000,000	1,060,425,750	
第318回利付国債(10年)	895,000,000	940,251,200	
第319回利付国債(10年)	980,000,000	1,036,506,800	
第320回利付国債(10年)	960,000,000	1,010,697,600	
第321回利付国債(10年)	930,000,000	981,140,700	
第322回利付国債(10年)	1,065,000,000	1,118,143,500	
第323回利付国債(10年)	510,000,000	536,428,200	
第324回利付国債(10年)	1,035,000,000	1,083,106,800	
第325回利付国債(10年)	1,440,000,000	1,509,696,000	
第326回利付国債(10年)	830,000,000	866,611,300	
第327回利付国債(10年)	375,000,000	393,735,000	
第328回利付国債(10年)	790,000,000	821,268,200	

第329回利付国債(10年)	2,675,000,000	2,818,326,500	
第330回利付国債(10年)	1,300,000,000	1,371,981,000	
第332回利付国債(10年)	978,000,000	1,020,132,240	
第333回利付国債(10年)	1,855,000,000	1,935,061,800	
第334回利付国債(10年)	1,330,000,000	1,387,416,100	
第335回利付国債(10年)	1,345,000,000	1,393,823,500	
第336回利付国債(10年)	940,000,000	974,479,200	
第337回利付国債(10年)	1,090,000,000	1,112,966,300	
第338回利付国債(10年)	1,260,000,000	1,296,489,600	
第339回利付国債(10年)	1,880,000,000	1,934,538,800	
第340回利付国債(10年)	1,900,000,000	1,955,936,000	
第341回利付国債(10年)	2,245,000,000	2,291,269,450	
第342回利付国債(10年)	2,165,000,000	2,170,845,500	
第343回利付国債(10年)	2,025,000,000	2,029,677,750	
第344回利付国債(10年)	2,490,000,000	2,494,731,000	
第345回利付国債(10年)	795,000,000	795,771,150	
第2回利付国債(30年)	510,000,000	648,816,900	
第4回利付国債(30年)	300,000,000	404,280,000	
第5回利付国債(30年)	290,000,000	364,738,800	
第7回利付国債(30年)	474,000,000	605,525,520	
第9回利付国債(30年)	100,000,000	114,541,000	
第10回利付国債(30年)	585,000,000	641,984,850	
第11回利付国債(30年)	570,000,000	678,339,900	
第12回利付国債(30年)	590,000,000	739,016,300	
第14回利付国債(30年)	860,000,000	1,122,300,000	
第16回利付国債(30年)	465,000,000	615,246,150	
第18回利付国債(30年)	510,000,000	658,869,000	
第19回利付国債(30年)	490,000,000	633,261,300	
第21回利付国債(30年)	345,000,000	445,708,950	
第22回利付国債(30年)	335,000,000	445,064,250	
第23回利付国債(30年)	329,000,000	437,619,350	
第24回利付国債(30年)	310,000,000	412,455,000	
第25回利付国債(30年)	300,000,000	388,635,000	
第26回利付国債(30年)	353,000,000	463,916,130	
第27回利付国債(30年)	395,000,000	528,577,150	
第28回利付国債(30年)	436,000,000	585,482,600	

第29回利付国債(30年)	287,000,000	380,952,320	
第30回利付国債(30年)	602,000,000	789,914,300	
第31回利付国債(30年)	505,000,000	654,586,050	
第32回利付国債(30年)	705,000,000	930,903,150	
第33回利付国債(30年)	743,000,000	935,615,320	
第34回利付国債(30年)	770,000,000	1,005,858,700	
第35回利付国債(30年)	730,000,000	924,143,500	
第36回利付国債(30年)	480,000,000	609,187,200	
第37回利付国債(30年)	640,000,000	799,654,400	
第38回利付国債(30年)	560,000,000	688,223,200	
第39回利付国債(30年)	455,000,000	570,024,000	
第40回利付国債(30年)	475,000,000	584,221,500	
第41回利付国債(30年)	475,000,000	573,211,000	
第42回利付国債(30年)	480,000,000	579,350,400	
第43回利付国債(30年)	415,000,000	500,992,150	
第44回利付国債(30年)	500,000,000	603,705,000	
第45回利付国債(30年)	625,000,000	723,743,750	
第46回利付国債(30年)	540,000,000	625,212,000	
第47回利付国債(30年)	730,000,000	863,852,800	
第48回利付国債(30年)	615,000,000	697,576,050	
第49回利付国債(30年)	575,000,000	651,986,750	
第50回利付国債(30年)	565,000,000	554,536,200	
第51回利付国債(30年)	560,000,000	477,064,000	
第52回利付国債(30年)	655,000,000	591,039,250	
第53回利付国債(30年)	195,000,000	180,607,050	
第40回利付国債(20年)	10,000,000	10,402,400	
第42回利付国債(20年)	480,000,000	508,056,000	
第43回利付国債(20年)	1,120,000,000	1,209,398,400	
第46回利付国債(20年)	775,000,000	835,643,750	
第48回利付国債(20年)	955,000,000	1,051,206,700	
第50回利付国債(20年)	918,000,000	993,560,580	
第52回利付国債(20年)	720,000,000	792,482,400	
第54回利付国債(20年)	965,000,000	1,072,076,400	
第56回利付国債(20年)	818,000,000	908,470,800	
第59回利付国債(20年)	1,455,000,000	1,604,675,850	
第61回利付国債(20年)	1,215,000,000	1,293,075,900	

第64回利付国債(20年)	1,025,000,000	1,155,328,750	
第65回利付国債(20年)	1,020,000,000	1,154,221,800	
第69回利付国債(20年)	1,020,000,000	1,172,286,000	
第70回利付国債(20年)	780,000,000	916,414,200	
第72回利付国債(20年)	753,000,000	871,461,960	
第74回利付国債(20年)	664,000,000	771,295,760	
第75回利付国債(20年)	490,000,000	571,207,700	
第78回利付国債(20年)	590,000,000	680,753,800	
第82回利付国債(20年)	620,000,000	728,214,800	
第84回利付国債(20年)	850,000,000	994,313,000	
第85回利付国債(20年)	645,000,000	763,022,100	
第88回利付国債(20年)	742,000,000	895,267,520	
第89回利付国債(20年)	20,000,000	23,945,800	
第90回利付国債(20年)	580,000,000	697,171,600	
第92回利付国債(20年)	734,000,000	878,098,880	
第93回利付国債(20年)	632,000,000	752,098,960	
第95回利付国債(20年)	305,000,000	373,179,700	
第97回利付国債(20年)	677,000,000	824,051,170	
第99回利付国債(20年)	673,000,000	814,087,720	
第100回利付国債(20年)	282,000,000	345,142,620	
第101回利付国債(20年)	355,000,000	442,227,050	
第102回利付国債(20年)	382,000,000	477,163,840	
第105回利付国債(20年)	425,000,000	517,820,000	
第106回利付国債(20年)	370,000,000	455,003,800	
第107回利付国債(20年)	433,000,000	528,948,470	
第108回利付国債(20年)	340,000,000	407,473,000	
第109回利付国債(20年)	555,000,000	666,599,400	
第111回利付国債(20年)	526,000,000	652,129,540	
第113回利付国債(20年)	527,000,000	648,236,350	
第114回利付国債(20年)	813,000,000	1,002,380,220	
第116回利付国債(20年)	375,000,000	467,853,750	
第118回利付国債(20年)	460,000,000	563,067,600	
第119回利付国債(20年)	520,000,000	622,715,600	
第120回利付国債(20年)	540,000,000	632,772,000	
第121回利付国債(20年)	470,000,000	569,574,200	
第122回利付国債(20年)	565,000,000	677,310,700	

第123回利付国債(20年)	380,000,000	471,420,400	
第124回利付国債(20年)	365,000,000	447,957,200	
第125回利付国債(20年)	195,000,000	244,855,650	
第126回利付国債(20年)	280,000,000	344,033,200	
第127回利付国債(20年)	175,000,000	212,660,000	
第128回利付国債(20年)	500,000,000	608,190,000	
第129回利付国債(20年)	515,000,000	618,963,050	
第130回利付国債(20年)	535,000,000	643,471,250	
第131回利付国債(20年)	460,000,000	546,875,600	
第132回利付国債(20年)	490,000,000	582,815,800	
第133回利付国債(20年)	680,000,000	818,380,000	
第134回利付国債(20年)	210,000,000	252,867,300	
第135回利付国債(20年)	345,000,000	410,501,700	
第136回利付国債(20年)	320,000,000	375,916,800	
第137回利付国債(20年)	210,000,000	249,956,700	
第138回利付国債(20年)	45,000,000	52,222,050	
第139回利付国債(20年)	400,000,000	470,320,000	
第140回利付国債(20年)	895,000,000	1,065,587,000	
第141回利付国債(20年)	520,000,000	619,684,000	
第142回利付国債(20年)	450,000,000	542,952,000	
第143回利付国債(20年)	345,000,000	405,675,150	
第144回利付国債(20年)	180,000,000	208,951,200	
第145回利付国債(20年)	515,000,000	613,354,700	
第146回利付国債(20年)	380,000,000	452,568,600	
第147回利付国債(20年)	1,275,000,000	1,497,296,250	
第148回利付国債(20年)	795,000,000	920,761,050	
第149回利付国債(20年)	960,000,000	1,111,267,200	
第150回利付国債(20年)	825,000,000	940,392,750	
第151回利付国債(20年)	860,000,000	949,964,600	
第152回利付国債(20年)	835,000,000	921,180,350	
第153回利付国債(20年)	897,000,000	1,003,967,250	
第154回利付国債(20年)	1,070,000,000	1,177,288,900	
第155回利付国債(20年)	890,000,000	946,212,400	
第156回利付国債(20年)	920,000,000	877,247,600	
第157回利付国債(20年)	935,000,000	854,692,850	
第158回利付国債(20年)	895,000,000	864,176,200	

	第159回利付国債(20年)	250,000,000	245,432,500	
国債証券合計		147,968,000,000	163,526,437,680	
地方債証券	第1回東京都公募公債(20年)	100,000,000	109,303,000	
	第1回東京都公募公債(30年)	100,000,000	124,035,000	
	第6回東京都公募公債(20年)	100,000,000	114,801,000	
	第7回東京都公募公債(20年)	100,000,000	116,923,000	
	第8回東京都公募公債(20年)	100,000,000	119,516,000	
	第8回東京都公募公債(30年)	400,000,000	500,172,000	
	第13回東京都公募公債(30年)	500,000,000	601,660,000	
	第660回東京都公募公債	300,000,000	306,261,000	
	第674回東京都公募公債	100,100,000	103,638,535	
	平成20年度第4回北海道公募公債	100,000,000	102,628,000	
	平成20年度第12回北海道公募公債	100,000,000	103,158,000	
	平成21年度第14回北海道公募公債	100,000,000	104,541,000	
	平成25年度第15回北海道公募公債	100,000,000	103,829,000	
	第1回神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	117,565,000	
	第3回神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	115,979,000	
	第7回神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	119,240,000	
	第57回神奈川県公募公債(5年)	200,000,000	200,954,000	
	第157回神奈川県公募公債	115,600,000	118,941,996	
	第167回神奈川県公募公債	100,000,000	103,896,000	
	第97回大阪府公募公債(5年)	102,000,000	102,473,280	
	第313回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	101,949,000	
	第326回大阪府公募公債(10年)	200,000,000	207,478,000	
	第332回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	104,343,000	
	第342回大阪府公募公債(10年)	200,000,000	208,542,000	
	第361回大阪府公募公債(10年)	200,000,000	209,122,000	
	第373回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	105,179,000	
	第377回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	104,179,000	
	平成19年度第1回京都府公募公債	30,260,000	30,585,295	
	平成20年度第3回京都府公募公債	100,000,000	102,850,000	
	平成26年度第13回京都府公募公債	100,000,000	102,582,000	
	平成27年度第4回京都府公募公債	100,000,000	103,102,000	
	第5回兵庫県公募公債(15年)	300,000,000	330,705,000	
	平成20年度第5回兵庫県公募公債	100,000,000	102,552,000	
	平成21年度第3回兵庫県公募公債	200,000,000	207,244,000	

平成21年度第11回兵庫県公募公債	200,000,000	207,678,000	
第7回静岡県公募公債（30年）	100,000,000	122,116,000	
平成20年度第1回静岡県公募公債	200,000,000	233,988,000	
平成20年度第7回静岡県公募公債	100,000,000	103,005,000	
平成21年度第5回静岡県公募公債	300,000,000	310,680,000	
平成20年度第3回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	102,437,000	
平成20年度第6回愛知県公募公債（10年）	500,000,000	515,040,000	
平成21年度第1回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	103,503,000	
平成21年度第7回愛知県公募公債（10年）	200,000,000	207,688,000	
平成21年度第8回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	103,599,000	
平成21年度第10回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	103,686,000	
平成22年度第12回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	104,038,000	
平成23年度第18回愛知県公募公債（7年）	100,000,000	101,114,000	
平成21年度第1回広島県公募公債	100,000,000	103,534,000	
平成20年度第7回埼玉県公募公債	100,000,000	102,964,000	
平成21年度第1回埼玉県公募公債	100,000,000	103,298,000	
平成21年度第2回埼玉県公募公債	100,000,000	103,531,000	
平成21年度第4回埼玉県公募公債	200,000,000	207,064,000	
平成20年度第10回福岡県公募公債	100,000,000	103,005,000	
平成21年度第3回福岡県公募公債	100,000,000	103,873,000	
平成25年度第5回福岡県公募公債	600,000,000	602,298,000	
平成25年度第11回福岡県公募公債	100,000,000	104,065,000	
平成25年度第12回福岡県公募公債	100,000,000	100,314,000	
平成26年度第4回福岡県公募公債	100,000,000	100,324,000	
平成26年度第10回福岡県公募公債	100,000,000	102,318,000	
平成20年度第8回千葉県公募公債	100,000,000	102,960,000	
平成21年度第2回千葉県公募公債	345,000,000	357,137,100	
平成21年度第6回千葉県公募公債	100,000,000	103,632,000	
第9回群馬県公募公債（10年）	100,000,000	104,232,000	
平成21年度第1回岐阜県公募公債（10年）	200,000,000	207,194,000	
第51回共同発行市場公募地方債	500,000	503,190	
第62回共同発行市場公募地方債	200,000,000	204,350,000	
第64回共同発行市場公募地方債	300,000,000	307,566,000	
第65回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,427,000	
第73回共同発行市場公募地方債	400,000,000	413,748,000	

第75回共同発行市場公募地方債	900,000,000	934,371,000	
第76回共同発行市場公募地方債	300,000,000	310,113,000	
第77回共同発行市場公募地方債	200,000,000	207,660,000	
第79回共同発行市場公募地方債	200,000,000	207,120,000	
第81回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,723,000	
第82回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,118,000	
第91回共同発行市場公募地方債	300,000,000	309,741,000	
第115回共同発行市場公募地方債	600,000,000	625,224,000	
第137回共同発行市場公募地方債	200,000,000	206,248,000	
平成21年度第4回大阪市公募公債	300,000,000	312,054,000	
平成26年度第2回大阪市公募公債(5年)	200,000,000	200,924,000	
第1回名古屋市公募公債(20年)	200,000,000	225,792,000	
第3回名古屋市公募公債(20年)	100,000,000	115,322,000	
第467回名古屋市公募公債(10年)	100,000,000	103,749,000	
第1回京都市公募公債(30年)	100,000,000	130,350,000	
第7回京都市公募公債(20年)	100,000,000	122,727,000	
平成26年度第1回京都市公募公債	100,000,000	100,382,000	
平成26年度第17回神戸市公募公債	100,000,000	100,940,000	
第4回横浜市公募公債(20年)	100,000,000	114,994,000	
第9回横浜市公募公債(20年)	100,000,000	119,848,000	
第14回横浜市公募公債(20年)	100,000,000	121,509,000	
平成20年度第6回横浜市公募公債	200,000,000	205,960,000	
平成25年度第1回横浜市公債「ハマ債5」	100,000,000	100,290,000	
平成26年度第4回札幌市公募公債(10年)	100,000,000	102,938,000	
第2回川崎市15年公募公債	100,000,000	105,382,000	
第4回川崎市15年公募公債	100,000,000	109,977,000	
平成20年度第5回福岡市公募公債	100,000,000	102,612,000	
平成25年度第5回福岡市公募公債(5年)	100,000,000	100,425,000	
平成21年度第1回千葉市公募公債	200,000,000	206,882,000	
地方債証券合計	16,293,460,000	17,280,211,396	
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	102,808,000
	第2回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	200,000,000	205,136,000
	第3回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	200,000,000	228,114,000
	第5回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	103,028,000
	第15回政府保証日本政策投資銀行債券	100,000,000	109,696,000
	第20回政府保証日本政策投資銀行債券	100,000,000	111,622,000

第23回政府保証日本政策投資銀行債券	400,000,000	409,628,000	
第36回日本政策投資銀行債券	100,000,000	119,298,000	
第51回日本政策投資銀行債券	100,000,000	102,441,000	
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	213,896,000	
第7回道路債券	100,000,000	114,023,000	
第8回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	119,892,000	
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	107,799,000	
第9回道路債券	100,000,000	133,248,000	
第18回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	142,343,000	
第22回日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	412,122,000	
第36回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	53,000,000	53,332,840	
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	404,120,000	
第42回道路債券	100,000,000	116,196,000	
第47回日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	247,204,000	
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	101,423,000	
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	203,286,000	
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	203,274,000	
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	510,865,000	
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	102,449,000	
第62回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	307,389,000	
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	205,450,000	
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	102,848,000	
第71回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	205,198,000	
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	241,910,000	
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	128,140,000	
	600,000,000	620,502,000	

第 8 9 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券			
第 9 0 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	363,603,000	
第 9 5 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,446,000	
第 9 9 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	122,536,000	
第 1 0 3 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1,300,000,000	1,352,104,000	
第 1 0 4 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	208,960,000	
第 1 2 0 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,339,000	
第 3 4 0 回政府保証道路債券	100,000,000	105,427,000	
第 1 回政府保証地方公営企業等金融機構債券	300,000,000	307,974,000	
第 1 回政府保証地方公共団体金融機構債券	300,000,000	310,479,000	
第 2 回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,370,000	
第 2 回地方公営企業等金融機構債券(20年)	100,000,000	122,170,000	
第 3 回政府保証地方公営企業等金融機構債券	100,000,000	102,557,000	
第 3 回公営企業債券(20年)	100,000,000	105,718,000	
第 3 回地方公共団体金融機構債券	300,000,000	311,847,000	
第 4 回政府保証地方公営企業等金融機構債券	100,000,000	102,515,000	
第 4 回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,355,000	
第 5 回政府保証地方公営企業等金融機構債券	100,000,000	102,612,000	
第 5 回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,216,000	
第 5 回公営企業債券(20年)	100,000,000	113,176,000	
第 6 回政府保証地方公営企業等金融機構債券	100,000,000	102,702,000	
第 6 回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	208,384,000	
第 7 回政府保証地方公営企業等金融機構債券	500,000,000	515,140,000	
第 8 回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,405,000	
第 1 1 回公営企業債券(20年)	100,000,000	115,334,000	
第 1 1 回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	104,613,000	
第 1 4 回政府保証地方公共団体金融機構債券(6年)	200,000,000	201,354,000	
第 1 6 回公営企業債券(20年)	100,000,000	116,329,000	
第 1 7 回公営企業債券(20年)	100,000,000	119,387,000	
第 1 8 回公営企業債券(20年)	100,000,000	121,622,000	
第 2 2 回公営企業債券(20年)	100,000,000	120,292,000	

第24回公営企業債券(20年)	200,000,000	242,068,000	
第30回公営企業債券	200,000,000	205,230,000	
第42回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	104,267,000	
第45回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	208,458,000	
第61回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,925,000	
第63回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,974,000	
第65回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,651,000	
F74回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,366,000	
第883回政府保証公営企業債券	100,000,000	101,514,000	
第884回政府保証公営企業債券	300,000,000	304,878,000	
第885回政府保証公営企業債券	200,000,000	204,270,000	
第886回政府保証公営企業債券	200,000,000	204,798,000	
第34回株式会社日本政策金融公庫社債	200,000,000	200,702,000	
第27回国際協力銀行債券	100,000,000	100,120,000	
第19回都市再生債券	100,000,000	102,192,000	
第7回本州四国連絡橋債券	100,000,000	116,876,000	
第332回東京交通債券	100,000,000	107,184,000	
第342回東京交通債券	100,000,000	111,871,000	
第13回関西国際空港株式会社社債	100,000,000	102,713,000	
第16回関西国際空港株式会社社債	100,000,000	103,358,000	
第51回政府保証関西国際空港債券	100,000,000	111,657,000	
第14回独立行政法人福祉医療機構債券	200,000,000	201,306,000	
第17回独立行政法人福祉医療機構債券	100,000,000	102,639,000	
第199回政府保証預金保険機構債	300,000,000	300,543,000	
第201回政府保証預金保険機構債	200,000,000	200,434,000	
第203回政府保証預金保険機構債	600,000,000	601,884,000	
第208回政府保証預金保険機構債	600,000,000	602,280,000	
第209回政府保証預金保険機構債	600,000,000	602,394,000	
第1回貸付債権担保住宅金融公庫債券	23,150,000	23,549,106	
第3回貸付債権担保住宅金融公庫債券	11,544,000	11,756,525	
第3回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	17,320,000	18,147,376	
第4回貸付債権担保住宅金融公庫債券	12,411,000	12,707,126	
第4回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	22,804,000	24,383,861	
第5回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	17,592,000	18,410,028	
第6回貸付債権担保住宅金融公庫債券	27,180,000	28,077,483	
第7回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	22,731,000	24,218,289	

第 8 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	13,753,000	14,140,009	
第 8 回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	101,005,000	
第 9 回貸付債権担保 S 種住宅金融公庫債券	38,650,000	41,211,722	
第 9 回貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券	22,985,000	24,544,072	
第 1 0 回貸付債権担保 S 種住宅金融公庫債券	59,718,000	63,675,511	
第 1 0 回貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券	22,555,000	23,817,177	
第 1 1 回貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券	23,907,000	25,433,461	
第 1 2 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	15,427,000	15,940,873	
第 1 4 回貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券	26,575,000	27,557,743	
第 1 4 回一般担保住宅金融支援機構債券	200,000,000	204,000,000	
第 1 7 回貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券	59,412,000	61,878,786	
第 1 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	31,136,000	33,424,184	
第 2 1 回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	103,028,000	
第 2 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	63,596,000	69,025,190	
第 2 5 回一般担保住宅金融支援機構債券	200,000,000	206,096,000	
第 2 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	95,718,000	103,202,190	
第 2 7 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	34,431,000	37,008,504	
第 2 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	38,265,000	41,040,743	
第 2 9 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	19,527,000	20,385,211	
第 2 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	40,294,000	43,170,185	
第 3 0 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	40,505,000	43,380,855	
第 3 2 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	23,077,000	24,114,311	
第 3 2 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	80,950,000	86,244,939	
第 3 5 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	22,800,000	23,919,708	
第 3 5 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	45,147,000	48,103,677	
第 3 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	46,691,000	49,621,794	
第 3 9 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	21,048,000	22,089,665	
第 4 1 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	22,726,000	24,126,830	
第 4 3 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	42,838,000	45,851,224	
第 4 3 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	59,708,000	63,214,053	
第 4 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	52,369,000	55,973,558	
第 4 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	99,724,000	106,812,381	
第 4 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	49,102,000	52,271,043	

第5 1 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	20,208,000	21,533,442	
第5 1 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	107,138,000	113,630,562	
第5 2 回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	119,566,000	
第5 3 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	21,811,000	23,206,031	
第5 5 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	130,156,000	136,855,129	
第5 7 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	63,294,000	66,640,353	
第5 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	65,473,000	68,798,373	
第5 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	129,914,000	136,785,151	
第6 0 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	198,684,000	208,125,463	
第6 1 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	65,027,000	67,927,854	
第6 7 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	71,485,000	74,016,283	
第6 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	145,682,000	152,491,176	
第7 0 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	132,588,000	138,698,980	
第7 3 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	72,664,000	76,302,286	
第9 5 回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	105,133,000	
第9 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	90,209,000	92,664,488	
第1 3 0 回一般担保住宅金融支援機構債券	200,000,000	233,458,000	
第1 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	43,482,000	46,107,877	
第2 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	45,844,000	48,840,363	
第3 回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	21,102,000	22,546,642	
第6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	21,988,000	23,363,349	
第5 回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	43,182,000	45,807,033	
い第7 5 8号商工債	100,000,000	100,558,000	
い第7 4 9号農林債	300,000,000	300,588,000	
い第7 5 2号農林債	500,000,000	501,335,000	
い第7 6 8号農林債	100,000,000	100,645,000	
第2 8 1回信金中金債(5年)	100,000,000	100,284,000	
第2 8 3回信金中金債(5年)	100,000,000	100,458,000	
第2 9 1回信金中金債(5年)	100,000,000	100,474,000	
第2 9 3回信金中金債(5年)	100,000,000	100,512,000	
第2 9 7回信金中金債(5年)	200,000,000	200,904,000	
第3 0 1回信金中金債(5年)	300,000,000	301,746,000	
第1 7 1号商工債(3年)	300,000,000	300,096,000	
第1 7 5号商工債(3年)	100,000,000	100,071,000	
第1 7 7号商工債(3年)	300,000,000	300,282,000	
第1 8 1号商工債(3年)	100,000,000	100,142,000	

	第183号商工債(3年)	500,000,000	500,825,000	
	第185号商工債(3年)	200,000,000	200,350,000	
	第197号商工債(3年)	200,000,000	200,024,000	
	第15回政府保証東日本高速道路債券	100,000,000	102,638,000	
	第5回中日本高速道路株式会社社債	200,000,000	205,870,000	
	第6回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	103,138,000	
	第19回政府保証中日本高速道路債券	124,000,000	125,723,600	
	第21回政府保証中日本高速道路債券	200,000,000	204,260,000	
	第25回政府保証中日本高速道路債券	200,000,000	206,986,000	
	第46回中日本高速道路株式会社社債	200,000,000	200,402,000	
	第8回政府保証西日本高速道路債券	33,000,000	33,135,300	
	第15回政府保証西日本高速道路債券	100,000,000	102,380,000	
	第19回政府保証西日本高速道路債券	100,000,000	103,032,000	
	第20回西日本高速道路株式会社社債	100,000,000	103,968,000	
特殊債券合計		26,067,297,000	27,407,081,968	
社債券	第11回ジェー・ピー・モルガン・チェース・アンド・カンパニー	200,000,000	200,870,000	
	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	200,506,000	
	第21回コーペラティブ・セントラル・ライフアイゼン・ボエレンリーバンク・ピー・エー	200,000,000	201,048,000	
	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	301,143,000	
	第18回 積水ハウス株式会社無担保社債	100,000,000	100,029,000	
	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	208,376,000	
	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	100,615,000	
	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	102,008,000	
	第8回株式会社三菱ケミカルホールディングス無担保社債	100,000,000	102,616,000	
	第4回花王株式会社無担保社債	100,000,000	101,560,000	
	第64回新日本製鐵株式会社無担保社債	100,000,000	104,229,000	
	第62回株式会社神戸製鋼所無担保社債	100,000,000	99,344,000	
	第13回株式会社クボタ無担保社債	100,000,000	101,076,000	
	第16回株式会社日立製作所無担保社債	100,000,000	103,458,000	

第4回三菱電機株式会社無担保社債	100,000,000	100,450,000	
日本電産株式会社第1回無担保社債	100,000,000	100,166,000	
第3回富士通株式会社無担保社債	100,000,000	101,523,000	
第1回パナソニック株式会社無担保社債	200,000,000	201,432,000	
第1回パナソニック株式会社無担保社債	200,000,000	203,298,000	
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	200,816,000	
第1回日本生命2012基金特定目的会社特定社債	100,000,000	100,802,000	
第1回明治安田生命2013基金特定目的会社特定社債	100,000,000	100,708,000	
第1回明治安田生命2014基金特定目的会社特定社債	100,000,000	100,395,000	
第1回ユニ・ファミリーマートホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	99,956,000	
第6回三井物産株式会社無担保社債	100,000,000	118,191,000	
第4回住友商事株式会社無担保社債	100,000,000	102,088,000	
第3回株式会社みずほコーポレート銀行無担保社債	100,000,000	102,186,000	
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	122,720,000	
株式会社三菱東京UFJ銀行第1回無担保社債	200,000,000	201,766,000	
第2回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	300,000,000	312,084,000	
第1回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	100,000,000	103,883,000	
株式会社三井住友フィナンシャル第1回無担保社債	100,000,000	101,882,000	
第4回株式会社りそな銀行無担保社債	100,000,000	106,014,000	
第9回三菱UFJ信託銀行株式会社無担保社債	100,000,000	105,954,000	
第7回住友信託銀行株式会社無担保社債	100,000,000	100,399,000	
第8回住友信託銀行株式会社無担保社債	100,000,000	118,140,000	
第6回株式会社セブン銀行無担保社債	200,000,000	200,288,000	
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	102,379,000	
第2回株式会社三井住友銀行無担保社債	200,000,000	209,952,000	
第2回株式会社三井住友銀行無担保社債	100,000,000	105,791,000	
第8回株式会社みずほ銀行無担保社債	200,000,000	200,674,000	
第9回株式会社みずほ銀行無担保社債	100,000,000	118,312,000	

第17回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	106,108,000	
第53回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	100,386,000	
第54回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	101,151,000	
第113回オリックス株式会社無担保社債	100,000,000	100,334,000	
第162回オリックス株式会社無担保社債	100,000,000	100,244,000	
第165回オリックス株式会社無担保社債	100,000,000	100,386,000	
第48回三菱UFJリース株式会社無担保社債	100,000,000	99,786,000	
第21回野村ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	105,262,000	
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	201,520,000	
第58回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	128,433,000	
第110回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	101,028,000	
第15回東日本旅客鉄道株式会社社債	100,000,000	108,975,000	
第34回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	116,826,000	
第110回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	115,546,000	
第41回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	120,748,000	
第42回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	200,000,000	245,394,000	
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	101,404,000	
第524回東京電力株式会社社債	100,000,000	100,099,000	
第526回東京電力株式会社社債	300,000,000	301,287,000	
第528回東京電力株式会社社債	100,000,000	103,741,000	
第532回東京電力株式会社社債	100,000,000	100,918,000	
第537回東京電力株式会社社債	100,000,000	104,380,000	
第544回東京電力株式会社社債	100,000,000	102,371,000	
第547回東京電力株式会社社債	100,000,000	105,350,000	
第518回中部電力株式会社社債	100,000,000	99,736,000	
第440回関西電力株式会社社債	100,000,000	100,001,000	
第467回関西電力株式会社社債	100,000,000	102,502,000	
第471回東北電力株式会社社債	100,000,000	105,643,000	
第472回東北電力株式会社社債	100,000,000	104,131,000	
第253回四国電力株式会社社債	100,000,000	104,653,000	

	第400回九州電力株式会社社債	100,000,000	104,970,000	
	第328回北海道電力株式会社社債	100,000,000	100,581,000	
	第11回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	113,178,000	
	第18回大阪瓦斯株式会社無担保社債	200,000,000	214,946,000	
	第27回東邦瓦斯株式会社無担保社債	100,000,000	105,270,000	
社債券合計		9,700,000,000	10,096,415,000	
	合計		218,310,146,044	

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28年 2月18日現在） （平成29年 2月20日現在）

資産の部		
流動資産		
預金	3,308,834,984	1,276,386,108
金銭信託	1,287,790,120	-
コール・ローン	-	184,404,868
株式	140,920,599,322	205,761,661,640
投資証券	3,618,227,970	5,313,704,577
派生商品評価勘定	103,225,445	61,997,675
未収入金	123,118,123	2,137,113,312
未収配当金	215,527,987	322,939,923
差入委託証拠金	1,181,615,316	1,576,414,906
流動資産合計	150,758,939,267	216,634,623,009
資産合計	150,758,939,267	216,634,623,009
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	29,507,628	3,950,426
前受金	75,594,517	53,248,749
未払金	7,738,430	17,108,010
未払解約金	357,147,432	532,193,674
未払利息	-	454
その他未払費用	-	2,105
流動負債合計	469,988,007	606,503,418
負債合計	469,988,007	606,503,418
純資産の部		
元本等		
元本	60,812,934,115	72,540,837,139
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	89,476,017,145	143,487,282,452
元本等合計	150,288,951,260	216,028,119,591
純資産合計	150,288,951,260	216,028,119,591

(平成28年 2月18日現在)

(平成29年 2月20日現在)

負債純資産合計

150,758,939,267

216,634,623,009

注記表

(重要な会計方針の注記)

項目	自 平成28年 2月19日 至 平成29年 2月20日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式、投資証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額(ただし、売気配相場は使用しない)、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1) 先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場によっております。</p> <p>(2) 為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金の計上基準 受取配当金は原則として、配当落ち日において、確定配当金額または予想配当金額を計上しております。なお、配当金額が未確定の場合は、入金日基準で計上しております。</p>
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建資産等の会計処理 「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

項目	(平成28年 2月18日現在)	(平成29年 2月20日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	60,812,934,115口	72,540,837,139口
2. 1単位当たり純資産の額	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)	1口当たり純資産額 2.9780円 (10,000口当たりの純資産額 29,780円)

（金融商品に関する注記）

．金融商品の状況に関する事項

項 目	自 平成28年 2月19日 至 平成29年 2月20日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>(1)金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、株式、投資証券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいておりません。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。当計算期間については、先物取引、為替予約取引を行っております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2)金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する委員会をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用グループに是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用グループは、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。その後、当該関連運用グループの対処の実施や対処方針の決定等に関し、必要に応じてリスク管理を行う部署が当該部署の担当役員、当該関連運用グループの担当役員およびリスク管理委員会へ報告を行う体制となっております。</p> <p>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する部会にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。</p>

4.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって認める評価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。
---------------------------	--

・金融商品の時価等に関する事項

項目	(平成29年 2月20日現在)
1.貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1) 有価証券（株式、投資証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

（デリバティブ取引に関する注記）

（平成28年 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	うち1年超	時価	評価損益
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	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
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	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
	イスラエルシケ ル	4,974,000	-	4,962,300	11,700
	合計	7,798,613,668	-	7,872,331,485	73,717,817

（平成29年 2月20日現在）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

（単位：円）

区 分	種 類	契 約 額 等		時 価	評 価 損 益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	4,648,314,454	-	4,701,563,203	53,248,749
	SPMINI 1703	3,241,541,096	-	3,286,383,804	44,842,708
	DJ EUR 1703	829,008,522	-	830,534,901	1,526,379
	FTSE 1703	331,365,304	-	335,568,098	4,202,794
	SPI200 1703	246,399,532	-	249,076,400	2,676,868
市場取引以外 の取引	為替予約取引				
	買建	24,818,300	-	24,598,600	219,700
	スウェーデンク ローナ	2,048,000	-	2,027,200	20,800
	デンマーククロー ネ	14,823,900	-	14,669,200	154,700
	香港ドル	3,675,000	-	3,635,000	40,000
	イスラエルシケ ル	4,271,400	-	4,267,200	4,200
	売建	672,797,300	-	667,779,100	5,018,200

米ドル	303,795,600	-	302,491,600	1,304,000
カナダドル	15,608,800	-	15,510,600	98,200
ユーロ	214,211,700	-	212,063,700	2,148,000
英ポンド	56,633,400	-	56,080,000	553,400
スイスフラン	9,037,600	-	9,004,000	33,600
スウェーデンク ローナ	2,540,000	-	2,534,000	6,000
ノルウェークロー ネ	1,635,900	-	1,620,000	15,900
デンマーククロー ネ	967,200	-	967,200	-
オーストラリアドル	58,818,800	-	57,987,800	831,000
香港ドル	8,752,000	-	8,724,000	28,000
シンガポールドル	796,300	-	796,200	100
合計	5,345,930,054	-	5,393,940,903	58,047,249

(注) 1. 時価の算定方法

(1) 株価指数先物取引の時価の算定方法について

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

2) 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

(2) 為替予約取引の時価の算定方法について

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

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

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

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

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

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

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

自 平成28年 2月19日

至 平成29年 2月20日

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

(その他の注記)

(平成28年 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・DC外国株式インデックスファンドS	8,520,048,160円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	198,225,937円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	847,976,275円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	572,353,182円
SMAM・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・DCターゲットイヤーファンド2020	2,966,762円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2025	6,874,650円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2030	27,293,669円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2035	25,355,393円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2040	15,579,454円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2045	34,898,099円
外国株式指数ファンド	431,467,598円
三井住友・DC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
SMAM・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VA(安定運用型) <適格機関投資家限定>	51,917,974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>	6,155,451,330円
SMAM・バランスファンドVA25 <適格機関投資家専用>	3,690,017,668円
SMAM・バランスファンドVA37.5 <適格機関投資家専用>	2,714,788,088円
SMAM・バランスファンドVA50 <適格機関投資家専用>	11,474,740,811円
SMAM・バランスファンドVL30 <適格機関投資家限定>	29,451,740円
SMAM・バランスファンドVL50 <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

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 >	141,397,142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)	2,530,233,327円
S M A M ・ アセットバランスファンド V A 2 0 A < 適格機関投資家専用 >	38,232,319円
S M A M ・ アセットバランスファンド V A 3 5 A < 適格機関投資家専用 >	23,824,479円
S M A M ・ アセットバランスファンド V A 5 0 A < 適格機関投資家専用 >	11,369,463円
S M A M ・ アセットバランスファンド V A 2 0 L < 適格機関投資家専用 >	86,662,919円
S M A M ・ アセットバランスファンド V A 2 5 L < 適格機関投資家専用 >	201,264,023円
S M A M ・ アセットバランスファンド V A 2 0 T < 適格機関投資家専用 >	189,133,634円
S M A M ・ F G 新興国重視型バランス 2 0 V A < 適格機関投資家限定 >	243,873円
S M A M ・ F G グローバルバランス 2 5 V A < 適格機関投資家限定 >	3,735,225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 >	53,226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 >	93,084,388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 >	70,097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 >	65,125,817円
合計	60,812,934,115円

(平成29年 2月20日現在)

開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	60,812,934,115円
同期中における追加設定元本額	30,688,266,679円
同期中における一部解約元本額	18,960,363,655円
平成29年 2月20日現在における元本の内訳	
三井住友・D C 外国株式インデックスファンド S	10,171,434,808円
三井住友・D C 年金バランス 3 0 (債券重点型)	222,527,707円
三井住友・D C 年金バランス 5 0 (標準型)	904,071,965円
三井住友・D C 年金バランス 7 0 (株式重点型)	612,291,185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)	71,345,996円
三井住友・D C ターゲットイヤーファンド 2 0 2 0 (4資産タイプ)	3,182,251円
三井住友・D C ターゲットイヤーファンド 2 0 2 5 (4資産タイプ)	8,454,317円
三井住友・D C ターゲットイヤーファンド 2 0 3 0 (4資産タイプ)	26,099,614円
三井住友・D C ターゲットイヤーファンド 2 0 3 5 (4資産タイプ)	31,279,641円
三井住友・D C ターゲットイヤーファンド 2 0 4 0 (4資産タイプ)	17,659,381円
三井住友・D C ターゲットイヤーファンド 2 0 4 5 (4資産タイプ)	45,909,530円
外国株式指数ファンド	414,156,103円
三井住友・D C 全海外株式インデックスファンド	1,110,144,519円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	1,166,668,021円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	1,124,176,019円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	1,711,313,812円
イオン・バランス戦略ファンド	37,777,511円
三井住友・D C ターゲットイヤーファンド 2 0 5 0	2,436,348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)	5,300,129,750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 >	25,365,764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 >	3,457,913,739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 >	2,799,258,611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 >	2,258,676,680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 >	9,432,240,660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 >	26,312,223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 >	155,613,804円
世界6資産バランスファンドV A < 適格機関投資家限定 >	6,971,402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 >	1,141,544,224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 >	89,828,826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 >	250,127,294円
S M A M ・ インデックス・バランスV A 5 0 < 適格機関投資家専用 >	1,144,822,081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 >	1,912,826,591円
S M A M ・ バランスファンドV A 3 5 < 適格機関投資家専用 >	2,480,774,669円
S M A M ・ バランスV A 株4 0 T < 適格機関投資家限定 >	84,568,294円
三井住友・外国株式インデックスファンド・V A S（適格機関投資家専用）	1,072,168,092円
三井住友・5資産バランスファンド・V A S（適格機関投資家専用）	1,570,968,309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 >	210,437,878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 >	115,858,639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）	1,761,276,080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 >	36,165,085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 >	20,039,327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 >	10,467,324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 >	71,879,497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 >	168,749,633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 >	174,556,172円
S M A M ・ グローバルバランスファンド（標準型）V A < 適格機関投資家限定 >	1,902,371,382円
S M A M ・ グローバルバランスファンド（債券重視型）V A < 適格機関投資家限定 >	322,084,017円
S M A M ・ 世界バランスファンドV A < 適格機関投資家限定 >	10,068,650,498円
S M A M ・ 世界バランスファンドV A 2 < 適格機関投資家限定 >	4,292,749,119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 >	17,631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 >	690,886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 >	2,346,100,500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 >	117,424円
S M A M ・ マルチアセットストラテジーファンド2 0 1 6 - 0 4 < 適格機関投資家限定 >	69,940,200円
S M A M ・ マルチアセットストラテジーファンド2 0 1 6 - 0 5 < 適格機関投資家限定 >	33,491,190円
S M A M ・ マルチアセットストラテジー・オープン < 適格機関投資家限定 >	44,154,916円
合計	72,540,837,139円

附属明細表

有価証券明細表

(a) 株式

	評価額
--	-----

通貨	銘柄	株数	単価	金額	備考
米ドル	ANADARKO PETROLEUM CORP	32,423	66.77	2,164,883.71	
	ANTERO RESOURCES CORP	8,176	25.07	204,972.32	
	APACHE CORPORATION	22,337	55.44	1,238,363.28	
	BAKER HUGHES INC	23,756	60.76	1,443,414.56	
	CABOT OIL & GAS CORPORATION	26,164	23.11	604,650.04	
	CHENIERE ENERGY INC	11,680	46.71	545,572.80	
	CHEVRON CORPORATION	109,821	110.33	12,116,550.93	
	CIMAREX ENERGY CO	5,271	132.02	695,877.42	
	CONCHO RESOURCES INC	8,234	140.06	1,153,254.04	
	CONOCOPHILLIPS	72,622	47.51	3,450,271.22	
	CONTINENTAL RESOURCES, INC.	5,758	45.97	264,695.26	
	CORE LABORATORIES N.V.	2,680	114.12	305,841.60	
	DEVON ENERGY CORPORATION	27,742	44.17	1,225,364.14	
	DIAMONDBACK ENERGY INC	4,749	107.63	511,134.87	
	EOG RESOURCES INC	33,819	99.03	3,349,095.57	
	EQT CORPORATION	9,689	62.07	601,396.23	
	EXXON MOBIL CORPORATION	240,821	81.76	19,689,524.96	
	HALLIBURTON CO	50,521	53.71	2,713,482.91	
	HELMERICH & PAYNE INC	6,307	68.26	430,515.82	
	HESS CORPORATION	16,082	51.75	832,243.50	
	HOLLYFRONTIER CORP	8,311	29.92	248,665.12	
	KINDER MORGAN INC	111,242	21.77	2,421,738.34	
	MARATHON OIL CORP	52,001	16.23	843,976.23	
	MARATHON PETROLEUM CORPORATION	31,496	50.02	1,575,429.92	
	MURPHY OIL CORPORATION	9,993	28.09	280,703.37	
	NATIONAL-OILWELL VARCO INC.	22,038	39.31	866,313.78	
	NEWFIELD EXPLORATION CO	10,715	41.82	448,101.30	
	NOBLE ENERGY INC	24,229	37.05	897,684.45	
	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	44,803	66.27	2,969,094.81	
	ONEOK INC	13,043	53.64	699,626.52	
	PARSLEY ENERGY INC-CLASS A	13,729	31.82	436,856.78	
	PHILLIPS 66	27,562	78.66	2,168,026.92	
	PIONEER NATURAL RESOURCES CO	9,947	192.00	1,909,824.00	
	PLAINS GP HOLDINGS LP-CL A	4,306	31.93	137,490.58	
RANGE RESOURCES CORPORATION	10,817	31.27	338,247.59		
SCHLUMBERGER LTD	81,164	80.65	6,545,876.60		
SOUTHWESTERN ENERGY COMPANY	29,453	8.68	255,652.04		
SPECTRA ENERGY CORPORATION	41,037	41.09	1,686,210.33		
TARGA RESOURCES CORP	9,403	58.69	551,862.07		
TECHNIPFMC PLC	26,085	32.10	837,328.50		
TESORO CORPORATION	6,712	86.64	581,527.68		

VALERO ENERGY CORP	27,016	65.49	1,769,277.84
WILLIAMS COS INC	47,695	28.20	1,344,999.00
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	12,111	141.50	1,713,706.50
ALBEMARLE CORPORATION	6,617	91.92	608,234.64
ARCONIC INC	25,812	29.91	772,036.92
ASHLAND GLOBAL HOLDINGS INC	3,401	121.81	414,275.81
AVERY DENNISON CORP	4,688	79.41	372,274.08
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	13,952	29.65	413,676.80
BALL CORPORATION	10,229	73.27	749,478.83
CELANESE CORPORATION	7,980	89.64	715,327.20
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	12,356	34.11	421,463.16
CROWN HOLDINGS INC	7,595	52.78	400,864.10
DOW CHEMICAL	65,399	61.26	4,006,342.74
DU PONT (E.I.) DE NEMOURS	50,268	77.49	3,895,267.32
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	8,696	80.25	697,854.00
ECOLAB INC	15,156	123.95	1,878,586.20
FMC CORPORATION	7,651	58.23	445,517.73
FREEMONT-MCMORAN INC	74,285	14.91	1,107,589.35
INTERNATIONAL PAPER CO	22,997	52.15	1,199,293.55
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	4,622	122.37	565,594.14
LYONDELLBASELL INDU-CL A	20,802	92.91	1,932,713.82
MARTIN MARIETTA MATERIALS	3,548	217.55	771,867.40
MONSANTO CO	25,760	109.00	2,807,840.00
MOSAIC CO/THE	19,208	33.59	645,196.72
NEWMONT MINING CORP	31,236	37.01	1,156,044.36
NUCOR CORP	18,742	63.90	1,197,613.80
PACKAGING CORP OF AMERICA	5,524	95.26	526,216.24
PPG INDUSTRIES INC	15,676	102.37	1,604,752.12
PRAXAIR INC	16,792	117.42	1,971,716.64
SEALED AIR CORP	11,115	47.76	530,852.40
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	4,430	311.35	1,379,280.50
VALSPAR CORP/THE	4,415	111.00	490,065.00
VULCAN MATERIALS CO	7,931	119.33	946,406.23
WESTROCK CO	14,346	52.66	755,460.36
WR GRACE & CO	3,500	71.33	249,655.00
3M COMPANY	34,874	182.95	6,380,198.30
ACUITY BRANDS INC	2,353	220.29	518,342.37
AERCAP HOLDINGS NV	9,495	46.65	442,941.75
AGCO CORP	3,447	63.99	220,573.53
AMETEK INC	13,323	54.50	726,103.50
BE AEROSPACE INC	5,983	62.83	375,911.89
BOEING CO	34,392	172.71	5,939,842.32

CATERPILLAR INC	33,529	98.85	3,314,341.65
CUMMINS INC	9,431	152.91	1,442,094.21
DANAHER CORP	36,587	84.05	3,075,137.35
DEERE & CO	15,725	110.27	1,733,995.75
DOVER CORP	8,642	79.94	690,841.48
EATON CORP PLC	26,768	71.63	1,917,391.84
EMERSON ELECTRIC CO	37,885	61.89	2,344,702.65
FASTENAL COMPANY	16,429	50.71	833,114.59
FLOWSERVE CORPORATION	7,675	48.37	371,239.75
FLUOR CORP	8,892	56.43	501,775.56
FORTIVE CORP	17,402	57.69	1,003,921.38
GENERAL DYNAMICS CORP	15,276	189.06	2,888,080.56
GENERAL ELECTRIC CO	520,094	30.37	15,795,254.78
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	41,651	124.56	5,188,048.56
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES	2,653	211.91	562,197.23
ILLINOIS TOOL WORKS	18,807	130.31	2,450,740.17
INGERSOLL-RAND PLC	15,188	80.99	1,230,076.12
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	7,005	57.61	403,558.05
JARDINE MATHESON HOLDINGS LIMITED	14,100	64.95	915,795.00
L3 TECHNOLOGIES INC	4,316	168.23	726,080.68
LOCKHEED MARTIN CORPORATION	15,184	265.35	4,029,074.40
MASCO CORP	18,535	33.52	621,293.20
MIDDLEBY CORP	3,388	138.21	468,255.48
NORTHROP GRUMMAN CORP	9,987	243.58	2,432,633.46
PACCAR INC	20,636	68.85	1,420,788.60
PARKER HANNIFIN CORPORATION	7,528	153.89	1,158,483.92
PENTAIR PLC-REGISTERED	9,682	58.13	562,814.66
RAYTHEON COMPANY	17,372	152.86	2,655,483.92
ROCKWELL AUTOMATION INC	7,618	151.92	1,157,326.56
ROCKWELL COLLINS INC.	7,255	93.46	678,052.30
ROPER TECHNOLOGIES INC	5,966	207.14	1,235,797.24
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	10,115	41.54	420,177.10
SNAP-ON INC	3,266	172.57	563,613.62
STANLEY BLACK & DECKER INC	8,856	126.65	1,121,612.40
TEXTRON INC	16,605	48.35	802,851.75
TRANSDIGM GROUP INC	2,954	249.74	737,731.96
UNITED RENTALS INC	5,006	126.03	630,906.18
UNITED TECHNOLOGIES CORP	45,812	112.15	5,137,815.80
WABTEC CORP	5,727	87.77	502,658.79
WW GRAINGER INC	3,265	254.96	832,444.40
XYLEM INC	11,296	47.80	539,948.80
CINTAS CORP	4,708	118.61	558,415.88

DUN & BRADSTREET CORP	2,078	108.20	224,839.60
EQUIFAX INC	6,641	130.14	864,259.74
IHS MARKIT LTD	21,197	40.20	852,119.40
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	54,985	41.91	2,304,421.35
MANPOWERGROUP	4,034	97.35	392,709.90
NIELSEN HOLDINGS PLC	19,909	45.08	897,497.72
REPUBLIC SERVICES INC	13,657	60.75	829,662.75
ROBERT HALF INTL INC	7,661	48.59	372,247.99
STERICYCLE, INC.	4,902	85.15	417,405.30
VERISK ANALYTICS INC	9,152	84.90	777,004.80
WASTE CONNECTIONS INC	10,305	83.60	861,498.00
WASTE MANAGEMENT INC	26,037	72.45	1,886,380.65
AMERCO	390	381.21	148,671.90
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	8,575	46.91	402,253.25
C.H.ROBINSON WORLDWIDE, INC.	7,794	79.06	616,193.64
CSX CORPORATION	55,690	48.54	2,703,192.60
DELTA AIR LINES INC	10,570	51.23	541,501.10
EXPEDITORS INTL WASH INC	10,211	56.50	576,921.50
FEDEX CORP	14,851	193.70	2,876,638.70
J.B. HUNT TRANSPORT SERVICES INC	5,307	101.04	536,219.28
KANSAS CITY SOUTHERN	6,279	86.89	545,582.31
MACQUARIE INFRASTRUCTURE CORP	5,005	79.50	397,897.50
NORFOLK SOUTHERN CORP	17,281	122.78	2,121,761.18
SOUTHWEST AIRLINES	8,327	57.32	477,303.64
UNION PACIFIC CORP	48,000	109.82	5,271,360.00
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS INC	4,745	75.96	360,430.20
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	39,779	106.90	4,252,375.10
AUTOLIV INC	5,518	105.87	584,190.66
BORGWARNER INC	12,178	42.38	516,103.64
DELPHI AUTOMOTIVE PLC	15,341	75.46	1,157,631.86
FORD MOTOR COMPANY	212,224	12.58	2,669,777.92
GENERAL MOTORS CO	82,266	37.22	3,061,940.52
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	15,385	36.07	554,936.95
HARLEY-DAVIDSON INC	11,155	56.93	635,054.15
LEAR CORP	4,211	142.37	599,520.07
MOBILEYE NV	8,784	45.65	400,989.60
TESLA INC	7,576	272.23	2,062,414.48
WABCO HOLDINGS INC	3,471	115.56	401,108.76
COACH INC	15,728	38.21	600,966.88
D.R.HORTON INC	22,130	30.49	674,743.70
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY	9,004	57.06	513,768.24
GARMIN LTD	7,442	50.81	378,128.02

HANESBRANDS INC	21,525	21.02	452,455.50
HARMAN INTERNATIONAL	3,998	111.01	443,817.98
HASBRO INC	6,377	98.50	628,134.50
LEGGETT & PLATT INC	7,789	48.62	378,701.18
LENNAR CORP-CL A	10,746	46.46	499,259.16
LULULEMON ATHLETICA INC	6,998	66.73	466,976.54
MATTEL INC	19,175	26.10	500,467.50
MICHAEL KORS HOLDINGS LIMITED	9,739	38.30	373,003.70
MOHAWK INDUSTRIES INC	3,598	221.55	797,136.90
NEWELL BRANDS INC	24,405	46.64	1,138,249.20
NIKE INC -CL B	77,615	56.75	4,404,651.25
POLARIS INDUSTRIES INC	3,113	87.16	271,329.08
PULTE GROUP INC	16,248	21.40	347,707.20
PVH CORP	4,758	90.32	429,742.56
RALPH LAUREN CORPORATION	3,735	78.39	292,786.65
SMITH(A.O.) CORP	8,542	49.59	423,597.78
TOLL BROTHERS INC	9,275	31.49	292,069.75
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	11,107	21.88	243,021.16
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	11,448	19.75	226,098.00
VF CORP	19,532	52.68	1,028,945.76
WHIRLPOOL CORP	4,289	177.19	759,967.91
ARAMARK	12,558	35.75	448,948.50
CARNIVAL CORP	21,080	55.40	1,167,832.00
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	1,668	427.61	713,253.48
DARDEN RESTAURANTS INC	6,806	76.73	522,224.38
DOMINO'S PIZZA INC	3,062	187.93	575,441.66
H&R BLOCK INC	13,015	20.51	266,937.65
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS INC	11,081	58.50	648,238.50
LAS VEGAS SANDS CORP	25,733	52.03	1,338,887.99
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	19,468	89.36	1,739,660.48
MCDONALD'S CORPORATION	49,232	127.80	6,291,849.60
MELCO CROWN ENTERTAINME-ADR	10,584	16.99	179,822.16
MGM MIRAGE	25,809	26.60	686,519.40
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDINGS	10,163	47.69	484,673.47
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	9,610	95.21	914,968.10
STARBUCKS CORP	84,462	57.35	4,843,895.70
WYNDHAM WORLDWIDE CORP	6,427	84.85	545,330.95
WYNN RESORTS LTD	4,682	95.91	449,050.62
YUM! BRANDS INC	21,805	68.40	1,491,462.00
CBS CORP-CL B	23,953	65.69	1,573,472.57
CHARTER COMMUNICATTIONS INC-A	12,464	326.55	4,070,119.20
COMCAST CORP-CL A	138,941	75.32	10,465,036.12

DISCOVERY COMMUNICATIONS INC-A	10,192	28.68	292,306.56
DISCOVERY COMMUNICATIONS INC-C	14,681	28.09	412,389.29
DISH NETWORK CORP.	13,924	62.89	875,680.36
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	22,642	24.50	554,729.00
LIBERTY BROADBAND-C	5,788	86.44	500,314.72
LIBERTY GLOBAL PLC-A	14,258	36.75	523,981.50
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	34,465	35.58	1,226,264.70
LIBERTY LILAC GROUP-C	5,259	26.54	139,573.86
LIBERTY SIRIUS GROUP-C	11,891	37.86	450,193.26
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-A	6,460	38.02	245,609.20
NEWS CORP-CLASS A	22,918	13.08	299,767.44
OMNICOM GROUP	13,925	85.34	1,188,359.50
SCRIPPS NETWORKS INTERACTIVE	4,484	76.04	340,963.36
SIRIUS XM HOLDINGS INC	100,341	4.94	495,684.54
TEGNA INC	10,189	24.37	248,305.93
THE WALT DISNEY CO.	88,273	110.06	9,715,326.38
TIME WARNER INC	44,759	96.48	4,318,348.32
TWENTY-FIRST CE CL-A	62,638	30.35	1,901,063.30
TWENTY-FIRST CE CL-B	27,110	29.92	811,131.20
VIACOM INC-CLASS B	19,259	43.99	847,203.41
ADVANCE AUTO PARTS	4,092	161.58	661,185.36
AMAZON.COM INC	23,343	845.07	19,726,469.01
AUTONATION INC	4,917	47.77	234,885.09
AUTOZONE INC	1,721	741.05	1,275,347.05
BED BATH & BEYOND INC	8,527	41.14	350,800.78
BEST BUY COMPANY INC	16,151	45.24	730,671.24
CARMAX INC	11,272	67.02	755,449.44
DICK'S SPORTING GOODS INC	4,201	49.79	209,167.79
DOLLAR GENERAL CORP	16,586	77.67	1,288,234.62
DOLLAR TREE INC	13,251	80.00	1,060,080.00
EXPEDIA INC	7,572	119.41	904,172.52
FOOT LOCKER INC	7,641	71.00	542,511.00
GAP INC/THE	15,593	24.47	381,560.71
GENUINE PARTS CO	8,452	100.67	850,862.84
HOME DEPOT INC	71,447	143.00	10,216,921.00
KOHL'S CORP	11,726	41.97	492,140.22
L BRANDS INC	14,386	57.51	827,338.86
LIBERTY INTERACTIVE CORP QVC GROUP-A	24,979	19.30	482,094.70
LKQ CORPORATION	19,244	31.94	614,653.36
LOWE'S COMPANIES INC	50,641	76.74	3,886,190.34
MACY'S INC	17,457	32.30	563,861.10
NETFLIX INC	24,618	142.22	3,501,171.96

NORDSTROM INC	6,499	45.69	296,939.31
O'REILLY AUTOMOTIVE INC NEW	5,588	268.12	1,498,254.56
PRICELINE GROUP INC/THE	2,846	1,637.40	4,660,040.40
ROSS STORES INC	23,519	68.55	1,612,227.45
SIGNET JEWELERS LTD	4,682	73.91	346,046.62
STAPLES INC	38,290	9.31	356,479.90
TARGET CORP	32,150	65.79	2,115,148.50
TIFFANY & CO	7,222	86.18	622,391.96
TJX COMPANIES INC	38,657	77.19	2,983,933.83
TRACTOR SUPPLY COMPANY	8,359	72.18	603,352.62
TRIPADVISOR INC-W/I	7,039	47.06	331,255.34
ULTA BEAUTY INC	3,353	275.15	922,577.95
COSTCO WHOLESALE CORP	25,425	175.86	4,471,240.50
CVS HEALTH CORPORATION	61,881	79.69	4,931,296.89
KROGER CO	53,074	34.01	1,805,046.74
RITE AID CORP	59,420	5.94	352,954.80
SYSCO CORP	30,608	52.35	1,602,328.80
WAL-MART STORES INC	89,764	69.37	6,226,928.68
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	53,393	85.86	4,584,322.98
WHOLE FOODS MARKET INC	17,976	30.91	555,638.16
ALTRIA GROUP INC	113,398	72.97	8,274,652.06
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	34,248	44.69	1,530,543.12
BROWN-FORMAN CORPORATION	12,263	48.20	591,076.60
BUNGE LIMITED	7,871	77.78	612,206.38
CAMPBELL SOUP CO	11,170	58.48	653,221.60
COCA-COLA CO/THE	237,970	41.23	9,811,503.10
CONAGRA BRANDS INC	24,224	39.61	959,512.64
CONSTELLATION BRANDS INC-A	10,429	161.32	1,682,406.28
DR.PEPPER SNAPPLE GROUP, INC	10,761	93.98	1,011,318.78
GENERAL MILLS INC	35,296	59.23	2,090,582.08
HORMEL FOODS CORPORATION	16,378	37.26	610,244.28
INGREDION INC	4,088	120.79	493,789.52
JM SMUCKER CO/THE-NEW COM	6,757	135.95	918,614.15
KELLOGG CO	14,766	72.90	1,076,441.40
KRAFT HEINZ COMPANY	35,842	96.65	3,464,129.30
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	6,460	97.59	630,431.40
MEAD JOHNSON NUTRITION COMPANY	10,257	87.50	897,487.50
MOLSON COORS BREWING COMPANY	10,934	101.59	1,110,785.06
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	90,280	42.50	3,836,900.00
MONSTER BEVERAGE CORPORATION	23,533	43.63	1,026,744.79
PEPSICO INC	83,526	108.15	9,033,336.90
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL INC.	89,756	103.66	9,304,106.96

REYNOLDS AMERICAN INC	49,704	60.73	3,018,523.92
THE HERSHEY COMPANY	8,881	107.25	952,487.25
TYSON FOODS INC-CL A	17,263	65.26	1,126,583.38
WHITEWAVE FOODS CO	10,258	55.17	565,933.86
CHURCH & DWIGHT CO INC	14,360	49.70	713,692.00
CLOROX COMPANY	7,622	133.71	1,019,137.62
COLGATE-PALMOLIVE COMPANY	49,858	71.98	3,588,778.84
COTY INC-CL A	27,462	18.89	518,757.18
EDGEWELL PERSONAL CARE CO	2,963	80.02	237,099.26
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	12,823	85.00	1,089,955.00
KIMBERLY-CLARK CORP	21,172	131.93	2,793,221.96
PROCTER & GAMBLE CO	147,974	91.09	13,478,951.66
SPECTRUM BRANDS HOLDINGS INC	1,690	133.91	226,307.90
ABBOTT LABORATORIES	99,890	44.69	4,464,084.10
AETNA INC	20,652	125.27	2,587,076.04
ALIGN TECHNOLOGY INC	4,163	101.76	423,647.69
AMERISOURCEBERGEN CORP	10,636	90.76	965,323.36
ANTHEM INC	15,493	160.25	2,482,753.25
BARD(C.R.) INC	4,324	242.41	1,048,180.84
BAXTER INTERNATIONAL INC	28,410	49.73	1,412,829.30
BECTON DICKINSON & CO	12,535	180.90	2,267,581.50
BOSTON SCIENTIFIC CORP	80,107	25.39	2,033,916.73
CARDINAL HEALTH INC	18,755	80.71	1,513,716.05
CENTENE CORP	9,578	67.61	647,568.58
CERNER CORP	16,958	56.15	952,191.70
CIGNA CORP	15,104	143.56	2,168,330.24
COOPER COMPANIES INC (THE)	2,852	195.91	558,735.32
DAVITA INC	9,291	66.90	621,567.90
DENTSPLY SIRONA INC	13,264	62.68	831,387.52
DEXCOM INC	4,938	81.89	404,372.82
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	12,532	89.74	1,124,621.68
ENVISION HEALTHCARE CORP	6,386	71.59	457,173.74
EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO	37,101	69.97	2,595,956.97
HCA HOLDINGS, INC.	17,833	84.63	1,509,206.79
HENRY SCHEIN INC	4,543	168.11	763,723.73
HOLOGIC INC	14,057	40.00	562,280.00
HUMANA INC.	8,652	204.60	1,770,199.20
IDEXX LABORATORIES INC	4,934	142.23	701,762.82
INTUITIVE SURGICAL INC	2,266	724.66	1,642,079.56
LABORATORY CRP OF AMR HLDGS	5,705	139.59	796,360.95
MALLINCKRODT PLC	5,503	54.74	301,234.22
MCKESSON CORP	13,287	150.25	1,996,371.75

MEDNAX INC	4,959	70.07	347,477.13
MEDTRONIC PLC	80,438	78.88	6,344,949.44
PATTERSON COS INC	4,102	44.08	180,816.16
QUEST DIAGNOSTICS	8,585	95.64	821,069.40
QUINTILES IMS HOLDINGS INC	8,462	76.75	649,458.50
RESMED INC	7,656	72.27	553,299.12
STRYKER CORP	19,832	126.34	2,505,574.88
TELEFLEX INC	2,592	179.91	466,326.72
TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES-SP ADR	52,809	35.20	1,858,876.80
UNITEDHEALTH GROUP INC	55,275	157.62	8,712,445.50
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	4,903	122.95	602,823.85
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	5,497	83.61	459,604.17
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	11,608	116.87	1,356,626.96
ABBVIE INC	94,518	61.77	5,838,376.86
AGILENT TECHNOLOGIES INC	19,163	51.63	989,385.69
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	13,201	128.82	1,700,552.82
ALKERMES PLC	8,922	54.57	486,873.54
ALLERGAN PLC	22,980	247.35	5,684,103.00
AMGEN INC	43,434	173.29	7,526,677.86
BIOGEN INC	12,587	288.94	3,636,887.78
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	9,504	89.87	854,124.48
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	96,974	54.59	5,293,810.66
CELGENE CORP	44,986	121.16	5,450,503.76
ELI LILLY & CO	57,659	80.39	4,635,207.01
ENDO INTERNATIONAL PLC	10,390	13.08	135,901.20
GILEAD SCIENCES INC	76,591	69.85	5,349,881.35
ILLUMINA INC	8,630	163.37	1,409,883.10
INCYTE CORP	9,961	120.49	1,200,200.89
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	3,564	137.19	488,945.16
JOHNSON & JOHNSON	158,785	118.86	18,873,185.10
MERCK & CO. INC.	159,921	65.39	10,457,234.19
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL INC	1,522	471.55	717,699.10
MYLAN NV	26,767	42.05	1,125,552.35
PERRIGO CO PLC	8,020	84.47	677,449.40
PFIZER INC	352,040	33.62	11,835,584.80
REGENERON PHARMACEUTICALS	4,565	371.18	1,694,436.70
SEATTLE GENETICS INC	5,832	65.50	381,996.00
TARO PHARMACEUTICAL INDUSTRIES	906	116.71	105,739.26
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	22,646	158.64	3,592,561.44
UNITED THERAPEUTICS CORP	2,798	168.16	470,511.68
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	14,582	88.33	1,288,028.06
WATERS CORP	4,625	154.33	713,776.25

ZOETIS INC	27,686	52.51	1,453,791.86
BANK OF AMERICA CORP	592,268	24.52	14,522,411.36
BB & T CORPORATION	47,950	47.96	2,299,682.00
CIT GROUP INC	12,764	43.72	558,042.08
CITIGROUP INC	168,001	60.17	10,108,620.17
CITIZENS FINANCIAL GROUP	29,170	37.84	1,103,792.80
COMERICA INC	9,983	72.37	722,469.71
FIFTH THIRD BANCORP	43,129	27.54	1,187,772.66
FIRST REPUBLIC BANK/CA	8,821	95.60	843,287.60
HUNTINGTON BANCSHARES INC	61,678	14.13	871,510.14
JPMORGAN CHASE & CO	209,633	90.23	18,915,185.59
KEYCORP	63,708	18.96	1,207,903.68
M & T BANK CORP	8,306	167.91	1,394,660.46
NEW YORK COMMUNITY BANCORP	28,674	15.19	435,558.06
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL INC	18,321	19.19	351,579.99
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	28,226	126.86	3,580,750.36
REGIONS FINANCIAL CORPORATION	73,893	15.38	1,136,474.34
SIGNATURE BANK	3,150	159.30	501,795.00
SUNTRUST BANKS INC	29,184	59.59	1,739,074.56
US BANCORP	98,653	54.88	5,414,076.64
WELLS FARGO & COMPANY	277,699	58.09	16,131,534.91
AFFILIATED MANAGERS GROUP	3,086	168.42	519,744.12
ALLY FINANCIAL INC	24,733	23.21	574,052.93
AMERICAN EXPRESS COMPANY	45,104	79.71	3,595,239.84
AMERIPRISE FINANCIAL INC	9,503	128.99	1,225,791.97
BANK OF NEW YORK MELLON CORP(THE)	62,854	47.14	2,962,937.56
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	70,486	168.57	11,881,825.02
BLACKROCK INC	6,980	388.76	2,713,544.80
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	29,793	91.81	2,735,295.33
CME GROUP INC.	19,948	122.62	2,446,023.76
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	23,762	71.30	1,694,230.60
E*TRADE FINANCIAL CORPORATION	16,112	37.17	598,883.04
EATON VANCE CORP	5,530	43.53	240,720.90
FIRST DATA CORP-CLASS A	20,440	16.37	334,602.80
FRANKLIN RESOURCES INC	21,228	42.53	902,826.84
GOLDMAN SACHS GROUP INC	21,030	250.38	5,265,491.40
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	35,073	58.40	2,048,263.20
INVESCO LIMITED	23,418	32.54	762,021.72
LEUCADIA NATIONAL CORPORATION	18,603	25.56	475,492.68
MOODY'S CORP	10,189	112.90	1,150,338.10
MORGAN STANLEY	82,411	46.15	3,803,267.65
MSCI INC-A	5,292	94.27	498,876.84

NASDAQ INC	7,365	71.51	526,671.15
NAVIENT CORPORATION	15,911	15.45	245,824.95
NORTHERN TRUST CORP	12,672	87.20	1,104,998.40
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	7,507	78.86	592,002.02
S&P GLOBAL INC	15,542	130.39	2,026,521.38
SCHWAB (CHARLES) CORP	70,097	41.55	2,912,530.35
SEI INVESTMENTS COMPANY	8,073	50.49	407,605.77
STATE STREET CORP	22,960	80.67	1,852,183.20
SYNCHRONY FINANCIAL	49,093	36.68	1,800,731.24
T ROWE PRICE GROUP INC	13,893	71.10	987,792.30
TD AMERITRADE HOLDING CORPORATION	15,062	43.15	649,925.30
AFLAC INC	24,112	71.10	1,714,363.20
ALLEGHANY CORPORATION	969	636.79	617,049.51
ALLSTATE CORP	21,868	80.44	1,759,061.92
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	61,583	62.50	3,848,937.50
AON PLC	15,636	117.53	1,837,699.08
ARCH CAPITAL GROUP LTD.	6,878	94.02	646,669.56
ARTHUR J GALLAGHER & CO	10,422	56.94	593,428.68
ASSURANT INC	3,023	96.75	292,475.25
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	5,338	68.56	365,973.28
CHUBB LTD	26,715	136.19	3,638,315.85
CINCINNATI FINANCIAL CORP	8,560	72.67	622,055.20
EVEREST RE GROUP LTD	2,633	235.12	619,070.96
FNF GROUP	13,005	37.64	489,508.20
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	21,634	48.36	1,046,220.24
LINCOLN NATIONAL CORP	13,187	71.69	945,376.03
LOEWS CORPORATION	16,336	46.98	767,465.28
MARKEL CORP	799	964.71	770,803.29
MARSH & MCLENNAN COS	30,553	73.52	2,246,256.56
METLIFE INC	54,987	52.97	2,912,661.39
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	16,931	62.12	1,051,753.72
PROGRESSIVE CORP	34,257	38.57	1,321,292.49
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	25,026	111.11	2,780,638.86
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	4,066	129.09	524,879.94
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	2,159	146.04	315,300.36
TORCHMARK CORPORATION	6,698	77.12	516,549.76
TRAVELERS COS INC(THE)	16,971	121.95	2,069,613.45
UNUM GROUP	13,176	48.51	639,167.76
VOYA FINANCIAL INC	11,788	41.90	493,917.20
W.R.BERKLEY CORPORATION	5,781	70.56	407,907.36
WILLIS TOWERS WATSON PLC	7,721	128.35	990,990.35
XL GROUP LTD	15,879	40.95	650,245.05

CBRE GROUP INC-A	17,067	35.68	608,950.56
CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP	19,872	89.23	1,773,178.56
EQUINIX INC	4,184	374.28	1,565,987.52
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	63,800	6.89	439,582.00
JONES LANG LASALLE INC	2,660	116.28	309,304.80
ACCENTURE PLC-CL A	35,821	121.23	4,342,579.83
ACTIVISION BLIZZARD INC	34,920	45.33	1,582,923.60
ADOBE SYSTEMS INC	29,334	119.67	3,510,399.78
AKAMAI TECHNOLOGIES	9,733	62.34	606,755.22
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	3,241	235.04	761,764.64
ALPHABET INC-CL A	17,092	846.55	14,469,232.60
ALPHABET INC-CL C	17,903	828.07	14,824,937.21
ANSYS INC	4,975	100.27	498,843.25
AUTODESK INC	11,299	86.40	976,233.60
AUTOMATIC DATA PROCESSING	26,855	99.68	2,676,906.40
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS	6,436	68.58	441,380.88
CA INC	19,624	32.09	629,734.16
CADENCE DESIGN SYS INC	17,210	30.20	519,742.00
CDK GLOBAL INC	8,124	65.47	531,878.28
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES	7,952	101.21	804,821.92
CITRIX SYSTEMS INC	9,168	80.50	738,024.00
COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS CORPORATION	35,731	57.96	2,070,968.76
COMPUTER SCIENCES CORP	8,192	70.56	578,027.52
COSTAR GROUP INC	2,104	209.69	441,187.76
EBAY INC	63,142	33.76	2,131,673.92
ELECTRONIC ARTS INC	17,706	87.30	1,545,733.80
FACEBOOK INC-A	134,820	133.53	18,002,514.60
FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES	18,334	82.05	1,504,304.70
FISERV INC	12,940	111.98	1,449,021.20
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	5,450	166.47	907,261.50
FORTINET INC	9,060	37.45	339,342.30
GARTNER INC	5,234	103.13	539,782.42
GLOBAL PAYMENTS INC	8,574	77.95	668,343.30
INTL BUSINESS MACHINES CORP	52,495	180.67	9,484,271.65
INTUIT INC	14,310	119.86	1,715,196.60
MASTERCARD INC-CL A	55,938	109.42	6,120,735.96
MERCADOLIBRE INC	2,340	198.43	464,326.20
MICROSOFT CORP	429,651	64.62	27,764,047.62
NUANCE COMMUNICATIONS INC	16,413	16.96	278,364.48
ORACLE CORPORATION	178,552	42.06	7,509,897.12
PAYCHEX INC	18,205	59.13	1,076,461.65
PAYPAL HOLDINGS INC	63,946	41.96	2,683,174.16

RED HAT INC	10,322	82.60	852,597.20
SABRE CORP	12,278	21.30	261,521.40
SALESFORCE.COM, INC.	37,890	81.47	3,086,898.30
SERVICENOW INC	9,684	92.74	898,094.16
SPLUNK INC	7,630	64.37	491,143.10
SYMANTEC CORPORATION	34,431	28.80	991,612.80
SYNOPSYS INC	8,909	70.51	628,173.59
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	9,740	54.47	530,537.80
TWITTER INC	31,928	16.62	530,643.36
VANTIV INC-CL A	9,060	64.86	587,631.60
VERISIGN INC	5,652	82.30	465,159.60
VISA INC	109,057	87.46	9,538,125.22
VMWARE INC	3,826	91.22	349,007.72
WESTERN UNION COMPANY	30,448	19.82	603,479.36
WORKDAY INC-CLASS A	7,452	88.43	658,980.36
XEROX CORP	50,705	7.44	377,245.20
YAHOO! INC	53,230	45.10	2,400,673.00
ZILLOW GROUP INC-C	7,718	35.39	273,140.02
AMPHENOL CORPORATION -CL A	17,380	69.46	1,207,214.80
APPLE INC	312,736	135.72	42,444,529.92
ARROW ELECTRONICS INC	5,286	73.50	388,521.00
AVNET INC	6,544	46.41	303,707.04
CDW CORP/DE	9,358	59.99	561,386.42
CISCO SYSTEMS INC	290,765	33.74	9,810,411.10
CORNING INC	61,041	27.65	1,687,783.65
DELL TECHNOLOGIES INC-CL V	12,719	64.59	821,520.21
F5 NETWORKS INC	3,897	143.35	558,634.95
FLEX LTD	34,679	16.44	570,122.76
FLIR SYSTEMS INC	7,048	36.62	258,097.76
HARRIS CORP	7,099	109.46	777,056.54
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE C	97,825	24.40	2,386,930.00
HP INC	100,703	15.95	1,606,212.85
JUNIPER NETWORKS INC	20,290	28.39	576,033.10
MOTOROLA SOLUTIONS INC	8,355	79.31	662,635.05
NETAPP INC	16,097	40.17	646,616.49
PALO ALTO NETWORKS INC	5,121	154.76	792,525.96
QORVO INC	8,158	67.12	547,564.96
QUALCOMM INC	84,858	56.46	4,791,082.68
SEAGATE TECHNOLOGY	16,785	47.14	791,244.90
SKYWORKS SOLUTIONS INC	10,477	96.35	1,009,458.95
TE CONNECTIVITY LTD	20,931	75.21	1,574,220.51
TRIMBLE INC	14,277	31.18	445,156.86

WESTERN DIGITAL CORP	16,735	74.91	1,253,618.85
AT&T INC	357,051	41.48	14,810,475.48
CENTURYLINK INC	32,141	24.28	780,383.48
FRONTIER COMMUNICATIONS CORPORATION	55,620	3.29	182,989.80
LEVEL 3 COMMUNICATIONS INC	17,990	57.30	1,030,827.00
SBA COMMUNICATIONS CORP	7,336	108.47	795,735.92
SPRINT CORP	50,197	9.30	466,832.10
T-MOBILE US INC	16,265	63.92	1,039,658.80
VERIZON COMMUNICATIONS INC	236,581	49.19	11,637,419.39
ZAYO GROUP HOLDINGS INC	9,150	30.83	282,094.50
AES CORPORATION	34,931	11.46	400,309.26
ALLIANT ENERGY CORP	13,271	38.08	505,359.68
AMEREN CORPORATION	13,376	53.37	713,877.12
AMERICAN ELECTRIC POWER	29,063	64.11	1,863,228.93
AMERICAN WATER WORKS CO INC	9,814	73.81	724,371.34
ATMOS ENERGY CORP	5,637	76.04	428,637.48
CALPINE CORP	16,738	11.47	191,984.86
CENTERPOINT ENERGY INC	23,598	26.51	625,582.98
CMS ENERGY CORPORATION	16,033	43.22	692,946.26
CONSOLIDATED EDISON INC	17,921	73.50	1,317,193.50
DOMINION RESOURCES INC/VA	36,970	73.77	2,727,276.90
DTE ENERGY COMPANY	10,563	98.12	1,036,441.56
DUKE ENERGY CORP	40,561	78.36	3,178,359.96
EDISON INTERNATIONAL	19,180	76.34	1,464,201.20
ENERGY CORP	11,052	73.55	812,874.60
EVERSOURCE ENERGY	17,785	56.15	998,627.75
EXELON CORP	54,329	35.58	1,933,025.82
FIRSTENERGY CORP	23,453	31.01	727,277.53
NEXTERA ENERGY INC	26,518	126.86	3,364,073.48
NISOURCE INC	19,053	22.70	432,503.10
OGE ENERGY CORP	11,114	34.62	384,766.68
P G & E CORPORATION	29,671	63.92	1,896,570.32
PINNACLE WEST CAPITAL CORPORATION	5,985	78.70	471,019.50
PPL CORPORATION	39,919	35.63	1,422,313.97
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	29,362	43.49	1,276,953.38
SCANA CORP	8,509	65.65	558,615.85
SEMPRA ENERGY	13,970	105.85	1,478,724.50
SOUTHERN CO	57,616	47.80	2,754,044.80
UGI CORPORATION	9,182	47.46	435,777.72
WEC ENERGY GROUP INC	18,581	57.54	1,069,150.74
WESTAR ENERGY INC	8,114	53.05	430,447.70
XCEL ENERGY INC	29,903	42.00	1,255,926.00

	ANALOG DEVICES INC	17,368	82.48	1,432,512.64
	APPLIED MATERIALS INC	63,632	35.67	2,269,753.44
	BROADCOM LTD	22,774	210.41	4,791,877.34
	INTEL CORP	273,022	36.48	9,959,842.56
	KLA-TENCOR CORPORATION	8,674	88.46	767,302.04
	LAM RESEARCH CORP	8,980	114.90	1,031,802.00
	LINEAR TECHNOLOGY CORP	13,590	64.92	882,262.80
	MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	28,181	15.81	445,541.61
	MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	15,825	45.11	713,865.75
	MICROCHIP TECHNOLOGY INC	12,238	71.68	877,219.84
	MICRON TECHNOLOGY INC	58,658	23.35	1,369,664.30
	NVIDIA CORP	31,495	107.23	3,377,208.85
	NXP SEMICONDUCTORS NV	17,688	102.40	1,811,251.20
	TEXAS INSTRUMENTS INC	57,733	76.44	4,413,110.52
	XILINX INC	14,382	60.06	863,782.92
	米ドル 小計	18,010,369		1,208,946,525.69 (136,465,883,819)
カナダドル	ALTAGAS LTD	6,948	31.35	217,819.80
	ARC RESOURCES LTD	20,661	21.53	444,831.33
	CAMECO CORP	24,102	15.35	369,965.70
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	66,057	39.37	2,600,664.09
	CENOVUS ENERGY INC	46,412	17.88	829,846.56
	CRESCENT POINT ENERGY CORP	29,608	16.24	480,833.92
	ENBRIDGE INC	55,859	54.97	3,070,569.23
	ENCANA CORP	59,142	16.20	958,100.40
	HUSKY ENERGY INC	21,322	16.35	348,614.70
	IMPERIAL OIL LTD	15,807	42.87	677,646.09
	INTER PIPELINE LTD	22,863	29.51	674,687.13
	KEYERA CORP	8,467	41.31	349,771.77
	PEMBINA PIPELINE CORP	24,250	42.86	1,039,355.00
	PEYTO EXPLORATION & DEV CORP	8,811	28.71	252,963.81
	PRAIRIESKY ROYALTY LTD	12,442	29.90	372,015.80
	SEVEN GENERATIONS ENERGY-A	14,441	26.03	375,899.23
	SUNCOR ENERGY INC	95,482	42.13	4,022,656.66
	TOURMALINE OIL CORP	12,887	31.65	407,873.55
	TRANSCANADA CORP	48,854	62.24	3,040,672.96
	VERESEN INC	20,344	14.05	285,833.20
	VERMILION ENERGY INC	5,586	52.05	290,751.30
	AGNICO EAGLE MINES LIMITED	12,763	61.32	782,627.16
	AGRIUM INC	7,862	135.64	1,066,401.68
	BARRICK GOLD CORP	65,680	26.41	1,734,608.80
	CCL INDUSTRIES INC-CL B	1,825	270.00	492,750.00

ELDORADO GOLD CORPORATION	41,255	4.80	198,024.00
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	39,175	15.00	587,625.00
FRANCO-NEVADA CORPORATION	9,959	88.06	876,989.54
GOLDCORP INC	52,646	22.76	1,198,222.96
KINROSS GOLD CORP	75,698	5.06	383,031.88
METHANEX CORPORATION	5,484	66.23	363,205.32
POTASH CORP OF SASKATCHEWAN	49,417	24.50	1,210,716.50
SILVER WHEATON CORPORATION	23,656	28.22	667,572.32
TECK RESOURCES LIMITED-CL B	34,939	27.98	977,593.22
TURQUOISE HILL RESOURCES LTD	45,107	4.53	204,334.71
WEST FRASER TIMBER CO LTD	2,873	52.95	152,125.35
YAMANA GOLD INC	51,365	4.04	207,514.60
BOMBARDIER INC 'B'	115,394	2.53	291,946.82
CAE INC	13,932	20.42	284,491.44
FINNING INTERNATIONAL INC	7,972	25.45	202,887.40
SNC-LAVALIN GROUP INC	8,714	57.68	502,623.52
CANADIAN NATL RAILWAY CO	44,444	93.85	4,171,069.40
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	8,495	195.89	1,664,085.55
LINAMAR CORP	2,200	60.87	133,914.00
MAGNA INTERNATIONAL INC	21,981	59.60	1,310,067.60
GILDAN ACTIVEWEAR INC	12,997	32.78	426,041.66
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	13,831	70.67	977,436.77
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	26,188	28.03	734,049.64
THOMSON REUTERS CORP	20,474	58.87	1,205,304.38
CANADIAN TIRE CORP -CL A	3,990	157.49	628,385.10
DOLLARAMA INC	6,425	102.96	661,518.00
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC-B	25,515	61.39	1,566,365.85
EMPIRE CO LTD A	7,235	17.15	124,080.25
JEAN COUTU GROUP INC A	2,801	20.10	56,300.10
LOBLAW COMPANIES LTD	13,831	68.19	943,135.89
METRO INC	13,589	40.17	545,870.13
WESTON (GEORGE) LTD	3,180	110.60	351,708.00
SAPUTO INC	13,709	45.77	627,460.93
VALEANT PHARMACEUTICALS INTERN	20,194	21.02	424,477.88
BANK OF MONTREAL	37,971	101.41	3,850,639.11
BANK OF NOVA SCOTIA	69,217	81.82	5,663,334.94
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	23,244	116.49	2,707,693.56
NATIONAL BANK OF CANADA	18,686	58.23	1,088,085.78
ROYAL BANK OF CANADA	85,697	99.09	8,491,715.73
TORONTO-DOMINION BANK	106,939	69.44	7,425,844.16
CI FINANCIAL CORP	14,904	27.90	415,821.60
ELEMENT FLEET MANAGEMENT CORP	19,611	13.92	272,985.12

	IGM FINANCIAL INC	5,296	42.02	222,537.92
	ONEX CORPORATION	4,217	94.87	400,066.79
	FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	1,327	618.00	820,086.00
	GREAT-WEST LIFE CO INC	17,440	37.40	652,256.00
	INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANCE AND FINANC	4,851	58.48	283,686.48
	INTACT FINANCIAL CORPORATION	7,415	96.69	716,956.35
	MANULIFE FINANCIAL CORP	118,140	24.83	2,933,416.20
	POWER CORP OF CANADA	21,768	32.23	701,582.64
	POWER FINANCIAL CORP	14,523	35.61	517,164.03
	SUN LIFE FINANCIAL INC	37,008	49.89	1,846,329.12
	BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT INC	51,899	48.91	2,538,380.09
	FIRST CAPITAL REALTY INC	6,546	20.53	134,389.38
	CGI GROUP INC - CL A	13,534	63.73	862,521.82
	CONSTELLATION SOFTWARE	1,073	610.94	655,538.62
	OPEN TEXT CORPORATION	14,274	43.87	626,200.38
	BLACKBERRY LIMITED	23,701	9.79	232,032.79
	BCE INC	8,582	58.76	504,278.32
	ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	22,256	57.52	1,280,165.12
	TELUS CORPORATION	9,642	43.93	423,573.06
	ATCO LTD-CLASS I	4,985	45.73	227,964.05
	CANADIAN UTILITIES LIMITED	8,036	36.68	294,760.48
	EMERA INC	2,409	45.27	109,055.43
	FORTIS INC	21,944	43.20	947,980.80
	HYDRO ONE LTD	9,317	23.84	222,117.28
	カナダドル 小計	2,353,592		98,117,094.73 (8,455,731,223)
ユーロ	ENI SPA	151,544	14.12	2,139,801.28
	GALP ENERGIA SGPS S.A	29,714	13.70	407,081.80
	NESTE OYJ	7,547	34.83	262,862.01
	OMV AG	8,819	35.20	310,472.89
	REPSOL SA	64,593	13.62	880,079.62
	SAIPEM	393,610	0.46	182,044.62
	TENARIS S.A.	26,776	15.86	424,667.36
	TOTAL SA	130,015	47.44	6,167,911.60
	VOPAK	4,593	38.81	178,254.33
	AIR LIQUIDE	22,222	104.80	2,328,865.60
	AKZO NOBEL	14,000	62.79	879,060.00
	ARCELOR MITTAL	110,048	8.54	940,690.30
	ARKEMA	3,915	95.58	374,195.70
	BASF SE	53,307	89.10	4,749,653.70
	COVESTRO AG	4,691	72.10	338,221.10
	CRH PLC	48,530	32.20	1,562,666.00

EVONIK INDUSTRIES AG	8,771	30.74	269,620.54
FUCHS PETROLUB SE-PREF	3,370	43.68	147,201.60
HEIDELBERGCEMENT AG	8,804	85.44	752,213.76
IMERYS SA	2,030	76.69	155,680.70
K+S AG	9,644	22.75	219,401.00
KONINKLIJKE DSM NV	11,271	61.01	687,643.71
LANXESS	5,325	67.72	360,609.00
LINDE AG	11,161	152.20	1,698,704.20
SOLVAY SA	4,680	115.90	542,412.00
STORA ENSO OYJ-R SHS	29,833	10.27	306,384.91
SYMRISE AG	7,266	57.24	415,905.84
THYSSENKRUPP AG	19,734	22.89	451,809.93
UMICORE	4,905	49.46	242,625.82
UPM-KYMMENE OYJ	32,143	22.74	730,931.82
VOESTALPINE AG	6,996	40.89	286,101.42
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	12,367	29.68	367,114.39
AIRBUS SE	33,102	65.40	2,164,870.80
ALSTOM RGPT	8,821	26.00	229,390.10
ANDRITZ AG	4,484	50.65	227,114.60
BOSKALIS WESTMINSTER NV	5,738	34.97	200,657.86
BOUYGUES SA	12,200	35.04	427,549.00
BRENTAG AG	9,604	54.54	523,802.16
CNH INDUSTRIAL NV	55,561	8.81	489,492.41
COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	30,159	45.46	1,371,028.14
DASSAULT AVIATION SA	117	1,076.85	125,991.45
EIFFAGE SA	3,580	68.50	245,230.00
FERROVIAL SA	27,801	17.02	473,173.02
GEA GROUP AG	9,966	39.48	393,507.51
HOCHTIEF AG	1,364	140.70	191,914.80
KONE OYJ-B	19,406	41.62	807,677.72
KONINKLIJKE PHILIPS NV	55,048	27.76	1,528,132.48
LEGRAND SA	16,366	55.23	903,894.18
LEONARDO SPA	22,528	11.83	266,506.24
MAN SE	2,092	97.25	203,447.00
METSO OYJ	7,107	28.57	203,046.99
OSRAM LICHT AG	4,588	57.10	261,974.80
PRYSMIAN SPA	12,899	24.05	310,220.95
REXEL SA	18,396	15.80	290,656.80
SAFRAN SA	18,956	64.38	1,220,387.28
SCHNEIDER ELECTRIC SE	32,357	65.06	2,105,146.42
SIEMENS AG-REG	44,306	120.60	5,343,303.60
THALES SA	5,961	89.10	531,125.10

VINCI S.A.	30,333	68.21	2,069,013.93
WARTSILA OYJ-B SHARES	8,572	49.31	422,685.32
ZARDOYA OTIS SA	13,802	7.82	107,931.64
ZODIAC AEROSPACE	10,335	26.30	271,810.50
BIC	1,337	118.30	158,167.10
BUREAU VERITAS SA	15,733	18.65	293,499.11
EDENRED	12,710	20.75	263,732.50
PADDY POWER BETFAIR PLC	4,592	98.70	453,230.40
RANDSTAD HOLDING NV	6,526	55.50	362,193.00
ABERTIS INFRASTRUCTURAS SA	34,535	13.76	475,201.60
AENA SA	3,899	135.00	526,365.00
AEROPORTS DE PARIS (ADP)	1,346	107.50	144,695.00
ATLANTIA SPA	23,300	22.13	515,629.00
BOLLORE	39,433	3.66	144,443.07
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	12,281	13.50	165,793.50
DEUTSCHE POST AG-REG	58,213	31.89	1,856,703.63
FRAPORT AG	1,856	59.38	110,209.28
GROUPE EUROTUNNEL SE	23,484	9.01	211,708.26
INTERNATIONAL CONSOLIDATED AIRLINES GROUP	51,742	6.00	310,710.71
RYANAIR HOLDINGS PLC	1,614	14.18	22,886.52
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	19,817	85.03	1,685,039.51
BAYERISCHE MOTOREN WERKE(BMW)AG-PFD	3,579	69.38	248,311.02
CONTINENTAL AG	6,724	190.85	1,283,275.40
DAIMLER AG	55,366	67.61	3,743,295.26
FERRARI NV	7,007	61.45	430,580.15
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	56,806	10.64	604,415.84
MICHELIN (CGDE)-B	11,065	105.35	1,165,697.75
NOKIAN RENKAAT OYJ	6,990	36.40	254,436.00
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE PEF	9,110	53.97	491,666.70
PSA PEUGEOT CITROEN	27,565	18.52	510,641.62
RENAULT SA	11,718	87.08	1,020,403.44
SCHAEFFLER AG	9,576	14.75	141,293.88
VALEO SA	14,656	58.77	861,333.12
VOLKSWAGEN AG	1,615	144.85	233,932.75
VOLKSWAGEN AG PFD	9,764	140.25	1,369,401.00
ADIDAS AG	11,255	148.45	1,670,804.75
CHRISTIAN DIOR SE	3,366	198.65	668,655.90
HERMES INTERNATIONAL	1,475	407.50	601,062.50
HUGO BOSS AG	3,891	65.24	253,848.84
KERING	4,611	225.70	1,040,702.70
LUXOTTICA GROUP SPA	9,452	48.88	462,013.76
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	16,022	186.85	2,993,710.70

SEB SA	1,032	123.55	127,503.60
ACCOR SA	9,357	38.50	360,244.50
SODEXO	5,188	103.75	538,255.00
ALTICE NV -A W/I	20,146	20.35	409,971.10
ALTICE NV -B W/I	6,439	20.34	130,969.26
AXEL SPRINGER SE	2,952	48.31	142,611.12
EUTELSAT COMMUNICATIONS	8,726	17.20	150,130.83
JC DECAUX SA	2,828	30.19	85,391.46
LAGARDERE S.C.A.	6,108	23.76	145,126.08
PROSIEBEN SAT.1 MEDIA SE-REG	13,157	39.00	513,123.00
PUBLICIS GROUPE	10,644	63.47	675,574.68
RELX NV	60,806	16.46	1,001,170.79
RTL GROUP	2,567	73.05	187,519.35
SES	21,377	19.70	421,126.90
SFR GROUP SA	5,853	25.95	151,885.35
TELENET GROUP HOLDINGS NV	3,224	52.87	170,452.88
WOLTERS KLUWER-CVA	16,170	37.33	603,626.10
INDITEX	62,597	31.02	1,941,758.94
CARREFOUR SA	31,459	22.60	710,973.40
CASINO GUICHARD PERRACHON	2,725	50.95	138,838.75
COLRUYT NV	3,273	45.45	148,774.21
DISTRIBUIDORA INTERNACIONAL	29,663	4.96	147,128.48
JERONIMO MARTINS SGPS S.A.	15,715	16.14	253,640.10
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	76,857	20.38	1,566,345.66
METRO AG	9,739	29.80	290,222.20
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	44,169	102.05	4,507,446.45
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	11,503	33.71	387,766.13
DANONE	35,330	61.00	2,155,130.00
HEINEKEN HOLDING NV	5,455	71.33	389,105.15
HEINEKEN NV	14,053	76.90	1,080,675.70
KERRY GROUP PLC-A	9,177	70.51	647,070.27
PERNOD-RICARD SA	12,819	108.20	1,387,015.80
REMY COINTREAU	1,273	86.63	110,279.99
UNILEVER NV-CVA	94,486	44.80	4,232,972.80
BEIERSDORF AG	5,727	85.74	491,032.98
HENKEL AG & CO KGAA	6,185	104.05	643,549.25
HENKEL AG & CO KGAA	10,488	120.10	1,259,608.80
L'OREAL	14,416	176.10	2,538,657.60
ESSILOR INTERNATIONAL	12,197	107.75	1,314,226.75
FRESENIUS MEDICAL CARE AG AND CO.KGAA	12,641	75.90	959,451.90
FRESENIUS SE & CO KGAA	24,351	75.24	1,832,169.24
BAYER AG	47,995	106.50	5,111,467.50

EUROFINS SCIENTIFIC	646	415.15	268,186.90
GRIFOLS S.A.	17,560	21.11	370,691.60
MERCK KGAA	7,156	101.35	725,260.60
ORION OYJ	6,170	46.70	288,139.00
QIAGEN N.V.	12,422	26.97	335,083.45
SANOFI	66,893	81.49	5,451,110.57
UCB SA	7,443	68.08	506,719.44
ZALANDO SE	5,372	37.15	199,569.80
ABN AMRO GROUP NV-CVA	18,153	21.88	397,187.64
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	392,927	6.24	2,451,864.48
BANCO DE SABADELL SA	336,934	1.46	493,945.24
BANCO ESPIRITO SANTO,S.A(BES)	187,906	0.01	1,879.06
BANCO POPULAR ESPANOL	155,616	0.84	131,339.90
BANCO SANTANDER SA	852,341	5.14	4,381,032.74
BANK OF IRELAND	1,626,681	0.23	379,016.67
BANKIA SA	276,240	0.95	263,532.96
BANKINTER,S.A.	34,025	7.24	246,647.22
BNP PARIBAS	61,050	55.75	3,403,537.50
CAIXABANK	189,114	3.36	636,746.83
COMMERZBANK AG	60,611	7.41	449,248.73
CREDIT AGRICOLE SA	68,943	11.82	814,906.26
ERSTE GROUP BANK AG	16,913	29.41	497,495.89
INTESA SANPAOLO	749,949	2.17	1,627,389.33
INTESA SANPAOLO-RSP	50,545	2.08	105,133.60
KBC GROUPE SA	14,768	58.24	860,088.32
NATIXIS	57,006	5.49	313,361.98
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG	6,210	21.95	136,309.50
SOCIETE GENERALE	45,169	42.40	1,915,165.60
UNICREDIT SPA	111,206	12.90	1,434,557.40
DEUTSCHE BANK AG -REG	81,198	18.20	1,477,803.60
DEUTSCHE BOERSE AG-TENDER	11,803	83.28	982,953.84
EURAZEO	1,926	58.90	113,441.40
EXOR NV	6,517	45.14	294,177.38
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	4,779	79.73	381,029.67
ING GROEP NV-CVA	225,070	13.45	3,028,316.85
MEDIOBANCA SPA	34,833	8.04	280,231.48
WENDEL	1,532	107.10	164,077.20
AEGON NV	102,134	5.02	513,325.48
AGEAS	11,146	37.21	414,742.66
ALLIANZ SE-REG	26,302	162.80	4,281,965.60
ASSICURAZIONI GENERALI	65,527	14.86	973,731.22
AXA SA	111,036	22.46	2,494,423.74

CNP ASSURANCES	11,162	17.76	198,292.93
HANNOVER RUECKVERSICHERUNG SE	3,033	106.50	323,014.50
MAPFRE SA	68,075	2.88	196,464.45
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	9,278	177.45	1,646,381.10
NN GROUP NV	16,745	29.64	496,405.52
POSTE ITALIANE SPA	32,840	6.05	198,846.20
SAMPO OYJ-A SHS	26,317	43.35	1,140,841.95
SCOR SE	9,624	32.31	310,951.44
UNIPOLSAI SPA	49,963	2.01	100,425.63
DEUTSCHE WOHNEN AG-BR	18,909	32.13	607,546.17
VONOVIA SE	28,568	32.88	939,315.84
AMADEUS IT GROUP SA	25,833	43.30	1,118,568.90
ATOS SE	5,583	105.05	586,494.15
CAP GEMINI SA	10,073	82.02	826,187.46
DASSAULT SYSTEMES SA	6,868	76.02	522,105.36
GEMALTO	3,838	55.13	211,588.94
SAP SE	56,637	86.89	4,921,188.93
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	5,981	38.16	228,234.96
INGENICO S.A.	3,325	80.12	266,399.00
NOKIA OYJ	332,791	4.69	1,563,452.11
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	188,605	15.86	2,991,275.30
ELISA OYJ	8,373	31.24	261,572.52
ILIAD SA	1,546	195.00	301,470.00
KONINKLIJKE KPN NV	192,155	2.60	499,795.15
ORANGE S.A.	113,361	14.39	1,631,831.59
PROXIMUS SA	8,955	27.50	246,307.27
TELECOM ITALIA SPA	596,054	0.78	467,306.33
TELECOM ITALIA-RNC	365,506	0.64	235,751.37
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	48,244	3.94	190,419.06
TELEFONICA S.A.	269,286	9.32	2,510,822.66
VIVENDI SA	62,555	16.97	1,061,558.35
E.ON SE	112,982	7.06	797,991.86
EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	127,146	2.85	363,510.41
ELECTRICITE DE FRANCE(EDF)	13,019	9.04	117,756.85
ENAGAS	13,652	23.39	319,388.54
ENDESA S.A.	17,200	19.95	343,140.00
ENEL SPA	434,146	4.04	1,753,949.84
ENGIE	96,148	11.08	1,065,319.84
FORTUM OYJ	24,333	14.23	346,258.59
GAS NATURAL SDG SA	19,321	18.04	348,647.44
IBERDROLA SA	326,686	6.02	1,967,956.46
INNOGY SE	8,583	33.90	291,006.61

	RED ELECTRICA CORPORATION SA	24,948	17.28	431,226.18
	RWE AG	28,403	13.22	375,487.66
	SNAM SPA	127,541	3.80	485,165.96
	SUEZ	17,312	14.55	251,976.16
	TERNA SPA	87,158	4.37	380,880.46
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	28,101	16.00	449,616.00
	ASML HOLDING NV	21,273	118.65	2,524,041.45
	INFINEON TECHNOLOGIES AG	68,528	17.00	1,164,976.00
	STMICROELECTRONICS NV	33,781	13.31	449,794.01
	ユーロ 小計	13,492,787		206,995,525.46 (24,800,133,905)
英ポンド	BP PLC	1,090,179	4.46	4,862,198.34
	PETROFAC LIMITED	12,177	8.69	105,879.01
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	251,068	20.95	5,259,874.60
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	217,466	21.85	4,752,719.43
	ANGLO AMERICAN PLC	82,723	13.45	1,112,624.35
	ANTOFAGASTA PLC	19,439	8.37	162,704.43
	BHP BILLITON PLC	126,398	13.94	1,762,620.11
	CRODA INTERNATIONAL PLC	6,223	34.08	212,079.84
	FRESNILLO PLC	11,716	15.23	178,434.68
	GLENCORE PLC	718,130	3.19	2,294,066.28
	JOHNSON MATTHEY PLC	11,403	30.62	349,159.86
	MONDI PLC	20,772	18.59	386,151.48
	RANDGOLD RESOURCES LTD	5,368	73.85	396,426.80
	RIO TINTO PLC	71,800	35.99	2,584,441.00
	ASHTREAD GROUP PLC	31,411	17.04	535,243.44
	BAE SYSTEMS PLC	179,292	6.06	1,087,405.98
	BUNZL PLC	18,074	21.62	390,759.88
	COBHAM PLC	73,920	1.13	83,825.28
	DCC PLC	5,719	67.80	387,748.20
	IMI PLC	16,924	12.18	206,134.32
	MEGGITT PLC	52,383	4.17	218,908.55
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	112,489	6.66	749,176.74
	SMITHS GROUP PLC	22,759	15.14	344,571.26
	TRAVIS PERKINS PLC	12,496	15.02	187,689.92
	WEIR GROUP PLC/THE	12,829	19.50	250,165.50
	WOLSELEY PLC	15,463	49.91	771,758.33
	BABCOCK INTERNATIONAL GROUP PLC	11,442	8.95	102,463.11
	CAPITA PLC	41,602	5.22	217,162.44
	EXPERIAN PLC	53,872	16.08	866,261.76
	G4S PLC	93,347	2.60	242,888.89
	INTERTEK GROUP PLC	9,324	35.38	329,883.12

MERLIN ENTERTAINMENTS PLC	44,414	4.89	217,539.77
EASYJET PLC	7,630	9.63	73,515.05
ROYAL MAIL PLC	53,855	4.10	221,128.63
GKN PLC	93,825	3.47	325,854.22
BURBERRY GROUP PLC	27,904	16.60	463,206.40
PERSIMMON PLC	17,735	20.11	356,650.85
TAYLOR WIMPEY PLC	189,280	1.77	335,972.00
THE BERKELEY GROUP HOLDINGS	8,723	29.38	256,281.74
CARNIVAL PLC	10,738	43.03	462,056.14
COMPASS GROUP PLC	93,650	14.73	1,379,464.50
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	10,114	38.89	393,333.46
TUI AG-DI	28,865	11.24	324,442.60
WHITBREAD PLC	11,517	39.36	453,309.12
WILLIAM HILL PLC	41,877	2.62	109,885.24
ITV PLC	227,922	2.05	468,379.71
PEARSON PLC	46,957	6.68	313,907.54
RELX PLC	62,494	14.84	927,410.96
SKY PLC	63,702	9.95	633,834.90
WPP PLC	72,920	19.00	1,385,480.00
DIXONS CARPHONE PLC	49,868	3.01	150,202.41
KINGFISHER PLC	122,444	3.27	400,514.32
MARKS & SPENCER GROUP PLC	89,202	3.25	290,352.51
NEXT PLC	7,873	38.52	303,267.96
SAINSBURY (J) PLC	89,242	2.68	239,525.52
TESCO PLC	458,386	1.95	897,290.59
WILLIAM MORRISON SUPERMARKETS PLC	128,977	2.48	321,023.75
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	19,385	26.09	505,754.65
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	108,807	50.04	5,444,702.28
COCA-COLA HBC AG-CDI	8,704	19.89	173,122.56
DIAGEO PLC	147,096	22.73	3,343,492.08
IMPERIAL BRANDS PLC	56,259	37.81	2,127,152.79
TATE & LYLE PLC	24,535	7.38	181,068.30
UNILEVER PLC	75,296	37.97	2,858,989.12
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	59,885	5.20	311,701.42
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	36,699	71.00	2,605,629.00
MEDICLINIC INTERNATIONAL PLC	15,126	8.28	125,243.28
SMITH & NEPHEW PLC	53,445	12.03	642,943.35
ASTRAZENECA PLC	73,576	45.95	3,380,817.20
GLAXOSMITHKLINE PLC	284,816	16.39	4,669,558.32
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	7,449	20.34	151,512.66
SHIRE PLC	52,828	48.36	2,554,762.08
BARCLAYS PLC	981,723	2.37	2,326,683.51

	HSBC HOLDINGS PLC	1,154,504	7.07	8,168,115.80
	LLOYDS BANKING GROUP PLC	3,728,162	0.66	2,492,649.11
	ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	199,689	2.42	484,046.13
	STANDARD CHARTERED PLC	197,263	7.73	1,524,842.99
	3I GROUP PLC	52,448	7.20	377,625.60
	ABERDEEN ASSET MGMT PLC	60,380	2.64	159,825.86
	HARGREAVES LANSDOWN PLC	16,261	13.72	223,100.92
	INVESTEC PLC	33,008	5.90	194,912.24
	LONDON STOCK EXCHANGE GROUP PLC	17,642	31.30	552,194.60
	PROVIDENT FINANCIAL PLC	7,000	27.88	195,160.00
	SCHRODERS PLC	8,092	30.69	248,343.48
	ADMIRAL GROUP PLC	10,760	18.48	198,844.80
	AVIVA PLC	245,163	4.98	1,221,892.39
	DIRECT LINE INSURANCE GROUP	82,732	3.53	292,788.54
	LEGAL & GENERAL GROUP PLC	330,065	2.44	805,358.60
	OLD MUTUAL PLC	304,446	2.16	657,907.80
	PRUDENTIAL PLC	149,683	16.14	2,415,883.62
	RSA INSURANCE GROUP PLC	60,292	5.81	350,597.98
	ST JAMES'S PLACE PLC	26,198	10.90	285,558.20
	STANDARD LIFE PLC	124,704	3.67	457,913.08
	AUTO TRADER GROUP PLC	56,277	4.02	226,571.20
	SAGE GROUP PLC/THE	61,235	6.33	387,923.72
	WORLDPAY GROUP PLC	116,335	2.67	310,847.12
	BT GROUP PLC	503,713	3.16	1,592,236.79
	INMARSAT PLC	20,829	6.15	128,098.35
	VODAFONE GROUP PLC	1,544,287	1.98	3,057,688.26
	CENTRICA PLC	301,678	2.32	701,703.02
	NATIONAL GRID PLC	220,828	9.61	2,122,598.73
	SEVERN TRENT PLC	14,073	23.10	325,086.30
	SSE PLC	61,287	15.24	934,013.88
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	38,716	9.51	368,189.16
	英ポンド 小計	17,221,701		105,960,907.69 (14,856,778,867)
スイスフラン	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	421	574.00	241,654.00
	GIVAUDAN-REG	564	1,801.00	1,015,764.00
	LAFARGEHOLCIM LTD	27,522	55.85	1,537,103.70
	SIKA AG	117	5,395.00	631,215.00
	SYNGENTA AG	5,287	427.90	2,262,307.30
	ABB LTD	108,774	22.76	2,475,696.24
	GEBERIT AG-REG	2,096	426.90	894,782.40
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	1,025	190.80	195,570.00
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	2,341	193.40	452,749.40

	ADECCO GROUP AG-REG	10,096	70.70	713,787.20	
	SGS SA	340	2,129.00	723,860.00	
	KUEHNE&NAGEL INTL AG-REG	3,195	139.50	445,702.50	
	CIE FINANCIERE RICHEMONT SA-REGD A	31,213	74.80	2,334,732.40	
	THE SWATCH GROUP AG-B	1,730	336.60	582,318.00	
	THE SWATCH GROUP AG-REG	2,516	65.95	165,930.20	
	DUFREY AG-REG	2,687	142.40	382,628.80	
	ARYZTA AG	4,011	32.79	131,520.69	
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	109	1,289.00	140,501.00	
	LINDT & SPRUENGLI AG	60	5,575.00	334,500.00	
	LINDT & SPRUENGLI AG-REG	7	65,050.00	455,350.00	
	NESTLE SA-REGISTERED	180,111	73.85	13,301,197.35	
	SONOVA HOLDING AG	3,138	127.40	399,781.20	
	ACTELION LTD	5,710	267.00	1,524,570.00	
	GALENICA AG-REG	170	1,119.00	190,230.00	
	LONZA GROUP AG-REG	2,987	179.60	536,465.20	
	NOVARTIS AG-REG SHS	130,101	77.00	10,017,777.00	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	40,886	243.50	9,955,741.00	
	CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	119,287	15.31	1,826,283.97	
	JULIUS BAER GROUP LTD	12,563	48.35	607,421.05	
	PARGESA HOLDING SA-BR	1,867	65.70	122,661.90	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	944	529.50	499,848.00	
	UBS GROUP AG	212,290	15.81	3,356,304.90	
	BALOISE HOLDING AG	2,989	128.80	384,983.20	
	SWISS LIFE HOLDING AG	1,719	313.20	538,390.80	
	SWISS RE AG	18,635	92.75	1,728,396.25	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	8,862	278.60	2,468,953.20	
	SWISS PRIME SITE-REG	4,185	85.35	357,189.75	
	SWISSCOM AG-REG	1,525	447.90	683,047.50	
	スイスフラン 小計	952,080		64,616,915.10 (7,272,633,794)	
スウェーデンク ローナ	LUNDIN PETROLEUM AB	11,490	190.50	2,188,845.00	
	BOLIDEN AB	15,874	278.00	4,412,972.00	
	ALFA LAVAL AB	17,285	163.20	2,820,912.00	
	ASSA ABLOY AB-B	56,368	174.30	9,824,942.40	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	38,902	290.70	11,308,811.40	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	21,853	261.20	5,708,003.60	
	SANDVIK AB	65,341	121.20	7,919,329.20	
	SKANSKA AB-B SHS	19,178	216.80	4,157,790.40	
	SKF AB-B SHARES	22,855	167.50	3,828,212.50	
	VOLVO AB-B SHS	93,743	118.80	11,136,668.40	
	SECURITAS AB-B SHS	16,445	132.30	2,175,673.50	

	ELECTROLUX AB-SER B	13,837	235.90	3,264,148.30	
	HUSQVARNA AB-B SHS	18,593	76.20	1,416,786.60	
	HENNES & MAURITZ AB-B SHS	57,248	243.20	13,922,713.60	
	ICA GRUPPEN AB	3,550	292.40	1,038,020.00	
	SWEDISH MATCH AB	11,038	277.20	3,059,733.60	
	SVENSKA CELLULOSA AB-B SHS	37,127	273.60	10,157,947.20	
	GETINGE AB-B SHS	9,989	146.10	1,459,392.90	
	NORDEA BANK AB	173,353	108.80	18,860,806.40	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN AB-A	85,831	103.60	8,892,091.60	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	92,255	131.40	12,122,307.00	
	SWEDBANK AB - A SHARES	53,464	231.40	12,371,569.60	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	9,247	177.10	1,637,643.70	
	INVESTOR AB-B SHS	27,778	359.80	9,994,524.40	
	KINNEVIK AB-B SHS	11,257	236.80	2,665,657.60	
	LUNDBERGS AB-B SHS	1,567	581.00	910,427.00	
	ERICSSON LM-B SHS	186,985	53.20	9,947,602.00	
	HEXAGON AB-B SHS	14,555	363.70	5,293,653.50	
	MILLICOM INTL CELLULAR-SDR	3,357	484.70	1,627,137.90	
	TELE2 AB-B SHS	18,224	79.55	1,449,719.20	
	TELIA CO AB	161,947	35.40	5,732,923.80	
	スウェーデンクローナ 小計	1,370,536		191,306,966.30 (2,423,859,263)	
ノルウェーク ローネ	STATOIL ASA	66,077	147.10	9,719,926.70	
	NORSK HYDRO ASA	73,158	48.65	3,559,136.70	
	YARA INTERNATIONAL ASA	10,162	326.00	3,312,812.00	
	SCHIBSTED ASA	3,623	218.50	791,625.50	
	SCIBSTED ASA-B SHS	5,736	198.00	1,135,728.00	
	MARINE HARVEST ASA	24,516	144.00	3,530,304.00	
	ORKLA ASA	45,534	75.35	3,430,986.90	
	DNB ASA	59,569	140.40	8,363,487.60	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	9,626	132.10	1,271,594.60	
	TELENOR ASA	43,038	132.40	5,698,231.20	
	ノルウェークローネ 小計	341,039		40,813,833.20 (551,394,886)	
デンマークク ローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	5,510	422.10	2,325,771.00	
	NOVOZYMES A/S-B SHARES	13,280	277.00	3,678,560.00	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	12,858	517.00	6,647,586.00	
	ISS A/S	8,394	253.00	2,123,682.00	
	A P MOLLER-MAERSK A/S-A	226	11,480.00	2,594,480.00	
	A P MOLLER-MAERSK A/S-B	407	11,970.00	4,871,790.00	
	DSV A/S	10,662	347.80	3,708,243.60	
	PANDORA A/S	6,148	826.00	5,078,248.00	

	CARLSBERG AS-B	6,051	614.50	3,718,339.50
	COLOPLAST-B	6,296	492.30	3,099,520.80
	WILLIAM DEMANT HOLDING	4,455	133.00	592,515.00
	GENMAB A/S	3,569	1,407.00	5,021,583.00
	NOVO NORDISK A/S-B	111,918	247.00	27,643,746.00
	DANSKE BANK A/S	41,689	242.40	10,105,413.60
	TRYG A/S	5,005	131.70	659,158.50
	TDC A/S	48,014	37.52	1,801,485.28
	DONG ENERGY A/S	9,552	257.30	2,457,729.60
	デンマーククローネ 小計	294,034		86,127,851.88 (1,388,380,972)
オーストラリア ドル	CALTEX AUSTRALIA LIMITED	14,497	29.77	431,575.69
	OIL SEARCH LTD	78,703	7.19	565,874.57
	ORIGIN ENERGY LIMITED	109,923	6.87	755,171.01
	SANTOS LTD	91,834	3.99	366,417.66
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	44,207	31.75	1,403,572.25
	ALUMINA LTD	106,977	1.96	209,674.92
	AMCOR LIMITED	71,469	14.76	1,054,882.44
	BHP BILLITON LTD	187,484	26.64	4,994,573.76
	BORAL LIMITED	72,331	6.09	440,495.79
	FORTESCUE METALS GROUP LIMITED	84,994	6.88	584,758.72
	INCITEC PIVOT LTD	85,406	3.78	322,834.68
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	28,089	18.68	524,702.52
	NEWCREST MINING LIMITED	42,676	22.99	981,121.24
	ORICA LIMITED	22,325	18.47	412,342.75
	RIO TINTO LIMITED	25,737	67.79	1,744,711.23
	SOUTH32 LTD	297,652	2.69	800,683.88
	CIMIC GROUP LTD	6,927	38.43	266,204.61
	BRAMBLES LIMITED	97,313	10.51	1,022,759.63
	SEEK LIMITED	16,538	15.78	260,969.64
	AURIZON HOLDINGS LTD	111,161	5.28	586,930.08
	QANTAS AIRWAYS LIMITED	24,631	3.48	85,715.88
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	33,863	15.70	531,649.10
	CROWN RESORTS LTD	22,315	11.52	257,068.80
	DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES LIMITED	3,373	56.10	189,225.30
	FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD	2,650	30.06	79,659.00
	TABCORP HOLDINGS LIMITED	47,022	4.32	203,135.04
TATTS GROUP LTD	83,323	4.06	338,291.38	
REA GROUP LTD	2,708	55.11	149,237.88	
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	33,786	5.10	172,308.60	
WESFARMERS LIMITED	66,698	43.09	2,874,016.82	
WOOLWORTHS LIMITED	73,570	25.49	1,875,299.30	

	COCA-COLA AMATIL LIMITED	35,718	10.00	357,180.00
	TREASURY WINE ESTATES LTD	40,165	11.90	477,963.50
	COCHLEAR LIMITED	3,752	132.08	495,564.16
	HEALTHSCOPE LTD	104,035	2.33	242,401.55
	RAMSAY HEALTH CARE LTD	8,123	71.64	581,931.72
	SONIC HEALTHCARE LTD	21,609	21.37	461,784.33
	CSL LIMITED	26,426	120.27	3,178,255.02
	AUST AND NZ BANKING GROUP LT	171,544	30.77	5,278,408.88
	BANK OF QUEENSLAND LIMITED	17,851	11.49	205,107.99
	BENDIGO AND ADELAIDE BANK	27,851	12.43	346,187.93
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	99,544	85.39	8,500,062.16
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	155,565	31.71	4,932,966.15
	WESTPAC BANKING CORPORATION	194,206	33.88	6,579,699.28
	ASX LTD	11,397	51.74	589,680.78
	CHALLENGER FINANCIAL SERVICE	30,000	11.78	353,400.00
	MACQUARIE GROUP LTD	17,198	87.06	1,497,257.88
	AMP LIMITED	165,331	5.19	858,067.89
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP LT	132,301	5.93	784,544.93
	MEDIBANK PRIVATE LTD	173,315	2.70	467,950.50
	QBE INSURANCE GROUP LIMITED	76,262	12.68	967,002.16
	SUNCORP GROUP LTD	79,368	13.57	1,077,023.76
	COMPUTERSHARE LIMITED	27,209	13.63	370,858.67
	VOCUS GROUP LIMITED	33,249	4.08	135,655.92
	TELSTRA CORPORATION LIMITED	246,276	4.84	1,191,975.84
	TPG TELECOM LTD	17,758	6.36	112,940.88
	AGL ENERGY LIMITED	37,149	24.59	913,493.91
	AUSNET SERVICES	85,220	1.65	140,613.00
	オーストラリアドル 小計	4,028,604		65,583,842.96 (5,676,937,446)
ニュージーランドドル	FLETCHER BUILDING LTD	35,307	10.09	356,247.63
	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	57,402	6.79	389,759.58
	RYMAN HEALTHCARE LIMITED	22,111	8.72	192,807.92
	SPARK NEW ZEALAND LIMITED	116,717	3.48	406,175.16
	CONTACT ENERGY LIMITED	35,357	4.89	172,895.73
	MERCURY NZ LTD	46,516	2.96	137,919.94
	MERIDIAN ENERGY LTD	81,880	2.60	212,888.00
	ニュージーランドドル 小計	395,290		1,868,693.96 (151,382,897)
香港ドル	NWS HOLDINGS LTD	91,500	13.98	1,279,170.00
	CATHAY PACIFIC AIRWAYS	57,000	11.14	634,980.00
	MTR CORPORATION	85,000	40.45	3,438,250.00
	LI & FUNG LTD	395,200	3.48	1,375,296.00

TECHTRONIC INDUSTRIES CO	83,000	27.55	2,286,650.00		
YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	45,000	26.90	1,210,500.00		
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LIMITED	125,000	36.85	4,606,250.00		
MGM CHINA HOLDINGS LTD	44,000	14.14	622,160.00		
SANDS CHINA LTD	150,800	32.30	4,870,840.00		
SHANGRI-LA ASIA LTD.	64,000	9.23	590,720.00		
SJM HOLDINGS LIMITED	164,000	6.27	1,028,280.00		
WYNN MACAU LTD	78,000	13.86	1,081,080.00		
WH GROUP LIMITED	442,500	6.02	2,663,850.00		
BANK OF EAST ASIA	74,020	33.10	2,450,062.00		
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	205,000	31.40	6,437,000.00		
HANG SENG BANK LTD	46,900	163.50	7,668,150.00		
CHEUNG KONG PROPERTY HOLDING	163,924	52.15	8,548,636.60		
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	161,924	93.30	15,107,509.20		
FIRST PACIFIC COMPANY	86,000	5.64	485,040.00		
HONG KONG EXCHANGES & CLEARING LIMITED	69,600	200.20	13,933,920.00		
AIA GROUP LTD	693,400	49.00	33,976,600.00		
HANG LUNG GROUP LTD	42,000	31.50	1,323,000.00		
HANG LUNG PROPERTIES LTD	134,000	19.90	2,666,600.00		
HENDERSON LAND DEVELOPMENT	63,655	44.00	2,800,820.00		
HYSAN DEVELOPMENT CO	29,000	35.30	1,023,700.00		
KERRY PROPERTIES LTD	27,500	23.70	651,750.00		
NEW WORLD DEVELOPMENT	327,333	9.31	3,047,470.23		
SINO LAND CO	160,200	12.62	2,021,724.00		
SUN HUNG KAI PROPERTIES	82,000	108.10	8,864,200.00		
SWIRE PACIFIC LTD 'A'	30,500	80.35	2,450,675.00		
SWIRE PROPERTIES LIMITED	81,800	23.25	1,901,850.00		
WHARF HOLDINGS LTD	77,000	59.50	4,581,500.00		
WHEELLOCK&COMPANY LTD	54,000	48.80	2,635,200.00		
PCCW LIMITED	194,000	4.71	913,740.00		
CHEUNG KONG INFRASTRUCTURE	37,000	63.70	2,356,900.00		
CLP HOLDINGS LTD	95,100	77.10	7,332,210.00		
HK ELECTRIC INVESTMENTS-SS	160,000	6.68	1,068,800.00		
HONG KONG & CHINA GAS	468,981	14.94	7,006,576.14		
POWER ASSETS HOLDINGS LIMITED	77,000	69.80	5,374,600.00		
ASM PACIFIC TECHNOLOGY	12,400	101.40	1,257,360.00		
香港ドル 小計	5,479,237		173,573,619.17 (2,523,760,422)		
シンガポールドル	KEPPEL CORP LTD	80,000	6.64	531,200.00	
	SEMBICORP INDUSTRIES LTD	63,020	3.19	201,033.80	
	SINGAPORE TECHNOLOGIES ENG	93,200	3.62	337,384.00	
	YANGZIJANG SHIPBUILDING HOLDINGS LTD	90,000	0.91	82,350.00	

	COMFORTDELGRO CORP LTD	107,000	2.40	256,800.00	
	SATS LTD	45,100	4.92	221,892.00	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	33,466	9.84	329,305.44	
	GENTING SINGAPORE PLC	351,800	0.98	344,764.00	
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	100,750	3.46	348,595.00	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	4,700	42.24	198,528.00	
	GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	353,600	0.43	152,048.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	122,000	3.94	480,680.00	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	106,900	18.60	1,988,340.00	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	178,600	9.52	1,700,272.00	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	71,700	21.18	1,518,606.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	50,200	7.59	381,018.00	
	CAPITALAND LTD	151,000	3.46	522,460.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	21,000	9.26	194,460.00	
	GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES LIMITED	160,500	2.75	441,375.00	
	UOL GROUP LIMITED	19,200	6.53	125,376.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	458,915	4.00	1,835,660.00	
	STARHUB LIMITED	44,700	2.80	125,160.00	
	シンガポールドル 小計	2,707,351		12,317,307.24	(980,827,175)
イスラエルシュケル	FRUTAROM INDUSTRIES LTD	1,842	196.50	361,953.00	
	ISRAEL CHEMICALS LIMITED	32,527	17.04	554,260.08	
	ELBIT SYSTEMS LTD	1,581	437.90	692,319.90	
	BANK HAPOLIM BM	53,450	22.90	1,224,005.00	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	94,152	16.06	1,512,081.12	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	9,515	61.05	580,890.75	
	AZRIELI GROUP	1,762	171.80	302,711.60	
	NICE LTD	3,671	256.90	943,079.90	
	BEZEQ ISRAELI TELECOMMUNICATION CORP LTD	126,910	6.66	845,982.06	
	イスラエルシュケル 小計	325,410		7,017,283.41	(213,956,971)
	合 計	66,972,030		205,761,661,640	(205,761,661,640)

(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 602銘柄	63.2%	66.3%
カナダドル	株式 91銘柄	3.9%	4.1%
ユーロ	株式 235銘柄	11.5%	12.1%
英ポンド	株式 104銘柄	6.9%	7.2%
スイスフラン	株式 38銘柄	3.4%	3.5%
スウェーデンクローナ	株式 31銘柄	1.1%	1.2%

ノルウェークローネ	株式	10銘柄	0.3%	0.3%
デンマーククローネ	株式	17銘柄	0.6%	0.7%
オーストラリアドル	株式	58銘柄	2.6%	2.8%
ニュージーランドドル	株式	7銘柄	0.1%	0.1%
香港ドル	株式	40銘柄	1.2%	1.2%
シンガポールドル	株式	22銘柄	0.5%	0.5%
イスラエルシェケル	株式	9銘柄	0.1%	0.1%

(b) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	米ドル	AGNC INVESTMENT CORPORATION	19,807	386,038.43	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITIES, INC.	4,202	489,028.76	
		AMERICAN TOWER CORP	25,049	2,708,047.39	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	58,607	634,127.74	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	7,969	1,422,785.26	
		BOSTON PROPERTIES INC	9,048	1,241,295.12	
		BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	16,568	388,353.92	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	5,168	424,137.76	
		COLONY NORTHSTAR INC-CLASS A	30,148	426,292.72	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	9,380	976,927.00	
		DUKE REALTY CORP	19,835	500,040.35	
		EQUITY RESIDENTIAL	21,520	1,325,201.60	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	3,856	879,553.60	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	7,123	550,251.75	
		FEDERAL REALTY INVESTMENT TRUST	3,882	546,042.12	
		GGP INC	32,657	817,078.14	
		HCP, INC.	25,915	805,179.05	
		HOST HOTELS AND RESORTS INC	43,710	803,826.90	
		HUTCHISON PORT HOLDINGS TRUST	283,000	107,540.00	
		IRON MOUNTAIN INC	14,246	529,238.90	
		KIMCO REALTY CORPORATION	24,728	601,632.24	
		LIBERTY PROPERTY TRUST	8,638	337,313.90	
		MACERICH COMPANY/THE	7,717	512,485.97	
		MID-AMERICA APARTMENT COMMUNITIES	6,365	634,081.30	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	8,661	387,319.92			
PROLOGIS INC	31,022	1,556,994.18			
PUBLIC STORAGE	8,677	1,958,919.52			
REALTY INCOME CORPORATION	14,528	883,302.40			
REGENCY CENTERS CORP	6,174	430,636.50			

	SIMON PROPERTY GROUP INC	18,031	3,265,233.79
	SL GREEN REALTY CORP	5,628	626,283.84
	UDR INC	15,084	536,839.56
	VENTAS INC	20,684	1,285,717.44
	VEREIT INC	54,976	479,940.48
	VORNADO REALTY TRUST	9,519	1,045,091.01
	WELLTOWER INC	21,070	1,388,934.40
	WEYERHAEUSER CO	44,078	1,477,494.56
	米ドル 小計	947,270	33,369,207.52 (3,766,716,144)
カナダドル	H&R REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	8,036	187,881.68
	RIOCAN REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	10,703	287,803.67
	SMART REAL ESTATE INVESTMENT	4,552	153,584.48
	カナダドル 小計	23,291	629,269.83 (54,230,473)
ユーロ	FONCIERE DES REGIONS	1,550	120,884.50
	GECINA SA	2,342	286,543.70
	ICADE	1,873	128,937.32
	KLEPIERRE	12,954	467,509.86
	UNIBAIL-RODAMCO SE	6,008	1,325,665.20
	ユーロ 小計	24,727	2,329,540.58 (279,102,256)
英ポンド	BRITISH LAND CO PLC	53,233	324,721.30
	HAMMERSON PLC	52,071	293,940.79
	INTU PROPERTIES PLC	52,522	143,647.67
	LAND SECURITIES GROUP PLC	44,622	470,315.88
	SEGRO PLC	49,235	245,288.77
	英ポンド 小計	251,683	1,477,914.41 (207,218,379)
オーストラリアドル	APA GROUP	70,136	609,481.84
	DEXUS PROPERTY GROUP	53,132	494,127.60
	DUET GROUP	144,076	400,531.28
	GOODMAN GROUP	103,937	764,976.32
	GPT GROUP	98,809	482,187.92
	LENDLEASE GROUP	36,065	534,483.30
	MIRVAC GROUP	242,291	520,925.65
	SCENTRE GROUP	322,650	1,448,698.50
	STOCKLAND	137,366	629,136.28
	SYDNEY AIRPORT	65,814	396,200.28
	TRANSURBAN GROUP	116,522	1,279,411.56
	VICINITY CENTRES	183,407	535,548.44

	WESTFIELD CORP	109,178	989,152.68
	オーストラリアドル 小計	1,683,383	9,084,861.65 (786,385,624)
香港ドル	HKT TRUST AND HKT LTD	161,000	1,664,740.00
	LINK REIT	137,500	7,294,375.00
	香港ドル 小計	298,500	8,959,115.00 (130,265,532)
シンガポールドル	ASCENDAS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	146,600	363,568.00
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	132,400	205,220.00
	CAPITALAND MALL TRUST	146,900	289,393.00
	SUNTEC REIT	155,700	269,361.00
	シンガポールドル 小計	581,600	1,127,542.00 (89,786,169)
	合計		5,313,704,577 (5,313,704,577)

(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 37銘柄	1.7%	70.9%
カナダドル	投資証券 3銘柄	0.0%	1.0%
ユーロ	投資証券 5銘柄	0.1%	5.3%
英ポンド	投資証券 5銘柄	0.1%	3.9%
オーストラリアドル	投資証券 13銘柄	0.4%	14.8%
香港ドル	投資証券 2銘柄	0.1%	2.5%
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28年 2月18日現在)	(平成29年 2月20日現在)
資産の部		
流動資産		
預金	825,340,017	1,630,095,689
金銭信託	352,441,486	-
コール・ローン	-	420,483,961
国債証券	180,251,698,471	212,934,137,705
派生商品評価勘定	10,541,643	3,366,000
未収入金	1,347,086,025	-

	（平成28年 2月18日現在）	（平成29年 2月20日現在）
未収利息	1,569,916,558	1,456,904,963
前払費用	19,303,386	248,360,400
流動資産合計	184,376,327,586	216,693,348,718
資産合計	184,376,327,586	216,693,348,718
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	2,122,019	-
未払解約金	1,312,070,060	184,808,571
未払利息	-	1,036
その他未払費用	-	2,223
流動負債合計	1,314,192,079	184,811,830
負債合計	1,314,192,079	184,811,830
純資産の部		
元本等		
元本	105,835,628,786	130,285,580,252
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	77,226,506,721	86,222,956,636
元本等合計	183,062,135,507	216,508,536,888
純資産合計	183,062,135,507	216,508,536,888
負債純資産合計	184,376,327,586	216,693,348,718

注記表

（重要な会計方針の注記）

項目	自平成28年 2月19日 至平成29年 2月20日
1.有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券は個別法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。</p>
3.その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建資産等の会計処理</p> <p>「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。</p>

（貸借対照表に関する注記）

項目	(平成28年 2月18日現在)	(平成29年 2月20日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	105,835,628,786口	130,285,580,252口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 (10,000口当たりの純資産額) 1.7297円 17,297円)	1口当たり純資産額 (10,000口当たりの純資産額) 1.6618円 16,618円)

(金融商品に関する注記)

. 金融商品の状況に関する事項

項目	自平成28年 2月19日 至平成29年 2月20日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、国債証券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいておりません。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。当計算期間については、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29年 2月20日現在)
1.貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	<p>(1) 有価証券（国債証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

（デリバティブ取引に関する注記）

（平成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	うち1年超	時 価	評 価 損 益
市場取引以外 の取引	為替予約取引				
	買建	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

（平成29年 2月20日現在）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

（単位：円）

区 分	種 類	契 約 額 等	うち1年超	時 価	評 価 損 益
市場取引以外 の取引	為替予約取引				
	売建	362,796,000	-	359,430,000	3,366,000
	ユーロ	362,796,000	-	359,430,000	3,366,000
合計	362,796,000	-	359,430,000	3,366,000	

（注）1．時価の算定方法

(1)為替予約取引の時価の算定方法について

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

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

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

- ・ 計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物相場が発表されている場合には、発表されている対顧客先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの対顧客先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いています。
 - ・ 計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い受渡日として、発表されている対顧客先物相場の仲値を用いています。
- 2) 計算期間末日において対顧客先物相場の仲値が発表されていない外貨については、計算期間末日の対顧客相場の仲値で評価しております。

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

自 平成28年 2月19日 至 平成29年 2月20日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。

（その他の注記）

（平成28年 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・DC外国債券インデックスファンドS	7,156,914,733円
三井住友・DC年金バランス30（債券重点型）	283,155,221円
三井住友・DC年金バランス50（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

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 >	130,038,973円
世界 6 資産バランスファンド V A < 適格機関投資家限定 >	13,725,292円
S M A M ・ バランスファンド V A 7 5 < 適格機関投資家専用 >	936,651,340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 >	142,165,035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 >	1,513,583,466円
S M A M ・ インデックス・バランス V A 5 0 < 適格機関投資家専用 >	1,924,991,258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 >	4,995,407,835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 >	9,191,592,746円
S M A M ・ バランス V A 株 4 0 T < 適格機関投資家限定 >	150,974,873円
S M A M ・ 外国債券パッシブファンド V A < 適格機関投資家限定 >	14,447,331,155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 ）	1,306,786,613円
三井住友・ 5 資産バランスファンド・ V A S （ 適格機関投資家専用 ）	4,226,873,483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 >	244,324,035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 >	861,343,324円
三井住友・ 7 資産バランスファンド・ V A S （ 適格機関投資家専用 ）	3,749,286,729円
S M A M ・ アセットバランスファンド V A 2 0 A < 適格機関投資家専用 >	185,069,203円
S M A M ・ アセットバランスファンド V A 3 5 A < 適格機関投資家専用 >	54,495,867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 >	16,602,801円
S M A M ・ アセットバランスファンド V A 2 0 L < 適格機関投資家専用 >	209,180,765円
S M A M ・ アセットバランスファンド V A 2 5 L < 適格機関投資家専用 >	716,753,636円
S M A M ・ アセットバランスファンド V A 2 0 T < 適格機関投資家専用 >	226,773,526円
S M A M ・ アセットバランスファンド V A 2 0 A 2 < 適格機関投資家専用 >	203,301,882円
S M A M ・ アセットバランスファンド V A 3 5 A 2 < 適格機関投資家専用 >	57,130,687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 >	6,416,885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 >	1,772,298,242円
S M A M ・ アセットバランスファンド V A 2 0 T 2 < 適格機関投資家専用 >	27,895,415円
S M A M ・ F G 新興国重視型バランス 2 0 V A < 適格機関投資家限定 >	2,420,864円
S M A M ・ F G グローバルバランス 2 5 V A < 適格機関投資家限定 >	21,046,912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 >	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

(平成29年 2月20日現在)

開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	105,835,628,786円
同期中における追加設定元本額	34,882,825,852円
同期中における一部解約元本額	10,432,874,386円
平成29年 2月20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	8,358,315,433円
三井住友・ D C 年金バランス 3 0 (債券重点型)	389,830,570円

三井住友・DC年金バランス50(標準型)	1,052,407,898円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	538,770,076円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2020(4資産タイプ)	9,769,176円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2025(4資産タイプ)	28,929,706円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2030(4資産タイプ)	69,434,880円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2035(4資産タイプ)	54,726,029円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2040(4資産タイプ)	27,486,608円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2045(4資産タイプ)	65,848,707円
三井住友・DC年金バランスゼロ(債券型)	8,677,298円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	922,153,129円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	1,004,280,447円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	943,312,291円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2050	1,684,478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>	1,858,733,714円
SMAM・バランスファンドVA安定成長型<適格機関投資家限定>	3,077,480,090円
SMAM・バランスファンドVA25<適格機関投資家専用>	17,376,105,571円
SMAM・バランスファンドVA37.5<適格機関投資家専用>	7,352,945,318円
SMAM・バランスファンドVA50<適格機関投資家専用>	16,474,464,883円
SMAM・バランスファンドVL30<適格機関投資家限定>	44,556,535円
SMAM・バランスファンドVL50<適格機関投資家限定>	132,257,986円
世界6資産バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	8,183,393円
SMAM・バランスファンドVA75<適格機関投資家専用>	1,004,398,480円
SMAM・バランスファンドVL国際分散型<適格機関投資家限定>	152,420,385円
SMAM・インデックス・バランスVA25<適格機関投資家専用>	1,522,471,675円
SMAM・インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用>	1,968,892,164円
SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用>	5,027,493,405円
SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>	8,722,624,976円
SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定>	147,363,511円
SMAM・外国債券パッシブファンドVA<適格機関投資家限定>	14,054,439,171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)	1,253,064,467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)	2,773,090,197円
SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	248,946,684円
SMAM・バランスファンドVA20<適格機関投資家専用>	809,563,317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)	3,091,050,370円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>	183,025,865円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>	51,000,429円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用>	17,370,270円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>	193,870,007円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	668,513,101円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T<適格機関投資家専用>	220,923,296円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A2<適格機関投資家専用>	201,813,759円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A2<適格機関投資家専用>	57,866,612円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A2<適格機関投資家専用>	7,027,104円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L2<適格機関投資家専用>	1,734,420,431円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T2<適格機関投資家専用>	25,670,897円
SMAM・グローバルバランスファンド(標準型)VA<適格機関投資家限定>	5,405,578,472円
SMAM・グローバルバランスファンド(債券重視型)VA<適格機関投資家限定>	2,894,723,008円
SMAM・世界バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	8,664,062,208円

S M A M ・ 世界バランスファンドV A 2 < 適格機関投資家限定 >	8,849,409,963円
S M A M ・ F G 新興国重視型バランス2 0 V A < 適格機関投資家限定 >	171,310円
S M A M ・ F G グローバルバランス2 5 V A < 適格機関投資家限定 >	4,611,078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 >	133,552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 >	49,010,896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 >	358,269円
S M A M ・ マルチアセットストラテジーファンド2 0 1 6 - 0 4 < 適格機関投資家限定 >	227,318,078円
S M A M ・ マルチアセットストラテジーファンド2 0 1 6 - 0 5 < 適格機関投資家限定 >	108,891,749円
S M A M ・ マルチアセットストラテジー・オープン < 適格機関投資家限定 >	143,636,880円
合計	130,285,580,252円

附属明細表

有価証券明細表

(a) 株式

該当事項はありません。

(b) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	米ドル	US TREASURY N/B 0.625	3,000,000.00	2,987,109.39	
		US TREASURY N/B 0.625	2,000,000.00	1,989,218.76	
		US TREASURY N/B 0.75	7,000,000.00	6,986,328.16	
		US TREASURY N/B 0.75	3,000,000.00	2,993,203.14	
		US TREASURY N/B 0.75	4,000,000.00	3,989,375.00	
		US TREASURY N/B 0.75	2,000,000.00	1,994,062.50	
		US TREASURY N/B 0.75	3,000,000.00	2,986,640.64	
		US TREASURY N/B 0.75	3,500,000.00	3,482,500.00	
		US TREASURY N/B 0.75	3,000,000.00	2,982,656.25	
		US TREASURY N/B 0.75	2,000,000.00	1,986,718.76	
		US TREASURY N/B 0.75	2,000,000.00	1,981,406.26	
		US TREASURY N/B 0.75	2,000,000.00	1,971,875.00	
		US TREASURY N/B 0.75	3,000,000.00	2,955,468.75	
		US TREASURY N/B 0.875	2,000,000.00	1,999,531.26	
		US TREASURY N/B 0.875	4,000,000.00	3,995,625.00	
		US TREASURY N/B 0.875	3,000,000.00	2,995,078.14	
		US TREASURY N/B 0.875	3,000,000.00	2,993,203.14	
		US TREASURY N/B 0.875	2,000,000.00	1,991,875.00	
		US TREASURY N/B 0.875	4,000,000.00	3,965,937.52	

US TREASURY N/B 0.875	3,000,000.00	2,971,875.00	
US TREASURY N/B 0.875	3,000,000.00	2,969,296.89	
US TREASURY N/B 0.875	3,000,000.00	2,961,796.89	
US TREASURY N/B 1	4,000,000.00	4,002,812.52	
US TREASURY N/B 1	2,000,000.00	2,000,781.26	
US TREASURY N/B 1	3,000,000.00	3,000,000.00	
US TREASURY N/B 1	5,000,000.00	4,998,828.15	
US TREASURY N/B 1	3,000,000.00	2,997,421.89	
US TREASURY N/B 1	3,000,000.00	2,995,312.50	
US TREASURY N/B 1	3,000,000.00	2,991,093.75	
US TREASURY N/B 1	4,000,000.00	3,979,375.00	
US TREASURY N/B 1	3,000,000.00	2,977,265.64	
US TREASURY N/B 1	4,000,000.00	3,963,437.52	
US TREASURY N/B 1	2,000,000.00	1,979,375.00	
US TREASURY N/B 1	2,000,000.00	1,979,062.50	
US TREASURY N/B 1	2,000,000.00	1,976,718.76	
US TREASURY N/B 1	3,000,000.00	2,965,078.14	
US TREASURY N/B 1.125	2,000,000.00	2,002,812.50	
US TREASURY N/B 1.125	3,000,000.00	2,995,312.50	
US TREASURY N/B 1.125	3,000,000.00	2,995,312.50	
US TREASURY N/B 1.125	2,000,000.00	1,991,718.76	
US TREASURY N/B 1.125	4,000,000.00	3,963,750.00	
US TREASURY N/B 1.125	2,800,000.00	2,766,750.00	
US TREASURY N/B 1.125	3,000,000.00	2,960,859.39	
US TREASURY N/B 1.125	3,800,000.00	3,704,703.14	
US TREASURY N/B 1.125	3,000,000.00	2,909,765.64	
US TREASURY N/B 1.125	3,000,000.00	2,906,015.64	
US TREASURY N/B 1.125	5,000,000.00	4,839,843.75	
US TREASURY N/B 1.125	5,000,000.00	4,832,812.50	
US TREASURY N/B 1.25	3,000,000.00	3,004,921.89	
US TREASURY N/B 1.25	3,000,000.00	3,004,921.89	
US TREASURY N/B 1.25	3,000,000.00	3,003,515.64	
US TREASURY N/B 1.25	3,000,000.00	3,003,515.64	
US TREASURY N/B 1.25	3,000,000.00	3,002,812.50	
US TREASURY N/B 1.25	4,000,000.00	4,002,968.76	
US TREASURY N/B 1.25	2,000,000.00	1,997,968.76	
US TREASURY N/B 1.25	2,000,000.00	1,991,093.76	
US TREASURY N/B 1.25	3,000,000.00	2,979,843.75	
US TREASURY N/B 1.25	3,000,000.00	2,977,968.75	
US TREASURY N/B 1.25	4,000,000.00	3,913,750.00	
US TREASURY N/B 1.25	5,000,000.00	4,855,468.75	
US TREASURY N/B 1.25	3,000,000.00	2,831,953.14	

US TREASURY N/B 1.375	3,000,000.00	3,014,296.89
US TREASURY N/B 1.375	3,000,000.00	3,013,828.14
US TREASURY N/B 1.375	4,500,000.00	4,518,281.25
US TREASURY N/B 1.375	5,000,000.00	5,018,359.40
US TREASURY N/B 1.375	2,000,000.00	2,006,718.76
US TREASURY N/B 1.375	5,000,000.00	5,014,062.50
US TREASURY N/B 1.375	3,000,000.00	2,993,671.89
US TREASURY N/B 1.375	3,000,000.00	2,992,031.25
US TREASURY N/B 1.375	4,000,000.00	3,988,750.00
US TREASURY N/B 1.375	5,000,000.00	4,980,078.15
US TREASURY N/B 1.375	4,000,000.00	3,981,562.52
US TREASURY N/B 1.375	4,000,000.00	3,977,187.52
US TREASURY N/B 1.375	3,000,000.00	2,980,546.89
US TREASURY N/B 1.375	5,000,000.00	4,953,125.00
US TREASURY N/B 1.375	3,000,000.00	2,968,125.00
US TREASURY N/B 1.375	5,000,000.00	4,942,968.75
US TREASURY N/B 1.375	3,000,000.00	2,956,406.25
US TREASURY N/B 1.375	4,000,000.00	3,930,000.00
US TREASURY N/B 1.375	4,000,000.00	3,925,312.52
US TREASURY N/B 1.375	3,000,000.00	2,858,437.50
US TREASURY N/B 1.375	4,000,000.00	3,801,250.00
US TREASURY N/B 1.375	3,000,000.00	2,847,421.89
US TREASURY N/B 1.5	5,000,000.00	5,031,250.00
US TREASURY N/B 1.5	4,700,000.00	4,726,070.33
US TREASURY N/B 1.5	2,000,000.00	2,010,937.50
US TREASURY N/B 1.5	4,000,000.00	4,021,250.00
US TREASURY N/B 1.5	3,000,000.00	3,012,421.89
US TREASURY N/B 1.5	3,000,000.00	3,005,859.39
US TREASURY N/B 1.5	5,000,000.00	5,007,812.50
US TREASURY N/B 1.5	3,000,000.00	2,992,031.25
US TREASURY N/B 1.5	3,000,000.00	2,939,062.50
US TREASURY N/B 1.5	4,000,000.00	3,858,125.00
US TREASURY N/B 1.5	3,000,000.00	2,890,312.50
US TREASURY N/B 1.5	8,000,000.00	7,364,375.04
US TREASURY N/B 1.625	5,000,000.00	5,036,328.15
US TREASURY N/B 1.625	4,000,000.00	4,028,125.00
US TREASURY N/B 1.625	3,000,000.00	3,019,921.89
US TREASURY N/B 1.625	2,000,000.00	2,012,500.00
US TREASURY N/B 1.625	3,000,000.00	3,018,281.25
US TREASURY N/B 1.625	5,000,000.00	5,022,656.25
US TREASURY N/B 1.625	3,500,000.00	3,502,187.50
US TREASURY N/B 1.625	3,000,000.00	2,999,296.89
US TREASURY N/B 1.625	5,000,000.00	4,983,593.75

US TREASURY N/B 1.625	3,000,000.00	2,938,593.75
US TREASURY N/B 1.625	3,500,000.00	3,414,414.08
US TREASURY N/B 1.625	3,000,000.00	2,908,593.75
US TREASURY N/B 1.625	3,000,000.00	2,905,312.50
US TREASURY N/B 1.625	3,000,000.00	2,892,187.50
US TREASURY N/B 1.625	8,000,000.00	7,484,375.04
US TREASURY N/B 1.625	7,000,000.00	6,532,968.75
US TREASURY N/B 1.75	1,000,000.00	1,010,000.00
US TREASURY N/B 1.75	4,000,000.00	4,034,687.52
US TREASURY N/B 1.75	4,300,000.00	4,310,750.00
US TREASURY N/B 1.75	5,000,000.00	5,002,734.40
US TREASURY N/B 1.75	3,000,000.00	2,980,312.50
US TREASURY N/B 1.75	3,000,000.00	2,972,812.50
US TREASURY N/B 1.75	4,500,000.00	4,453,242.21
US TREASURY N/B 1.75	3,000,000.00	2,965,312.50
US TREASURY N/B 1.75	3,000,000.00	2,964,140.64
US TREASURY N/B 1.75	3,000,000.00	2,951,484.39
US TREASURY N/B 1.75	3,000,000.00	2,939,765.64
US TREASURY N/B 1.75	7,000,000.00	6,832,656.25
US TREASURY N/B 1.875	3,000,000.00	3,027,421.89
US TREASURY N/B 1.875	3,000,000.00	2,995,781.25
US TREASURY N/B 1.875	3,000,000.00	2,983,125.00
US TREASURY N/B 1.875	4,000,000.00	3,963,750.00
US TREASURY N/B 1.875	3,000,000.00	2,968,593.75
US TREASURY N/B 2	3,000,000.00	3,037,734.39
US TREASURY N/B 2	2,300,000.00	2,327,312.50
US TREASURY N/B 2	4,000,000.00	4,042,187.52
US TREASURY N/B 2	3,000,000.00	3,028,593.75
US TREASURY N/B 2	4,000,000.00	4,030,625.00
US TREASURY N/B 2	3,000,000.00	3,015,703.14
US TREASURY N/B 2	3,000,000.00	3,013,828.14
US TREASURY N/B 2	6,000,000.00	6,025,781.28
US TREASURY N/B 2	5,000,000.00	5,021,093.75
US TREASURY N/B 2	5,100,000.00	5,116,335.96
US TREASURY N/B 2	3,000,000.00	2,995,546.89
US TREASURY N/B 2	5,000,000.00	4,976,562.50
US TREASURY N/B 2	7,500,000.00	7,450,195.35
US TREASURY N/B 2	8,000,000.00	7,798,125.04
US TREASURY N/B 2	8,000,000.00	7,758,750.00
US TREASURY N/B 2	8,000,000.00	7,692,500.00
US TREASURY N/B 2.125	3,500,000.00	3,556,601.58
US TREASURY N/B 2.125	4,000,000.00	4,057,187.52

US TREASURY N/B 2.125	4,000,000.00	4,050,000.00
US TREASURY N/B 2.125	5,000,000.00	5,053,906.25
US TREASURY N/B 2.125	3,000,000.00	3,031,171.89
US TREASURY N/B 2.125	4,000,000.00	4,038,437.52
US TREASURY N/B 2.125	3,000,000.00	3,017,578.14
US TREASURY N/B 2.125	4,000,000.00	4,005,937.52
US TREASURY N/B 2.125	4,000,000.00	3,978,437.52
US TREASURY N/B 2.125	9,000,000.00	8,834,062.50
US TREASURY N/B 2.25	2,000,000.00	2,034,375.00
US TREASURY N/B 2.25	4,000,000.00	4,073,437.52
US TREASURY N/B 2.25	2,000,000.00	2,036,562.50
US TREASURY N/B 2.25	4,000,000.00	4,066,875.00
US TREASURY N/B 2.25	4,000,000.00	4,006,875.00
US TREASURY N/B 2.25	8,000,000.00	7,959,375.04
US TREASURY N/B 2.25	8,500,000.00	8,393,750.00
US TREASURY N/B 2.25	5,000,000.00	4,218,359.40
US TREASURY N/B 2.375	2,000,000.00	2,036,562.50
US TREASURY N/B 2.375	2,000,000.00	2,048,750.00
US TREASURY N/B 2.375	8,000,000.00	8,050,625.04
US TREASURY N/B 2.5	6,000,000.00	6,112,031.28
US TREASURY N/B 2.5	8,000,000.00	8,129,375.04
US TREASURY N/B 2.5	5,500,000.00	4,923,789.09
US TREASURY N/B 2.5	5,300,000.00	4,734,804.71
US TREASURY N/B 2.5	5,000,000.00	4,464,453.15
US TREASURY N/B 2.625	4,000,000.00	4,064,375.00
US TREASURY N/B 2.625	2,000,000.00	2,038,906.26
US TREASURY N/B 2.625	4,000,000.00	4,132,500.00
US TREASURY N/B 2.625	5,500,000.00	5,685,195.34
US TREASURY N/B 2.75	3,000,000.00	3,055,078.14
US TREASURY N/B 2.75	3,000,000.00	3,090,000.00
US TREASURY N/B 2.75	6,200,000.00	6,408,765.65
US TREASURY N/B 2.75	7,000,000.00	7,235,703.16
US TREASURY N/B 2.75	2,000,000.00	1,899,062.50
US TREASURY N/B 2.75	11,000,000.00	10,431,953.18
US TREASURY N/B 2.875	3,000,000.00	3,062,812.50
US TREASURY N/B 2.875	3,000,000.00	2,911,875.00
US TREASURY N/B 2.875	4,000,000.00	3,867,187.52
US TREASURY N/B 2.875	4,500,000.00	4,356,210.96
US TREASURY N/B 3	2,800,000.00	2,790,156.26
US TREASURY N/B 3	4,000,000.00	3,967,187.52
US TREASURY N/B 3	4,000,000.00	3,963,750.00
US TREASURY N/B 3	6,000,000.00	5,943,281.28
US TREASURY N/B 3.125	2,000,000.00	2,079,531.26

US TREASURY N/B 3.125	5,000,000.00	5,264,453.15
US TREASURY N/B 3.125	2,000,000.00	2,038,437.50
US TREASURY N/B 3.125	2,500,000.00	2,547,070.32
US TREASURY N/B 3.125	6,000,000.00	6,095,156.28
US TREASURY N/B 3.375	5,000,000.00	5,264,062.50
US TREASURY N/B 3.375	4,000,000.00	4,255,625.00
US TREASURY N/B 3.5	2,500,000.00	2,562,500.00
US TREASURY N/B 3.5	4,500,000.00	4,774,218.75
US TREASURY N/B 3.5	2,000,000.00	2,192,187.50
US TREASURY N/B 3.625	5,000,000.00	5,274,609.40
US TREASURY N/B 3.625	6,000,000.00	6,373,593.78
US TREASURY N/B 3.625	5,000,000.00	5,359,375.00
US TREASURY N/B 3.625	6,000,000.00	6,669,375.00
US TREASURY N/B 3.625	5,000,000.00	5,555,859.40
US TREASURY N/B 3.75	3,000,000.00	3,134,531.25
US TREASURY N/B 3.75	2,000,000.00	2,260,937.50
US TREASURY N/B 3.75	4,000,000.00	4,543,437.52
US TREASURY N/B 3.875	6,000,000.00	6,215,156.28
US TREASURY N/B 3.875	2,000,000.00	2,304,687.50
US TREASURY N/B 4	2,500,000.00	2,609,765.62
US TREASURY N/B 4.25	2,000,000.00	2,434,062.50
US TREASURY N/B 4.25	2,000,000.00	2,434,531.26
US TREASURY N/B 4.375	1,200,000.00	1,493,718.75
US TREASURY N/B 4.375	1,500,000.00	1,857,187.50
US TREASURY N/B 4.375	2,500,000.00	3,095,703.12
US TREASURY N/B 4.375	2,000,000.00	2,482,500.00
US TREASURY N/B 4.5	1,500,000.00	1,899,375.00
US TREASURY N/B 4.5	1,000,000.00	1,266,093.75
US TREASURY N/B 4.5	1,000,000.00	1,258,359.38
US TREASURY N/B 4.625	4,000,000.00	5,123,750.00
US TREASURY N/B 4.75	1,500,000.00	1,959,492.19
US TREASURY N/B 5	1,000,000.00	1,342,734.38
US TREASURY N/B 5.25	1,000,000.00	1,275,312.50
US TREASURY N/B 5.25	500,000.00	640,312.50
US TREASURY N/B 5.375	1,320,000.00	1,760,343.75
US TREASURY N/B 5.5	1,000,000.00	1,295,937.50
US TREASURY N/B 6	1,000,000.00	1,292,421.88
US TREASURY N/B 6.125	1,000,000.00	1,342,890.63
US TREASURY N/B 6.25	800,000.00	999,187.50
US TREASURY N/B 6.25	1,000,000.00	1,415,937.50
US TREASURY N/B 6.5	500,000.00	676,328.12
US TREASURY N/B 8	1,300,000.00	1,659,023.44

	US TREASURY N/B 8.75	1,000,000.00	1,241,328.13
	US TREASURY N/B 8.875	1,100,000.00	1,267,750.00
	米ドル 小計	838,520,000.00	844,992,588.07 (95,382,763,341)
カナダドル	CANADA-GOV'T 0.25	1,000,000.00	997,700.00
	CANADA-GOV'T 0.5	2,000,000.00	1,993,920.00
	CANADA-GOV'T 0.5	2,000,000.00	1,991,720.00
	CANADA-GOV'T 0.5	2,000,000.00	1,989,300.00
	CANADA-GOV'T 0.5	2,000,000.00	1,935,200.00
	CANADA-GOV'T 0.75	1,000,000.00	990,650.00
	CANADA-GOV'T 0.75	2,000,000.00	1,974,300.00
	CANADA-GOV'T 0.75	2,000,000.00	1,967,000.00
	CANADA-GOV'T 1	1,000,000.00	922,900.00
	CANADA-GOV'T 1.25	1,000,000.00	1,003,160.00
	CANADA-GOV'T 1.25	1,000,000.00	1,005,960.00
	CANADA-GOV'T 1.25	2,000,000.00	2,012,520.00
	CANADA-GOV'T 1.25	1,000,000.00	1,007,900.00
	CANADA-GOV'T 1.5	1,000,000.00	1,004,890.00
	CANADA-GOV'T 1.5	2,000,000.00	2,033,700.00
	CANADA-GOV'T 1.5	2,000,000.00	2,015,100.00
	CANADA-GOV'T 1.5	2,000,000.00	1,964,800.00
	CANADA-GOV'T 1.75	1,000,000.00	1,019,540.00
	CANADA-GOV'T 1.75	1,000,000.00	1,022,740.00
	CANADA-GOV'T 2.25	1,000,000.00	1,049,690.00
	CANADA-GOV'T 2.5	2,000,000.00	2,139,260.00
	CANADA-GOV'T 2.75	1,000,000.00	1,076,800.00
	CANADA-GOV'T 2.75	2,000,000.00	2,150,000.00
	CANADA-GOV'T 3.25	1,000,000.00	1,089,380.00
	CANADA-GOV'T 3.5	2,000,000.00	2,162,480.00
	CANADA-GOV'T 3.5	1,500,000.00	1,824,585.00
	CANADA-GOV'T 3.75	2,500,000.00	2,664,250.00
	CANADA-GOV'T 4	3,000,000.00	3,851,520.00
	CANADA-GOV'T 4.25	1,500,000.00	1,567,350.00
	CANADA-GOV'T 5	1,500,000.00	2,129,385.00
CANADA-GOV'T 5.75	1,500,000.00	2,107,515.00	
CANADA-GOV'T 5.75	1,500,000.00	2,213,790.00	
CANADA-GOV'T 8	500,000.00	789,035.00	
	カナダドル 小計	51,500,000.00	55,668,040.00 (4,797,471,687)
メキシコペソ	MEXICAN BONOS 10	40,000,000.00	46,399,680.00
	MEXICAN BONOS 5.75	20,000,000.00	17,824,740.00
	MEXICAN BONOS 6.5	30,000,000.00	29,105,460.00
	MEXICAN BONOS 7.75	20,000,000.00	20,204,340.00

	MEXICAN BONOS 8	50,000,000.00	51,468,750.00
	MEXICAN BONOS 8	20,000,000.00	20,770,620.00
	MEXICAN BONOS 8.5	20,000,000.00	20,564,500.00
	MEXICAN BONOS 8.5	50,000,000.00	53,465,400.00
	MEXICAN BONOS 8.5	40,000,000.00	42,369,760.00
	メキシコペソ 小計	290,000,000.00	302,173,250.00 (1,667,996,340)
ユーロ	BELGIAN 0326 4	1,000,000.00	1,387,640.00
	BELGIAN 0.2	1,000,000.00	1,005,150.00
	BELGIAN 0.8	2,000,000.00	2,048,220.00
	BELGIAN 0.8	1,000,000.00	996,850.00
	BELGIAN 0291 5.5	2,000,000.00	2,997,780.00
	BELGIAN 0304 5	2,500,000.00	3,990,825.00
	BELGIAN 0308 4	1,500,000.00	1,826,940.00
	BELGIAN 0312 4	1,000,000.00	1,051,330.00
	BELGIAN 0315 4	1,500,000.00	1,644,810.00
	BELGIAN 0318 3.75	2,000,000.00	2,305,040.00
	BELGIAN 0320 4.25	2,500,000.00	3,825,025.00
	BELGIAN 0321 4.25	1,700,000.00	2,061,012.00
	BELGIAN 0324 4.5	1,000,000.00	1,349,830.00
	BELGIAN 0325 4.25	2,000,000.00	2,492,520.00
	BELGIAN 0327 3	2,000,000.00	2,185,580.00
	BELGIAN 0328 2.25	2,000,000.00	2,284,060.00
	BELGIAN 0329 1.25	2,000,000.00	2,050,400.00
	BELGIAN 0332 2.6	2,000,000.00	2,336,960.00
	BELGIAN 0333 3	500,000.00	630,390.00
	BELGIAN 1	2,000,000.00	2,060,220.00
	BELGIAN 1	1,000,000.00	971,890.00
	BELGIAN 1.9	1,000,000.00	1,065,090.00
	BELGIAN 2.15	500,000.00	499,255.00
	BELGIAN 3.75	1,000,000.00	1,442,950.00
	BTPS 0.05	1,000,000.00	993,900.00
	BTPS 0.1	1,000,000.00	999,620.00
	BTPS 0.25	2,000,000.00	2,010,340.00
	BTPS 0.3	1,000,000.00	1,005,520.00
	BTPS 0.35	2,000,000.00	1,949,700.00
	BTPS 0.45	2,000,000.00	1,978,100.00
	BTPS 0.65	2,000,000.00	2,012,100.00
	BTPS 0.65	2,000,000.00	1,888,140.00
	BTPS 0.7	2,000,000.00	2,018,460.00
	BTPS 0.95	2,000,000.00	1,952,600.00
	BTPS 1.05	2,000,000.00	2,041,860.00
	BTPS 1.25	3,000,000.00	2,758,260.00

BTPS 1.35	2,000,000.00	2,024,960.00	
BTPS 1.45	2,000,000.00	2,026,080.00	
BTPS 1.5	3,000,000.00	3,089,730.00	
BTPS 1.5	2,000,000.00	1,933,020.00	
BTPS 1.6	2,000,000.00	1,911,380.00	
BTPS 1.65	2,000,000.00	1,789,880.00	
BTPS 2	2,000,000.00	1,985,720.00	
BTPS 2.15	2,000,000.00	2,112,660.00	
BTPS 2.25	1,000,000.00	917,860.00	
BTPS 2.5	3,000,000.00	3,152,100.00	
BTPS 2.5	3,000,000.00	3,132,840.00	
BTPS 2.7	2,000,000.00	1,781,520.00	
BTPS 2.8	1,000,000.00	827,230.00	
BTPS 3.25	1,500,000.00	1,494,660.00	
BTPS 3.5	3,400,000.00	3,556,978.00	
BTPS 3.5	2,000,000.00	2,123,460.00	
BTPS 3.5	3,000,000.00	3,311,430.00	
BTPS 3.75	3,000,000.00	3,373,470.00	
BTPS 3.75	2,000,000.00	2,250,200.00	
BTPS 3.75	3,300,000.00	3,726,228.00	
BTPS 3.75	2,000,000.00	2,266,900.00	
BTPS 4	3,500,000.00	3,929,100.00	
BTPS 4	3,000,000.00	3,462,540.00	
BTPS 4.25	2,400,000.00	2,594,904.00	
BTPS 4.25	3,500,000.00	3,848,985.00	
BTPS 4.25	3,300,000.00	3,683,724.00	
BTPS 4.5	2,000,000.00	2,089,500.00	
BTPS 4.5	3,000,000.00	3,198,270.00	
BTPS 4.5	2,700,000.00	2,939,571.00	
BTPS 4.5	2,700,000.00	3,027,591.00	
BTPS 4.5	2,800,000.00	3,302,152.00	
BTPS 4.5	3,000,000.00	3,551,010.00	
BTPS 4.5	3,000,000.00	3,569,790.00	
BTPS 4.75	2,600,000.00	3,048,994.00	
BTPS 4.75	3,500,000.00	4,202,380.00	
BTPS 4.75	3,000,000.00	3,673,050.00	
BTPS 4.75	2,000,000.00	2,510,700.00	
BTPS 5	3,000,000.00	3,575,610.00	
BTPS 5	3,000,000.00	3,677,790.00	
BTPS 5	2,470,000.00	3,198,477.10	
BTPS 5	2,000,000.00	2,590,680.00	
BTPS 5	2,500,000.00	3,223,675.00	

BTPS 5.25	3,700,000.00	4,774,147.00
BTPS 5.5	2,500,000.00	3,069,525.00
BTPS 5.5	2,500,000.00	3,075,100.00
BTPS 5.75	2,200,000.00	3,044,624.00
BTPS 6	4,100,000.00	5,729,463.00
BTPS 6.5	2,960,000.00	4,108,420.80
BTPS 7.25	1,000,000.00	1,436,670.00
BTPS 9	1,000,000.00	1,469,970.00
BUNDESÖBL-165 0.5	1,000,000.00	1,013,900.00
BUNDESÖBL-166 0.25	2,000,000.00	2,026,020.00
BUNDESÖBL-167 1	2,000,000.00	2,060,820.00
BUNDESÖBL-168 1	1,000,000.00	1,037,370.00
BUNDESÖBL-169 0.5	2,000,000.00	2,058,020.00
BUNDESÖBL-170 0.25	1,000,000.00	1,028,690.00
BUNDESÖBL-171 0	3,000,000.00	3,071,370.00
BUNDESÖBL-172 0.25	2,000,000.00	2,069,180.00
BUNDESÖBL-173 0	3,000,000.00	3,077,760.00
BUNDESÖBL-174 0	3,000,000.00	3,078,570.00
BUNDESSCHATZANW 0	2,000,000.00	2,018,520.00
BUNDESSCHATZANW 0	2,000,000.00	2,022,780.00
BUNDESSCHATZANW 0	1,000,000.00	1,013,360.00
BUNDESSCHATZANW 0	2,000,000.00	2,030,120.00
DEUTSCHLAND REP 0	3,000,000.00	2,935,350.00
DEUTSCHLAND REP 0.5	3,000,000.00	3,129,540.00
DEUTSCHLAND REP 0.5	3,000,000.00	3,100,650.00
DEUTSCHLAND REP 1	2,000,000.00	2,167,820.00
DEUTSCHLAND REP 1	3,000,000.00	3,244,410.00
DEUTSCHLAND REP 1.5	2,500,000.00	2,770,050.00
DEUTSCHLAND REP 1.5	2,500,000.00	2,779,775.00
DEUTSCHLAND REP 1.5	2,000,000.00	2,228,820.00
DEUTSCHLAND REP 1.5	2,000,000.00	2,240,660.00
DEUTSCHLAND REP 1.75	2,500,000.00	2,798,025.00
DEUTSCHLAND REP 1.75	2,000,000.00	2,274,180.00
DEUTSCHLAND REP 2	2,000,000.00	2,248,280.00
DEUTSCHLAND REP 2	2,500,000.00	2,874,525.00
DEUTSCHLAND REP 2.25	2,500,000.00	2,765,275.00
DEUTSCHLAND REP 2.25	2,000,000.00	2,259,840.00
DEUTSCHLAND REP 2.5	2,000,000.00	2,248,140.00
DEUTSCHLAND REP 2.5	2,200,000.00	2,953,786.00
DEUTSCHLAND REP 2.5	2,000,000.00	2,712,960.00
DEUTSCHLAND REP 3	3,000,000.00	3,383,100.00
DEUTSCHLAND REP 3.25	3,000,000.00	3,353,220.00
DEUTSCHLAND REP 3.25	2,000,000.00	2,342,280.00

DEUTSCHLAND REP 3.25	1,500,000.00	2,251,710.00	
DEUTSCHLAND REP 3.5	4,000,000.00	4,414,800.00	
DEUTSCHLAND REP 3.75	3,500,000.00	3,804,045.00	
DEUTSCHLAND REP 4	3,200,000.00	5,065,312.00	
DEUTSCHLAND REP 4.25	3,200,000.00	3,425,344.00	
DEUTSCHLAND REP 4.25	1,500,000.00	2,516,460.00	
DEUTSCHLAND REP 4.75	1,300,000.00	1,935,700.00	
DEUTSCHLAND REP 4.75	3,100,000.00	5,157,098.00	
DEUTSCHLAND REP 4.75	2,400,000.00	4,327,632.00	
DEUTSCHLAND REP 5.5	1,800,000.00	2,996,442.00	
DEUTSCHLAND REP 5.625	1,580,000.00	2,478,862.00	
DEUTSCHLAND REP 6.25	1,200,000.00	1,737,504.00	
DEUTSCHLAND REP 6.25	1,000,000.00	1,723,690.00	
DEUTSCHLAND REP 6.5	2,000,000.00	3,276,020.00	
FINNISH GOV'T 0.75	1,000,000.00	980,210.00	
FINNISH GOV'T 1.5	1,000,000.00	1,095,180.00	
FINNISH GOV'T 1.625	1,000,000.00	1,099,230.00	
FINNISH GOV'T 2	1,000,000.00	1,133,800.00	
FINNISH GOV'T 2.625	500,000.00	655,610.00	
FINNISH GOV'T 2.75	600,000.00	738,624.00	
FINNISH GOV'T 3.375	1,200,000.00	1,349,004.00	
FINNISH GOV'T 3.5	1,000,000.00	1,163,070.00	
FINNISH GOV'T 4	1,000,000.00	1,310,750.00	
FINNISH GOV'T 4.375	1,000,000.00	1,119,890.00	
FRANCE O.A.T. 0	1,000,000.00	1,006,140.00	
FRANCE O.A.T. 0	3,000,000.00	3,031,440.00	
FRANCE O.A.T. 0	3,000,000.00	3,033,150.00	
FRANCE O.A.T. 0	3,000,000.00	3,017,700.00	
FRANCE O.A.T. 0	2,000,000.00	1,990,380.00	
FRANCE O.A.T. 0.25	3,000,000.00	3,056,820.00	
FRANCE O.A.T. 0.25	2,000,000.00	1,855,280.00	
FRANCE O.A.T. 0.5	3,000,000.00	3,077,340.00	
FRANCE O.A.T. 0.5	4,000,000.00	3,930,160.00	
FRANCE O.A.T. 0.5	3,000,000.00	2,881,800.00	
FRANCE O.A.T. 1	3,000,000.00	3,059,970.00	
FRANCE O.A.T. 1	3,000,000.00	3,081,870.00	
FRANCE O.A.T. 1	2,000,000.00	2,067,240.00	
FRANCE O.A.T. 1	3,000,000.00	3,042,810.00	
FRANCE O.A.T. 1.25	2,000,000.00	1,840,560.00	
FRANCE O.A.T. 1.5	3,000,000.00	3,021,450.00	
FRANCE O.A.T. 1.75	4,000,000.00	4,363,800.00	
FRANCE O.A.T. 1.75	4,000,000.00	4,354,440.00	

FRANCE O.A.T. 1.75	1,000,000.00	850,050.00
FRANCE O.A.T. 2.25	3,800,000.00	4,249,502.00
FRANCE O.A.T. 2.25	4,000,000.00	4,505,240.00
FRANCE O.A.T. 2.5	4,500,000.00	4,961,655.00
FRANCE O.A.T. 2.5	4,000,000.00	4,558,080.00
FRANCE O.A.T. 2.75	4,000,000.00	4,647,120.00
FRANCE O.A.T. 3	5,000,000.00	5,767,700.00
FRANCE O.A.T. 3.25	4,800,000.00	5,546,304.00
FRANCE O.A.T. 3.25	3,200,000.00	4,021,120.00
FRANCE O.A.T. 3.5	5,000,000.00	5,614,750.00
FRANCE O.A.T. 3.5	5,000,000.00	6,145,850.00
FRANCE O.A.T. 3.75	5,000,000.00	5,563,700.00
FRANCE O.A.T. 3.75	4,700,000.00	5,471,176.00
FRANCE O.A.T. 4	4,000,000.00	4,217,120.00
FRANCE O.A.T. 4	3,700,000.00	5,177,447.00
FRANCE O.A.T. 4	1,370,000.00	2,030,216.70
FRANCE O.A.T. 4	1,500,000.00	2,258,280.00
FRANCE O.A.T. 4.25	4,000,000.00	4,324,720.00
FRANCE O.A.T. 4.25	4,400,000.00	4,856,720.00
FRANCE O.A.T. 4.25	5,000,000.00	6,288,050.00
FRANCE O.A.T. 4.5	4,200,000.00	6,310,920.00
FRANCE O.A.T. 4.75	3,100,000.00	4,631,493.00
FRANCE O.A.T. 5.5	3,500,000.00	5,187,560.00
FRANCE O.A.T. 5.75	4,200,000.00	6,716,472.00
FRANCE O.A.T. 6	3,500,000.00	5,050,430.00
FRANCE O.A.T. 8.5	850,000.00	1,054,867.00
FRANCE O.A.T. 8.5	700,000.00	1,051,925.00
IRISH GOVT 0.8	1,000,000.00	1,036,180.00
IRISH GOVT 1	1,000,000.00	995,450.00
IRISH GOVT 2	1,000,000.00	965,950.00
IRISH GOVT 2.4	1,000,000.00	1,100,000.00
IRISH GOVT 3.4	1,000,000.00	1,192,620.00
IRISH GOVT 3.9	1,000,000.00	1,214,290.00
IRISH GOVT 4.4	1,000,000.00	1,112,460.00
IRISH GOVT 4.5	1,000,000.00	1,082,600.00
IRISH GOVT 4.5	1,490,000.00	1,714,647.30
IRISH GOVT 5	1,000,000.00	1,193,530.00
IRISH GOVT 5.4	1,500,000.00	2,031,525.00
IRISH GOVT 5.9	800,000.00	934,120.00
NETHERLANDS GOVT 0	2,000,000.00	2,017,700.00
NETHERLANDS GOVT 0	2,000,000.00	2,028,560.00
NETHERLANDS GOVT 0.25	2,000,000.00	2,051,740.00
NETHERLANDS GOVT 0.25	2,000,000.00	1,989,420.00

NETHERLANDS GOVT 0.5	1,500,000.00	1,504,530.00	
NETHERLANDS GOVT 1.25	2,000,000.00	2,075,180.00	
NETHERLANDS GOVT 1.75	2,200,000.00	2,460,304.00	
NETHERLANDS GOVT 2	2,000,000.00	2,276,380.00	
NETHERLANDS GOVT 2.25	2,000,000.00	2,275,360.00	
NETHERLANDS GOVT 2.5	1,100,000.00	1,368,279.00	
NETHERLANDS GOVT 2.75	2,000,000.00	2,772,480.00	
NETHERLANDS GOVT 3.25	1,500,000.00	1,747,950.00	
NETHERLANDS GOVT 3.5	2,000,000.00	2,280,300.00	
NETHERLANDS GOVT 3.75	1,000,000.00	1,234,870.00	
NETHERLANDS GOVT 3.75	1,500,000.00	2,371,335.00	
NETHERLANDS GOVT 4	1,500,000.00	1,600,500.00	
NETHERLANDS GOVT 4	1,500,000.00	1,670,010.00	
NETHERLANDS GOVT 4	2,200,000.00	3,404,258.00	
NETHERLANDS GOVT 5.5	1,500,000.00	2,280,330.00	
REP OF AUSTRIA 0.25	1,000,000.00	1,023,700.00	
REP OF AUSTRIA 0.75	900,000.00	914,004.00	
REP OF AUSTRIA 1.15	1,000,000.00	1,030,880.00	
REP OF AUSTRIA 1.2	1,500,000.00	1,602,750.00	
REP OF AUSTRIA 1.5	1,000,000.00	993,830.00	
REP OF AUSTRIA 1.65	1,000,000.00	1,108,960.00	
REP OF AUSTRIA 1.75	1,000,000.00	1,115,750.00	
REP OF AUSTRIA 1.95	1,000,000.00	1,061,130.00	
REP OF AUSTRIA 2.4	1,000,000.00	1,203,200.00	
REP OF AUSTRIA 3.15	500,000.00	694,875.00	
REP OF AUSTRIA 3.4	1,000,000.00	1,204,670.00	
REP OF AUSTRIA 3.5	2,000,000.00	2,355,960.00	
REP OF AUSTRIA 3.65	1,000,000.00	1,201,480.00	
REP OF AUSTRIA 3.8	500,000.00	837,705.00	
REP OF AUSTRIA 3.9	1,500,000.00	1,728,420.00	
REP OF AUSTRIA 4.15	1,300,000.00	1,972,776.00	
REP OF AUSTRIA 4.35	1,200,000.00	1,324,860.00	
REP OF AUSTRIA 4.85	1,000,000.00	1,394,570.00	
REP OF AUSTRIA 6.25	1,000,000.00	1,575,060.00	
SPANISH GOV'T 0.25	2,000,000.00	2,012,500.00	
SPANISH GOV'T 0.25	3,000,000.00	3,023,640.00	
SPANISH GOV'T 0.75	2,000,000.00	2,040,860.00	
SPANISH GOV'T 1.15	3,000,000.00	3,110,460.00	
SPANISH GOV'T 1.3	2,000,000.00	1,942,720.00	
SPANISH GOV'T 1.4	2,000,000.00	2,082,860.00	
SPANISH GOV'T 1.6	2,000,000.00	2,034,560.00	
SPANISH GOV'T 1.95	2,500,000.00	2,579,275.00	

	SPANISH GOV'T 1.95	2,000,000.00	1,959,900.00
	SPANISH GOV'T 2.15	2,000,000.00	2,105,780.00
	SPANISH GOV'T 2.75	2,000,000.00	2,127,020.00
	SPANISH GOV'T 2.75	3,000,000.00	3,322,770.00
	SPANISH GOV'T 2.9	1,000,000.00	990,810.00
	SPANISH GOV'T 3.45	500,000.00	512,530.00
	SPANISH GOV'T 3.75	2,200,000.00	2,351,250.00
	SPANISH GOV'T 3.8	3,000,000.00	3,547,230.00
	SPANISH GOV'T 4	3,000,000.00	3,377,280.00
	SPANISH GOV'T 4.1	2,000,000.00	2,125,480.00
	SPANISH GOV'T 4.2	2,050,000.00	2,571,171.50
	SPANISH GOV'T 4.3	3,000,000.00	3,349,800.00
	SPANISH GOV'T 4.4	3,000,000.00	3,666,960.00
	SPANISH GOV'T 4.5	2,500,000.00	2,612,625.00
	SPANISH GOV'T 4.6	2,500,000.00	2,785,550.00
	SPANISH GOV'T 4.65	3,000,000.00	3,765,840.00
	SPANISH GOV'T 4.7	1,500,000.00	2,021,445.00
	SPANISH GOV'T 4.8	2,000,000.00	2,503,000.00
	SPANISH GOV'T 4.85	2,000,000.00	2,346,100.00
	SPANISH GOV'T 4.9	2,500,000.00	3,443,750.00
	SPANISH GOV'T 5.15	1,500,000.00	2,011,560.00
	SPANISH GOV'T 5.15	2,000,000.00	2,861,620.00
	SPANISH GOV'T 5.4	3,000,000.00	3,811,980.00
	SPANISH GOV'T 5.5	3,000,000.00	3,659,250.00
	SPANISH GOV'T 5.75	2,200,000.00	3,210,064.00
	SPANISH GOV'T 5.85	2,500,000.00	3,154,875.00
	SPANISH GOV'T 5.9	2,500,000.00	3,438,050.00
	SPANISH GOV'T 6	3,400,000.00	4,882,944.00
	ユーロ 小計	602,170,000.00	699,128,004.40 (83,762,526,207)
英債券	UK TSY GILT 0.5	1,000,000.00	990,200.00
	UK TSY GILT 1.25	3,500,000.00	3,557,435.00
	UK TSY GILT 1.5	3,000,000.00	3,125,550.00
	UK TSY GILT 1.5	2,500,000.00	2,567,200.00
	UK TSY GILT 1.5	1,000,000.00	913,080.00
	UK TSY GILT 1.75	2,000,000.00	2,077,880.00
	UK TSY GILT 1.75	3,000,000.00	3,182,700.00
	UK TSY GILT 1.75	1,000,000.00	978,000.00
	UK TSY GILT 2	3,000,000.00	3,172,050.00
	UK TSY GILT 2	2,500,000.00	2,691,100.00
	UK TSY GILT 2.25	2,700,000.00	2,958,660.00
	UK TSY GILT 2.5	1,500,000.00	1,869,825.00
	UK TSY GILT 2.75	2,000,000.00	2,267,800.00

	UK TSY GILT 3.25	3,000,000.00	3,827,670.00	
	UK TSY GILT 3.5	2,500,000.00	3,341,675.00	
	UK TSY GILT 3.5	2,000,000.00	3,178,000.00	
	UK TSY GILT 3.75	2,000,000.00	2,185,300.00	
	UK TSY GILT 3.75	2,800,000.00	3,148,600.00	
	UK TSY GILT 3.75	2,400,000.00	2,758,824.00	
	UK TSY GILT 3.75	2,300,000.00	3,455,382.00	
	UK TSY GILT 4	1,500,000.00	1,761,660.00	
	UK TSY GILT 4	2,000,000.00	3,362,660.00	
	UK TSY GILT 4.25	1,300,000.00	1,684,657.00	
	UK TSY GILT 4.25	2,000,000.00	2,708,380.00	
	UK TSY GILT 4.25	3,000,000.00	4,176,720.00	
	UK TSY GILT 4.25	1,500,000.00	2,145,525.00	
	UK TSY GILT 4.25	2,500,000.00	3,631,775.00	
	UK TSY GILT 4.25	1,900,000.00	2,906,715.00	
	UK TSY GILT 4.25	1,900,000.00	3,026,092.00	
	UK TSY GILT 4.25	2,100,000.00	3,564,435.00	
	UK TSY GILT 4.5	2,700,000.00	2,945,322.00	
	UK TSY GILT 4.5	2,500,000.00	3,543,050.00	
	UK TSY GILT 4.5	2,000,000.00	3,059,220.00	
	UK TSY GILT 4.75	2,700,000.00	3,074,004.00	
	UK TSY GILT 4.75	2,300,000.00	3,201,370.00	
	UK TSY GILT 4.75	2,500,000.00	3,787,725.00	
	UK TSY GILT 5	2,500,000.00	2,628,050.00	
	UK TSY GILT 5	2,500,000.00	3,274,725.00	
	UK TSY GILT 6	1,200,000.00	1,799,520.00	
	UK TSY GILT 8	1,620,000.00	2,148,233.40	
	英債券 小計	87,920,000.00	110,676,769.40 (15,517,989,837)	
スイスフラン	SWISS (GOVT) 2.25	900,000.00	996,030.00	
	SWISS (GOVT) 3	1,000,000.00	1,089,500.00	
	SWISS (GOVT) 4	500,000.00	638,550.00	
	SWISS (GOVT) 4	700,000.00	1,022,000.00	
	スイスフラン 小計	3,100,000.00	3,746,080.00 (421,621,304)	
スウェーデンクローナ	SWEDISH GOVRNMNT 1	8,000,000.00	8,244,640.00	
	SWEDISH GOVRNMNT 1.5	12,000,000.00	13,007,880.00	
	SWEDISH GOVRNMNT 2.5	8,000,000.00	9,324,080.00	
	SWEDISH GOVRNMNT 3.5	11,000,000.00	13,035,220.00	
	SWEDISH GOVRNMNT 3.5	6,000,000.00	8,028,900.00	
	SWEDISH GOVRNMNT 4.25	12,000,000.00	13,209,360.00	
	SWEDISH GOVRNMNT 5	11,000,000.00	13,196,700.00	

スウェーデンクローナ 小計		68,000,000.00	78,046,780.00 (988,852,702)
ノルウェークローネ	NORWEGIAN GOV'T 1.5	5,000,000.00	4,937,500.00
	NORWEGIAN GOV'T 1.75	5,000,000.00	5,074,500.00
	NORWEGIAN GOV'T 2	10,000,000.00	10,411,500.00
	NORWEGIAN GOV'T 3	4,000,000.00	4,420,000.00
	NORWEGIAN GOV'T 3.75	11,000,000.00	12,255,100.00
	NORWEGIAN GOV'T 4.5	6,000,000.00	6,513,600.00
ノルウェークローネ 小計		41,000,000.00	43,612,200.00 (589,200,822)
デンマーククローネ	DENMARK - BULLET 0.25	10,000,000.00	10,153,000.00
	DENMARK - BULLET 1.5	5,000,000.00	5,507,000.00
	DENMARK - BULLET 1.75	10,000,000.00	11,230,600.00
	DENMARK - BULLET 3	10,000,000.00	11,582,300.00
	DENMARK - BULLET 4	8,000,000.00	9,014,400.00
	DENMARK - BULLET 4.5	17,000,000.00	28,701,100.00
	DENMARK - BULLET 7	3,080,000.00	4,721,024.00
デンマーククローネ 小計		63,080,000.00	80,909,424.00 (1,304,259,914)
ポーランドズロチ	POLAND GOVT BOND 1.5	3,000,000.00	2,895,000.00
	POLAND GOVT BOND 1.75	3,000,000.00	2,851,800.00
	POLAND GOVT BOND 2	3,000,000.00	2,939,700.00
	POLAND GOVT BOND 2.5	5,000,000.00	5,035,000.00
	POLAND GOVT BOND 2.5	4,000,000.00	3,615,200.00
	POLAND GOVT BOND 3.25	5,000,000.00	4,900,000.00
	POLAND GOVT BOND 4	2,000,000.00	2,084,000.00
	POLAND GOVT BOND 5.25	5,000,000.00	5,122,500.00
	POLAND GOVT BOND 5.25	2,000,000.00	2,170,000.00
	POLAND GOVT BOND 5.5	4,000,000.00	4,316,000.00
	POLAND GOVT BOND 5.75	4,000,000.00	4,492,000.00
	POLAND GOVT BOND 5.75	4,200,000.00	4,732,686.00
	POLAND GOVT BOND 5.75	2,000,000.00	2,362,200.00
ポーランドズロチ 小計		46,200,000.00	47,516,086.00 (1,316,195,582)
オーストラリアドル	AUSTRALIAN GOVT. 1.75	3,000,000.00	2,962,200.00
	AUSTRALIAN GOVT. 2	1,000,000.00	988,300.00
	AUSTRALIAN GOVT. 2.25	2,000,000.00	1,878,600.00
	AUSTRALIAN GOVT. 2.75	3,000,000.00	3,064,650.00
	AUSTRALIAN GOVT. 2.75	3,000,000.00	3,031,176.00
	AUSTRALIAN GOVT. 2.75	2,000,000.00	1,983,600.00
	AUSTRALIAN GOVT. 2.75	1,000,000.00	913,200.00
	AUSTRALIAN GOVT. 3	1,000,000.00	855,675.00
	AUSTRALIAN GOVT. 3.25	2,000,000.00	2,049,160.00

	AUSTRALIAN GOVT. 3.25	4,000,000.00	4,174,800.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 3.25	1,500,000.00	1,543,500.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 3.25	1,000,000.00	949,100.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 3.75	1,000,000.00	1,034,200.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 4.25	4,000,000.00	4,494,800.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 4.5	3,000,000.00	3,225,468.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 4.5	1,500,000.00	1,740,450.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 4.75	3,200,000.00	3,747,520.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 5.25	3,000,000.00	3,205,533.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 5.5	2,500,000.00	2,939,125.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 5.75	3,000,000.00	3,434,100.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 5.75	4,000,000.00	4,698,200.00	
	オーストラリアドル 小計	49,700,000.00	52,913,357.00	(4,580,180,181)
シンガポールドル	SINGAPORE GOV'T 2.25	500,000.00	512,750.00	
	SINGAPORE GOV'T 2.75	1,000,000.00	1,048,500.00	
	SINGAPORE GOV'T 2.75	400,000.00	418,400.00	
	SINGAPORE GOV'T 2.875	400,000.00	416,656.00	
	SINGAPORE GOV'T 3	1,000,000.00	1,062,500.00	
	SINGAPORE GOV'T 3.125	1,000,000.00	1,069,000.00	
	SINGAPORE GOV'T 3.25	1,000,000.00	1,061,200.00	
	SINGAPORE GOV'T 3.375	500,000.00	558,750.00	
	SINGAPORE GOV'T 3.5	1,500,000.00	1,653,000.00	
	SINGAPORE GOV'T 4	2,100,000.00	2,193,660.00	
	シンガポールドル 小計	9,400,000.00	9,994,416.00	(795,855,346)
マレーシアリングgit	MALAYSIA GOVT 3.418	8,000,000.00	7,820,000.00	
	MALAYSIA GOVT 3.502	9,000,000.00	8,336,817.00	
	MALAYSIA GOVT 4.24	5,000,000.00	5,054,500.00	
	MALAYSIA GOVT 4.378	5,000,000.00	5,110,500.00	
	マレーシアリングgit 小計	27,000,000.00	26,321,817.00	(666,994,842)
南アフリカランド	REP SOUTH AFRICA 6.5	60,000,000.00	43,380,000.00	
	REP SOUTH AFRICA 6.75	30,000,000.00	28,765,500.00	
	REP SOUTH AFRICA 7	60,000,000.00	49,992,000.00	
	REP SOUTH AFRICA 8	10,000,000.00	10,065,000.00	
	南アフリカランド 小計	160,000,000.00	132,202,500.00	(1,142,229,600)
	合計		212,934,137,705	(212,934,137,705)

(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 233銘柄	44.1%	44.8%
カナダドル	国債証券 33銘柄	2.2%	2.3%
メキシコペソ	国債証券 9銘柄	0.8%	0.8%
ユーロ	国債証券 276銘柄	38.7%	39.3%
英ポンド	国債証券 40銘柄	7.2%	7.3%
スイスフラン	国債証券 4銘柄	0.2%	0.2%
スウェーデンクローナ	国債証券 7銘柄	0.5%	0.5%
ノルウェークローネ	国債証券 6銘柄	0.3%	0.3%
デンマーククローネ	国債証券 7銘柄	0.6%	0.6%
ポーランドズロチ	国債証券 13銘柄	0.6%	0.6%
オーストラリアドル	国債証券 21銘柄	2.1%	2.2%
シンガポールドル	国債証券 10銘柄	0.4%	0.4%
マレーシアリングット	国債証券 4銘柄	0.3%	0.3%
南アフリカランド	国債証券 4銘柄	0.5%	0.5%

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

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29年 3月31日現在

資産総額	6,748,505,190円
負債総額	2,779,489円
純資産総額（ - ）	6,745,725,701円
発行済口数	4,852,546,985口
1口当たり純資産額（ / ）	1.3901円
（1万口当たり純資産額）	（13,901円）

三井住友・DC年金バランス50（標準型）

平成29年 3月31日現在

資産総額	18,422,850,031円
負債総額	21,826,664円
純資産総額（ - ）	18,401,023,367円
発行済口数	12,730,371,346口
1口当たり純資産額（ / ）	1.4454円
（1万口当たり純資産額）	（14,454円）

三井住友・DC年金バランス70（株式重点型）

平成29年 3月31日現在

資産総額	9,287,398,554円
負債総額	6,918,979円
純資産総額（ - ）	9,280,479,575円
発行済口数	6,302,040,189口
1口当たり純資産額（ / ）	1.4726円
（1万口当たり純資産額）	（14,726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29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。

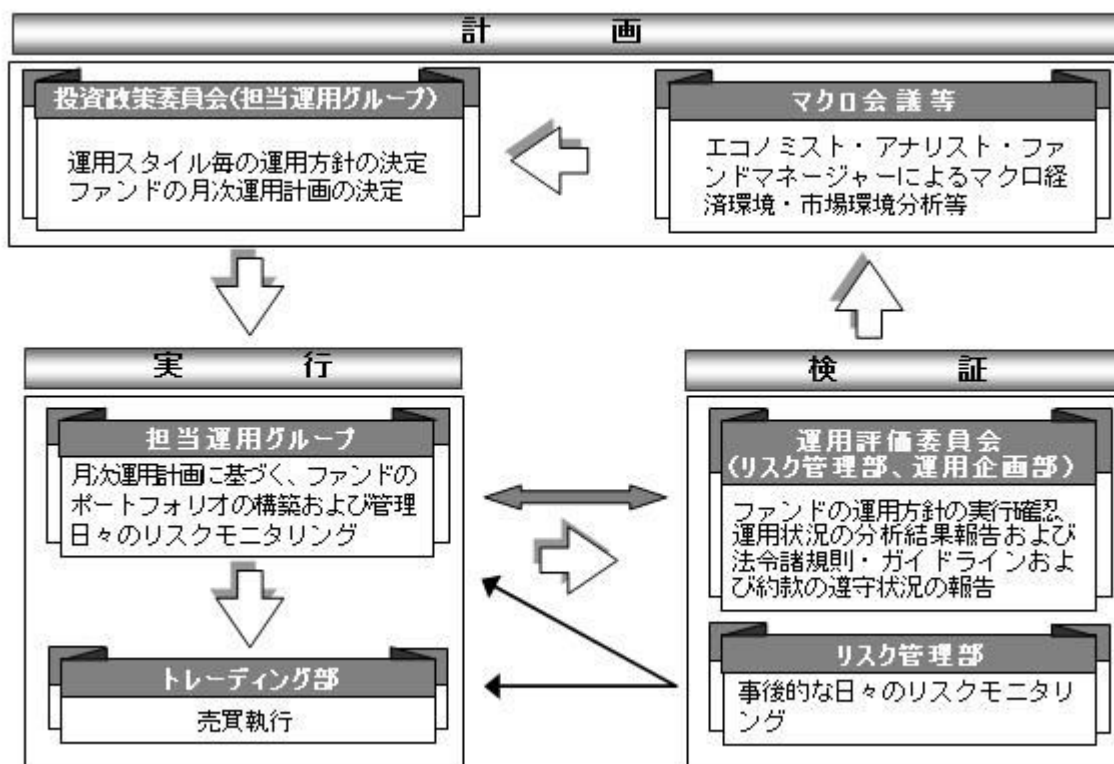
取締役の任期は、選任後1年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会の終結の時までとし、補欠または増員によって選任された取締役の任期は、他の現任取締役の任期の満了する時までとします。

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、代表取締役若干名を選定します。

また、取締役会の決議によって、取締役社長を1名選定します。

二 投資信託の運用の流れ



2【事業の内容及び営業の概況】

「投資信託及び投資法人に関する法律」に定める投資信託委託会社である委託会社は、証券投資信託の設定を行うとともに「金融商品取引法」に定める金融商品取引業者として投資運用業および投資助言業務を行っています。また、「金融商品取引法」に定める第二種金融商品取引業にかかる業務を行っています。

平成29年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29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	69 (21)	188,076 (80,034)
	追加型	458 (196)	5,170,292 (2,824,712)
	計	527 (217)	5,358,368 (2,904,747)
公社債投資信託	単位型	93 (93)	388,551 (388,551)
	追加型	1 (0)	28,808 (0)
	計	94 (93)	417,359 (388,551)
合 計		621 (310)	5,775,727 (3,293,298)

（ ）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31期（平成27年4月1日から平成28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32期中間会計期間（平成28年4月1日から平成28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27年 3月31日）	当事業年度 （平成28年 3月31日）
資産の部		
流動資産		
現金及び預金	2 25,021,336	10,857,507
顧客分別金信託	-	20,006

前払費用		291,119	324,934
未収入金		41,860	81,347
未収委託者報酬		4,897,032	5,418,116
未収運用受託報酬		1,000,744	1,635,461
未収投資助言報酬		455,390	382,911
未収収益		13,030	28,813
繰延税金資産		475,859	494,032
その他の流動資産		52,473	6,226
流動資産合計		32,248,847	19,249,357
固定資産			
有形固定資産	1		
建物		120,234	154,246
器具備品		230,712	240,748
有形固定資産合計		350,947	394,995
無形固定資産			
ソフトウェア		497,668	449,034
ソフトウェア仮勘定		77,155	146,452
電話加入権		91	79
商標権		222	60
無形固定資産合計		575,137	595,627
投資その他の資産			
投資有価証券		7,151,933	13,115,106
関係会社株式		509,146	10,412,523
長期差入保証金		600,480	603,625
長期前払費用		36,031	32,533
会員権		17,299	17,299
繰延税金資産		665,425	750,481
投資その他の資産合計		8,980,317	24,931,569
固定資産合計		9,906,402	25,922,192
資産合計		42,155,249	45,171,549

(単位：千円)

	前事業年度 (平成27年3月31日)	当事業年度 (平成28年3月31日)
負債の部		
流動負債		
顧客からの預り金	-	0
その他の預り金	82,723	73,103
未払金		
未払収益分配金	711	154
未払償還金	143,201	141,808
未払手数料	2,338,432	2,479,778
その他未払金	1,075,587	58,453
未払費用	2,095,111	2,092,669
未払消費税等	478,421	317,444
未払法人税等	454,520	992,491
賞与引当金	906,623	982,654
その他の流動負債	808	-
流動負債合計	7,576,142	7,138,557
固定負債		
退職給付引当金	2,633,080	3,028,212
賞与引当金	-	51,310

その他の固定負債	-	693
固定負債合計	2,633,080	3,080,216
負債合計	10,209,222	10,218,774
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	18,861,359	21,984,811
利益剰余金合計	20,682,564	23,806,015
株主資本計	31,311,548	34,434,999
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	634,478	517,775
評価・換算差額等合計	634,478	517,775
純資産合計	31,946,027	34,952,774
負債・純資産合計	42,155,249	45,171,549

(2) 【損益計算書】

(単位：千円)

	前事業年度 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)	当事業年度 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	30,094,858	32,339,255
運用受託報酬	3,862,895	7,401,835
投資助言報酬	2,106,161	1,909,892
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	27,345	8,546
サービス支援手数料	18,274	74,038
その他	52,255	55,319
営業収益計	36,166,790	41,793,887
営業費用		
支払手数料	15,123,724	16,006,652
広告宣伝費	407,991	615,596
公告費	4,737	4,507
調査費		
調査費	1,319,743	1,624,477
委託調査費	3,550,675	4,106,366
営業雑経費		
通信費	38,911	43,662
印刷費	294,002	399,236

協会費		26,955	23,328
諸会費		18,577	22,650
情報機器関連費		2,403,857	2,557,200
販売促進費		28,281	31,271
その他		144,250	161,974
営業費用合計		23,361,707	25,596,925
一般管理費			
給料			
役員報酬		190,241	181,739
給料・手当		5,186,853	5,824,767
賞与		569,685	609,597
賞与引当金繰入額		906,623	1,033,964
交際費		22,609	26,912
寄付金		-	23
事務委託費		366,661	540,251
旅費交通費		226,254	277,212
租税公課		108,953	161,628
不動産賃借料		552,589	595,051
退職給付費用		387,799	701,070
固定資産減価償却費		287,833	334,024
諸経費		283,156	354,884
一般管理費合計		9,089,262	10,641,129
営業利益		3,715,820	5,555,832
営業外収益			
受取配当金		26,821	36,102
有価証券利息		1,187	-
受取利息	1	6,113	3,728
時効成立分配金・償還金		12	1,394
原稿・講演料		1,899	1,766
雑収入		7,324	19,472
営業外収益合計		43,357	62,465
営業外費用			
為替差損		14,361	51,385
営業外費用合計		14,361	51,385
経常利益		3,744,816	5,566,912
特別利益			
投資有価証券償還益		4,181	13,036
投資有価証券売却益		893,251	38,823
投資有価証券清算益		-	29,214
特別利益合計		897,432	81,075
特別損失			
固定資産除却損	2	1,076	5,300
投資有価証券償還損		-	2,313
投資有価証券売却損		1,091	8,184
その他の特別損失	3	973,862	-
特別損失合計		976,030	15,798
税引前当期純利益		3,666,218	5,632,188
法人税、住民税及び事業税		1,574,213	1,598,176
法人税等調整額		166,505	41,999
法人税等合計		1,740,718	1,556,177
当期純利益		1,925,499	4,076,011

（ 3 ） 【株主資本等変動計算書】

前事業年度（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

当事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

（単位：千円）

	株主資本								株主資本 合計
	資本金	資本剰余金		利益準備金	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	18,861,359	20,682,564	31,311,548
当期変動額									
剰余金の配当							952,560	952,560	952,560

当期純利益							4,076,011	4,076,011	4,076,011
株主資本以外の項目 の当期変動額(純 額)									
当期変動額合計	-	-	-	-	-	-	3,123,451	3,123,451	3,123,451
当期末残高	2,000,000	8,628,984	8,628,984	284,245	60,000	1,476,959	21,984,811	23,806,015	34,434,999

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価証券 評価差額金	評価・換算 差額等合計	
当期首残高	634,478	634,478	31,946,027
当期変動額			
剰余金の配当			952,560
当期純利益			4,076,011
株主資本以外の項目の 当期変動額(純額)	116,703	116,703	116,703
当期変動額合計	116,703	116,703	3,006,747
当期末残高	517,775	517,775	34,952,774

[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。

(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27年3月31日)	当事業年度 (平成28年3月31日)
建物	258,412千円	281,421千円
器具備品	783,602千円	758,541千円

2 関係会社に対する資産及び負債

	前事業年度 (平成27年3月31日)	当事業年度 (平成28年3月31日)
現金及び預金	18,853,119千円	4,716,352千円

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27年3月31日)	当事業年度 (平成28年3月31日)
当座借越極度額の総額	10,000,000千円	10,000,000千円
借入実行残高	- 千円	- 千円
差引額	10,000,000千円	10,000,000千円

4 保証債務

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

	前事業年度 (平成27年3月31日)	当事業年度 (平成28年3月31日)
Sumitomo Mitsui Asset Management (New York) Inc.	355,376千円	296,815千円

(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26年4月1日 至 平成27年3月31日)	当事業年度 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)
受取利息	2,463千円	1,423千円

2 固定資産除却損

	前事業年度 (自 平成26年 4月 1日 至 平成27年 3月31日)	当事業年度 (自 平成27年 4月 1日 至 平成28年 3月31日)
器具備品	1,076千円	5,300千円

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

当事業年度(自 平成27年 4月 1日 至 平成28年 3月31日)

1. 発行済株式数に関する事項

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

2. 剰余金の配当に関する事項

(1) 配当金支払額等

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

(2) 基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生が翌事業年度になるもの
平成28年 6月27日開催の第31回定時株主総会において次の通り付議いたします。

決議	株式の種類	配当の原資	配当金の 総額(千円)	一株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
平成28年 6月27日 定時株主総会	普通株式	利益剰余金	2,010,960	114,000	平成28年 3月31日	平成28年 6月28日

(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27年3月31日)	当事業年度 (平成28年3月31日)
1年以内	572,402	579,592
1年超	1,340,637	756,470
合計	1,913,040	1,336,063

(金融商品関係)

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

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

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

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

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

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

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

市場リスクの管理

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

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

(4) 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

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

前事業年度(平成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)顧客分別金信託	-	-	-
(3)未収委託者報酬	4,897,032	4,897,032	-
(4)未収運用受託報酬	1,000,744	1,000,744	-
(5)未収投資助言報酬	455,390	455,390	-
(6)投資有価証券			
その他有価証券	7,131,075	7,131,075	-
(7)長期差入保証金	600,480	600,480	-
資産計	39,106,059	39,106,059	-
(1)顧客からの預り金	-	-	-
(2)未払手数料	2,338,432	2,338,432	-
負債計	2,338,432	2,338,432	-

当事業年度(平成28年3月31日)

(単位:千円)

	貸借対照表計上額	時価	差額
(1)現金及び預金	10,857,507	10,857,507	-
(2)顧客分別金信託	20,006	20,006	-
(3)未収委託者報酬	5,418,116	5,418,116	-
(4)未収運用受託報酬	1,635,461	1,635,461	-
(5)未収投資助言報酬	382,911	382,911	-
(6)投資有価証券			
その他有価証券	13,114,808	13,114,808	-
(7)長期差入保証金	603,625	603,625	-
資産計	32,032,437	32,032,437	-
(1)顧客からの預り金	0	0	-
(2)未払手数料	2,479,778	2,479,778	-
負債計	2,479,778	2,479,778	-

(注1)金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

資 産

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

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

(6)投資有価証券

これらの時価について、投資信託等については取引所の価格、取引金融機関から提示された価格及び公表されている基準価格によっております。

(7)長期差入保証金

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

負 債

(1)顧客からの預り金、(2)未払手数料

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

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

(単位：千円)

	前事業年度 (平成27年3月31日)	当事業年度 (平成28年3月31日)
その他有価証券		
非上場株式	298	298
投資証券	20,560	-
合計	20,858	298
子会社株式及び関連会社株式		
非上場株式	509,146	10,412,523
合計	509,146	10,412,523

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

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

(注3)金銭債権及び満期がある有価証券の決算日後の償還予定額

前事業年度(平成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	-	-	-
顧客分別金信託	-	-	-	-
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	-	-

当事業年度(平成28年3月31日)

(単位：千円)

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

(有価証券関係)

1.子会社株式及び関連会社株式

前事業年度(平成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。

当事業年度(平成28年3月31日)

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

2.その他有価証券

前事業年度(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。

当事業年度(平成28年3月31日)

(単位：千円)

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

(注)非上場株式等(貸借対照表計上額 298千円)については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載しておりません。

3. 当事業年度中に売却したその他有価証券

前事業年度(自平成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

当事業年度(自平成27年4月1日 至平成28年3月31日)

(単位：千円)

売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
327,278	38,823	8,184

(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26年4月1日 至平成27年3月31日)	当事業年度 (自平成27年4月1日 至平成28年3月31日)
退職給付債務の期首残高	1,802,340	2,633,080
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	2,484,508	2,633,080
勤務費用	217,881	225,881
利息費用	18,161	19,247
数理計算上の差異の発生額	276	285,510

退職給付の支払額	87,196	135,507
退職給付債務の期末残高	2,633,080	3,028,212

(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27年3月31日)	当事業年度 (平成28年3月31日)
非積立型制度の退職給付債務	2,633,080	3,028,212
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	2,633,080	3,028,212

(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26年4月1日 至平成27年3月31日)	当事業年度 (自平成27年4月1日 至平成28年3月31日)
勤務費用	217,881	225,881
利息費用	18,161	19,247
数理計算上の差異の費用処理額	276	285,510
その他	152,031	170,430
確定給付制度に係る退職給付費用	387,799	701,070

(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26年4月1日 至平成27年3月31日)	当事業年度 (自平成27年4月1日 至平成28年3月31日)
割引率	0.731%	0.000%

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105,357千円、当事業年度125,210千円であります。

(税効果会計関係)

1.繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

	(単位：千円)	
	前事業年度 (平成27年3月31日)	当事業年度 (平成28年3月31日)
流動の部		
繰延税金資産		
賞与引当金	299,729	303,247
調査費	77,863	74,734
未払金	321,602	44,028
未払事業税	49,504	67,598
その他	48,762	7,369
繰延税金資産小計	797,462	496,977
評価性引当額	321,602	2,945
繰延税金資産合計	475,859	494,032

固定の部

繰延税金資産		
退職給付引当金	849,431	927,238
特定外国子会社留保金額	211,024	205,413
ソフトウェア償却	62,560	35,707
賞与引当金	-	15,834
投資有価証券評価損	43,051	95
その他	6,291	5,971
繰延税金資産小計	1,172,360	1,190,261
評価性引当額	217,192	211,267
繰延税金資産合計	955,168	978,994
繰延税金負債		
その他有価証券評価差額金	289,742	228,513
繰延税金負債合計	289,742	228,513
繰延税金資産の純額	1,141,285	1,244,513

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27年3月31日)	当事業年度 (平成28年3月31日)
法定実効税率	35.6%	33.0%
(調整)		
評価性引当額の増減	9.6	5.5
交際費等永久に損金に算入されない項目	0.2	0.1
受取配当等永久に益金に算入されない項目	0.5	0.0
住民税均等割等	0.2	0.1
税率変更による期末繰延税金資産の減額修正	3.7	1.3
所得税額控除による税額控除	1.3	1.5
その他	0.1	0.0
税効果会計適用後の法人税等の負担率	47.5	27.6

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28年法律第15号）及び「地方税法等の一部を改正する等の法律」（平成28年法律第13号）が平成28年3月29日に成立し、平成28年4月1日以後に開始する事業年度から法人税率等の引下げ等が行われることとなりました。これに伴い、繰延税金資産および繰延税金負債の計算に使用する法定実効税率は従来の32.2%から平成28年4月1日に開始する事業年度及び平成29年4月1日に開始する事業年度に解消が見込まれる一時差異については30.8%、平成30年4月1日に開始する事業年度以降に解消が見込まれる一時差異については、30.6%となります。

この税率変更により、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）は62,206千円減少し、法人税等調整額が74,445千円、その他有価証券評価差額金が12,239千円、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。

当事業年度(自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)

1. セグメント情報

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

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

2. 関連情報

(1) 製品及びサービスごとの情報

(単位：千円)

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

(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

(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。

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。

当事業年度(自 平成27年4月1日 至 平成28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	2,740,552	未払手数料	471,118

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

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

(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。

2. 兄弟会社等

(単位：千円)

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金、出資金又は基金	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額	科目	期末残高
その他の関係会社の子会社	S M B 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	子会社株式の取得	9,877,717	-	-
							委託販売手数料	5,483,224	未払手数料	912,899

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

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

(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26年4月1日 至 平成27年3月31日)	当事業年度 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)
1株当たり純資産額	1,810,999.27円	1,981,449.82円
1株当たり当期純利益金額	109,155.30円	231,066.40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. 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26年4月1日 至 平成27年3月31日)	当事業年度 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)
1株当たり当期純利益金額		
当期純利益(千円)	1,925,499	4,076,011
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)	1,925,499	4,076,011
期中平均株式数(株)	17,640	17,640

(重要な後発事象)

該当事項はありません。

中間財務諸表

(1) 中間貸借対照表

(単位：千円)

第32期中間会計期間 (平成28年9月30日)	
資産の部	
流動資産	
現金及び預金	8,667,657
顧客分別金信託	20,007

前払費用		306,916
未収委託者報酬		5,324,329
未収運用受託報酬		1,209,751
未収投資助言報酬		355,952
未収収益		22,873
繰延税金資産		493,517
その他		3,031
流動資産合計		16,404,036
固定資産		
有形固定資産	1	474,760
無形固定資産		615,866
投資その他の資産		
投資有価証券		13,931,717
関係会社株式		10,412,523
その他		1,631,772
投資その他の資産合計		25,976,013
固定資産合計		27,066,640
資産合計		43,470,677
負債の部		
流動負債		
顧客からの預り金		98
その他の預り金		79,964
未払金		2,578,503
未払費用		1,682,389
未払法人税等		686,618
前受収益		414
賞与引当金		1,044,361
その他	2	125,455
流動負債合計		6,197,805
固定負債		
退職給付引当金		3,116,174
賞与引当金		30,000
その他		480
固定負債合計		3,146,654
負債合計		9,344,459
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		21,442,639
利益剰余金合計		23,263,844

株主資本合計	33,892,828
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	233,389
評価・換算差額等合計	233,389
純資産合計	34,126,217
負債純資産合計	43,470,677

(2)中間損益計算書

(単位：千円)

		第32期中間会計期間 (自 平成28年4月1日 至 平成28年9月30日)	
営業収益			
委託者報酬			15,185,419
運用受託報酬			2,663,858
投資助言報酬			869,344
その他の営業収益			63,406
営業収益計			18,782,028
営業費用			11,579,429
一般管理費	1		5,398,630
営業利益			1,803,967
営業外収益	2		116,871
営業外費用	3		3,173
経常利益			1,917,665
特別利益	4		179,785
特別損失	5		27,232
税引前中間純利益			2,070,218
法人税、住民税及び事業税			622,698
法人税等調整額			21,268
法人税等合計			601,429
中間純利益			1,468,788

(3)中間株主資本等変動計算書

第32期中間会計期間(自 平成28年4月1日 至 平成28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		利益剰余金				利益剰余金 合計	
		資本準備金	資本剰余金 合計	利益準備金	その他利益剰余金				
					配当準備 積立金	別途積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	2,000,000	8,628,984	8,628,984	284,245	60,000	1,476,959	21,984,811	23,806,015	34,434,999
当中間期変動額									

剰余金の配当							2,010,960	2,010,960	2,010,960
中間純利益							1,468,788	1,468,788	1,468,788
株主資本以外の項目の当中間 期間変動額（純額）									
当中間期間変動額合計	-	-	-	-	-	-	542,171	542,171	542,171
当中間期末残高	2,000,000	8,628,984	8,628,984	284,245	60,000	1,476,959	21,442,639	23,263,844	33,892,828

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価証券 評価差額金	評価・換算 差額等合計	
当期首残高	517,775	517,775	34,952,774
当中間期間変動額			
剰余金の配当			2,010,960
中間純利益			1,468,788
株主資本以外の項目の当中間 期間変動額（純額）	284,385	284,385	284,385
当中間期間変動額合計	284,385	284,385	826,557
当中間期末残高	233,389	233,389	34,126,217

（重要な会計方針）

1．資産の評価基準及び評価方法

(1)有価証券

満期保有目的の債券

償却原価法

子会社株式及び関連会社株式

移動平均法による原価法

その他有価証券

時価のあるもの

中間会計期間末日の市場価格等に基づく時価法

（評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定）

時価のないもの

移動平均法による原価法

2．固定資産の減価償却の方法

(1)有形固定資産

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

なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。

建物 3～50年

器具備品 3～20年

(2)無形固定資産

定額法によっております。

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

3．引当金の計上基準

(1)賞与引当金

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

(2)退職給付引当金

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

退職給付見込額の期間帰属方法

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

数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法

過去勤務費用については、その発生時において一時に費用処理しております。

数理計算上の差異については、その発生時において一時に費用処理しております。

4. その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項

消費税等の会計処理

消費税等の会計処理は税抜方式によっております。

(会計方針の変更)

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

この結果、当中間会計期間の営業利益、経常利益及び税引前中間純利益はそれぞれ729千円増加しております。

(追加情報)

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

(中間貸借対照表関係)

第32期中間会計期間 (平成28年9月30日)	
1.有形固定資産の減価償却累計額	1,094,757千円
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248,465千円の支払保証を行っております。	

(中間損益計算書関係)

第32期中間会計期間 (自 平成28年4月1日 至 平成28年9月30日)	
--	--

1. 減価償却実施額	
有形固定資産	73,172千円
無形固定資産	112,944千円
2. 営業外収益のうち主要なもの	
受取配当金	106,640千円
雑収入	9,734千円
3. 営業外費用のうち主要なもの	
為替差損	3,173千円
4. 特別利益のうち主要なもの	
投資有価証券償還益	179,784千円
5. 特別損失のうち主要なもの	
投資有価証券償還損	10,871千円
事務所移転費用	8,962千円

(中間株主資本等変動計算書関係)

第32期中間会計期間(自平成28年4月1日至平成28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28年6月27日 定時株主総会	普通株式	2,010,960	114,000	平成28年 3月31日	平成28年 6月28日

(リース取引関係)

第32期中間会計期間 (自平成28年4月1日至平成28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	606,895千円
1年超	785,123千円
合計	1,392,018千円

(金融商品関係)

1. 金融商品の時価等に関する事項

第32期中間会計期間(平成28年9月30日)

平成28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	8,667,657	8,667,657	-
(2)顧客分別金信託	20,007	20,007	-
(3)未収委託者報酬	5,324,329	5,324,329	-
(4)未収運用受託報酬	1,209,751	1,209,751	-
(5)未収投資助言報酬	355,952	355,952	-
(6)投資有価証券			
その他有価証券	13,931,419	13,931,419	-
(7)投資その他の資産			
長期差入保証金	662,172	662,172	-
資産計	30,171,290	30,171,290	-
(1)顧客からの預り金	98	98	-
(2)未払金			
未払手数料	2,393,062	2,393,062	-
負債計	2,393,160	2,393,160	-

(注1) 金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

資産

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

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

- (6) 投資有価証券

その他有価証券

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

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

- (7) 投資その他の資産

長期差入保証金

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

負債

- (1) 顧客からの預り金、及び(2) 未払金 未払手数料

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

(注2) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

(単位：千円)

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

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

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

（有価証券関係）

第32期中間会計期間（平成28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	5,237,120	4,771,627	465,493
小計	5,237,120	4,771,627	465,493
(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	8,694,298	8,823,400	129,101
小計	8,694,298	8,823,400	129,101
合計	13,931,419	13,595,027	336,392

（注）非上場株式等（中間貸借対照表計上額 298千円）については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載しておりません。

（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32期中間会計期間（自 平成28年4月1日 至 平成28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	15,185,419	2,663,858	869,344	63,406	18,782,028

(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32期中間会計期間 (自 平成28年 4 月 1 日 至 平成28年 9 月30日)	
1株当たり純資産額	1,934,592円84銭
1株当たり中間純利益	83,264円67銭
<p>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。</p>	
(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	34,126,217千円
普通株式に係る純資産額	34,126,217千円
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	1,468,788千円
普通株式に係る中間純利益	1,468,788千円
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 通常の取引の条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託会社の親法人等（委託会社の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。）または子法人等（委託会社が総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。）と有価証券の売買その他の取引または店頭デリバティブ取引を行うこと。
- ニ 委託会社の親法人等または子法人等の利益を図るため、その行う投資運用業に関して運用の方針、運用財産の額もしくは市場の状況に照らして不必要な取引を行うことを内容とした運用を行うこと。
- ホ 上記ハ、ニに掲げるもののほか、委託会社の親法人等または子法人等が関与する行為であって、投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのあるものとして内閣府令で定める行為。

5【その他】

イ 定款の変更、その他の重要事項

平成28年6月27日に開催された定時株主総会において、監査体制の見直しにより監査役の員数を2名増員し6名以内とする定款の変更が決議されました。

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

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

イ 受託会社

- (イ) 名称 三井住友信託銀行株式会社
- (ロ) 資本金の額 342,037百万円（平成28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28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DC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28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28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】

販売会社である住友生命保険相互会社は、委託会社株式を3,528株（持株比率20.0%）保有していません。

第3【その他】

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

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28年 6月17日

三井住友アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 小 澤 陽 一 印指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 池ヶ谷 正 印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている三井住友アセットマネジメント株式会社の平成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28年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以 上

(注) 1．上記は監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。 2．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29年3月28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28年2月19日から平成29年2月20日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三井住友・DC年金バランス30（債券重点型）の平成29年2月20日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以 上

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

独立監査人の監査報告書

平成29年3月28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28年2月19日から平成29年2月20日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三井住友・DC年金バランス50（標準型）の平成29年2月20日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以上

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

独立監査人の監査報告書

平成29年3月28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28年2月19日から平成29年2月20日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三井住友・DC年金バランス70（株式重点型）の平成29年2月20日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以上

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

独立監査人の中間監査報告書

平成28年11月24日

三井住友アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	小澤陽一	印
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	池ヶ谷正	印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている三井住友アセットマネジメント株式会社の平成28年4月1日から平成29年3月31日までの第32期事業年度の中間会計期間（平成28年4月1日から平成28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28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28年4月1日から平成28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. XBR Lデータは中間監査の対象には含まれていません。