

【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	平成30年11月15日提出
【発行者名】	三井住友アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 松下 隆史
【本店の所在の場所】	東京都港区愛宕二丁目5番1号
【事務連絡者氏名】	土田 雅央
【電話番号】	03-5405-0740
【届出の対象とした募集(売出)内国投資 信託受益証券に係るファンドの名称】	三井住友・DC年金バランス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30年11月16日から平成31年5月15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】

2018年11月16日から2019年5月15日まで

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

（８）【申込取扱場所】

販売会社において申込みを取り扱います。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 日本以外の地域における募集
ありません。

ハ クーリング・オフ制度（金融商品取引法第37条の6）の適用

ありません。

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、日本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、ベンチマークの動きに連動する投資成果を目指します。詳細については、後述の「2 投資方針」をご参照ください。
- ハ 委託会社は、受託会社と合意の上、各ファンドそれぞれ金5,000億円を限度として信託金を追加することができます。この限度額は、委託会社、受託会社の合意により変更できます。
- ニ 当ファンドが該当する商品分類、属性区分は次の通りです。

（イ）当ファンドが該当する商品分類

項目	該当する商品分類	内容
単体型・追加型	追加型投信	一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行われ従来の信託財産とともに運用されるファンドをいいます。

投資 対象 地域	内外	目論見書または信託約款において、国内および海外の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいいます。
----------------	----	--

投資対象資産（収益の源泉）	資産複合	目論見書または信託約において、株式、債券、不動産投信、その他資産のうち複数の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいいます。
---------------	------	--

補足 分類	イン デッ クス 型	目論見書または信託約款において、各種指数の動き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。
----------	---------------------	---

(口) 当ファンドが該当する属性区分

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

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
追加型	海外	債券	
	内外	不動産投信	特殊型
		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 (日本を含む)	ファミリーファンド	あり	日経225
一般 大型株 中小型株	年2回	日本			
債券	年4回	北米			
一般 公債 社債 その他債券 クレジット属性 ()	年6回(隔月)	欧州			
	年12回(毎月)	アジア	ファンド・オブ・ ファンズ	なし	TOPIX
	日々	オセアニア			
	その他	中南米			
不動産投信	()	アフリカ			
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)			
資産複合 () 資産配分固 定型 資産配分変 更型		エマージング			その他 (合成指数)

(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】

2005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」

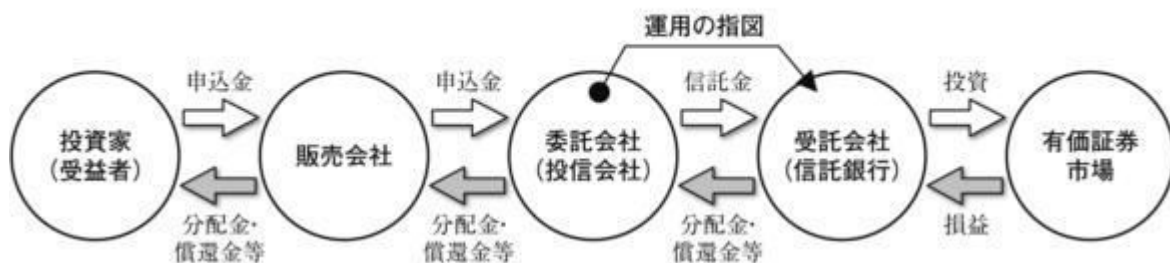
証券投資信託契約に基づき、信託財産の保管・管理・計算等を行います。なお、信託事務の一部につき、日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社に委託することがあります。また、外国における資産の保管は、その業務を行うに十分な能力を有すると認められる外国の金融機関が行う場合があります。

(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。

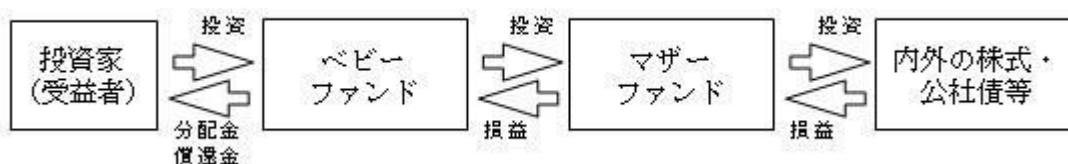
委託会社は販売会社としての役割も有します。

運営の仕組み



当ファンドの運用は、「ファミリーファンド方式」で行われます。

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



ロ 委託会社の概況

(イ) 資本金の額

2,000百万円（2018年8月31日現在）

(ロ) 会社の沿革

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

(八) 大株主の状況

(2018年8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、日本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、ベンチマークの動き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%
MSCI コクサイインデックス(配当込み、円ベース)	10%	15%	20%
FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)	10%	10%	10%
有担保コール翌日物	5%	5%	5%

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

(二) 非株式割合に関する制限

a. マイパッケージ30

制限はありません。

b. マイパッケージ50

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

c. マイパッケージ70

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

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

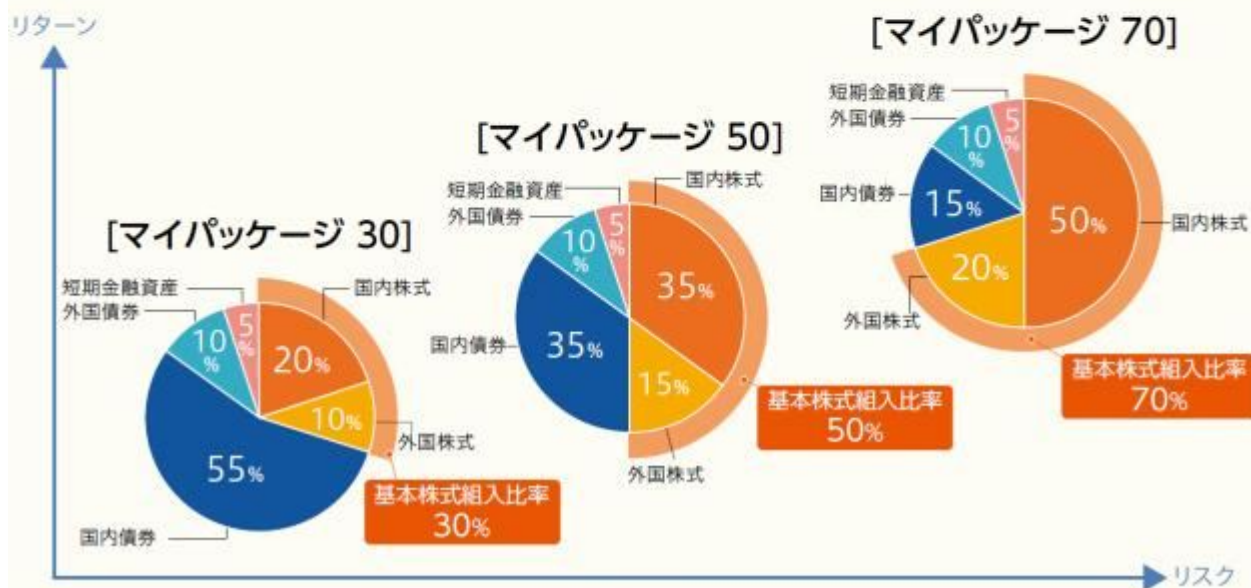
ファンドの特色

1 内外の株式・公社債に投資する4つのマザーファンドの組入れを通じて、日本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、ベンチマークの動き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]

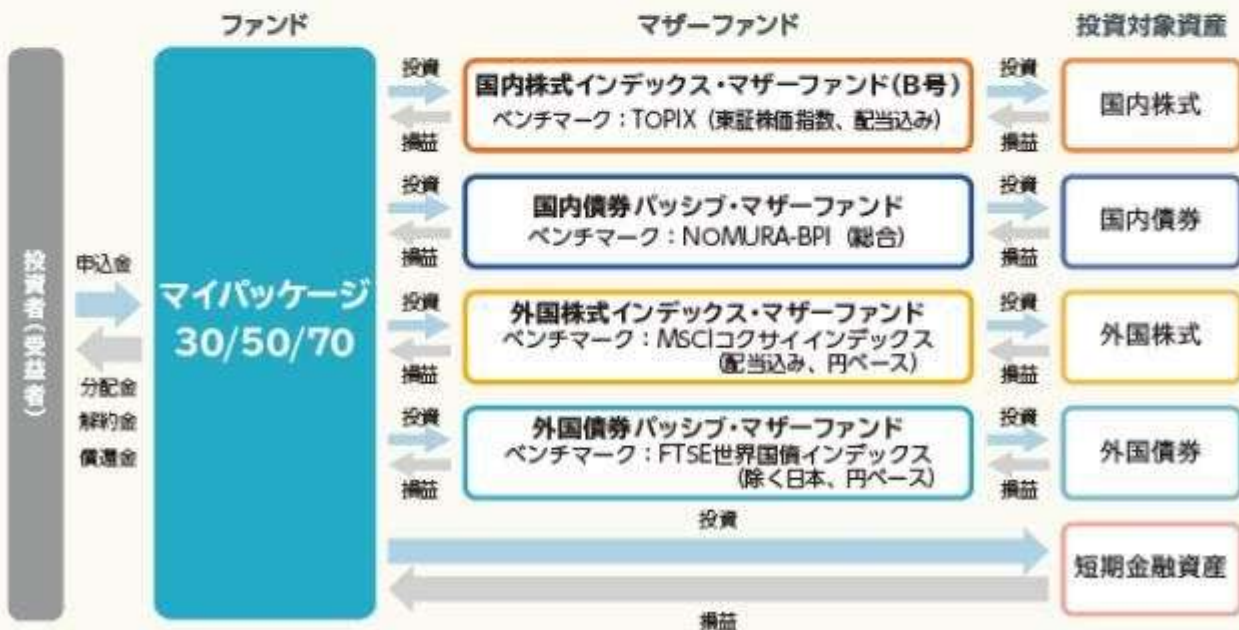
	マイパッケージ30	マイパッケージ50	マイパッケージ70
TOPIX(東証株価指数、配当込み)	20%	35%	50%
NOMURA-BPI(総合)	55%	35%	15%
MSCIコクサイインデックス(配当込み、円ベース)	10%	15%	20%
FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)	10%	10%	10%
有担保コール翌日物	5%	5%	5%

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、ベンチマークの動き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、FTSE世界国債インデックスは、それぞれ東京証券取引所、野村證券株式会社、MSCI Inc.、FTSE Fixed Income LLCが公表している指数で各社の知的財産です。
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、FTSE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)

- 主として日本の株式に投資し、TOPIX(東証株価指数、配当込み)の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。
- ポートフォリオの作成にあたっては、東証1部銘柄の中から、原則として投資不適格銘柄および低流動性銘柄を除外した上で、マルチファクターモデルを活用した最適化法により、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

- 日本の公社債および短期金融資産を主要投資対象とし、NOMURA-BPI(総合)の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。
- ポートフォリオの作成にあたっては、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（配当込み、円ベース）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。
- ポートフォリオの作成にあたっては、原則として投資不適格銘柄および低流動性銘柄を除外した上で、マルチファクターモデルを活用した最適化法により推定トラッキングエラーの低減のみならず、制約条件を加えることで実績トラッキングエラーを抑えることを目指してポートフォリオを構築します。
- MSCIコクサイインデックス（配当込み、円ベース）との連動性を随時チェックし、必要に応じてマルチファクターモデルを使用してポートフォリオのリバランスを行います。

▶ 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、FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース）の動きに連動する投資成果を目指した運用を行います。
- ポートフォリオの作成にあたっては、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FTSE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。
- FTSE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

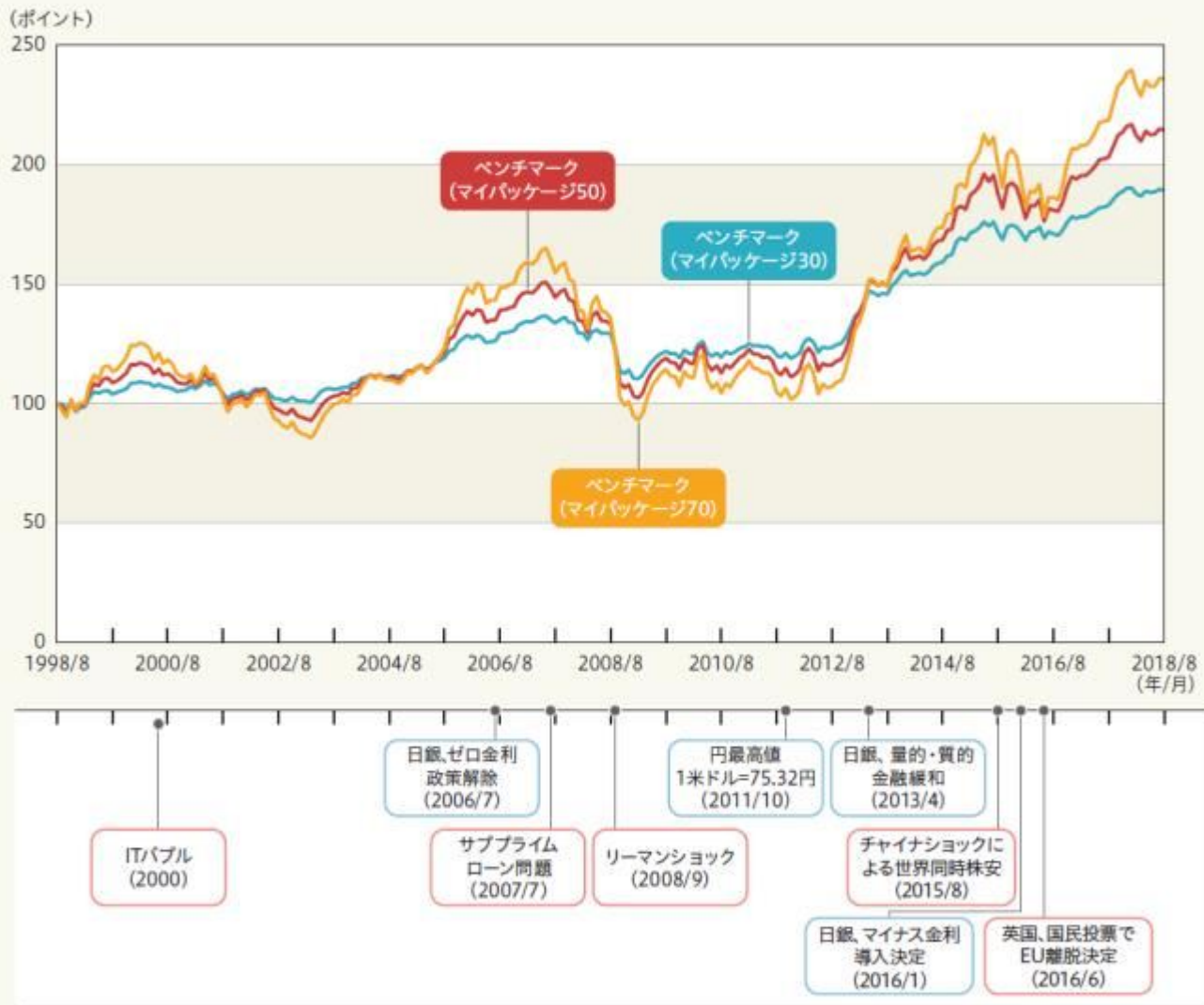
ポートフォリオとベンチマークのリターンの乖離のことをいいます。

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1998年8月末～2018年8月末。1998年8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のデータを基に委託会社作成

(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。

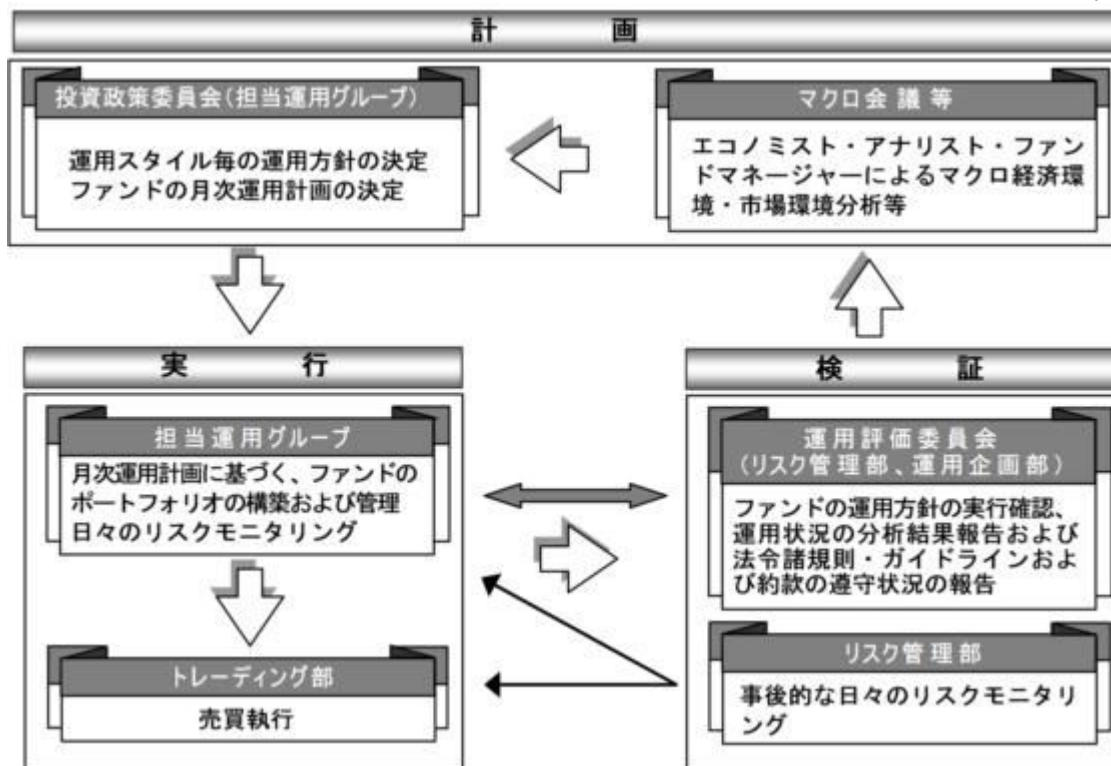
売買執行については、組織的に分離されたトレーディング部が、最良と思われる手法をもって売買を執行します。

(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11名程度、運用企画部は11名程度で構成されています。

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

ロ 委託会社によるファンドの関係法人（販売会社を除く）に対する管理体制

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

（４）【分配方針】

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

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

ファンドは複利効果による信託財産の成長を優先するため、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 同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。
- ヘ 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。
- ト デリバティブ取引（法人税法第61条の5に定めるものをいいます。）は、価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。
- チ 外国為替予約取引は、為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。

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るものとします。
- （ロ）信用取引の指図は、当該売付けにかかる建玉の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- （ハ）信託財産の一部解約等の事由により、信用取引の売付けにかかる建玉の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する売付けの一部を決済するための指図をするものとします。

ハ 先物取引等の指図

- （イ）委託会社は、日本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、日本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。

- (八) 委託会社は、日本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、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、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

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

へ 有価証券の貸付けの指図

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

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

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

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

ト 有価証券の空売りの指図

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

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

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

チ 有価証券の借入れの指図

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

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

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

(ニ) 有価証券の借入れにかかる品借料は、信託財産中から支弁します。

リ 特別の場合の外貨建有価証券への投資制限

外貨建有価証券への投資については、日本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、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。
- ハ 信用リスク集中回避のための投資制限（金融商品取引業等に関する内閣府令第130条第1項第8号の2）
委託会社は、運用財産に関し、信用リスク（保有する有価証券その他の資産について取引の相手方の債務不履行その他の理由により発生し得る危険をいいます。）を適正に管理する方法としてあらかじめ委託会社が定めた合理的な方法に反することとなる取引を行うことを受託会社に指図しないものとします。

（参考情報：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

主として日本の株式に投資し、TOPIX（東証株価指数、配当込み）の動きに連動する投資成

果を目指して運用を行います。

□ 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）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。
- (ロ) 株価指数先物取引等を含む株式の実質組入比率は、原則として高位を保ちます。ただし、資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。
- (ハ) 株式以外の資産への投資割合は、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。
- (ハ) 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。
- (ニ) デリバティブ取引（法人税法第61条の5に定めるものをいいます。）は、価格変動リスクおよび金利変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。

(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

日本の公社債および短期金融資産を主要投資対象とし、NOMURA - BPI（総合）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。

ロ 投資態度

- (イ) NOMURA - BPI（総合）をベンチマークとし、ベンチマークの動きに連動する投資成果を目指します。
- (ロ) 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せん。

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) 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。
- (ヘ) デリバティブ取引（法人税法第61条の5に定めるものをいいます。）は、価格変動リスクおよび金利変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。

(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）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。

ロ 投資態度

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

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。

八 投資対象とする金融商品

前記「2 投資方針 (2) 投資対象 八 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。

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

(ニ) デリバティブ取引(法人税法第61条の5に定めるものをいいます。)は、価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。

(ホ) 外国為替予約取引は、為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。

(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

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

ロ 投資態度

(イ) F T S E 世界国債インデックス(除く日本、円ベース)をベンチマークとし、ベンチマークの動きに連動する投資成果を目指します。

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

(ハ) ベンチマークの月次の変化状況とポートフォリオのリスク量の状況を勘案しながらリバランスを行います。

(ニ) 保有する外貨建資産については、原則として対円で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、信託財産の純資産総額の5%以内とします。
- （ホ）同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。
- （ヘ）一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。
- （ト）デリバティブ取引（法人税法第61条の5に定めるものをいいます。）は、価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。
- （チ）外国為替予約取引は、為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。

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おりません。

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。

(二) 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) 指数の動きと連動しない要因

ファンドは、委託会社が独自に作成した合成指数の動き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、株価指数先物等とインデックスの動きとの不一致等から、上記合成指数の動き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。

ロ 投資リスクの管理体制

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

年間騰落率：
2013年9月～2018年8月

分配金再投資基準価額：
2013年9月～2018年8月



ファンドと他の代表的な 資産クラスとの騰落率の比較

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

ファンド：
2013年9月～2018年8月

他の資産クラス：
2013年9月～2018年8月



■マイパッケージ50

年間騰落率：
2013年9月～2018年8月

分配金再投資基準価額：
2013年9月～2018年8月



ファンド：
2013年9月～2018年8月

他の資産クラス：
2013年9月～2018年8月



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

※分配実績がない場合は、分配金再投資基準価額は基準価額と同じです。

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

※すべての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。

「ファンドの年間騰落率および 分配金再投資基準価額の推移」

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

■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。

各資産クラスの指数

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

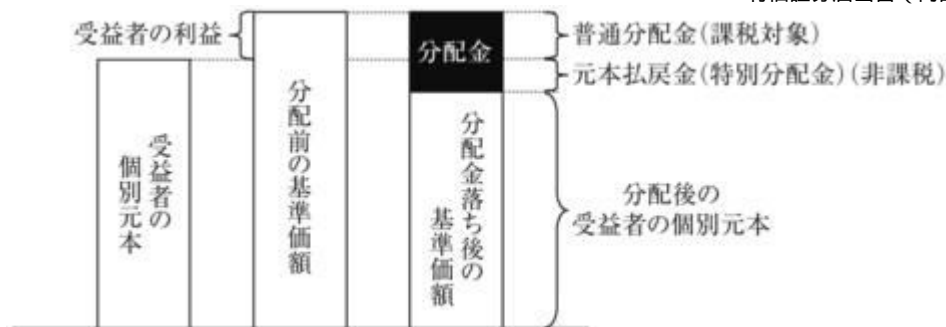
ハ 収益分配金の課税について

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。また、当ファンドは、非課税累積投資契約に係る少額投資非課税制度「つみたて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およびつみたてNISA（ニーサ）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。

つみたてNISA（ニーサ）、NISA（ニーサ）、ジュニアNISA（ニーサ）をご利用になる場合、それぞれの制度の違いにご留意ください。また、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。

	非課税累積投資契約に係る 少額投資非課税制度 つみたてNISA	少額投資非課税制度 NISA	未成年者少額投資 非課税制度 ジュニアNISA
対象となる 投資信託	一定の要件を満たした 公募株式投資信託 (新たに積立投資が必要)	公募株式投資信託 (新たに購入が必要)	
非課税対象	公募株式投資信託から生じる配当所得および譲渡所得		
利用対象と なる方	20歳以上の日本居住者 (専用口座が開設される年の1月1日現在)		0～19歳の日本居住者 (専用口座が開設される年の 1月1日現在)
非課税の期間	最長 20 年間 (投資期間は2037年まで)	最長 5 年間 (投資期間は2023年まで)	
利用できる 限度額	40万円 /年 (最大 800万円)	120万円 /年 (最大 600万円)	80万円 /年 (最大 400万円)
留意事項	 つみたてNISAとNISAを併用した投資を行うことは できません。		

< 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、2018年8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)

2018年 8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	9,000,318,969	95.29
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		444,550,884	4.71
合計(純資産総額)		9,444,869,853	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)

2018年 8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	25,069,529,255	95.32
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1,231,386,917	4.68
合計(純資産総額)		26,300,916,172	100.00

三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)

2018年 8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	12,992,941,815	95.31
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		638,930,854	4.69
合計(純資産総額)		13,631,872,669	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

2018年 8月31日現在

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	投資 比率 (%)
日本	親投資信託受益証券	国内債券パッシブ・マザーファンド	4,133,371,890	1.2579	5,199,736,975	1.2558	5,190,688,419	54.96
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）	713,244,913	2.6931	1,920,910,229	2.6737	1,907,002,923	20.19
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	263,703,873	3.3312	878,459,269	3.6246	955,821,058	10.12
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	546,119,034	1.7086	933,102,193	1.7337	946,806,569	10.02

以上が、当ファンドが保有する有価証券のすべてです。

□ 種類別の投資比率

2018年 8月31日現在

種類	投資比率（%）
親投資信託受益証券	95.29
合計	95.29

三井住友・DC年金バランス50（標準型）

イ 主要投資銘柄

2018年 8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）	3,457,513,089	2.6948	9,317,590,606	2.6737	9,244,352,746	35.15
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	7,334,238,317	1.2579	9,226,327,958	1.2558	9,210,336,478	35.02
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	1,098,206,792	3.3334	3,660,772,946	3.6246	3,980,560,338	15.13
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	1,519,455,323	1.7095	2,597,601,246	1.7337	2,634,279,693	10.02

以上が、当ファンドが保有する有価証券のすべてです。

□ 種類別の投資比率

2018年 8月31日現在

種類	投資比率（%）
親投資信託受益証券	95.32
合計	95.32

三井住友・DC年金バランス70（株式重点型）

イ 主要投資銘柄

2018年 8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)	2,555,746,569	2.6955	6,889,059,200	2.6737	6,833,299,601	50.13
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	758,057,681	3.3331	2,526,725,554	3.6246	2,747,655,870	20.16
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	1,629,354,807	1.2582	2,050,176,169	1.2558	2,046,143,766	15.01
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	787,819,449	1.7100	1,347,228,608	1.7337	1,365,842,578	10.02

以上が、当ファンドが保有する有価証券のすべてです。

□ 種類別の投資比率

2018年 8月31日現在

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	95.31
合計	95.31

【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4期 (2009年 2月18日)	925,997,054	925,997,054	8,783	8,783
第5期 (2010年 2月18日)	1,428,892,994	1,428,892,994	9,699	9,699
第6期 (2011年 2月18日)	1,960,814,211	1,960,814,211	10,043	10,043
第7期 (2012年 2月20日)	2,456,937,455	2,456,937,455	9,914	9,914
第8期 (2013年 2月18日)	3,050,834,550	3,050,834,550	10,966	10,966
第9期 (2014年 2月18日)	3,743,242,037	3,743,242,037	12,196	12,196
第10期 (2015年 2月18日)	4,426,547,408	4,426,547,408	13,381	13,381
第11期 (2016年 2月18日)	4,963,496,383	4,963,496,383	13,158	13,158
第12期 (2017年 2月20日)	6,522,850,554	6,522,850,554	13,891	13,891
第13期 (2018年 2月19日)	8,363,355,544	8,363,355,544	14,611	14,611
2017年 8月末日	7,637,156,297		14,266	
9月末日	7,774,798,854		14,441	
10月末日	7,966,781,541		14,627	
11月末日	8,135,422,368		14,702	
12月末日	8,353,563,082		14,813	
2018年 1月末日	8,466,346,569		14,811	
2月末日	8,436,433,679		14,630	
3月末日	8,544,978,485		14,531	
4月末日	8,746,623,299		14,709	
5月末日	8,949,483,720		14,649	
6月末日	9,158,337,413		14,659	
7月末日	9,342,348,091		14,751	
8月末日	9,444,869,853		14,706	

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4期 (2009年 2月18日)	2,892,759,889	2,892,759,889	7,758	7,758
第5期 (2010年 2月18日)	4,608,495,307	4,608,495,307	8,983	8,983
第6期 (2011年 2月18日)	6,082,088,735	6,082,088,735	9,470	9,470

第7期	(2012年 2月20日)	6,937,357,284	6,937,357,284	9,064	9,064
第8期	(2013年 2月18日)	8,682,766,317	8,682,766,317	10,415	10,415
第9期	(2014年 2月18日)	10,955,496,410	10,955,496,410	12,155	12,155
第10期	(2015年 2月18日)	13,231,559,031	13,231,559,031	13,865	13,865
第11期	(2016年 2月18日)	14,015,482,569	14,015,482,569	13,215	13,215
第12期	(2017年 2月20日)	17,864,219,936	17,864,219,936	14,480	14,480
第13期	(2018年 2月19日)	23,340,195,738	23,340,195,738	15,652	15,652
	2017年 8月末日	20,896,683,217		15,001	
	9月末日	21,627,728,653		15,329	
	10月末日	22,334,944,999		15,669	
	11月末日	22,769,419,950		15,783	
	12月末日	23,354,196,780		15,961	
	2018年 1月末日	23,804,451,831		15,999	
	2月末日	23,517,477,629		15,668	
	3月末日	23,732,233,437		15,475	
	4月末日	24,425,014,014		15,785	
	5月末日	24,904,182,882		15,679	
	6月末日	25,395,837,394		15,676	
	7月末日	25,973,094,498		15,843	
	8月末日	26,300,916,172		15,805	

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4期 (2009年 2月18日)	1,169,406,901	1,169,406,901	6,771	6,771	
第5期 (2010年 2月18日)	2,060,345,540	2,060,345,540	8,216	8,216	
第6期 (2011年 2月18日)	2,906,265,010	2,906,265,010	8,802	8,802	
第7期 (2012年 2月20日)	3,235,878,337	3,235,878,337	8,153	8,153	
第8期 (2013年 2月18日)	4,273,161,707	4,273,161,707	9,718	9,718	
第9期 (2014年 2月18日)	5,675,436,056	5,675,436,056	11,894	11,894	
第10期 (2015年 2月18日)	7,091,879,077	7,091,879,077	14,104	14,104	
第11期 (2016年 2月18日)	7,026,639,080	7,026,639,080	13,019	13,019	
第12期 (2017年 2月20日)	9,067,400,207	9,067,400,207	14,788	14,788	
第13期 (2018年 2月19日)	12,058,838,561	12,058,838,561	16,422	16,422	
	2017年 8月末日	10,511,255,137		15,457	
	9月末日	10,922,106,621		15,942	
	10月末日	11,415,266,497		16,445	
	11月末日	11,723,438,404		16,597	
	12月末日	12,032,907,602		16,846	
	2018年 1月末日	12,406,828,813		16,926	

2月末日	12,176,265,515		16,431
3月末日	12,269,682,637		16,139
4月末日	12,730,880,834		16,588
5月末日	12,894,128,279		16,431
6月末日	13,126,948,141		16,413
7月末日	13,465,567,345		16,657
8月末日	13,631,872,669		16,628

【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4期	2008年 2月19日～2009年 2月18日	0
第5期	2009年 2月19日～2010年 2月18日	0
第6期	2010年 2月19日～2011年 2月18日	0
第7期	2011年 2月19日～2012年 2月20日	0
第8期	2012年 2月21日～2013年 2月18日	0
第9期	2013年 2月19日～2014年 2月18日	0
第10期	2014年 2月19日～2015年 2月18日	0
第11期	2015年 2月19日～2016年 2月18日	0
第12期	2016年 2月19日～2017年 2月20日	0
第13期	2017年 2月21日～2018年 2月19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4期	2008年 2月19日～2009年 2月18日	0
第5期	2009年 2月19日～2010年 2月18日	0
第6期	2010年 2月19日～2011年 2月18日	0
第7期	2011年 2月19日～2012年 2月20日	0
第8期	2012年 2月21日～2013年 2月18日	0
第9期	2013年 2月19日～2014年 2月18日	0
第10期	2014年 2月19日～2015年 2月18日	0
第11期	2015年 2月19日～2016年 2月18日	0
第12期	2016年 2月19日～2017年 2月20日	0
第13期	2017年 2月21日～2018年 2月19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4期	2008年 2月19日～2009年 2月18日	0
第5期	2009年 2月19日～2010年 2月18日	0
第6期	2010年 2月19日～2011年 2月18日	0
第7期	2011年 2月19日～2012年 2月20日	0
第8期	2012年 2月21日～2013年 2月18日	0
第9期	2013年 2月19日～2014年 2月18日	0
第10期	2014年 2月19日～2015年 2月18日	0
第11期	2015年 2月19日～2016年 2月18日	0
第12期	2016年 2月19日～2017年 2月20日	0
第13期	2017年 2月21日～2018年 2月19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
第13期	5.2
第14期（中間期）	0.2

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

三井住友・DC年金バランス50（標準型）

	収益率（％）
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
第13期	8.1
第14期（中間期）	0.3

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

三井住友・DC年金バランス70（株式重点型）

	収益率（％）
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
第13期	11.0
第14期（中間期）	0.5

（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
第13期	1,682,239,634	653,756,318
第14期（中間期）	909,792,161	274,516,098

（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
第13期	3,756,094,069	1,181,645,961
第14期（中間期）	2,116,161,988	549,404,504

（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
第13期	2,006,562,694	794,980,782
第14期（中間期）	1,100,504,597	335,473,686

（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）

2018年 8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	173,743,724,830	97.53
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		4,391,737,151	2.47
合計(純資産総額)		178,135,461,981	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	4,229,740,000	2.37
合計	買建	-	4,229,740,000	2.37

国内債券パッシブ・マザーファンド

2018年 8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	146,372,472,650	73.79
地方債証券	日本	18,241,373,733	9.20
特殊債券	日本	24,999,277,331	12.60
社債券	日本	7,292,710,000	3.68
	オーストラリア	200,644,000	0.10
	フランス	199,620,000	0.10
	小計	7,692,974,000	3.88
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1,052,421,169	0.53
合計(純資産総額)		198,358,518,883	100.00

外国株式インデックス・マザーファンド

2018年 8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	117,519,140,012	62.04
	イギリス	11,488,223,637	6.06
	フランス	7,042,398,321	3.72
	カナダ	6,933,105,068	3.66

ドイツ	6,764,464,095	3.57	
スイス	6,366,595,491	3.36	
オーストラリア	4,260,377,513	2.25	
オランダ	3,520,690,090	1.86	
アイルランド	2,733,281,371	1.44	
スペイン	2,091,056,852	1.10	
スウェーデン	1,863,885,046	0.98	
香港	1,681,645,392	0.89	
イタリア	1,282,654,047	0.68	
デンマーク	1,230,799,443	0.65	
ジャージー	933,479,871	0.49	
バミューダ	865,378,789	0.46	
シンガポール	826,572,675	0.44	
フィンランド	754,641,226	0.40	
ベルギー	742,841,936	0.39	
ノルウェー	517,285,544	0.27	
ケイマン諸島	432,336,261	0.23	
キュラソー	430,208,018	0.23	
イスラエル	388,976,250	0.21	
ルクセンブルグ	243,440,022	0.13	
オーストリア	167,399,306	0.09	
ニュージーランド	154,947,730	0.08	
ポルトガル	118,466,242	0.06	
リベリア	101,790,918	0.05	
英ヴァージン諸島	57,309,026	0.03	
パプアニューギニア	44,246,276	0.02	
マン島	38,257,255	0.02	
モーリシャス	7,895,888	0.00	
小計	181,603,789,611	95.87	
投資証券	アメリカ	2,935,160,645	1.55
	オーストラリア	512,161,324	0.27
	フランス	250,635,433	0.13
	イギリス	144,676,610	0.08
	香港	128,191,854	0.07
	シンガポール	79,897,958	0.04
	カナダ	38,171,549	0.02

	小計	4,088,895,373	2.16
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		3,737,265,621	1.97
合計(純資産総額)		189,429,950,605	100.00

その他以下の取引を行っております。

種類	買建/ 売建	国/地域	時価合計(円)	投資 比率 (%)
株価指数先物取引	買建	アメリカ	2,610,598,572	1.37
	買建	ドイツ	648,810,568	0.34
	買建	イギリス	238,762,524	0.12
	買建	オーストラリア	165,636,627	0.08
合計	買建	-	3,663,808,291	1.91

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		33,997,300	0.01

外国債券パッシブ・マザーファンド

2018年 8月31日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
国債証券	アメリカ	77,641,545,543	44.29
	フランス	17,875,055,915	10.20
	イタリア	15,683,138,214	8.95
	ドイツ	11,983,599,522	6.84
	イギリス	11,592,023,929	6.61
	スペイン	10,461,400,129	5.97
	ベルギー	4,551,619,650	2.60
	オーストラリア	3,662,682,615	2.09
	カナダ	3,636,081,577	2.07
	オランダ	3,488,023,257	1.99
	オーストリア	2,918,699,307	1.66
	アイルランド	1,490,776,906	0.85
	メキシコ	1,457,513,042	0.83
フィンランド	1,098,408,127	0.63	

	デンマーク	1,063,872,381	0.61
	ポーランド	1,063,034,427	0.61
	南アフリカ	920,725,520	0.53
	マレーシア	825,664,465	0.47
	シンガポール	692,112,463	0.39
	スウェーデン	652,573,828	0.37
	ノルウェー	391,784,750	0.22
	小計	173,150,335,567	98.76
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		2,169,315,338	1.24
合計(純資産総額)		175,319,650,905	100.00

その他以下の取引を行っております。

種類	買建/ 売建	国/地域	時価合計(円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	買建		241,958,482	0.13
	売建		240,929,512	0.13

(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)

2018年 8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	853,100	7,054.69	6,018,356,039	6,930.00	5,911,983,000	3.32
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	4,831,200	791.38	3,823,315,056	670.80	3,240,768,960	1.82
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	311,900	9,468.65	2,953,271,935	10,300.00	3,212,570,000	1.80
日本	株式	ソニー	電気機器	470,000	5,214.25	2,450,697,500	6,348.00	2,983,560,000	1.67
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	494,400	5,861.39	2,897,871,216	4,950.00	2,447,280,000	1.37
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	523,800	4,553.37	2,385,055,206	4,381.00	2,294,767,800	1.29
日本	株式	キーエンス	電気機器	34,400	64,963.88	2,234,757,472	62,890.00	2,163,416,000	1.21
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	631,300	3,742.61	2,362,709,693	3,292.00	2,078,239,600	1.17
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	9,400,000	203.87	1,916,378,000	195.10	1,833,940,000	1.03
日本	株式	KDDI	情報・通信業	607,100	3,207.37	1,947,194,327	2,941.00	1,785,481,100	1.00
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	517,400	2,653.97	1,373,164,078	3,387.00	1,752,433,800	0.98

日本	株式	任天堂	その他製品	43,200	45,135.77	1,949,865,264	40,160.00	1,734,912,000	0.97
日本	株式	三菱商事	卸売業	485,100	2,820.99	1,368,462,249	3,171.00	1,538,252,100	0.86
日本	株式	花王	化学	172,700	7,452.30	1,287,012,210	8,625.00	1,489,537,500	0.84
日本	株式	ファナック	電気機器	66,700	27,928.26	1,862,814,942	21,775.00	1,452,392,500	0.82
日本	株式	NTTドコモ	情報・通信業	494,700	2,904.61	1,436,910,567	2,885.00	1,427,209,500	0.80
日本	株式	村田製作所	電気機器	73,600	15,227.45	1,120,740,320	19,185.00	1,412,016,000	0.79
日本	株式	東海旅客鉄道	陸運業	62,800	20,799.52	1,306,209,856	22,315.00	1,401,382,000	0.79
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	260,700	4,969.30	1,295,496,510	5,237.00	1,365,285,900	0.77
日本	株式	日本電産	電気機器	84,400	15,323.45	1,293,299,180	16,105.00	1,359,262,000	0.76
日本	株式	ダイキン工業	機械	95,800	12,941.79	1,239,823,482	14,170.00	1,357,486,000	0.76
日本	株式	キヤノン	電気機器	377,600	4,292.14	1,620,712,064	3,563.00	1,345,388,800	0.76
日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	289,600	4,606.11	1,333,929,456	4,525.00	1,310,440,000	0.74
日本	株式	アステラス製薬	医薬品	690,000	1,428.90	985,941,000	1,882.00	1,298,580,000	0.73
日本	株式	東日本旅客鉄道	陸運業	125,600	10,868.22	1,365,048,432	10,055.00	1,262,908,000	0.71
日本	株式	信越化学工業	化学	121,100	11,757.62	1,423,847,782	10,425.00	1,262,467,500	0.71
日本	株式	日立製作所	電気機器	1,684,000	835.03	1,406,190,520	725.50	1,221,742,000	0.69
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	258,400	6,171.02	1,594,591,568	4,653.00	1,202,335,200	0.67
日本	株式	日本たばこ産業	食料品	406,500	3,711.99	1,508,923,935	2,922.00	1,187,793,000	0.67
日本	株式	資生堂	化学	139,400	5,689.09	793,059,146	7,824.00	1,090,665,600	0.61

□ 種別・業種別の投資比率

2018年 8月31日現在

種類	国内 / 外国	業種	投資比率 (%)
株式	国内	水産・農林業	0.10
		鉱業	0.29
		建設業	2.84
		食料品	3.90
		繊維製品	0.61
		パルプ・紙	0.28
		化学	7.35
		医薬品	4.81
		石油・石炭製品	0.83
		ゴム製品	0.71
		ガラス・土石製品	0.96
		鉄鋼	1.03
		非鉄金属	0.80
		金属製品	0.60
		機械	5.07
		電気機器	13.49
輸送用機器	8.36		
精密機器	1.75		

	その他製品	2.08
	電気・ガス業	1.66
	陸運業	4.12
	海運業	0.19
	空運業	0.55
	倉庫・運輸関連業	0.17
	情報・通信業	7.75
	卸売業	4.67
	小売業	4.68
	銀行業	6.67
	証券、商品先物取引業	0.89
	保険業	2.26
	その他金融業	1.17
	不動産業	2.26
	サービス業	4.62
合計		97.53

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）

2018年 8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329回利付国債(10年)	2,530,000,000	104.60	2,646,531,800	104.21	2,636,513,000	0.800	2023/6/20	1.33
日本	国債証券	第313回利付国債(10年)	2,105,000,000	104.03	2,189,915,700	103.58	2,180,380,050	1.300	2021/3/20	1.10
日本	国債証券	第349回利付国債(10年)	1,950,000,000	100.71	1,963,935,000	100.18	1,953,588,000	0.100	2027/12/20	0.98
日本	国債証券	第339回利付国債(10年)	1,875,000,000	103.06	1,932,495,000	102.82	1,927,912,500	0.400	2025/6/20	0.97
日本	国債証券	第340回利付国債(10年)	1,870,000,000	103.30	1,931,722,000	102.85	1,923,369,800	0.400	2025/9/20	0.97
日本	国債証券	第350回利付国債(10年)	1,900,000,000	100.65	1,912,442,100	100.09	1,901,786,000	0.100	2028/3/20	0.96
日本	国債証券	第344回利付国債(10年)	1,881,000,000	100.95	1,899,037,400	100.56	1,891,552,410	0.100	2026/9/20	0.95
日本	国債証券	第315回利付国債(10年)	1,800,000,000	104.10	1,873,908,000	103.65	1,865,826,000	1.200	2021/6/20	0.94
日本	国債証券	第348回利付国債(10年)	1,685,000,000	100.43	1,692,411,700	100.26	1,689,532,650	0.100	2027/9/20	0.85
日本	国債証券	第59回利付国債(20年)	1,455,000,000	108.30	1,575,808,650	107.67	1,566,642,150	1.700	2022/12/20	0.79
日本	国債証券	第346回利付国債(10年)	1,530,000,000	100.83	1,542,699,000	100.42	1,536,502,500	0.100	2027/3/20	0.77
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	1,500,000,000	102.41	1,536,255,000	102.06	1,531,005,000	1.300	2020/3/19	0.77
日本	国債証券	第342回利付国債(10年)	1,520,000,000	101.05	1,536,066,400	100.64	1,529,728,000	0.100	2026/3/20	0.77

日本	国債証券	第345回利付国債(10年)	1,498,000,000	100.89	1,511,332,200	100.49	1,505,430,080	0.100	2026/12/20	0.76
日本	国債証券	第325回利付国債(10年)	1,365,000,000	103.94	1,418,849,250	103.57	1,413,757,800	0.800	2022/9/20	0.71
日本	国債証券	第347回利付国債(10年)	1,380,000,000	100.76	1,390,488,000	100.34	1,384,816,200	0.100	2027/6/20	0.70
日本	国債証券	第343回利付国債(10年)	1,370,000,000	101.01	1,383,837,000	100.58	1,377,987,100	0.100	2026/6/20	0.69
日本	国債証券	第330回利付国債(10年)	1,285,000,000	104.78	1,346,423,000	104.37	1,341,270,150	0.800	2023/9/20	0.68
日本	国債証券	第334回利付国債(10年)	1,265,000,000	104.11	1,317,004,150	103.71	1,312,020,050	0.600	2024/6/20	0.66
日本	国債証券	第335回利付国債(10年)	1,250,000,000	103.61	1,295,187,500	103.24	1,290,512,500	0.500	2024/9/20	0.65
日本	国債証券	第61回利付国債(20年)	1,215,000,000	105.34	1,279,917,450	104.89	1,274,522,850	1.000	2023/3/20	0.64
日本	特殊債券	第89回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1,251,000,000	101.79	1,273,467,960	101.44	1,269,076,950	1.300	2019/9/30	0.64
日本	国債証券	第151回利付国債(20年)	1,100,000,000	113.47	1,248,223,200	111.89	1,230,856,000	1.200	2034/12/20	0.62
日本	国債証券	第128回利付国債(5年)	1,215,000,000	100.70	1,223,590,050	100.57	1,221,974,100	0.100	2021/6/20	0.62
日本	国債証券	第341回利付国債(10年)	1,187,000,000	102.61	1,218,075,660	102.15	1,212,532,370	0.300	2025/12/20	0.61
日本	国債証券	第129回利付国債(5年)	1,180,000,000	100.76	1,188,968,000	100.61	1,187,209,800	0.100	2021/9/20	0.60
日本	国債証券	第132回利付国債(20年)	970,000,000	119.96	1,163,679,900	118.50	1,149,508,200	1.700	2031/12/20	0.58
日本	国債証券	第69回利付国債(20年)	1,020,000,000	112.72	1,149,815,400	111.91	1,141,563,600	2.100	2024/3/20	0.58
日本	国債証券	第338回利付国債(10年)	1,105,000,000	103.14	1,139,752,250	102.78	1,135,774,250	0.400	2025/3/20	0.57
日本	国債証券	第147回利付国債(20年)	960,000,000	119.68	1,148,995,200	117.97	1,132,569,600	1.600	2033/12/20	0.57

□ 種類別の投資比率

2018年 8月31日現在

種類	投資比率(%)
国債証券	73.79
地方債証券	9.20
特殊債券	12.60
社債券	3.88
合計	99.47

外国株式インデックス・マザーファンド

イ 主要投資銘柄(上位30銘柄)

2018年 8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	221,620	18,830.22	4,173,154,022	24,991.83	5,538,689,764	2.92
アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	小売	18,009	129,704.97	2,335,856,910	222,384.32	4,004,919,269	2.11
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	319,735	9,273.51	2,965,065,720	12,433.16	3,975,318,651	2.10
アメリカ	株式	FACEBOOK INC-A	ソフトウェア・サービス	104,729	19,457.39	2,037,753,779	19,728.69	2,066,166,855	1.09
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	149,713	11,520.25	1,724,731,758	12,793.00	1,915,278,619	1.01
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	ソフトウェア・サービス	13,763	113,633.26	1,563,934,560	137,616.66	1,894,018,191	1.00
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	ソフトウェア・サービス	13,018	115,326.92	1,501,325,912	139,318.10	1,813,643,109	0.96
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	117,351	15,508.41	1,819,928,408	14,987.54	1,758,803,628	0.93
アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORPORATION	エネルギー	185,591	9,124.68	1,693,460,267	8,941.44	1,659,450,902	0.88
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	425,371	3,139.66	1,335,522,951	3,443.97	1,464,965,218	0.77
アメリカ	株式	WELLS FARGO & COMPANY	銀行	203,880	6,295.99	1,283,626,726	6,492.56	1,323,704,682	0.70
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	各種金融	55,936	21,123.61	1,181,570,666	23,294.83	1,303,019,891	0.69
アメリカ	株式	VISA INC	ソフトウェア・サービス	78,794	12,207.71	961,894,711	16,296.94	1,284,101,437	0.68
スイス	株式	NESTLE SA-REGISTERED	食品・飲料・タバコ	136,671	9,725.86	1,329,244,276	9,315.93	1,273,218,016	0.67
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	42,297	24,758.60	1,047,214,750	29,807.39	1,260,763,319	0.67
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	260,204	4,021.48	1,046,405,858	4,608.99	1,199,277,634	0.63
アメリカ	株式	HOME DEPOT INC	小売	51,078	19,685.38	1,005,490,095	22,129.81	1,130,346,721	0.60
アメリカ	株式	AT&T INC	電気通信サービス	317,508	3,868.36	1,228,236,915	3,549.47	1,126,987,534	0.59
アメリカ	株式	CHEVRON CORPORATION	エネルギー	83,703	13,002.91	1,088,382,728	13,306.09	1,113,760,371	0.59
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	209,837	4,166.97	874,384,736	5,236.47	1,098,807,044	0.58
アメリカ	株式	INTEL CORP	半導体・半導体製造装置	204,835	4,884.64	1,000,545,476	5,357.53	1,097,410,559	0.58
アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS INC	電気通信サービス	180,171	5,537.15	997,634,415	6,080.53	1,095,536,071	0.58
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	109,765	9,912.10	1,088,002,205	9,263.51	1,016,809,680	0.54
アメリカ	株式	MASTERCARD INC-CL A	ソフトウェア・サービス	40,637	16,492.40	670,202,065	23,744.62	964,910,448	0.51
アメリカ	株式	BOEING CO	資本財	24,437	30,178.33	737,467,943	38,526.71	941,477,310	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	97,442	9,592.71	934,733,555	9,325.11	908,657,369	0.48

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	118,397	6,146.06	727,675,113	7,612.05	901,244,168	0.48
アメリカ	株式	CITIGROUP INC	銀行	111,855	8,333.94	932,193,127	7,936.34	887,720,161	0.47
アメリカ	株式	COCA-COLA CO/THE	食品・飲料・タバコ	176,397	5,047.67	890,395,079	4,992.14	880,599,754	0.46
イギリス	株式	HSBC HOLDINGS PLC	銀行	878,070	1,073.70	942,788,196	975.78	856,803,145	0.45

ロ 種類別・業種別の投資比率

2018年 8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	6.74
		素材	4.49
		資本財	7.05
		商業・専門サービス	1.10
		運輸	1.94
		自動車・自動車部品	1.25
		耐久消費財・アパレル	1.84
		消費者サービス	1.73
		メディア	1.95
		小売	4.97
		食品・生活必需品小売り	1.50
		食品・飲料・タバコ	4.57
		家庭用品・パーソナル用品	1.83
		ヘルスケア機器・サービス	4.75
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	8.15
		銀行	8.61
		各種金融	4.31
		保険	3.67
		不動産	0.76
		ソフトウェア・サービス	11.76
テクノロジー・ハードウェアおよび機器	4.70		
電気通信サービス	2.26		
公益事業	2.94		
半導体・半導体製造装置	2.98		
投資証券			2.16
合計			98.03

外国債券パッシブ・マザーファンド

イ 主要投資銘柄(上位30銘柄)

2018年 8月31日現在

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.375	8,000,000	11,173.67	893,894,175	10,844.83	867,586,842	2.375	2024/8/15	0.49
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 1.75	5,100,000	14,287.66	728,670,963	14,288.26	728,701,540	1.750	2024/11/25	0.42
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 3	5,000,000	14,840.70	742,035,466	14,530.15	726,507,700	3.000	2022/4/25	0.41
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 2.75	4,500,000	15,759.28	709,168,037	15,551.86	699,833,887	2.750	2027/10/25	0.40
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.25	6,500,000	11,051.58	718,352,739	10,685.18	694,537,140	2.250	2025/11/15	0.40
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 4.5	3,300,000	21,337.23	704,128,801	20,928.60	690,643,937	4.500	2041/4/25	0.39
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.75	6,200,000	11,438.31	709,175,368	11,094.72	687,872,672	2.750	2023/11/15	0.39
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.25	6,300,000	11,084.30	698,311,445	10,751.99	677,375,764	2.250	2024/11/15	0.39
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 3.625	6,000,000	11,520.73	691,244,381	11,268.25	676,095,106	3.625	2020/2/15	0.39
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.25	6,200,000	11,007.15	682,443,709	10,607.09	657,640,057	2.250	2027/2/15	0.38
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.25	6,200,000	10,891.25	675,257,747	10,556.77	654,519,966	2.250	2027/11/15	0.37
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.75	5,900,000	10,987.49	648,262,440	11,057.41	652,387,264	2.750	2025/6/30	0.37
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2	6,200,000	10,794.51	669,259,710	10,419.68	646,020,405	2.000	2026/11/15	0.37
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.25	6,100,000	10,997.16	670,826,833	10,570.65	644,810,024	2.250	2027/8/15	0.37
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.375	6,000,000	11,122.48	667,349,131	10,700.80	642,048,275	2.375	2027/5/15	0.37
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.75	5,800,000	11,016.21	638,940,397	10,999.27	637,958,143	2.750	2028/2/15	0.36
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 2.25	4,300,000	14,664.89	630,590,546	14,612.03	628,317,545	2.250	2024/5/25	0.36
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.5	5,700,000	11,261.48	641,904,588	10,934.20	623,249,631	2.500	2024/5/15	0.36
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 3.625	5,000,000	13,099.87	654,993,703	12,335.46	616,773,448	3.625	2044/2/15	0.35
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 5.75	2,900,000	21,719.43	629,863,714	21,248.35	616,202,389	5.750	2032/10/25	0.35
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 1.625	6,000,000	10,526.40	631,584,338	10,205.37	612,322,369	1.625	2026/2/15	0.35
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.625	5,500,000	11,317.70	622,473,947	11,092.11	610,066,463	2.625	2020/11/15	0.35
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 1.75	5,700,000	10,859.58	618,996,380	10,613.17	604,950,761	1.750	2023/5/15	0.35
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 4.25	3,800,000	16,284.39	618,807,064	15,862.54	602,776,864	4.250	2023/10/25	0.34
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2	5,600,000	10,889.43	609,808,248	10,571.52	592,005,330	2.000	2025/2/15	0.34
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2	5,500,000	11,010.55	605,580,679	10,755.46	591,550,678	2.000	2023/2/15	0.34
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 3.625	4,800,000	13,081.75	627,924,355	12,309.43	590,853,085	3.625	2043/8/15	0.34
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 4.75	2,900,000	20,629.83	598,265,326	20,232.73	586,749,385	4.750	2035/4/25	0.33
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 1.5	5,800,000	10,373.00	601,634,232	10,049.19	582,853,292	1.500	2026/8/15	0.33
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 5.5	3,000,000	19,868.28	596,048,553	19,393.57	581,807,318	5.500	2029/4/25	0.33

□ 種類別の投資比率

2018年 8月31日現在

種類	投資比率（％）
国債証券	98.76
合計	98.76

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）

2018年 8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	244	日本円	4,211,629,520	4,229,740,000	2.37

（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

2018年 8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 1809	買建	162	米ドル	22,871,398.5	2,540,097,517	23,506,200	2,610,598,572	1.37
	ドイツ	ユーレック ス・ドイツ 金融先物取 引所	DJ EUR 1809	買建	146	ユーロ	5,109,792	662,024,652	5,007,800	648,810,568	0.34

オーストラリア	シドニー先物取引所	SP1200 1809	買建	13	オーストラリアドル	2,023,983.5	163,112,830	2,055,300	165,636,627	0.08
イギリス	ロンドン国際金融先物オプション取引所	FTSE 1809	買建	22	英ポンド	1,671,174	241,584,913	1,651,650	238,762,524	0.12

(注) 主たる取引所の発表する清算値段または最終相場で評価しております。

2018年 8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	210,000.00	23,300,445	23,316,300	0.01
	カナダドル	売建	10,000.00	854,018	854,500	0.00
	ユーロ	売建	30,000.00	3,883,530	3,886,800	0.00
	英ポンド	売建	20,000.00	2,888,276	2,890,800	0.00
	スイスフラン	売建	10,000.00	1,145,873	1,147,000	0.00
	スウェーデンクローナ	売建	30,000.00	365,035	365,400	0.00
	ノルウェークローネ	売建	10,000.00	132,968	132,900	0.00
	デンマーククローネ	売建	10,000.00	173,613	173,800	0.00
	オーストラリアドル	売建	10,000.00	804,810	805,600	0.00
	香港ドル	売建	30,000.00	424,072	424,200	0.00

(注) 日本における対顧客先物相場の仲値で評価しております。

外国債券パッシブ・マザーファンド

2018年 8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	ユーロ	買建	1,867,540.00	242,978,159	241,958,482	0.13
	ユーロ	売建	459.34	59,590	59,512	0.00
	スイスフラン	売建	2,100,000.00	241,500,000	240,870,000	0.13

(注) 日本における対顧客先物相場の仲値で評価しております。

参考情報

基準日:2018年8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
2018年2月	0円
2017年2月	0円
2016年2月	0円
2015年2月	0円
2014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
2018年2月	0円
2017年2月	0円
2016年2月	0円
2015年2月	0円
2014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
2018年2月	0円
2017年2月	0円
2016年2月	0円
2015年2月	0円
2014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。

主要な資産の状況

■マイパッケージ30

資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
親投資信託受益証券	日本	95.29
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		4.71
合計(純資産総額)		100.00

主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	比率(%)
日本	親投資信託受益証券	国内債券パッシブ・マザーファンド	54.96
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)	20.19
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	10.12
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	10.02

■マイパッケージ50

資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
親投資信託受益証券	日本	95.32
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		4.68
合計(純資産総額)		100.00

主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	比率(%)
日本	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)	35.15
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	35.02
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	15.13
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	10.02

■マイパッケージ70

資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
親投資信託受益証券	日本	95.31
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		4.69
合計(純資産総額)		100.00

主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	比率(%)
日本	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)	50.13
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	20.16
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	15.01
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	10.02

※比率は、各ファンドのそれぞれの純資産総額に対する時価の比率です。

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

▶ 投資対象とする投資信託の現況

■国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
株式	日本	97.53
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		2.47
合計(純資産総額)		100.00

※株価指数先物取引の買建て 2.37%

主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	業種	比率(%)
日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	3.32
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	1.82
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	1.80
日本	株式	ソニー	電気機器	1.67
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	1.37
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	1.29
日本	株式	キーエンス	電気機器	1.21
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	1.17
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	1.03
日本	株式	KDDI	情報・通信業	1.00

■国内債券パッシブ・マザーファンド

資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
国債証券	日本	73.79
特殊債券	日本	12.60
地方債証券	日本	9.20
社債券	日本	3.68
	オーストラリア	0.10
	フランス	0.10
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		0.53
合計(純資産総額)		100.00

主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	利率(%)	償還期限	比率(%)
日本	国債証券	第329回利付国債(10年)	0.800	2023/06/20	1.33
日本	国債証券	第313回利付国債(10年)	1.300	2021/03/20	1.10
日本	国債証券	第349回利付国債(10年)	0.100	2027/12/20	0.98
日本	国債証券	第339回利付国債(10年)	0.400	2025/06/20	0.97
日本	国債証券	第340回利付国債(10年)	0.400	2025/09/20	0.97
日本	国債証券	第350回利付国債(10年)	0.100	2028/03/20	0.96
日本	国債証券	第344回利付国債(10年)	0.100	2026/09/20	0.95
日本	国債証券	第315回利付国債(10年)	1.200	2021/06/20	0.94
日本	国債証券	第348回利付国債(10年)	0.100	2027/09/20	0.85
日本	国債証券	第59回利付国債(20年)	1.700	2022/12/20	0.79

■外国株式インデックス・マザーファンド

資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
株式	アメリカ	62.04
	イギリス	6.06
	フランス	3.72
	カナダ	3.66
	ドイツ	3.57
	スイス	3.36
	その他	13.46
投資証券	アメリカ・その他	2.16
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1.97
合計(純資産総額)		100.00

※株価指数先物取引の買建て 1.91%

主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	業種	比率(%)
アメリカ	株式	APPLE INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	2.92
アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	小売	2.11
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	2.10
アメリカ	株式	FACEBOOK INC-A	ソフトウェア・サービス	1.09
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	1.01
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	ソフトウェア・サービス	1.00
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	ソフトウェア・サービス	0.96
アメリカ	株式	JOHNSON & JOHNSON	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	0.93
アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORPORATION	エネルギー	0.88
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	0.77

※比率は、各マザーファンドのそれぞれの純資産総額に対する時価の比率です。

■外国債券パッシブ・マザーファンド

資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
国債証券	アメリカ	44.29
	フランス	10.20
	イタリア	8.95
	ドイツ	6.84
	イギリス	6.61
	スペイン	5.97
	ベルギー	2.60
	その他	13.33
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1.24
合計(純資産総額)		100.00

主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	利率(%)	償還期限	比率(%)
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.375	2.375	2024/08/15	0.49
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 1.75	1.750	2024/11/25	0.42
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 3	3.000	2022/04/25	0.41
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 2.75	2.750	2027/10/25	0.40
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.25	2.250	2025/11/15	0.40
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 4.5	4.500	2041/04/25	0.39
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.75	2.750	2023/11/15	0.39
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.25	2.250	2024/11/15	0.39
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 3.625	3.625	2020/02/15	0.39
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.25	2.250	2027/02/15	0.38

※比率は、マザーファンドの純資産総額に対する時価の比率です。

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



※2018年の収益率は、年初から2018年8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、原則として日本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、原則として日本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】

2005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。

（ニ）受託会社の辞任および解任に伴う取扱い

- a. 受託会社は、委託会社の承諾を受けてその任務を辞任することができます。また、受託会社はその任務に背いた場合、その他重要な事由が生じたときは、委託会社または受益者は、裁判所に受託会社の解任を請求することができます。
- b. 上記により受託会社が辞任し、または解任された場合は、委託会社は新受託会社を選任します。
- c. 委託会社が新受託会社を選任できないとき、委託会社は当ファンドの信託契約を解約し、信託を終了させます。

ロ 収益分配金、償還金の支払い

（イ）収益分配金

- a. 分配金額は、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。分配対象額が少

額の場合等には委託会社の判断により分配を行わない場合もあるため、将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

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

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

(ロ) 償還金

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

八 信託約款の変更

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

二 反対者の買取請求権

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

ホ 販売会社との契約の更改等

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

へ 委託会社の事業の譲渡および承継に伴う取扱い

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

ト 公告

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

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

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

チ 運用にかかる報告書の開示方法

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

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

4【受益者の権利等】

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

受益者の有する主な権利は次の通りです。

イ 分配金請求権

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

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

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

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

ロ 償還金請求権

受益者は、持分に応じて償還金を請求する権利を有します。

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

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

ハ 一部解約実行請求権

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

ニ 信託約款変更等に対する異議申立権および受益権の買取請求権

委託会社が、当ファンドの解約(監督官庁の命令による解約等の場合を除きます。)または重大な信託約款の変更を行おうとする場合において、当該解約または信託約款変更に関する異議のある受益者は、それぞれの手続きにおいて設けられる異議申立期間中に異議を申し立てることができます。異議を申し立てた受益者の受益権の口数が、受益権の総口数の過半数となるときは、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13期(平成29年2月21日から平成30年2月19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12期 （平成29年 2月20日現在）	第13期 （平成30年 2月19日現在）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	349,735,664	355,919,031
親投資信託受益証券	6,184,111,708	7,958,601,651
未収入金	-	65,000,000
流動資産合計	6,533,847,372	8,379,520,682
資産合計	6,533,847,372	8,379,520,682
負債の部		
流動負債		
未払解約金	3,671,378	6,371,260
未払受託者報酬	976,479	1,305,625
未払委託者報酬	6,184,297	8,268,903
未払利息	862	1,000
その他未払費用	163,802	218,350
流動負債合計	10,996,818	16,165,138
負債合計	10,996,818	16,165,138
純資産の部		
元本等		
元本	4,695,698,893	5,724,182,209
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	1,827,151,661	2,639,173,335
元本等合計	6,522,850,554	8,363,355,544
純資産合計	6,522,850,554	8,363,355,544
負債純資産合計	6,533,847,372	8,379,520,682

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第12期		第13期	
	自	平成28年 2月19日 至 平成29年 2月20日	自	平成29年 2月21日 至 平成30年 2月19日
営業収益				
有価証券売買等損益		317,250,837		385,639,943
営業収益合計		317,250,837		385,639,943
営業費用				
支払利息		204,496		312,362
受託者報酬		1,820,176		2,432,535
委託者報酬		11,527,645		15,405,968
その他費用		354,954		447,828
営業費用合計		13,907,271		18,598,693
営業利益又は営業損失（ ）		303,343,566		367,041,250
経常利益又は経常損失（ ）		303,343,566		367,041,250
当期純利益又は当期純損失（ ）		303,343,566		367,041,250
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（ ）		14,086,396		27,869,700
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		1,191,278,129		1,827,151,661
剰余金増加額又は欠損金減少額		471,599,641		730,126,162
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		471,599,641		730,126,162
剰余金減少額又は欠損金増加額		124,983,279		257,276,038
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		124,983,279		257,276,038
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（ ）		1,827,151,661		2,639,173,335

(3) 【注記表】

(重要な会計方針の注記)

項 目	第13期	
	自 平成29年 2月21日 至 平成30年 2月19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>当計算期間は前期末および当期末が休日のため、平成29年 2月21日から平成30年 2月19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12期		第13期	
	(平成29年 2月20日現在)		(平成30年 2月19日現在)	
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	4,695,698,893口		5,724,182,209口	
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額	1.3891円	1口当たり純資産額	1.4611円
	(10,000口当たりの純資産額)	13,891円	(10,000口当たりの純資産額)	14,611円

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第12期	第13期
	自 平成28年 2月19日 至 平成29年 2月20日	自 平成29年 2月21日 至 平成30年 2月19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(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(105,120,550円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(234,051,000円)、収益調整金(2,018,310,508円)、および分配準備積立金(812,508,112円)より、分配対象収益は3,169,990,170円(1万口当たり5,537.87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13期
	自 平成29年 2月21日 至 平成30年 2月19日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>(1)金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、親投資信託受益証券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。</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13期 自 平成29年 2月21日 至 平成30年 2月19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13期 (平成30年 2月19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

第13期（自 平成29年 2月21日 至 平成30年 2月19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	345,192,211円
合計	345,192,211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13期 自 平成29年 2月21日 至 平成30年 2月19日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。

（その他の注記）

項 目	第12期 （平成29年 2月20日現在）	第13期 （平成30年 2月19日現在）
期首元本額	3,772,218,254円	4,695,698,893円
期中追加設定元本額	1,313,785,041円	1,682,239,634円
期中一部解約元本額	390,304,402円	653,756,318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)	638,526,687	1,725,362,960	
	外国株式インデックス・マザーファンド	240,357,105	800,605,481	
	外国債券パッシブ・マザーファンド	482,033,249	822,975,366	
	国内債券パッシブ・マザーファンド	3,664,566,217	4,609,657,844	
合計		5,025,483,258	7,958,601,651	

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12期 （平成29年 2月20日現在）	第13期 （平成30年 2月19日現在）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	967,487,474	909,178,053
親投資信託受益証券	16,926,566,403	22,224,159,988
未収入金	-	250,000,000
流動資産合計	17,894,053,877	23,383,338,041
資産合計	17,894,053,877	23,383,338,041
負債の部		
流動負債		
未払解約金	8,546,584	14,601,221
未払受託者報酬	2,716,864	3,642,928
未払委託者報酬	18,112,348	24,286,142
未払利息	2,385	2,556
その他未払費用	455,760	609,456
流動負債合計	29,833,941	43,142,303
負債合計	29,833,941	43,142,303
純資産の部		
元本等		
元本	12,337,069,119	14,911,517,227
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	5,527,150,817	8,428,678,511
元本等合計	17,864,219,936	23,340,195,738
純資産合計	17,864,219,936	23,340,195,738
負債純資産合計	17,894,053,877	23,383,338,041

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第12期		第13期	
	自	平成28年 2月19日 至 平成29年 2月20日	自	平成29年 2月21日 至 平成30年 2月19日
営業収益				
有価証券売買等損益		1,513,885,524		1,630,063,585
営業収益合計		1,513,885,524		1,630,063,585
営業費用				
支払利息		539,160		851,699
受託者報酬		5,081,791		6,733,757
委託者報酬		33,878,424		44,891,585
その他費用		976,754		1,238,987
営業費用合計		40,476,129		53,716,028
営業利益又は営業損失 ()		1,473,409,395		1,576,347,557
経常利益又は経常損失 ()		1,473,409,395		1,576,347,557
当期純利益又は当期純損失 ()		1,473,409,395		1,576,347,557
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 ()		41,476,291		88,984,331
期首剰余金又は期首欠損金 ()		3,409,880,084		5,527,150,817
剰余金増加額又は欠損金減少額		949,018,968		1,950,859,812
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		949,018,968		1,950,859,812
剰余金減少額又は欠損金増加額		263,681,339		536,695,344
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		263,681,339		536,695,344
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 ()		5,527,150,817		8,428,678,511

(3) 【注記表】

(重要な会計方針の注記)

項 目	第13期	
	自 平成29年 2月21日 至 平成30年 2月19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>当計算期間は前期末および当期末が休日のため、平成29年 2月21日から平成30年 2月19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12期		第13期	
	(平成29年 2月20日現在)		(平成30年 2月19日現在)	
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	12,337,069,119口		14,911,517,227口	
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額	1.4480円	1口当たり純資産額	1.5652円
	(10,000口当たりの純資産額)	14,480円	(10,000口当たりの純資産額)	15,652円

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第12期	第13期
	自 平成28年 2月19日 至 平成29年 2月20日	自 平成29年 2月21日 至 平成30年 2月19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(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(333,086,489円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(1,154,276,737円)、収益調整金(6,221,126,387円)、および分配準備積立金(3,436,796,216円)より、分配対象収益は11,145,285,829円(1万口当たり7,474.25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13期
	自 平成29年 2月21日 至 平成30年 2月19日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>(1)金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、親投資信託受益証券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。</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13期 自 平成29年 2月21日 至 平成30年 2月19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13期 (平成30年 2月19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

第13期（自 平成29年 2月21日 至 平成30年 2月19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	1,504,719,337円
合計	1,504,719,337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13期 自 平成29年 2月21日 至 平成30年 2月19日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。

（その他の注記）

項 目	第12期 （平成29年 2月20日現在）	第13期 （平成30年 2月19日現在）
期首元本額	10,605,602,485円	12,337,069,119円
期中追加設定元本額	2,542,481,389円	3,756,094,069円
期中一部解約元本額	811,014,755円	1,181,645,961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）	3,080,226,224	8,323,079,279	
	外国株式インデックス・マザーファンド	1,036,536,616	3,452,599,814	
	外国債券パッシブ・マザーファンド	1,356,533,104	2,316,008,968	
	国内債券パッシブ・マザーファンド	6,465,117,996	8,132,471,927	
合計		11,938,413,940	22,224,159,988	

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12期 （平成29年 2月20日現在）	第13期 （平成30年 2月19日現在）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	461,356,361	494,609,119
親投資信託受益証券	8,623,426,727	11,487,565,645
未収入金	3,250,000	110,000,000
流動資産合計	9,088,033,088	12,092,174,764
資産合計	9,088,033,088	12,092,174,764
負債の部		
流動負債		
未払解約金	9,385,842	18,090,996
未払受託者報酬	1,376,891	1,866,446
未払委託者報酬	9,638,144	13,065,099
未払利息	1,137	1,390
その他未払費用	230,867	312,272
流動負債合計	20,632,881	33,336,203
負債合計	20,632,881	33,336,203
純資産の部		
元本等		
元本	6,131,734,500	7,343,316,412
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	2,935,665,707	4,715,522,149
元本等合計	9,067,400,207	12,058,838,561
純資産合計	9,067,400,207	12,058,838,561
負債純資産合計	9,088,033,088	12,092,174,764

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第12期		第13期	
	自	平成28年 2月19日 至 平成29年 2月20日	自	平成29年 2月21日 至 平成30年 2月19日
営業収益				
有価証券売買等損益		1,069,442,256		1,097,328,918
営業収益合計		1,069,442,256		1,097,328,918
営業費用				
支払利息		263,475		437,608
受託者報酬		2,561,889		3,423,253
委託者報酬		17,933,060		23,962,690
その他費用		490,692		630,148
営業費用合計		21,249,116		28,453,699
営業利益又は営業損失 ()		1,048,193,140		1,068,875,219
経常利益又は経常損失 ()		1,048,193,140		1,068,875,219
当期純利益又は当期純損失 ()		1,048,193,140		1,068,875,219
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 ()		41,182,520		78,549,697
期首剰余金又は期首欠損金 ()		1,629,260,400		2,935,665,707
剰余金増加額又は欠損金減少額		479,849,573		1,177,501,917
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		479,849,573		1,177,501,917
剰余金減少額又は欠損金増加額		180,454,886		387,970,997
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		180,454,886		387,970,997
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		-		-
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金 ()		2,935,665,707		4,715,522,149

(3)【注記表】

(重要な会計方針の注記)

項目	第13期	
	自 平成29年 2月21日 至 平成30年 2月19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 当計算期間は前期末および当期末が休日のため、平成29年 2月21日から平成30年 2月19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12期		第13期	
	(平成29年 2月20日現在)		(平成30年 2月19日現在)	
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	6,131,734,500口		7,343,316,412口	
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額	1.4788円	1口当たり純資産額	1.6422円
	(10,000口当たりの純資産額)	14,788円	(10,000口当たりの純資産額)	16,422円

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第12期	第13期
	自 平成28年 2月19日 至 平成29年 2月20日	自 平成29年 2月21日 至 平成30年 2月19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(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。	計算期間末における費用控除後の配当等収益(188,609,584円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(801,715,938円)、収益調整金(3,881,114,524円)、および分配準備積立金(1,881,707,257円)より、分配対象収益は6,753,147,303円(1万口当たり9,196.30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13期
	自 平成29年 2月21日 至 平成30年 2月19日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>(1)金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、親投資信託受益証券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。</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13期 自 平成29年 2月21日 至 平成30年 2月19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13期 (平成30年 2月19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

第13期（自 平成29年 2月21日 至 平成30年 2月19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	1,026,396,179円
合計	1,026,396,179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13期 自 平成29年 2月21日 至 平成30年 2月19日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。

（その他の注記）

項 目	第12期 （平成29年 2月20日現在）	第13期 （平成30年 2月19日現在）
期首元本額	5,397,378,680円	6,131,734,500円
期中追加設定元本額	1,323,647,752円	2,006,562,694円
期中一部解約元本額	589,291,932円	794,980,782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）	2,271,789,019	6,138,601,108	
	外国株式インデックス・マザーファンド	719,814,382	2,397,629,725	
	外国債券パッシブ・マザーファンド	680,716,519	1,162,187,312	
	国内債券パッシブ・マザーファンド	1,422,328,882	1,789,147,500	
合計		5,094,648,802	11,487,565,645	

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29年 2月20日現在)	(平成30年 2月19日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	1,348,419,802	2,786,649,006
株式	215,854,667,050	185,261,262,630
派生商品評価勘定	29,800,280	41,517,400
未収入金	-	6,717,392
未収配当金	340,806,366	264,957,200
前払金	-	44,170,000
差入委託証拠金	3,350,000	52,560,000
流動資産合計	217,577,043,498	188,457,833,628
資産合計	217,577,043,498	188,457,833,628
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	276,480	85,880,720
前受金	29,540,000	-
未払解約金	291,326,226	76,767,000

	（平成29年 2月20日現在）	（平成30年 2月19日現在）
未払利息	3,324	7,834
その他未払費用	6,654	4,126
流動負債合計	321,152,684	162,659,680
負債合計	321,152,684	162,659,680
純資産の部		
元本等		
元本	94,226,159,685	69,684,287,877
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	123,029,731,129	118,610,886,071
元本等合計	217,255,890,814	188,295,173,948
純資産合計	217,255,890,814	188,295,173,948
負債純資産合計	217,577,043,498	188,457,833,628

注記表

（重要な会計方針の注記）

項 目	自 平成29年 2月21日 至 平成30年 2月19日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>先物取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場によっております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金の計上基準</p> <p>受取配当金は原則として、配当落ち日において、確定配当金額または予想配当金額を計上しております。なお、配当金額が未確定の場合は、入金日基準で計上しております。</p>

（貸借対照表に関する注記）

項 目	（平成29年 2月20日現在）	（平成30年 2月19日現在）
1. 担保資産	代用として、担保に供している資産は次の通りであります。	代用として、担保に供している資産は次の通りであります。

	株式	3,216,000,000円	株式	3,689,500,000円
2. 当計算期間の末日における受益権の総数		94,226,159,685口		69,684,287,877口
3. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 (10,000口当たりの純資産額)	2.3057円 23,057円)	1口当たり純資産額 (10,000口当たりの純資産額)	2.7021円 27,021円)

(金融商品に関する注記)

. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 平成29年 2月21日 至 平成30年 2月19日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>(1)金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、株式を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。 当計算期間については、先物取引を行っております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2)金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>

3.金融商品に係るリスク管理体制	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する委員会をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用グループに是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用グループは、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。その後、当該関連運用グループの対処の実施や対処方針の決定等に関し、必要に応じてリスク管理を行う部署が当該部署の担当役員、当該関連運用グループの担当役員およびリスク管理委員会へ報告を行う体制となっております。</p> <p>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する部会にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。</p>
4.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<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30年 2月19日現在)
1.貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	<p>(1) 有価証券（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

（平成30年 2月19日現在）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

（単位：円）

区 分	種 類	契 約 額 等		時 価	評 価 損 益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	3,210,873,320	-	3,166,510,000	44,363,320
	東証株価指数先物	3,210,873,320	-	3,166,510,000	44,363,320
合計		3,210,873,320	-	3,166,510,000	44,363,320

（注）1．時価の算定方法

(1) 株価指数先物取引の時価の算定方法について

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

2) 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

2．ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

自 平成29年 2月21日 至 平成30年 2月19日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。

（その他の注記）

（平成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VA(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VA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VA25 <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VA37.5 <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VA50 <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VL30 <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VL50 <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VA <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VA75 <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VL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VA25 <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VA50 <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VA40 <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VA35 <適格機関投資家専用>	4,235,320,573円
S M A M・バランスVA株40T <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・VAS(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40VA <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VA20 <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・VAS(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VA20A <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VA35A <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VA50A <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VA20L <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VA25L <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VA20T <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

(平成30年 2月19日現在)

開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	94,226,159,685円
同期中における追加設定元本額	9,581,959,783円
同期中における一部解約元本額	34,123,831,591円
平成30年 2月19日現在における元本の内訳	
三井住友・日本株式インデックス年金ファンド	9,811,777,456円
三井住友・D C 年金バランス3 0 (債券重点型)	638,526,687円
三井住友・D C 年金バランス5 0 (標準型)	3,080,226,224円
三井住友・D C 年金バランス7 0 (株式重点型)	2,271,789,019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)	134,223,760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)	7,072,256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)	21,977,451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)	54,543,383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)	62,737,591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)	35,055,593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)	97,562,483円
国内株式指数ファンド (T O P I X)	1,612,896,348円
三井住友・D C つみたてN I S A ・ 日本株インデックスファンド	4,282,050,855円
アセットアロケーション・ファンド (安定型)	1,069,532,241円
アセットアロケーション・ファンド (安定成長型)	1,213,867,144円
アセットアロケーション・ファンド (成長型)	1,135,822,135円
イオン・バランス戦略ファンド	23,458,196円
三井住友・D C ターゲットイヤーファンド2 0 5 0	3,853,991円
三井住友・資産最適化ファンド (1 安定重視型)	263,856円
三井住友・資産最適化ファンド (2 やや安定型)	1,161,752円

三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	10,557,399円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	10,490,423円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	42,667,970円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	1,497,787円
SMAM・国内株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	7,628,143,731円
バランスファンドVA(安定運用型)＜適格機関投資家限定＞	29,332,036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＞	2,852,615,400円
SMAM・バランスファンドVA25＜適格機関投資家専用＞	3,892,930,593円
SMAM・バランスファンドVA37.5＜適格機関投資家専用＞	2,575,394,920円
SMAM・バランスファンドVA50＜適格機関投資家専用＞	9,423,534,192円
SMAM・バランスファンドVL30＜適格機関投資家限定＞	54,641,962円
SMAM・バランスファンドVL50＜適格機関投資家限定＞	229,178,880円
世界6資産バランスファンドVA＜適格機関投資家限定＞	1,346,769円
SMAM・バランスファンドVA75＜適格機関投資家専用＞	1,058,651,349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＞	57,201,706円
SMAM・インデックス・バランスVA25＜適格機関投資家専用＞	394,439,565円
SMAM・インデックス・バランスVA50＜適格機関投資家専用＞	1,139,461,875円
SMAM・バランスファンドVA40＜適格機関投資家専用＞	1,228,823,342円
SMAM・バランスファンドVA35＜適格機関投資家専用＞	3,292,030,822円
SMAM・バランスVA株40T＜適格機関投資家限定＞	57,274,907円
三井住友・5資産バランスファンド・VAS(適格機関投資家専用)	1,434,434,866円
SMAM・グローバルバランス40VA＜適格機関投資家限定＞	70,349,641円
SMAM・バランスファンドVA20＜適格機関投資家専用＞	109,096,653円
三井住友・7資産バランスファンド・VAS(適格機関投資家専用)	1,676,254,768円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A＜適格機関投資家専用＞	107,737,120円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A＜適格機関投資家専用＞	47,862,698円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A＜適格機関投資家専用＞	24,251,578円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L＜適格機関投資家専用＞	213,046,805円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L＜適格機関投資家専用＞	393,506,462円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T＜適格機関投資家専用＞	162,861,286円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A2＜適格機関投資家専用＞	113,765,518円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A2＜適格機関投資家専用＞	58,297,842円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A2＜適格機関投資家専用＞	10,726,854円
SMAM・アセットバランスファンドVA30L2＜適格機関投資家専用＞	75,815,538円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L2＜適格機関投資家専用＞	997,354,799円
SMAM・国内株式インデックスファンド・VA(適格機関投資家専用)	196,489,306円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T2＜適格機関投資家専用＞	19,532,457円
SMAM・グローバルバランスファンド(標準型)VA＜適格機関投資家限定＞	1,806,219,572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＞	265,581,987円
SMAM・世界バランスファンドVA＜適格機関投資家限定＞	1,772,189,307円
SMAM・世界バランスファンドVA2＜適格機関投資家限定＞	373,132,170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＞	148,268円
SMAM・マルチアセットストラテジーファンド2016-04＜適格機関投資家限定＞	88,696,522円
SMAM・マルチアセットストラテジーファンド2016-05＜適格機関投資家限定＞	42,476,846円
SMAM・マルチアセットストラテジー・オープン＜適格機関投資家限定＞	85,809,974円
SMAM・マルチアセット・ダイナミックアロケーション・ストラテジー・ファンド＜適格機関投資家限定＞	34,991円
合計	69,684,287,877円

附属明細表

有価証券明細表

(a) 株式

(単位：円)

銘柄	株数	評価額		備考
		単価	金額	
極洋	3,400	3,880.00	13,192,000	
日本水産	92,700	538.00	49,872,600	
マルハニチロ	15,500	3,330.00	51,615,000	
カネコ種苗	3,800	1,605.00	6,099,000	
サカタのタネ	11,900	3,690.00	43,911,000	
ホクト	8,100	2,080.00	16,848,000	
住石ホールディングス	21,000	160.00	3,360,000	
日鉄鉱業	2,300	7,050.00	16,215,000	
三井松島産業	5,000	1,472.00	7,360,000	
国際石油開発帝石	397,000	1,342.00	532,774,000	
石油資源開発	12,500	2,626.00	32,825,000	
K&Oエナジーグループ	5,100	1,717.00	8,756,700	
ショーボンドホールディングス	7,600	7,480.00	56,848,000	
ミライト・ホールディングス	24,600	1,627.00	40,024,200	
タマホーム	8,700	1,174.00	10,213,800	
インベスターズクラウド	7,600	1,996.00	15,169,600	
ダイセキ環境ソリューション	3,600	1,157.00	4,165,200	
安藤・間	62,800	779.00	48,921,200	
東急建設	31,100	1,195.00	37,164,500	
コムシスホールディングス	28,700	2,792.00	80,130,400	
ミサワホーム	8,000	870.00	6,960,000	
ピーアールホールディングス	10,900	480.00	5,232,000	
高松コンストラクショングループ	5,000	2,955.00	14,775,000	
東建コーポレーション	3,000	12,040.00	36,120,000	
大成建設	81,200	5,360.00	435,232,000	
大林組	244,200	1,199.00	292,795,800	
清水建設	249,100	1,012.00	252,089,200	
飛鳥建設	81,500	184.00	14,996,000	
長谷工コーポレーション	95,100	1,563.00	148,641,300	
松井建設	10,800	831.00	8,974,800	
銭高組	1,400	5,690.00	7,966,000	
鹿島建設	358,000	1,008.00	360,864,000	
不動テトラ	71,700	192.00	13,766,400	

鉄建建設	5,100	3,060.00	15,606,000
西松建設	19,200	2,742.00	52,646,400
三井住友建設	61,400	624.00	38,313,600
大豊建設	30,000	624.00	18,720,000
前田建設工業	58,700	1,271.00	74,607,700
ナカノフドー建設	8,300	641.00	5,320,300
奥村組	13,500	4,675.00	63,112,500
東鉄工業	9,500	3,265.00	31,017,500
イチケン	2,000	2,492.00	4,984,000
浅沼組	31,000	461.00	14,291,000
戸田建設	95,000	808.00	76,760,000
熊谷組	12,800	3,210.00	41,088,000
青木あすなろ建設	6,000	1,012.00	6,072,000
北野建設	21,000	450.00	9,450,000
三井ホーム	12,000	680.00	8,160,000
矢作建設工業	12,500	848.00	10,600,000
ピーエス三菱	11,500	869.00	9,993,500
日本ハウスホールディングス	18,800	638.00	11,994,400
大東建託	29,600	18,815.00	556,924,000
新日本建設	10,300	1,019.00	10,495,700
N I P P O	18,000	2,540.00	45,720,000
東亜道路工業	2,000	4,200.00	8,400,000
前田道路	26,000	2,304.00	59,904,000
日本道路	2,400	5,860.00	14,064,000
東亜建設工業	6,900	2,244.00	15,483,600
若築建設	5,800	1,679.00	9,738,200
東洋建設	26,400	543.00	14,335,200
五洋建設	97,500	787.00	76,732,500
世紀東急工業	13,900	702.00	9,757,800
福田組	2,700	6,500.00	17,550,000
住友林業	51,900	1,869.00	97,001,100
日成ビルド工業	12,500	1,221.00	15,262,500
ヤマダ・エスバイエルホーム	67,000	80.00	5,360,000
大和ハウス工業	241,200	3,993.00	963,111,600
ライト工業	15,900	1,158.00	18,412,200
積水ハウス	266,000	1,924.00	511,784,000
日特建設	9,500	652.00	6,194,000
北陸電気工事	5,400	1,131.00	6,107,400
ユアテック	13,200	868.00	11,457,600
中電工	10,000	2,960.00	29,600,000
関電工	31,600	1,198.00	37,856,800
きんでん	54,100	1,747.00	94,512,700

東京エネシス	9,800	1,204.00	11,799,200
トーエネック	2,700	3,080.00	8,316,000
住友電設	6,500	2,297.00	14,930,500
日本電設工業	12,200	2,183.00	26,632,600
協和エクシオ	29,400	2,838.00	83,437,200
新日本空調	7,100	1,625.00	11,537,500
N D S	1,800	4,630.00	8,334,000
九電工	16,100	4,970.00	80,017,000
三機工業	16,900	1,148.00	19,401,200
日揮	70,500	2,425.00	170,962,500
中外炉工業	3,400	2,350.00	7,990,000
ヤマト	9,100	856.00	7,789,600
太平電業	5,700	2,527.00	14,403,900
高砂熱学工業	22,100	1,968.00	43,492,800
朝日工業社	2,300	3,535.00	8,130,500
明星工業	15,800	767.00	12,118,600
大気社	10,600	3,785.00	40,121,000
ダイダン	5,600	2,345.00	13,132,000
日比谷総合設備	9,100	2,021.00	18,391,100
東芝プラントシステム	17,600	2,126.00	37,417,600
O S J Bホールディングス	40,000	301.00	12,040,000
東洋エンジニアリング	10,200	1,005.00	10,251,000
千代田化工建設	53,800	1,050.00	56,490,000
新興プランテック	16,100	1,011.00	16,277,100
日本製粉	23,300	1,652.00	38,491,600
日清製粉グループ本社	88,700	2,142.00	189,995,400
日東富士製粉	1,200	4,880.00	5,856,000
昭和産業	6,200	2,777.00	17,217,400
鳥越製粉	9,400	988.00	9,287,200
中部飼料	8,900	2,062.00	18,351,800
フィード・ワン	50,900	235.00	11,961,500
日本甜菜製糖	5,000	2,383.00	11,915,000
三井製糖	5,700	4,340.00	24,738,000
日新製糖	3,800	2,174.00	8,261,200
森永製菓	17,200	5,120.00	88,064,000
中村屋	2,600	4,810.00	12,506,000
江崎グリコ	20,500	5,340.00	109,470,000
名糖産業	5,300	1,573.00	8,336,900
不二家	5,600	2,524.00	14,134,400
山崎製パン	59,700	2,165.00	129,250,500
モロゾフ	1,600	6,790.00	10,864,000
亀田製菓	4,600	5,150.00	23,690,000

寿スピリッツ	7,000	6,180.00	43,260,000
カルビー	33,400	3,655.00	122,077,000
森永乳業	14,700	4,420.00	64,974,000
六甲バター	4,100	2,296.00	9,413,600
ヤクルト本社	43,800	7,710.00	337,698,000
明治ホールディングス	48,200	8,200.00	395,240,000
雪印メグミルク	17,700	2,809.00	49,719,300
プリマハム	51,000	664.00	33,864,000
日本ハム	63,000	2,402.00	151,326,000
丸大食品	38,000	495.00	18,810,000
S Foods	5,100	4,300.00	21,930,000
伊藤ハム米久ホールディングス	44,000	936.00	41,184,000
サッポロホールディングス	26,900	3,200.00	86,080,000
アサヒグループホールディングス	153,400	5,677.00	870,851,800
キリンホールディングス	352,100	2,820.00	992,922,000
宝ホールディングス	59,500	1,340.00	79,730,000
オエノンホールディングス	28,800	388.00	11,174,400
養命酒製造	3,200	2,328.00	7,449,600
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールデ	51,300	3,810.00	195,453,000
サントリー食品インターナショナル	55,700	5,140.00	286,298,000
ダイドーグループホールディングス	3,700	6,610.00	24,457,000
伊藤園	24,300	4,575.00	111,172,500
キーコーヒー	7,500	2,155.00	16,162,500
日清オイリオグループ	8,400	2,991.00	25,124,400
不二製油グループ本社	20,000	3,160.00	63,200,000
かどや製油	1,000	6,620.00	6,620,000
J - オイルミルズ	3,800	3,645.00	13,851,000
キッコーマン	56,900	4,380.00	249,222,000
味の素	168,500	1,990.50	335,399,250
キューピー	40,900	3,010.00	123,109,000
ハウス食品グループ本社	27,900	3,775.00	105,322,500
カゴメ	29,400	3,720.00	109,368,000
焼津水産化学工業	7,800	1,195.00	9,321,000
アリアケジャパン	6,500	8,030.00	52,195,000
ニチレイ	34,900	2,692.00	93,950,800
東洋水産	40,100	4,260.00	170,826,000
日清食品ホールディングス	31,900	7,530.00	240,207,000
永谷園ホールディングス	9,000	1,589.00	14,301,000
一正蒲鉾	4,600	1,215.00	5,589,000
フジッコ	8,000	2,341.00	18,728,000
ロック・フィールド	7,900	2,152.00	17,000,800
日本たばこ産業	453,100	3,208.00	1,453,544,800

ケンコーマヨネーズ	5,000	3,700.00	18,500,000
わらべや日洋ホールディングス	4,900	2,537.00	12,431,300
なとり	5,300	1,960.00	10,388,000
北の達人コーポレーション	22,500	754.00	16,965,000
ユーグレナ	28,600	963.00	27,541,800
ミヨシ油脂	4,900	1,391.00	6,815,900
理研ビタミン	3,000	4,025.00	12,075,000
片倉工業	10,000	1,365.00	13,650,000
グンゼ	5,700	5,950.00	33,915,000
東洋紡	28,800	2,074.00	59,731,200
ユニチカ	23,000	703.00	16,169,000
富士紡ホールディングス	4,600	4,275.00	19,665,000
倉敷紡績	77,000	342.00	26,334,000
シキボウ	5,700	1,390.00	7,923,000
日本毛織	21,500	1,078.00	23,177,000
帝国繊維	8,300	2,012.00	16,699,600
帝人	62,500	2,189.00	136,812,500
東レ	555,100	1,109.50	615,883,450
サカイオーベックス	2,700	2,660.00	7,182,000
住江織物	2,700	2,984.00	8,056,800
アツギ	7,900	1,217.00	9,614,300
ダイニック	4,600	1,040.00	4,784,000
セーレン	17,600	2,049.00	36,062,400
小松精練	13,000	923.00	11,999,000
ワコールホールディングス	21,300	3,190.00	67,947,000
ホギメディカル	4,800	8,230.00	39,504,000
レナウン	26,700	180.00	4,806,000
T S Iホールディングス	28,900	748.00	21,617,200
三陽商会	4,900	2,363.00	11,578,700
オンワードホールディングス	46,800	912.00	42,681,600
ルックホールディングス	17,000	309.00	5,253,000
ゴールドウイン	2,200	11,900.00	26,180,000
デサント	17,400	1,731.00	30,119,400
特種東海製紙	4,200	4,210.00	17,682,000
王子ホールディングス	319,000	710.00	226,490,000
日本製紙	33,900	2,115.00	71,698,500
三菱製紙	12,500	698.00	8,725,000
北越紀州製紙	41,900	693.00	29,036,700
中越パルプ工業	3,700	1,944.00	7,192,800
巴川製紙所	17,000	296.00	5,032,000
大王製紙	29,700	1,510.00	44,847,000
レンゴー	74,000	887.00	65,638,000

トーマック	5,000	2,080.00	10,400,000
ザ・パック	5,300	3,565.00	18,894,500
クラレ	128,200	1,888.00	242,041,600
旭化成	476,700	1,361.50	649,027,050
共和レザー	6,300	987.00	6,218,100
昭和電工	50,900	5,190.00	264,171,000
住友化学	561,000	675.00	378,675,000
住友精化	3,200	5,530.00	17,696,000
日産化学工業	44,400	4,020.00	178,488,000
ラサ工業	3,400	2,406.00	8,180,400
クレハ	6,500	7,600.00	49,400,000
テイカ	5,900	2,723.00	16,065,700
石原産業	13,900	1,464.00	20,349,600
日東エフシー	6,500	800.00	5,200,000
日本曹達	53,000	655.00	34,715,000
東ソー	110,300	2,282.00	251,704,600
トクヤマ	22,300	3,150.00	70,245,000
セントラル硝子	16,000	2,444.00	39,104,000
東亜合成	45,200	1,215.00	54,918,000
大阪ソーダ	6,900	2,764.00	19,071,600
関東電化工業	18,600	1,256.00	23,361,600
デンカ	28,000	3,860.00	108,080,000
信越化学工業	127,300	11,505.00	1,464,586,500
日本カーバイド工業	3,200	2,233.00	7,145,600
堺化学工業	5,400	3,155.00	17,037,000
エア・ウォーター	62,300	2,129.00	132,636,700
大陽日酸	58,300	1,579.00	92,055,700
日本化学工業	3,300	3,095.00	10,213,500
日本パーカライズン	39,200	1,903.00	74,597,600
高压ガス工業	12,300	870.00	10,701,000
チタン工業	1,200	2,792.00	3,350,400
四国化成工業	10,800	1,544.00	16,675,200
戸田工業	1,800	3,580.00	6,444,000
ステラ ケミファ	4,200	2,674.00	11,230,800
保土谷化学工業	2,600	5,030.00	13,078,000
日本触媒	12,100	7,500.00	90,750,000
大日精化工業	5,800	4,605.00	26,709,000
カネカ	103,000	1,089.00	112,167,000
三菱瓦斯化学	62,900	2,666.00	167,691,400
三井化学	69,200	3,315.00	229,398,000
J S R	76,700	2,371.00	181,855,700
東京応化工業	13,300	4,070.00	54,131,000

大阪有機化学工業	6,200	1,544.00	9,572,800
三菱ケミカルホールディングス	511,500	1,103.50	564,440,250
KHネオケム	11,900	3,075.00	36,592,500
ダイセル	103,300	1,198.00	123,753,400
住友ベークライト	62,000	904.00	56,048,000
積水化学工業	157,600	2,000.00	315,200,000
日本ゼオン	64,600	1,581.00	102,132,600
アイカ工業	21,500	4,105.00	88,257,500
宇部興産	38,500	3,470.00	133,595,000
積水樹脂	11,500	2,499.00	28,738,500
タキロンシーアイ	16,400	736.00	12,070,400
旭有機材	5,200	2,053.00	10,675,600
日立化成	37,500	2,433.00	91,237,500
ニチバン	4,100	3,250.00	13,325,000
リケンテクノス	18,300	530.00	9,699,000
大倉工業	20,000	578.00	11,560,000
積水化成成品工業	10,000	1,145.00	11,450,000
群栄化学工業	2,300	3,550.00	8,165,000
ミライアル	3,400	2,023.00	6,878,200
ダイキョーニシカワ	15,000	1,839.00	27,585,000
日本化薬	49,600	1,389.00	68,894,400
カーリットホールディングス	7,900	1,168.00	9,227,200
日本精化	8,000	1,238.00	9,904,000
扶桑化学工業	5,500	2,888.00	15,884,000
ADEKA	33,000	1,978.00	65,274,000
日油	29,600	2,954.00	87,438,400
新日本理化	16,200	247.00	4,001,400
ハリマ化成グループ	8,000	879.00	7,032,000
花王	179,400	7,997.00	1,434,661,800
第一工業製薬	15,000	805.00	12,075,000
三洋化成工業	4,700	5,230.00	24,581,000
大日本塗料	9,000	1,570.00	14,130,000
日本ペイントホールディングス	58,800	3,680.00	216,384,000
関西ペイント	80,200	2,653.00	212,770,600
中国塗料	22,100	1,028.00	22,718,800
日本特殊塗料	5,100	1,989.00	10,143,900
藤倉化成	12,300	670.00	8,241,000
太陽ホールディングス	5,800	4,955.00	28,739,000
DIC	30,100	3,850.00	115,885,000
サカタインクス	15,400	1,378.00	21,221,200
東洋インキSCホールディングス	72,000	657.00	47,304,000
T&K TOKA	5,700	1,404.00	8,002,800

富士フィルムホールディングス	151,400	4,404.00	666,765,600
資生堂	136,000	6,357.00	864,552,000
ライオン	101,600	2,155.00	218,948,000
高砂香料工業	4,700	3,185.00	14,969,500
マンダム	14,000	3,835.00	53,690,000
ミルボン	9,700	4,035.00	39,139,500
ファンケル	17,700	3,465.00	61,330,500
コーセー	12,300	20,690.00	254,487,000
シーズ・ホールディングス	9,900	5,980.00	59,202,000
ポーラ・オルビスホールディングス	31,100	4,635.00	144,148,500
ノエビアホールディングス	4,500	8,240.00	37,080,000
エステー	5,700	2,219.00	12,648,300
アグロ カネショウ	3,500	2,386.00	8,351,000
コニシ	11,800	1,882.00	22,207,600
長谷川香料	9,500	2,045.00	19,427,500
星光PMC	5,000	1,091.00	5,455,000
小林製薬	20,400	7,150.00	145,860,000
荒川化学工業	6,900	1,931.00	13,323,900
メック	5,400	1,751.00	9,455,400
日本高純度化学	3,100	2,560.00	7,936,000
タカラバイオ	19,100	1,943.00	37,111,300
JCU	4,500	4,915.00	22,117,500
新田ゼラチン	7,400	778.00	5,757,200
デクセリアルズ	19,000	1,372.00	26,068,000
アース製薬	5,400	5,190.00	28,026,000
北興化学工業	10,000	762.00	7,620,000
大成ラミック	3,100	3,150.00	9,765,000
クミアイ化学工業	33,400	654.00	21,843,600
日本農薬	21,200	599.00	12,698,800
アキレス	6,200	2,117.00	13,125,400
有沢製作所	12,800	946.00	12,108,800
日東電工	55,100	8,452.00	465,705,200
レック	4,600	3,105.00	14,283,000
きもと	18,500	415.00	7,677,500
藤森工業	6,100	3,690.00	22,509,000
前澤化成工業	7,000	1,163.00	8,141,000
JSP	4,100	3,315.00	13,591,500
エフピコ	5,900	5,980.00	35,282,000
天馬	5,900	2,179.00	12,856,100
信越ポリマー	14,600	1,248.00	18,220,800
東リ	21,200	385.00	8,162,000
ニフコ	13,400	7,650.00	102,510,000

日本バルカー工業	6,000	3,225.00	19,350,000	
ユニ・チャーム	154,800	3,090.00	478,332,000	
協和発酵キリン	90,800	2,350.00	213,380,000	
武田薬品工業	268,800	5,978.00	1,606,886,400	
アステラス製薬	749,700	1,524.00	1,142,542,800	
大日本住友製薬	54,000	1,710.00	92,340,000	
塩野義製薬	104,500	5,605.00	585,722,500	
田辺三菱製薬	88,400	2,289.00	202,347,600	
あすか製薬	8,600	2,147.00	18,464,200	
日本新薬	19,100	6,370.00	121,667,000	
中外製薬	75,800	5,580.00	422,964,000	
科研製薬	13,300	6,190.00	82,327,000	
エーザイ	87,400	5,613.00	490,576,200	
ロート製薬	40,300	2,988.00	120,416,400	
小野薬品工業	172,700	3,028.00	522,935,600	
久光製薬	21,600	7,320.00	158,112,000	
持田製薬	5,300	7,750.00	41,075,000	
参天製薬	138,200	1,759.00	243,093,800	
扶桑薬品工業	3,400	2,810.00	9,554,000	
日本ケミファ	1,400	4,445.00	6,223,000	
ツムラ	26,300	3,520.00	92,576,000	
日医工	19,000	1,697.00	32,243,000	
キッセイ薬品工業	13,800	2,915.00	40,227,000	
生化学工業	14,500	2,111.00	30,609,500	
栄研化学	6,000	4,975.00	29,850,000	
鳥居薬品	4,600	2,736.00	12,585,600	
JCRファーマ	5,200	5,340.00	27,768,000	
東和薬品	3,500	6,710.00	23,485,000	
富士製薬工業	2,800	4,475.00	12,530,000	
沢井製薬	14,900	5,090.00	75,841,000	
ゼリア新薬工業	15,600	2,106.00	32,853,600	
第一三共	208,800	3,875.00	809,100,000	
キョーリン製薬ホールディングス	20,500	2,085.00	42,742,500	
大幸薬品	4,400	2,127.00	9,358,800	
ダイト	5,100	3,470.00	17,697,000	
大塚ホールディングス	151,600	5,097.00	772,705,200	
大正製薬ホールディングス	16,200	9,850.00	159,570,000	
ペプチドリーム	33,000	4,560.00	150,480,000	
日本コークス工業	71,000	114.00	8,094,000	
昭和シェル石油	67,900	1,420.00	96,418,000	
ニチレキ	9,800	1,356.00	13,288,800	
ユシロ化学工業	4,900	1,880.00	9,212,000	

ビーピー・カストロール	3,500	1,776.00	6,216,000
富士石油	18,000	464.00	8,352,000
MORESCO	3,400	1,931.00	6,565,400
出光興産	61,100	4,020.00	245,622,000
JXTGホールディングス	1,163,500	668.20	777,450,700
コスモエネルギーホールディングス	20,600	4,030.00	83,018,000
横浜ゴム	42,300	2,642.00	111,756,600
東洋ゴム工業	43,600	1,970.00	85,892,000
ブリヂストン	257,800	4,860.00	1,252,908,000
住友ゴム工業	75,100	2,095.00	157,334,500
藤倉ゴム工業	7,700	816.00	6,283,200
オカモト	26,000	1,109.00	28,834,000
ニッタ	7,500	4,200.00	31,500,000
住友理工	14,600	1,070.00	15,622,000
三ツ星ベルト	18,000	1,201.00	21,618,000
バンドー化学	14,700	1,221.00	17,948,700
日東紡績	11,000	2,544.00	27,984,000
旭硝子	74,400	4,560.00	339,264,000
日本板硝子	35,900	893.00	32,058,700
日本山村硝子	47,000	182.00	8,554,000
日本電気硝子	31,700	3,455.00	109,523,500
オハラ	3,200	3,140.00	10,048,000
住友大阪セメント	144,000	481.00	69,264,000
太平洋セメント	46,000	4,020.00	184,920,000
日本ヒューム	10,500	802.00	8,421,000
日本コンクリート工業	20,500	460.00	9,430,000
三谷セキサン	4,200	2,439.00	10,243,800
アジアパイルホールディングス	12,100	683.00	8,264,300
東海カーボン	66,300	1,861.00	123,384,300
日本カーボン	4,000	5,810.00	23,240,000
東洋炭素	5,000	3,510.00	17,550,000
ノリタケカンパニーリミテド	4,500	5,430.00	24,435,000
TOTO	56,000	5,770.00	323,120,000
日本碍子	88,900	2,021.00	179,666,900
日本特殊陶業	62,600	2,714.00	169,896,400
MARUWA	2,600	8,650.00	22,490,000
品川リフラクトリーズ	2,500	3,110.00	7,775,000
黒崎播磨	1,900	5,150.00	9,785,000
フジインコーポレーテッド	6,900	2,618.00	18,064,200
ニチアス	40,000	1,308.00	52,320,000
ニチハ	10,900	4,355.00	47,469,500
新日鐵住金	322,700	2,590.50	835,954,350

神戸製鋼所	132,500	1,195.00	158,337,500
中山製鋼所	10,400	710.00	7,384,000
合同製鐵	4,600	2,010.00	9,246,000
ジェイ エフ イー ホールディングス	194,900	2,527.00	492,512,300
日新製鋼	20,200	1,545.00	31,209,000
東京製鐵	38,700	904.00	34,984,800
共英製鋼	8,000	2,008.00	16,064,000
大和工業	15,400	3,285.00	50,589,000
東京鐵鋼	4,100	1,772.00	7,265,200
大阪製鐵	4,800	2,125.00	10,200,000
淀川製鋼所	10,300	3,125.00	32,187,500
東洋鋼鈹	19,800	714.00	14,137,200
丸一鋼管	25,600	3,380.00	86,528,000
モリ工業	2,800	4,065.00	11,382,000
大同特殊鋼	12,800	5,890.00	75,392,000
日本冶金工業	61,700	330.00	20,361,000
山陽特殊製鋼	8,300	2,429.00	20,160,700
愛知製鋼	3,900	4,740.00	18,486,000
日立金属	77,500	1,425.00	110,437,500
日本金属	2,200	2,765.00	6,083,000
大平洋金属	4,700	3,220.00	15,134,000
新日本電工	44,700	393.00	17,567,100
栗本鐵工所	4,400	2,135.00	9,394,000
三菱製鋼	5,500	2,684.00	14,762,000
日本精線	1,300	4,940.00	6,422,000
シンニッタン	7,900	872.00	6,888,800
大紀アルミニウム工業所	13,800	816.00	11,260,800
日本輕金属ホールディングス	213,900	293.00	62,672,700
三井金属鋳業	19,600	5,220.00	102,312,000
東邦亜鉛	4,100	6,080.00	24,928,000
三菱マテリアル	47,800	3,385.00	161,803,000
住友金属鋳山	92,500	5,259.00	486,457,500
D O W A ホールディングス	18,500	4,035.00	74,647,500
古河機械金属	12,000	2,304.00	27,648,000
大阪チタニウムテクノロジーズ	8,200	2,915.00	23,903,000
東邦チタニウム	13,900	1,534.00	21,322,600
U A C J	11,000	2,605.00	28,655,000
古河電気工業	24,100	5,700.00	137,370,000
住友電気工業	270,100	1,680.50	453,903,050
フジクラ	87,600	776.00	67,977,600
タツタ電線	16,000	723.00	11,568,000
平河ヒューテック	5,000	1,165.00	5,825,000

リヨービ	9,000	2,851.00	25,659,000
アーレスティ	11,000	938.00	10,318,000
アサヒホールディングス	12,700	2,048.00	26,009,600
稲葉製作所	5,200	1,350.00	7,020,000
宮地エンジニアリンググループ	2,600	2,399.00	6,237,400
トーカロ	5,100	5,500.00	28,050,000
アルファC o	3,300	1,880.00	6,204,000
SUMCO	66,600	2,851.00	189,876,600
川田テクノロジーズ	1,600	6,110.00	9,776,000
RS Technologies	1,200	6,940.00	8,328,000
東洋製罐グループホールディングス	49,000	1,569.00	76,881,000
ホッカカンホールディングス	24,000	388.00	9,312,000
コロナ	5,200	1,338.00	6,957,600
横河ブリッジホールディングス	13,400	2,522.00	33,794,800
駒井ハルテック	2,700	2,530.00	6,831,000
三和ホールディングス	69,100	1,513.00	104,548,300
文化シャッター	21,500	990.00	21,285,000
三協立山	10,200	1,512.00	15,422,400
アルインコ	7,500	1,157.00	8,677,500
LIXILグループ	106,500	2,704.00	287,976,000
日本フィルコン	8,000	640.00	5,120,000
ノーリツ	16,100	1,953.00	31,443,300
長府製作所	7,800	2,466.00	19,234,800
リンナイ	12,900	9,850.00	127,065,000
日東精工	12,800	620.00	7,936,000
岡部	15,300	1,005.00	15,376,500
ジーテクト	7,900	2,097.00	16,566,300
東ブレ	13,100	3,140.00	41,134,000
高周波熱錬	14,600	1,111.00	16,220,600
東京製綱	6,100	1,997.00	12,181,700
モリテック スチール	4,600	960.00	4,416,000
パイオラックス	10,500	2,943.00	30,901,500
エイチワン	6,000	1,382.00	8,292,000
日本発條	72,000	1,066.00	76,752,000
三益半導体工業	6,800	1,963.00	13,348,400
日本製綱所	23,600	3,395.00	80,122,000
三浦工業	31,400	3,005.00	94,357,000
タクマ	24,400	1,323.00	32,281,200
ツガミ	19,000	1,528.00	29,032,000
オークマ	8,400	6,630.00	55,692,000
東芝機械	41,000	772.00	31,652,000
アマダホールディングス	110,900	1,435.00	159,141,500

アイダエンジニアリング	18,200	1,407.00	25,607,400
滝澤鉄工所	3,200	2,172.00	6,950,400
富士機械製造	21,400	2,185.00	46,759,000
牧野フライス製作所	35,000	1,076.00	37,660,000
オーエスジー	33,400	2,504.00	83,633,600
旭ダイヤモンド工業	21,700	1,270.00	27,559,000
D M G 森精機	40,000	2,207.00	88,280,000
ソディック	15,900	1,425.00	22,657,500
ディスコ	9,800	24,350.00	238,630,000
日東工器	4,800	2,910.00	13,968,000
パンチ工業	7,000	1,293.00	9,051,000
豊和工業	4,300	1,487.00	6,394,100
O K K	4,500	1,167.00	5,251,500
石川製作所	2,100	2,941.00	6,176,100
東洋機械金属	6,800	952.00	6,473,600
津田駒工業	27,000	260.00	7,020,000
島精機製作所	9,100	6,430.00	58,513,000
オプトラン	6,000	3,940.00	23,640,000
フリュー	6,700	1,057.00	7,081,900
ヤマシンフィルタ	10,300	1,250.00	12,875,000
日阪製作所	11,700	1,098.00	12,846,600
やまびこ	14,000	1,680.00	23,520,000
平田機工	2,000	9,980.00	19,960,000
ペガサスミシン製造	9,000	748.00	6,732,000
ナプテスコ	39,700	4,495.00	178,451,500
三井海洋開発	7,700	2,682.00	20,651,400
レオン自動機	6,600	2,313.00	15,265,800
S M C	22,900	47,280.00	1,082,712,000
新川	7,100	1,112.00	7,895,200
ホソカワミクロン	2,800	7,950.00	22,260,000
ユニオンツール	3,400	3,845.00	13,073,000
オイレス工業	9,200	2,372.00	21,822,400
日精エー・エス・ビー機械	2,400	7,390.00	17,736,000
サトーホールディングス	9,500	3,470.00	32,965,000
技研製作所	3,900	2,839.00	11,072,100
日精樹脂工業	6,700	1,689.00	11,316,300
オカダアイヨン	2,700	1,664.00	4,492,800
ワイエイシイホールディングス	3,900	900.00	3,510,000
小松製作所	352,400	4,085.00	1,439,554,000
住友重機械工業	41,600	4,445.00	184,912,000
日立建機	33,900	4,570.00	154,923,000
日工	3,000	2,584.00	7,752,000

巴工業	4,100	1,937.00	7,941,700
井関農機	7,500	2,297.00	17,227,500
TOWA	6,200	1,590.00	9,858,000
北川鉄工所	4,000	2,804.00	11,216,000
ローツェ	3,800	2,395.00	9,101,000
クボタ	390,600	2,038.50	796,238,100
三菱化工機	3,000	2,214.00	6,642,000
月島機械	14,500	1,393.00	20,198,500
帝国電機製作所	6,100	1,609.00	9,814,900
新東工業	17,100	1,222.00	20,896,200
澁谷工業	6,400	4,345.00	27,808,000
アイチ コーポレーション	13,500	721.00	9,733,500
小森コーポレーション	18,300	1,367.00	25,016,100
鶴見製作所	6,400	1,902.00	12,172,800
住友精密工業	18,000	410.00	7,380,000
酒井重工業	1,800	4,145.00	7,461,000
荏原製作所	30,000	4,035.00	121,050,000
西島製作所	9,000	1,005.00	9,045,000
北越工業	8,900	1,149.00	10,226,100
ダイキン工業	99,600	12,870.00	1,281,852,000
オルガノ	3,100	3,275.00	10,152,500
トーヨーカネツ	3,400	3,675.00	12,495,000
栗田工業	39,500	3,215.00	126,992,500
椿本チエイン	42,000	883.00	37,086,000
大同工業	4,000	1,580.00	6,320,000
アネスト岩田	12,300	1,089.00	13,394,700
ダイフク	37,100	6,740.00	250,054,000
加藤製作所	3,700	2,605.00	9,638,500
タダノ	35,400	1,729.00	61,206,600
フジテック	22,900	1,418.00	32,472,200
C K D	20,100	2,583.00	51,918,300
キトー	6,000	2,103.00	12,618,000
平和	22,300	2,147.00	47,878,100
理想科学工業	7,000	2,145.00	15,015,000
S A N K Y O	18,500	3,920.00	72,520,000
日本金銭機械	7,900	1,256.00	9,922,400
マースエンジニアリング	5,200	2,434.00	12,656,800
福島工業	4,500	4,830.00	21,735,000
ダイコク電機	4,100	1,703.00	6,982,300
竹内製作所	12,200	2,521.00	30,756,200
アマノ	22,700	2,936.00	66,647,200
J U K I	10,900	1,645.00	17,930,500

サンデンホールディングス	9,000	1,640.00	14,760,000
蛇の目マシン工業	8,900	765.00	6,808,500
マックス	11,000	1,491.00	16,401,000
グローリー	21,900	4,035.00	88,366,500
新晃工業	7,500	1,947.00	14,602,500
大和冷機工業	11,800	1,264.00	14,915,200
セガサミーホールディングス	72,500	1,591.00	115,347,500
日本ピストンリング	3,800	2,365.00	8,987,000
リケン	3,400	6,090.00	20,706,000
T P R	8,000	3,050.00	24,400,000
ツバキ・ナカシマ	7,500	3,050.00	22,875,000
ホシザキ	23,000	9,900.00	227,700,000
大豊工業	6,400	1,539.00	9,849,600
日本精工	149,100	1,618.00	241,243,800
N T N	168,400	478.00	80,495,200
ジェイテクト	77,000	1,714.00	131,978,000
不二越	68,000	689.00	46,852,000
日本トムソン	24,100	778.00	18,749,800
T H K	45,500	4,635.00	210,892,500
ユーシン精機	3,600	3,385.00	12,186,000
イーグル工業	8,800	1,967.00	17,309,600
日本ピラー工業	8,100	1,746.00	14,142,600
キッツ	32,400	885.00	28,674,000
マキタ	94,900	5,140.00	487,786,000
日立造船	57,100	563.00	32,147,300
三菱重工業	122,300	4,354.00	532,494,200
I H I	56,100	3,540.00	198,594,000
スター精密	11,800	2,093.00	24,697,400
日清紡ホールディングス	44,900	1,609.00	72,244,100
イビデン	45,300	1,726.00	78,187,800
コニカミノルタ	170,600	974.00	166,164,400
ブラザー工業	89,200	2,584.00	230,492,800
ミネベアミツミ	135,400	2,454.00	332,271,600
日立製作所	1,752,000	834.70	1,462,394,400
三菱電機	729,700	1,873.50	1,367,092,950
富士電機	220,000	825.00	181,500,000
東洋電機製造	4,000	1,716.00	6,864,000
安川電機	84,600	4,950.00	418,770,000
シンフォニアテクノロジー	49,000	363.00	17,787,000
明電舎	63,000	415.00	26,145,000
オリジン電気	3,300	1,852.00	6,111,600
山洋電気	3,600	8,200.00	29,520,000

デンヨー	7,400	1,813.00	13,416,200
東芝テック	52,000	654.00	34,008,000
芝浦メカトロニクス	13,000	472.00	6,136,000
マブチモーター	20,400	5,380.00	109,752,000
日本電産	87,800	16,415.00	1,441,237,000
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	3,000	2,726.00	8,178,000
東光高岳	4,500	1,618.00	7,281,000
ダブル・スコープ	10,800	1,541.00	16,642,800
ダイヘン	40,000	838.00	33,520,000
ヤーマン	9,500	1,731.00	16,444,500
JVCケンウッド	54,900	366.00	20,093,400
ミマキエンジニアリング	7,500	934.00	7,005,000
第一精工	3,900	2,908.00	11,341,200
日新電機	17,400	1,087.00	18,913,800
大崎電気工業	17,600	779.00	13,710,400
オムロン	77,500	6,290.00	487,475,000
日東工業	11,700	1,795.00	21,001,500
I D E C	9,600	2,896.00	27,801,600
ジーエス・ユアサ コーポレーション	133,000	593.00	78,869,000
サクサホールディングス	2,400	2,132.00	5,116,800
メルコホールディングス	3,700	3,495.00	12,931,500
日本電気	94,300	3,195.00	301,288,500
富士通	750,000	657.80	493,350,000
沖電気工業	30,500	1,455.00	44,377,500
電気興業	4,700	3,140.00	14,758,000
サンケン電気	43,000	797.00	34,271,000
アイホン	5,200	1,711.00	8,897,200
ルネサスエレクトロニクス	37,300	1,149.00	42,857,700
セイコーエプソン	108,300	2,088.00	226,130,400
ワコム	57,800	572.00	33,061,600
アルバック	16,400	6,390.00	104,796,000
E I Z O	6,700	5,120.00	34,304,000
ジャパンディスプレイ	111,200	220.00	24,464,000
日本信号	20,400	1,044.00	21,297,600
京三製作所	19,000	774.00	14,706,000
能美防災	9,600	2,273.00	21,820,800
ホーチキ	5,600	1,980.00	11,088,000
エレコム	6,500	2,343.00	15,229,500
パナソニック	833,300	1,649.50	1,374,528,350
シャープ	48,000	3,490.00	167,520,000
アンリツ	53,700	1,321.00	70,937,700
富士通ゼネラル	22,700	2,061.00	46,784,700

ソニー	487,400	5,305.00	2,585,657,000
T D K	38,100	9,300.00	354,330,000
タムラ製作所	28,500	775.00	22,087,500
アルプス電気	62,300	2,823.00	175,872,900
池上通信機	34,000	164.00	5,576,000
パイオニア	122,700	198.00	24,294,600
日本電波工業	9,500	705.00	6,697,500
日本トリム	1,900	5,770.00	10,963,000
ローランド ディー・ジー・	4,200	2,668.00	11,205,600
フォスター電機	8,700	2,949.00	25,656,300
クラリオン	39,000	332.00	12,948,000
S M K	21,000	446.00	9,366,000
ヨコオ	5,500	2,119.00	11,654,500
ホシデン	18,600	1,500.00	27,900,000
ヒロセ電機	11,800	15,410.00	181,838,000
日本航空電子工業	19,000	1,624.00	30,856,000
T O A	8,300	1,447.00	12,010,100
マクセルホールディングス	14,500	2,139.00	31,015,500
古野電気	10,500	747.00	7,843,500
ユニデンホールディングス	25,000	298.00	7,450,000
アルパイン	18,000	2,247.00	40,446,000
スミダコーポレーション	8,000	1,592.00	12,736,000
アイコム	4,700	2,768.00	13,009,600
リオン	3,700	2,815.00	10,415,500
本多通信工業	6,400	1,229.00	7,865,600
船井電機	9,200	754.00	6,936,800
横河電機	73,100	2,231.00	163,086,100
新電元工業	2,600	8,330.00	21,658,000
アズビル	22,000	4,765.00	104,830,000
日本光電工業	30,800	2,871.00	88,426,800
チノー	3,500	1,676.00	5,866,000
共和電業	14,300	448.00	6,406,400
堀場製作所	14,600	7,850.00	114,610,000
アドバンテスト	41,100	2,224.00	91,406,400
エスベック	6,600	2,617.00	17,272,200
キーエンス	35,800	63,980.00	2,290,484,000
日置電機	4,300	3,575.00	15,372,500
シスメックス	56,700	8,850.00	501,795,000
日本マイクロニクス	13,000	1,095.00	14,235,000
メガチップス	6,000	3,620.00	21,720,000
O B A R A G R O U P	4,200	6,750.00	28,350,000
澤藤電機	1,200	2,119.00	2,542,800

コーセル	10,700	1,623.00	17,366,100
イリソ電子工業	6,100	6,970.00	42,517,000
新日本無線	5,400	873.00	4,714,200
オブテックスグループ	6,000	5,890.00	35,340,000
千代田インテグレ	3,900	2,437.00	9,504,300
アイ・オー・データ機器	4,300	1,090.00	4,687,000
レーザーテック	16,100	4,275.00	68,827,500
スタンレー電気	55,800	4,235.00	236,313,000
岩崎電気	4,000	1,640.00	6,560,000
ウシオ電機	44,800	1,467.00	65,721,600
ハリオス テクノ ホールディング	7,200	996.00	7,171,200
日本セラミック	7,700	2,922.00	22,499,400
遠藤照明	5,300	1,122.00	5,946,600
古河電池	6,100	1,054.00	6,429,400
双信電機	4,300	691.00	2,971,300
山一電機	5,600	1,923.00	10,768,800
図研	5,500	1,798.00	9,889,000
日本電子	28,000	788.00	22,064,000
カシオ計算機	59,100	1,519.00	89,772,900
ファナック	69,400	28,160.00	1,954,304,000
日本シイエムケイ	13,800	952.00	13,137,600
エンプラス	3,500	3,660.00	12,810,000
大真空	3,700	1,419.00	5,250,300
ローム	32,700	11,200.00	366,240,000
浜松ホトニクス	53,200	4,235.00	225,302,000
三井ハイテック	9,900	2,085.00	20,641,500
新光電気工業	27,700	898.00	24,874,600
京セラ	119,700	6,225.00	745,132,500
太陽誘電	33,300	1,810.00	60,273,000
村田製作所	76,500	15,135.00	1,157,827,500
ユーシン	13,400	764.00	10,237,600
双葉電子工業	11,900	2,212.00	26,322,800
北陸電気工業	4,100	1,689.00	6,924,900
ニチコン	23,000	1,339.00	30,797,000
日本ケミコン	6,100	2,841.00	17,330,100
K O A	10,400	2,355.00	24,492,000
市光工業	11,300	1,126.00	12,723,800
小糸製作所	43,600	7,560.00	329,616,000
ミツバ	13,500	1,337.00	18,049,500
S C R E E Nホールディングス	13,900	9,610.00	133,579,000
キャノン電子	6,700	2,618.00	17,540,600
キャノン	392,800	3,996.00	1,569,628,800

リコー	219,300	1,189.00	260,747,700	
東京エレクトロン	48,700	20,655.00	1,005,898,500	
トヨタ紡織	21,200	2,254.00	47,784,800	
芦森工業	1,900	2,361.00	4,485,900	
ユニプレス	14,400	2,626.00	37,814,400	
豊田自動織機	58,700	6,870.00	403,269,000	
モリタホールディングス	11,800	2,016.00	23,788,800	
三櫻工業	11,700	760.00	8,892,000	
デンソー	161,700	6,348.00	1,026,471,600	
東海理化電機製作所	19,400	2,255.00	43,747,000	
三井造船	26,900	2,006.00	53,961,400	
川崎重工業	56,700	4,080.00	231,336,000	
名村造船所	22,900	629.00	14,404,100	
日本車輛製造	31,000	301.00	9,331,000	
三菱ロジスネクスト	9,700	917.00	8,894,900	
日産自動車	860,100	1,127.00	969,332,700	
いすゞ自動車	211,800	1,778.50	376,686,300	
トヨタ自動車	887,300	7,379.00	6,547,386,700	代用有価証券 500,000株
日野自動車	103,800	1,470.00	152,586,000	
三菱自動車工業	270,100	832.00	224,723,200	
エフテック	5,500	1,318.00	7,249,000	
武蔵精密工業	7,900	3,770.00	29,783,000	
日産車体	28,700	1,030.00	29,561,000	
新明和工業	31,800	947.00	30,114,600	
極東開発工業	13,900	1,668.00	23,185,200	
日信工業	14,600	1,879.00	27,433,400	
トピー工業	6,200	3,185.00	19,747,000	
ティラド	3,200	3,840.00	12,288,000	
曙ブレーキ工業	23,700	308.00	7,299,600	
タチエス	12,600	1,870.00	23,562,000	
N O K	39,300	2,292.00	90,075,600	
フタバ産業	22,700	936.00	21,247,200	
K Y B	7,600	5,570.00	42,332,000	
大同メタル工業	10,900	1,301.00	14,180,900	
プレス工業	39,000	658.00	25,662,000	
ミクニ	11,700	694.00	8,119,800	
太平洋工業	15,300	1,470.00	22,491,000	
ケーヒン	16,600	2,107.00	34,976,200	
河西工業	9,000	1,469.00	13,221,000	
アイシン精機	59,800	6,200.00	370,760,000	
マツダ	229,600	1,505.00	345,548,000	
今仙電機製作所	8,400	1,208.00	10,147,200	

本田技研工業	656,700	3,851.00	2,528,951,700
スズキ	144,800	6,030.00	873,144,000
S U B A R U	226,500	3,768.00	853,452,000
安永	3,700	2,549.00	9,431,300
ヤマハ発動機	102,700	3,535.00	363,044,500
ショーワ	19,200	1,466.00	28,147,200
T B K	14,300	537.00	7,679,100
エクセディ	8,500	3,435.00	29,197,500
豊田合成	26,400	2,567.00	67,768,800
愛三工業	13,100	1,260.00	16,506,000
ヨロズ	7,700	1,871.00	14,406,700
エフ・シー・シー	11,900	3,000.00	35,700,000
シマノ	29,400	15,750.00	463,050,000
テイ・エス テック	17,100	4,210.00	71,991,000
ジャムコ	3,900	2,373.00	9,254,700
テルモ	111,800	5,580.00	623,844,000
日機装	25,700	1,217.00	31,276,900
島津製作所	87,100	2,668.00	232,382,800
J M S	11,500	630.00	7,245,000
長野計器	6,900	1,231.00	8,493,900
ブイ・テクノロジー	1,700	23,500.00	39,950,000
東京計器	5,700	1,191.00	6,788,700
東京精密	13,200	4,470.00	59,004,000
マニー	9,100	3,930.00	35,763,000
ニコン	127,200	2,154.00	273,988,800
トプコン	39,500	2,418.00	95,511,000
オリンパス	108,700	4,275.00	464,692,500
理研計器	7,200	2,223.00	16,005,600
タムロン	6,400	2,481.00	15,878,400
H O Y A	148,800	5,588.00	831,494,400
ノーリツ鋼機	7,700	2,169.00	16,701,300
シチズン時計	87,900	845.00	74,275,500
リズム時計工業	4,000	2,229.00	8,916,000
大研医器	10,200	746.00	7,609,200
メニコン	10,100	2,561.00	25,866,100
松風	6,200	1,429.00	8,859,800
セイコーホールディングス	11,200	2,894.00	32,412,800
ニプロ	51,000	1,575.00	80,325,000
スノーピーク	3,000	1,173.00	3,519,000
パラマウントベッドホールディングス	7,700	5,690.00	43,813,000
トランザクション	4,000	1,063.00	4,252,000
ニホンフラッシュ	3,800	2,553.00	9,701,400

前田工織	7,700	1,975.00	15,207,500
永大産業	14,000	576.00	8,064,000
アートネイチャー	11,000	746.00	8,206,000
バンダイナムコホールディングス	75,000	3,610.00	270,750,000
S H O E I	3,300	4,570.00	15,081,000
フランスベッドホールディングス	10,700	1,035.00	11,074,500
パイロットコーポレーション	12,800	5,590.00	71,552,000
萩原工業	5,000	1,798.00	8,990,000
トッパン・フォームズ	14,800	1,211.00	17,922,800
フジシールインターナショナル	16,200	3,585.00	58,077,000
タカラトミー	30,600	1,116.00	34,149,600
アーク	39,600	123.00	4,870,800
プロネクサス	7,900	1,313.00	10,372,700
大建工業	5,800	2,654.00	15,393,200
凸版印刷	204,000	940.00	191,760,000
大日本印刷	94,700	2,280.00	215,916,000
図書印刷	5,700	943.00	5,375,100
共同印刷	2,500	3,275.00	8,187,500
N I S S H A	15,100	3,015.00	45,526,500
宝印刷	5,300	1,799.00	9,534,700
アシックス	72,000	1,682.00	121,104,000
ツツミ	2,900	2,120.00	6,148,000
小松ウオール工業	3,300	2,511.00	8,286,300
ヤマハ	49,000	4,695.00	230,055,000
河合楽器製作所	3,300	3,895.00	12,853,500
クリナップ	8,600	839.00	7,215,400
ピジョン	44,000	4,510.00	198,440,000
キングジム	8,400	999.00	8,391,600
リンテック	17,300	3,085.00	53,370,500
イトーキ	16,900	720.00	12,168,000
任天堂	45,000	46,790.00	2,105,550,000
三菱鉛筆	11,800	2,509.00	29,606,200
タカラスタンダード	14,500	1,823.00	26,433,500
コクヨ	35,000	1,954.00	68,390,000
ナカバヤシ	9,900	627.00	6,207,300
グローブライド	4,100	2,301.00	9,434,100
岡村製作所	25,200	1,453.00	36,615,600
美津濃	7,100	3,200.00	22,720,000
東京電力ホールディングス	580,100	414.00	240,161,400
中部電力	223,700	1,408.00	314,969,600
関西電力	298,000	1,309.00	390,082,000
中国電力	100,200	1,249.00	125,149,800

北陸電力	72,300	841.00	60,804,300
東北電力	169,400	1,392.00	235,804,800
四国電力	66,000	1,231.00	81,246,000
九州電力	160,300	1,223.00	196,046,900
北海道電力	73,600	660.00	48,576,000
沖縄電力	11,700	2,857.00	33,426,900
電源開発	58,100	2,809.00	163,202,900
エフオン	4,400	1,139.00	5,011,600
イーレックス	12,400	799.00	9,907,600
東京瓦斯	156,200	2,692.50	420,568,500
大阪瓦斯	142,300	2,178.00	309,929,400
東邦瓦斯	36,300	3,305.00	119,971,500
広島ガス	22,200	393.00	8,724,600
西部瓦斯	9,000	2,787.00	25,083,000
静岡ガス	21,100	920.00	19,412,000
メタウォーター	4,400	3,070.00	13,508,000
SBSホールディングス	8,300	1,248.00	10,358,400
東武鉄道	77,600	3,375.00	261,900,000
相鉄ホールディングス	23,600	2,880.00	67,968,000
東京急行電鉄	197,400	1,750.00	345,450,000
京浜急行電鉄	100,100	1,972.00	197,397,200
小田急電鉄	107,900	2,256.00	243,422,400
京王電鉄	40,600	4,805.00	195,083,000
京成電鉄	50,700	3,545.00	179,731,500
富士急行	10,100	2,799.00	28,269,900
東日本旅客鉄道	131,000	10,315.00	1,351,265,000
西日本旅客鉄道	65,900	7,619.00	502,092,100
東海旅客鉄道	65,400	19,995.00	1,307,673,000
西武ホールディングス	93,100	1,928.00	179,496,800
鴻池運輸	10,200	1,853.00	18,900,600
西日本鉄道	20,600	2,913.00	60,007,800
ハマキョウレックス	5,400	3,315.00	17,901,000
サカイ引越センター	3,900	5,160.00	20,124,000
近鉄グループホールディングス	68,800	4,180.00	287,584,000
阪急阪神ホールディングス	91,900	4,015.00	368,978,500
南海電気鉄道	33,100	2,764.00	91,488,400
京阪ホールディングス	30,900	3,370.00	104,133,000
神戸電鉄	2,600	3,920.00	10,192,000
名古屋鉄道	53,200	2,768.00	147,257,600
山陽電気鉄道	6,200	2,792.00	17,310,400
日本通運	27,000	7,180.00	193,860,000
ヤマトホールディングス	121,200	2,750.00	333,300,000

山九	17,900	5,310.00	95,049,000
丸全昭和運輸	28,000	509.00	14,252,000
センコーグループホールディングス	41,500	717.00	29,755,500
トナミホールディングス	1,800	5,140.00	9,252,000
ニッコンホールディングス	26,500	2,712.00	71,868,000
福山通運	9,900	4,550.00	45,045,000
セイノーホールディングス	51,600	1,805.00	93,138,000
神奈川中央交通	2,400	3,705.00	8,892,000
日立物流	14,700	2,645.00	38,881,500
丸和運輸機関	3,800	3,685.00	14,003,000
C & F ロジホールディングス	8,600	1,470.00	12,642,000
九州旅客鉄道	58,300	3,320.00	193,556,000
S Gホールディングス	50,000	2,343.00	117,150,000
日本郵船	57,600	2,359.00	135,878,400
商船三井	43,600	3,375.00	147,150,000
川崎汽船	32,100	2,669.00	85,674,900
N S ユナイテッド海運	3,600	2,276.00	8,193,600
飯野海運	36,300	564.00	20,473,200
乾汽船	9,000	832.00	7,488,000
日本航空	128,600	4,038.00	519,286,800
A N Aホールディングス	135,800	4,346.00	590,186,800
トランコム	2,000	7,170.00	14,340,000
日新	6,000	2,790.00	16,740,000
三菱倉庫	23,900	2,551.00	60,968,900
三井倉庫ホールディングス	44,000	350.00	15,400,000
住友倉庫	50,000	735.00	36,750,000
澁澤倉庫	5,200	1,864.00	9,692,800
東陽倉庫	22,300	353.00	7,871,900
日本トランスシティ	22,000	440.00	9,680,000
川西倉庫	2,200	2,026.00	4,457,200
安田倉庫	8,700	943.00	8,204,100
東洋埠頭	3,600	1,764.00	6,350,400
上組	43,400	2,373.00	102,988,200
キューソー流通システム	2,400	2,561.00	6,146,400
近鉄エクスプレス	12,900	2,097.00	27,051,300
エーアイティー	6,300	1,144.00	7,207,200
N E C ネットズエスアイ	7,700	2,697.00	20,766,900
システナ	5,900	4,430.00	26,137,000
デジタルアーツ	3,700	3,590.00	13,283,000
新日鉄住金ソリューションズ	11,100	2,931.00	32,534,100
キューブシステム	6,900	792.00	5,464,800
コア	3,800	1,343.00	5,103,400

ソフトクリエイティブホールディングス	5,000	1,513.00	7,565,000
T I S	24,000	3,870.00	92,880,000
電算システム	3,700	1,928.00	7,133,600
グリー	44,600	666.00	29,703,600
コーエーテクモホールディングス	12,200	2,251.00	27,462,200
三菱総合研究所	3,300	3,445.00	11,368,500
ファインデックス	8,000	705.00	5,640,000
ヒト・コミュニケーションズ	2,100	1,911.00	4,013,100
K L a b	14,200	1,597.00	22,677,400
ポルトトゥウィン・ピットクルーホールディングス	5,900	2,257.00	13,316,300
ネクソン	80,500	3,850.00	309,925,000
アイスタイル	17,800	1,460.00	25,988,000
エムアップ	3,000	1,121.00	3,363,000
エイチーム	5,300	2,581.00	13,679,300
テクノスジャパン	7,700	918.00	7,068,600
コロプラ	23,600	982.00	23,175,200
ブロードリーフ	18,800	1,217.00	22,879,600
ハーツユナイテッドグループ	4,600	1,563.00	7,189,800
メディアドゥホールディングス	2,800	2,014.00	5,639,200
フィックスターズ	1,400	7,230.00	10,122,000
VOYAGE GROUP	4,400	1,245.00	5,478,000
オブティム	1,700	2,393.00	4,068,100
セレス	2,600	1,830.00	4,758,000
ティーガイア	7,000	2,926.00	20,482,000
日本アジアグループ	11,000	502.00	5,522,000
豆蔵ホールディングス	6,600	1,230.00	8,118,000
テクマトリックス	4,800	1,835.00	8,808,000
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	197,200	347.00	68,428,400
GMOペイメントゲートウェイ	5,100	9,270.00	47,277,000
インターネットイニシアティブ	11,900	2,338.00	27,822,200
さくらインターネット	9,900	756.00	7,484,400
GMOクラウド	2,100	2,327.00	4,886,700
SRAホールディングス	4,100	3,390.00	13,899,000
フリービット	6,400	918.00	5,875,200
コムチュア	4,400	3,445.00	15,158,000
メディカル・データ・ビジョン	3,300	2,586.00	8,533,800
g u m i	9,200	1,095.00	10,074,000
P C Iホールディングス	1,600	3,185.00	5,096,000
オープンドア	3,300	2,200.00	7,260,000
アカツキ	1,500	5,820.00	8,730,000
L I N E	20,600	4,440.00	91,464,000
オークネット	3,700	1,351.00	4,998,700

AOI TYO Holdings	6,600	1,237.00	8,164,200
マクロミル	9,700	3,010.00	29,197,000
ソルクシーズ	3,100	1,140.00	3,534,000
フェイス	5,000	1,178.00	5,890,000
野村総合研究所	47,800	4,695.00	224,421,000
サイバネットシステム	7,900	750.00	5,925,000
インタージホールディングス	9,500	1,191.00	11,314,500
ソースネクスト	10,800	654.00	7,063,200
フォーカスシステムズ	5,600	919.00	5,146,400
クレスコ	1,800	3,780.00	6,804,000
フジ・メディア・ホールディングス	75,000	1,873.00	140,475,000
オービック	22,600	8,700.00	196,620,000
ジャストシステム	12,000	2,420.00	29,040,000
TDCソフト	4,800	1,171.00	5,620,800
ヤフー	515,500	515.00	265,482,500
トレンドマイクロ	35,000	6,120.00	214,200,000
日本オラクル	11,600	8,450.00	98,020,000
アルファシステムズ	3,300	2,355.00	7,771,500
フューチャー	11,100	1,257.00	13,952,700
CAC Holdings	7,900	1,128.00	8,911,200
ソフトバンク・テクノロジー	3,600	1,933.00	6,958,800
トーセ	2,300	1,904.00	4,379,200
オービックビジネスコンサルタント	3,700	6,290.00	23,273,000
伊藤忠テクノソリューションズ	16,300	4,170.00	67,971,000
アイティフォー	11,300	748.00	8,452,400
大塚商会	21,500	9,740.00	209,410,000
サイボウズ	13,400	537.00	7,195,800
電通国際情報サービス	4,900	2,819.00	13,813,100
デジタルガレージ	13,000	3,225.00	41,925,000
EMシステムズ	3,500	2,510.00	8,785,000
ウェザーニューズ	3,300	3,265.00	10,774,500
WOWOW	3,700	3,380.00	12,506,000
スカラ	7,000	877.00	6,139,000
イマジカ・ロボットホールディングス	6,800	1,153.00	7,840,400
ネットワンシステムズ	29,400	1,579.00	46,422,600
アルゴグラフィックス	3,800	3,455.00	13,129,000
マーベラス	13,200	939.00	12,394,800
エイベックス	13,600	1,639.00	22,290,400
日本ユニシス	19,800	2,197.00	43,500,600
兼松エレクトロニクス	4,500	3,005.00	13,522,500
東京放送ホールディングス	43,100	2,343.00	100,983,300
日本テレビホールディングス	65,600	2,064.00	135,398,400

朝日放送	9,700	883.00	8,565,100
テレビ朝日ホールディングス	20,000	2,236.00	44,720,000
スカパーJ S A Tホールディングス	54,000	487.00	26,298,000
テレビ東京ホールディングス	6,200	2,664.00	16,516,800
ビジョン	2,200	2,823.00	6,210,600
ワイヤレスゲート	4,400	1,211.00	5,328,400
コネクシオ	5,400	2,324.00	12,549,600
日本電信電話	513,900	4,807.00	2,470,317,300
K D D I	644,800	2,645.50	1,705,818,400
光通信	8,700	15,570.00	135,459,000
N T T ドコモ	529,600	2,728.00	1,444,748,800
エムティーアイ	11,400	627.00	7,147,800
G M O インターネット	26,200	1,901.00	49,806,200
カドカワ	20,700	1,206.00	24,964,200
学研ホールディングス	2,700	4,980.00	13,446,000
ゼンリン	8,800	3,370.00	29,656,000
アイネット	5,600	1,582.00	8,859,200
松竹	4,800	15,330.00	73,584,000
東宝	47,100	3,510.00	165,321,000
東映	2,700	10,900.00	29,430,000
エヌ・ティ・ティ・データ	221,100	1,116.00	246,747,600
D T S	7,500	3,755.00	28,162,500
スクウェア・エニックス・ホールディングス	33,400	4,465.00	149,131,000
シーイーシー	4,600	3,145.00	14,467,000
カブコン	15,400	4,345.00	66,913,000
ジャステック	5,800	1,240.00	7,192,000
S C S K	16,600	4,340.00	72,044,000
日本システムウエア	2,800	2,599.00	7,277,200
アイネス	11,300	1,082.00	12,226,600
T K C	6,700	4,270.00	28,609,000
富士ソフト	9,800	3,900.00	38,220,000
N S D	11,500	2,155.00	24,782,500
コナミホールディングス	29,300	5,670.00	166,131,000
福井コンピュータホールディングス	2,500	2,398.00	5,995,000
J B C C ホールディングス	8,000	1,072.00	8,576,000
ミロク情報サービス	6,500	3,175.00	20,637,500
ソフトバンクグループ	324,200	8,999.00	2,917,475,800
伊藤忠食品	1,900	6,030.00	11,457,000
エレマテック	3,800	2,336.00	8,876,800
J A L U X	2,600	3,105.00	8,073,000
あらた	3,600	4,895.00	17,622,000
東京エレクトロン デバイス	3,800	2,134.00	8,109,200

フィールズ	6,700	1,178.00	7,892,600
双日	425,900	347.00	147,787,300
アルフレッサ ホールディングス	79,500	2,391.00	190,084,500
横浜冷凍	18,400	1,107.00	20,368,800
アルコニックス	8,000	2,486.00	19,888,000
神戸物産	4,700	4,280.00	20,116,000
ペッパーフードサービス	3,900	4,720.00	18,408,000
あい ホールディングス	10,700	2,972.00	31,800,400
ダイワボウホールディングス	6,200	4,270.00	26,474,000
マクニカ・富士エレホールディングス	13,200	2,981.00	39,349,200
ラクト・ジャパン	1,200	3,855.00	4,626,000
バイタルケーエスケー・ホールディングス	15,000	1,022.00	15,330,000
U K Cホールディングス	5,400	2,278.00	12,301,200
ジューテックホールディングス	2,400	1,248.00	2,995,200
T O K A Iホールディングス	38,700	1,149.00	44,466,300
三洋貿易	4,400	2,341.00	10,300,400
ウイン・パートナーズ	5,800	1,578.00	9,152,400
シップヘルスケアホールディングス	15,000	3,640.00	54,600,000
コメダホールディングス	14,300	2,183.00	31,216,900
小野建	7,200	1,950.00	14,040,000
佐島電機	7,600	1,107.00	8,413,200
伯東	5,300	1,615.00	8,559,500
コンドーテック	8,000	984.00	7,872,000
ナガイレーベン	9,900	2,773.00	27,452,700
三菱食品	7,400	3,160.00	23,384,000
松田産業	5,800	1,935.00	11,223,000
第一興商	11,000	5,520.00	60,720,000
メディバルホールディングス	71,800	2,163.00	155,303,400
萩原電気	2,900	3,400.00	9,860,000
アズワン	5,700	6,930.00	39,501,000
尾家産業	4,400	1,287.00	5,662,800
シモジマ	6,000	1,127.00	6,762,000
ドウシシャ	7,900	2,389.00	18,873,100
高速	6,400	1,205.00	7,712,000
丸文	8,400	1,044.00	8,769,600
ハピネット	5,400	1,704.00	9,201,600
日本ライフライン	20,600	3,545.00	73,027,000
エクセル	3,300	2,712.00	8,949,600
マルカキカイ	3,700	2,100.00	7,770,000
I D O M	22,700	720.00	16,344,000
日本エム・ディ・エム	6,500	956.00	6,214,000
進和	5,100	2,313.00	11,796,300

ダイトロン	4,100	2,357.00	9,663,700
シークス	4,600	4,690.00	21,574,000
オーハシテクニカ	5,600	1,797.00	10,063,200
伊藤忠商事	527,500	2,071.00	1,092,452,500
丸紅	591,000	812.50	480,187,500
長瀬産業	43,700	1,863.00	81,413,100
蝶理	5,400	1,896.00	10,238,400
豊田通商	79,800	4,100.00	327,180,000
三共生興	18,800	509.00	9,569,200
兼松	30,500	1,430.00	43,615,000
三井物産	611,100	1,949.50	1,191,339,450
日本紙パルプ商事	4,000	4,285.00	17,140,000
日立ハイテクノロジーズ	25,100	5,160.00	129,516,000
カメイ	9,700	1,629.00	15,801,300
スターゼン	3,000	5,150.00	15,450,000
山善	27,500	1,205.00	33,137,500
住友商事	453,900	1,847.00	838,353,300
内田洋行	3,800	3,185.00	12,103,000
三菱商事	504,500	3,091.00	1,559,409,500
第一実業	3,900	3,275.00	12,772,500
キャノンマーケティングジャパン	20,700	2,946.00	60,982,200
西華産業	5,000	2,584.00	12,920,000
佐藤商事	8,500	1,144.00	9,724,000
菱洋エレクトロ	7,300	1,837.00	13,410,100
東京産業	12,500	580.00	7,250,000
ユアサ商事	6,700	3,730.00	24,991,000
神鋼商事	2,000	3,695.00	7,390,000
阪和興業	13,600	5,030.00	68,408,000
正栄食品工業	4,200	4,040.00	16,968,000
カナデン	8,200	1,372.00	11,250,400
菱電商事	6,700	1,837.00	12,307,900
フルサト工業	5,700	1,778.00	10,134,600
岩谷産業	16,500	4,060.00	66,990,000
すてきナイスグループ	4,900	1,423.00	6,972,700
イワキ	14,000	413.00	5,782,000
三愛石油	19,100	1,497.00	28,592,700
稲畑産業	17,000	1,551.00	26,367,000
ワキタ	16,100	1,255.00	20,205,500
東邦ホールディングス	21,500	2,528.00	54,352,000
サンゲツ	25,200	2,256.00	56,851,200
ミツウロコグループホールディングス	12,500	763.00	9,537,500
シナネンホールディングス	4,200	2,686.00	11,281,200

伊藤忠エネクス	15,600	1,020.00	15,912,000
サンリオ	21,000	1,946.00	40,866,000
サンワテクノス	5,000	2,229.00	11,145,000
リョーサン	9,400	3,925.00	36,895,000
新光商事	8,400	1,903.00	15,985,200
トーホー	4,100	2,445.00	10,024,500
三信電気	7,300	1,889.00	13,789,700
東陽テクニカ	11,000	979.00	10,769,000
モスフードサービス	9,600	3,235.00	31,056,000
加賀電子	6,600	2,752.00	18,163,200
ソーダニッカ	12,900	694.00	8,952,600
立花エレテック	5,500	2,198.00	12,089,000
PALTA C	9,900	5,310.00	52,569,000
三谷産業	13,600	438.00	5,956,800
太平洋興発	6,600	1,058.00	6,982,800
西本Wismettacホールディングス	1,600	3,995.00	6,392,000
ヤマタネ	5,200	1,967.00	10,228,400
日鉄住金物産	5,500	6,050.00	33,275,000
泉州電業	2,800	2,930.00	8,204,000
トラスコ中山	14,800	2,768.00	40,966,400
オートバックスセブン	29,100	2,085.00	60,673,500
モリト	7,900	944.00	7,457,600
加藤産業	11,000	3,820.00	42,020,000
イノテック	8,000	1,272.00	10,176,000
イエローハット	7,000	3,310.00	23,170,000
J Kホールディングス	10,000	893.00	8,930,000
日伝	6,600	2,141.00	14,130,600
杉本商事	6,000	1,846.00	11,076,000
因幡電機産業	9,300	5,030.00	46,779,000
バイテックホールディングス	4,300	1,682.00	7,232,600
ミスミグループ本社	83,500	3,145.00	262,607,500
タキヒヨー	3,700	2,330.00	8,621,000
スズケン	32,700	4,345.00	142,081,500
ジェコス	6,500	1,236.00	8,034,000
ローソン	18,200	7,380.00	134,316,000
サンエー	5,300	5,610.00	29,733,000
カワチ薬品	5,800	2,566.00	14,882,800
エービーシー・マート	13,200	6,870.00	90,684,000
ハードオフコーポレーション	5,500	1,145.00	6,297,500
アスクル	7,500	3,880.00	29,100,000
ゲオホールディングス	13,300	1,975.00	26,267,500
アダストリア	11,300	2,241.00	25,323,300

くらコーポレーション	4,300	6,340.00	27,262,000
キャンドウ	5,000	1,743.00	8,715,000
パルグループホールディングス	4,000	3,035.00	12,140,000
エディオン	27,300	1,326.00	36,199,800
サーラコーポレーション	14,300	680.00	9,724,000
ハローズ	3,200	2,508.00	8,025,600
あみやき亭	1,900	5,240.00	9,956,000
ひらまつ	14,400	552.00	7,948,800
大黒天物産	2,000	5,220.00	10,440,000
ハニーズホールディングス	8,800	1,013.00	8,914,400
アルペン	5,900	2,470.00	14,573,000
クオール	8,200	2,287.00	18,753,400
ジーンズ	5,100	5,360.00	27,336,000
ビックカメラ	41,100	1,675.00	68,842,500
D C Mホールディングス	38,600	1,071.00	41,340,600
Monotaro	25,800	3,665.00	94,557,000
DDホールディングス	1,700	3,585.00	6,094,500
アークランドサービスホールディングス	6,300	2,274.00	14,326,200
J.フロント リテイリング	85,600	1,954.00	167,262,400
ドトール・日レスホールディングス	12,500	2,554.00	31,925,000
マツモトキヨシホールディングス	29,700	4,495.00	133,501,500
ブロンコビリー	4,200	3,315.00	13,923,000
スタートトゥデイ	70,700	3,125.00	220,937,500
物語コーポレーション	2,100	9,630.00	20,223,000
ココカラファイン	7,500	7,180.00	53,850,000
三越伊勢丹ホールディングス	134,300	1,263.00	169,620,900
Hamee	2,700	1,955.00	5,278,500
ウエルシアホールディングス	19,000	4,775.00	90,725,000
クリエイティブSDホールディングス	10,500	2,715.00	28,507,500
チムニー	2,700	2,894.00	7,813,800
シュッピン	4,800	1,247.00	5,985,600
ネクステージ	8,100	1,085.00	8,788,500
ジョイフル本田	11,700	3,510.00	41,067,000
鳥貴族	3,100	3,000.00	9,300,000
ホットランド	5,300	1,330.00	7,049,000
すかいらーく	45,400	1,485.00	67,419,000
綿半ホールディングス	3,000	3,950.00	11,850,000
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホール	21,800	1,126.00	24,546,800
あさひ	6,500	1,321.00	8,586,500
日本調剤	2,900	3,470.00	10,063,000
コスモス薬品	3,700	19,940.00	73,778,000
セブン&アイ・ホールディングス	301,300	4,464.00	1,345,003,200

葉王堂	3,300	3,355.00	11,071,500
クリエイト・レストランツ・ホールディング	19,400	1,248.00	24,211,200
ツルハホールディングス	15,500	15,590.00	241,645,000
サンマルクホールディングス	5,300	3,195.00	16,933,500
トリドールホールディングス	8,900	3,515.00	31,283,500
TOKYO BASE	1,500	4,260.00	6,390,000
パロックジャパンリミテッド	7,200	903.00	6,501,600
クスリのアオキホールディングス	5,700	6,160.00	35,112,000
スシローグローバルホールディングス	7,000	4,570.00	31,990,000
LIXILビバ	7,500	2,085.00	15,637,500
メディカルシステムネットワーク	10,700	591.00	6,323,700
総合メディカル	3,200	6,150.00	19,680,000
ノジマ	12,500	2,573.00	32,162,500
カッパ・クリエイト	11,000	1,272.00	13,992,000
ライトオン	8,300	912.00	7,569,600
良品計画	9,500	36,000.00	342,000,000
アドヴァン	9,000	1,092.00	9,828,000
アルビス	2,000	3,330.00	6,660,000
コナカ	14,000	589.00	8,246,000
G-7ホールディングス	2,600	2,467.00	6,414,200
コジマ	16,600	354.00	5,876,400
コーナン商事	10,400	2,568.00	26,707,200
エコス	4,800	1,286.00	6,172,800
ワタミ	10,000	1,271.00	12,710,000
ドンキホーテホールディングス	46,600	6,020.00	280,532,000
西松屋チェーン	16,200	1,247.00	20,201,400
ゼンショーホールディングス	37,800	2,222.00	83,991,600
幸楽苑ホールディングス	5,500	1,869.00	10,279,500
サイゼリヤ	10,700	3,100.00	33,170,000
VTホールディングス	26,000	550.00	14,300,000
ユナイテッドアローズ	9,000	4,150.00	37,350,000
ハイデイ日高	8,000	3,305.00	26,440,000
京都きもの友禅	9,600	777.00	7,459,200
コロワイド	23,600	2,419.00	57,088,400
ピーシーデポコーポレーション	11,900	755.00	8,984,500
壱番屋	5,100	4,505.00	22,975,500
スギホールディングス	15,900	5,850.00	93,015,000
ヴィア・ホールディングス	9,900	703.00	6,959,700
スクロール	15,000	448.00	6,720,000
ヨンドシーホールディングス	7,500	2,687.00	20,152,500
ユニー・ファミリーマートホールディングス	23,000	7,850.00	180,550,000
木曽路	9,300	2,733.00	25,416,900

S R S ホールディングス	12,200	950.00	11,590,000
千趣会	15,300	612.00	9,363,600
ケーヨー	15,800	625.00	9,875,000
上新電機	8,400	3,685.00	30,954,000
日本瓦斯	13,300	4,425.00	58,852,500
ロイヤルホールディングス	12,700	2,834.00	35,991,800
いなげや	8,200	1,824.00	14,956,800
島忠	17,600	3,490.00	61,424,000
チヨダ	8,400	2,759.00	23,175,600
ライフコーポレーション	5,200	2,872.00	14,934,400
リンガーハット	9,400	2,433.00	22,870,200
MrMaxHD	10,500	771.00	8,095,500
AOKIホールディングス	14,200	1,659.00	23,557,800
オークワ	11,000	1,073.00	11,803,000
コメリ	11,500	3,015.00	34,672,500
青山商事	13,900	4,435.00	61,646,500
しまむら	8,400	12,960.00	108,864,000
高島屋	113,000	1,106.00	124,978,000
松屋	15,000	1,546.00	23,190,000
エイチ・ツー・オー リテイリング	34,100	2,115.00	72,121,500
近鉄百貨店	2,800	3,895.00	10,906,000
パルコ	7,000	1,457.00	10,199,000
丸井グループ	69,000	2,004.00	138,276,000
アクシアル リテイリング	5,900	4,225.00	24,927,500
イオン	276,500	1,883.00	520,649,500
イズミ	13,000	7,110.00	92,430,000
平和堂	14,300	2,367.00	33,848,100
フジ	8,700	2,239.00	19,479,300
ヤオコー	8,000	5,950.00	47,600,000
ゼビオホールディングス	9,700	2,205.00	21,388,500
ケーズホールディングス	30,600	3,030.00	92,718,000
Olympicグループ	9,000	594.00	5,346,000
日産東京販売ホールディングス	15,700	398.00	6,248,600
Genky DrugStores	3,300	3,465.00	11,434,500
アインホールディングス	9,400	6,540.00	61,476,000
元気寿司	2,400	2,762.00	6,628,800
ヤマダ電機	240,500	681.00	163,780,500
アーランドサカモト	12,300	1,790.00	22,017,000
ニトリホールディングス	28,600	18,045.00	516,087,000
グルメ杵屋	9,000	1,158.00	10,422,000
吉野家ホールディングス	25,000	1,952.00	48,800,000
松屋フーズ	3,800	3,830.00	14,554,000

サガミチェーン	11,900	1,381.00	16,433,900
関西スーパーマーケット	6,900	1,139.00	7,859,100
王将フードサービス	5,200	5,020.00	26,104,000
プレナス	8,100	2,111.00	17,099,100
ミニストップ	5,700	2,195.00	12,511,500
アークス	13,200	2,631.00	34,729,200
パローホールディングス	17,100	2,957.00	50,564,700
ベルク	3,200	6,230.00	19,936,000
大庄	5,200	1,714.00	8,912,800
ファーストリテイリング	12,000	43,670.00	524,040,000
サンドラッグ	30,400	4,955.00	150,632,000
サクスパー ホールディングス	7,900	1,162.00	9,179,800
ベルーナ	17,700	1,278.00	22,620,600
じもとホールディングス	55,300	191.00	10,562,300
めぶきフィナンシャルグループ	370,000	450.00	166,500,000
東京ＴＹフィナンシャルグループ	9,800	2,786.00	27,302,800
九州フィナンシャルグループ	117,000	629.00	73,593,000
ゆうちょ銀行	202,500	1,477.00	299,092,500
富山第一銀行	21,300	517.00	11,012,100
コンコルディア・フィナンシャルグループ	435,500	629.00	273,929,500
西日本フィナンシャルホールディングス	49,300	1,351.00	66,604,300
新生銀行	61,800	1,755.00	108,459,000
あおぞら銀行	42,600	4,490.00	191,274,000
三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	5,085,900	793.60	4,036,170,240
りそなホールディングス	787,000	633.70	498,721,900
三井住友トラスト・ホールディングス	142,000	4,444.00	631,048,000
三井住友フィナンシャルグループ	544,800	4,831.00	2,631,928,800
第四銀行	8,800	4,985.00	43,868,000
北越銀行	7,700	2,411.00	18,564,700
千葉銀行	256,000	924.00	236,544,000
群馬銀行	144,400	668.00	96,459,200
武蔵野銀行	11,600	3,615.00	41,934,000
千葉興業銀行	22,900	502.00	11,495,800
筑波銀行	33,500	373.00	12,495,500
七十七銀行	22,800	2,745.00	62,586,000
青森銀行	6,000	3,455.00	20,730,000
秋田銀行	5,100	2,960.00	15,096,000
山形銀行	8,300	2,435.00	20,210,500
岩手銀行	5,200	4,330.00	22,516,000
東邦銀行	63,300	402.00	25,446,600
東北銀行	4,500	1,490.00	6,705,000
みちのく銀行	5,300	1,809.00	9,587,700

ふくおかフィナンシャルグループ	290,000	583.00	169,070,000
静岡銀行	188,000	1,129.00	212,252,000
十六銀行	9,600	2,968.00	28,492,800
スルガ銀行	73,300	2,013.00	147,552,900
八十二銀行	127,000	650.00	82,550,000
山梨中央銀行	45,000	442.00	19,890,000
大垣共立銀行	11,500	2,830.00	32,545,000
福井銀行	6,600	2,655.00	17,523,000
北國銀行	8,300	4,345.00	36,063,500
清水銀行	2,900	3,015.00	8,743,500
富山銀行	1,700	4,040.00	6,868,000
滋賀銀行	67,000	568.00	38,056,000
南都銀行	8,600	3,060.00	26,316,000
百五銀行	67,600	537.00	36,301,200
京都銀行	27,300	6,120.00	167,076,000
紀陽銀行	27,400	1,794.00	49,155,600
三重銀行	4,000	2,383.00	9,532,000
ほくほくフィナンシャルグループ	47,500	1,585.00	75,287,500
広島銀行	104,700	869.00	90,984,300
山陰合同銀行	43,300	1,049.00	45,421,700
中国銀行	49,100	1,368.00	67,168,800
伊予銀行	101,100	882.00	89,170,200
百十四銀行	76,000	364.00	27,664,000
四国銀行	11,700	1,563.00	18,287,100
阿波銀行	57,000	668.00	38,076,000
大分銀行	4,400	4,285.00	18,854,000
宮崎銀行	5,100	3,565.00	18,181,500
佐賀銀行	4,800	2,589.00	12,427,200
十八銀行	48,000	283.00	13,584,000
沖縄銀行	7,000	4,440.00	31,080,000
琉球銀行	14,500	1,637.00	23,736,500
セブン銀行	269,900	380.00	102,562,000
みずほフィナンシャルグループ	9,779,300	202.80	1,983,242,040
山口フィナンシャルグループ	67,000	1,289.00	86,363,000
名古屋銀行	6,000	4,080.00	24,480,000
北洋銀行	110,000	377.00	41,470,000
愛知銀行	2,600	5,470.00	14,222,000
第三銀行	5,000	1,684.00	8,420,000
中京銀行	3,700	2,360.00	8,732,000
大光銀行	3,000	2,415.00	7,245,000
愛媛銀行	11,000	1,298.00	14,278,000
みなと銀行	6,800	2,105.00	14,314,000

京葉銀行	63,000	504.00	31,752,000
関西アーバン銀行	10,500	1,426.00	14,973,000
栃木銀行	38,900	433.00	16,843,700
北日本銀行	2,500	3,070.00	7,675,000
東和銀行	13,300	1,393.00	18,526,900
福島銀行	8,000	826.00	6,608,000
大東銀行	4,200	1,450.00	6,090,000
トモニホールディングス	60,100	493.00	29,629,300
フィデアホールディングス	75,100	199.00	14,944,900
池田泉州ホールディングス	78,000	424.00	33,072,000
F P G	25,300	1,407.00	35,597,100
S B Iホールディングス	81,400	2,554.00	207,895,600
ジャフコ	10,400	5,440.00	56,576,000
大和証券グループ本社	616,000	725.70	447,031,200
野村ホールディングス	1,239,000	666.40	825,669,600
岡三証券グループ	61,000	694.00	42,334,000
丸三証券	23,000	1,015.00	23,345,000
東洋証券	28,000	316.00	8,848,000
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	79,800	789.00	62,962,200
水戸証券	25,000	397.00	9,925,000
いちよし証券	15,600	1,296.00	20,217,600
松井証券	35,500	1,058.00	37,559,000
マネックスグループ	78,600	381.00	29,946,600
カブドットコム証券	49,000	379.00	18,571,000
極東証券	10,000	1,596.00	15,960,000
岩井コスモホールディングス	8,000	1,381.00	11,048,000
藍澤證券	15,000	767.00	11,505,000
マネーパートナーズグループ	12,000	386.00	4,632,000
かんぽ生命保険	27,100	2,811.00	76,178,100
S O M P Oホールディングス	141,000	4,170.00	587,970,000
アニコム ホールディングス	5,000	3,535.00	17,675,000
M S & A Dインシュアランスグループホールディングス	188,200	3,398.00	639,503,600
ソニーフィナンシャルホールディングス	59,100	2,014.00	119,027,400
第一生命ホールディングス	407,200	2,209.50	899,708,400
東京海上ホールディングス	271,200	5,109.00	1,385,560,800
T & Dホールディングス	223,000	1,848.50	412,215,500
アドバンスクリエイト	2,000	1,963.00	3,926,000
全国保証	20,500	4,805.00	98,502,500
アルヒ	6,000	1,461.00	8,766,000
クレディセゾン	54,400	1,866.00	101,510,400
芙蓉総合リース	8,200	7,230.00	59,286,000
興銀リース	13,700	2,766.00	37,894,200

東京センチュリー	14,200	6,170.00	87,614,000
日本証券金融	32,000	666.00	21,312,000
アイフル	123,500	378.00	46,683,000
リコーリース	5,800	3,600.00	20,880,000
イオンフィナンシャルサービス	50,900	2,505.00	127,504,500
アコム	144,900	480.00	69,552,000
ジャックス	9,200	2,553.00	23,487,600
オリエントコーポレーション	154,800	173.00	26,780,400
日立キャピタル	20,000	2,876.00	57,520,000
アプラスフィナンシャル	40,900	107.00	4,376,300
オリックス	479,300	1,933.00	926,486,900
三菱UFJリース	180,000	680.00	122,400,000
日本取引所グループ	211,000	1,850.00	390,350,000
イー・ギャランティ	2,400	3,820.00	9,168,000
NECキャピタルソリューション	3,700	2,116.00	7,829,200
いちご	102,800	463.00	47,596,400
日本駐車場開発	92,300	186.00	17,167,800
ヒューリック	150,300	1,240.00	186,372,000
三栄建築設計	3,300	2,158.00	7,121,400
野村不動産ホールディングス	48,000	2,617.00	125,616,000
三重交通グループホールディングス	17,500	502.00	8,785,000
サムティ	6,800	1,883.00	12,804,400
日本商業開発	4,700	1,904.00	8,948,800
プレサンスコーポレーション	10,600	1,645.00	17,437,000
ユニゾホールディングス	8,700	2,978.00	25,908,600
日本管理センター	5,800	1,752.00	10,161,600
フージャースホールディングス	10,300	771.00	7,941,300
オープンハウス	11,700	6,690.00	78,273,000
東急不動産ホールディングス	173,800	812.00	141,125,600
飯田グループホールディングス	60,000	1,992.00	119,520,000
ムゲンエステート	5,600	1,291.00	7,229,600
ケイアイスター不動産	2,800	2,780.00	7,784,000
パーク24	40,400	2,638.00	106,575,200
パラカ	3,400	2,480.00	8,432,000
三井不動産	359,500	2,651.50	953,214,250
三菱地所	536,000	1,914.50	1,026,172,000
平和不動産	13,000	2,027.00	26,351,000
東京建物	78,900	1,735.00	136,891,500
ダイビル	18,800	1,343.00	25,248,400
京阪神ビルディング	15,700	866.00	13,596,200
住友不動産	173,000	3,989.00	690,097,000
大京	11,100	2,222.00	24,664,200

テーオーシー	25,400	857.00	21,767,800
東京楽天地	1,900	5,160.00	9,804,000
レオパレス21	87,100	835.00	72,728,500
スターツコーポレーション	9,700	2,828.00	27,431,600
フジ住宅	12,900	872.00	11,248,800
空港施設	12,900	632.00	8,152,800
ゴールドクレスト	6,100	2,214.00	13,505,400
日本エスリード	3,700	2,200.00	8,140,000
日神不動産	10,800	803.00	8,672,400
日本エスコン	14,100	974.00	13,733,400
タカラレーベン	35,100	470.00	16,497,000
サンヨーハウジング名古屋	6,500	1,226.00	7,969,000
イオンモール	46,600	2,222.00	103,545,200
カチタス	7,000	3,240.00	22,680,000
トーセイ	10,100	1,331.00	13,443,100
エヌ・ティ・ティ都市開発	45,200	1,325.00	59,890,000
サンフロンティア不動産	9,300	1,205.00	11,206,500
エフ・ジェー・ネクスト	7,200	876.00	6,307,200
日本空港ビルデング	21,200	4,015.00	85,118,000
日本工営	4,900	2,927.00	14,342,300
LIFULL	24,900	1,034.00	25,746,600
ジェイエシーリクルートメント	6,100	2,224.00	13,566,400
日本M&Aセンター	24,300	6,710.00	163,053,000
タケエイ	8,700	1,264.00	10,996,800
トラスト・テック	3,300	3,175.00	10,477,500
コシダカホールディングス	3,800	6,570.00	24,966,000
パソナグループ	5,900	2,361.00	13,929,900
リンクアンドモチベーション	13,700	1,016.00	13,919,200
GCA	9,500	945.00	8,977,500
エス・エム・エス	13,900	4,400.00	61,160,000
パーソルホールディングス	64,400	2,781.00	179,096,400
リニカル	5,400	1,377.00	7,435,800
クックパッド	23,900	597.00	14,268,300
学情	4,000	1,599.00	6,396,000
スタジオアリス	4,300	2,716.00	11,678,800
シミックホールディングス	4,700	2,677.00	12,581,900
総合警備保障	27,800	5,320.00	147,896,000
カカクコム	54,300	1,993.00	108,219,900
アイロムグループ	3,000	2,821.00	8,463,000
ルネサンス	4,600	1,766.00	8,123,600
ディップ	9,900	3,400.00	33,660,000
オプトホールディング	6,100	1,149.00	7,008,900

ツクイ	17,600	832.00	14,643,200
エムスリー	73,600	4,460.00	328,256,000
アウトソーシング	20,800	2,026.00	42,140,800
ウェルネット	7,400	1,147.00	8,487,800
ワールドホールディングス	2,400	4,000.00	9,600,000
ディー・エヌ・エー	38,000	1,930.00	73,340,000
博報堂DYホールディングス	96,500	1,594.00	153,821,000
ぐるなび	11,900	1,383.00	16,457,700
エスアールジータカミヤ	10,700	672.00	7,190,400
ジャパンベストレスキューシステム	10,800	810.00	8,748,000
ファンコミュニケーションズ	20,200	751.00	15,170,200
ライク	3,200	2,144.00	6,860,800
WDBホールディングス	3,400	4,180.00	14,212,000
バリューコマース	7,900	1,337.00	10,562,300
インフォマート	36,400	920.00	33,488,000
J Pホールディングス	27,400	308.00	8,439,200
E P Sホールディングス	10,700	2,388.00	25,551,600
プレステージ・インターナショナル	15,100	1,381.00	20,853,100
アミューズ	4,900	3,630.00	17,787,000
ドリームインキュベータ	3,100	2,738.00	8,487,800
クイック	5,100	2,066.00	10,536,600
ケネディクス	97,700	695.00	67,901,500
電通	84,900	4,960.00	421,104,000
テイクアンドギヴ・ニーズ	4,600	958.00	4,406,800
ぴあ	2,400	5,490.00	13,176,000
イオンファンタジー	2,400	4,940.00	11,856,000
シーティーエス	8,500	780.00	6,630,000
ネクシィーズグループ	3,200	1,731.00	5,539,200
みらかホールディングス	21,000	4,315.00	90,615,000
アルプス技研	6,600	2,286.00	15,087,600
日本空調サービス	10,100	765.00	7,726,500
オリエンタルランド	82,500	10,755.00	887,287,500
ダスキン	19,300	2,659.00	51,318,700
明光ネットワークジャパン	10,600	1,281.00	13,578,600
ファルコホールディングス	5,500	1,758.00	9,669,000
ラウンドワン	21,900	1,783.00	39,047,700
リゾートトラスト	29,900	2,434.00	72,776,600
ビー・エム・エル	9,100	2,612.00	23,769,200
りらいあコミュニケーションズ	11,600	1,329.00	15,416,400
リソー教育	13,600	820.00	11,152,000
ユー・エス・エス	85,600	2,202.00	188,491,200
サイバーエージェント	46,000	4,495.00	206,770,000

楽天	359,100	938.00	336,835,800
クリーク・アンド・リバー社	4,500	992.00	4,464,000
テー・オー・ダブリュー	8,700	921.00	8,012,700
セントラルスポーツ	3,100	3,970.00	12,307,000
フルキャストホールディングス	6,300	2,643.00	16,650,900
テクノプロ・ホールディングス	12,700	6,060.00	76,962,000
Gunosy	3,000	2,558.00	7,674,000
イー・ガーディアン	4,000	3,065.00	12,260,000
ジャパンマテリアル	6,400	4,130.00	26,432,000
ベクトル	9,000	2,240.00	20,160,000
I B J	6,600	1,092.00	7,207,200
アサンテ	4,100	1,868.00	7,658,800
N・フィールド	4,800	2,101.00	10,084,800
バリューHR	2,200	2,273.00	5,000,600
M&Aキャピタルパートナーズ	1,500	7,820.00	11,730,000
アビスト	1,300	4,975.00	6,467,500
ウィルグループ	3,700	1,656.00	6,127,200
エスクロー・エージェント・ジャパン	11,000	487.00	5,357,000
リクルートホールディングス	538,300	2,677.50	1,441,298,250
日本郵政	393,900	1,315.00	517,978,500
ベルシステム24ホールディングス	12,000	1,498.00	17,976,000
エボラブルアジア	2,000	2,018.00	4,036,000
ストライク	800	6,140.00	4,912,000
ソラスト	4,800	2,551.00	12,244,800
インソース	1,000	3,325.00	3,325,000
リログループ	38,300	3,050.00	116,815,000
東祥	4,600	3,635.00	16,721,000
エイチ・アイ・エス	10,900	3,995.00	43,545,500
共立メンテナンス	12,400	4,430.00	54,932,000
イチネンホールディングス	8,900	1,542.00	13,723,800
建設技術研究所	7,000	1,334.00	9,338,000
スペース	5,700	1,346.00	7,672,200
東京テアトル	4,800	1,458.00	6,998,400
ナガワ	1,500	4,250.00	6,375,000
よみうりランド	2,100	4,750.00	9,975,000
東京都競馬	5,400	3,715.00	20,061,000
常磐興産	5,300	1,885.00	9,990,500
カナモト	10,800	3,440.00	37,152,000
東京ドーム	28,800	983.00	28,310,400
西尾レントオール	6,200	3,850.00	23,870,000
トランス・コスモス	7,800	2,902.00	22,635,600
乃村工藝社	16,200	2,186.00	35,413,200

藤田観光	3,400	3,200.00	10,880,000
KNT-CTホールディングス	4,900	1,788.00	8,761,200
日本管財	7,700	2,092.00	16,108,400
トーカイ	6,800	2,578.00	17,530,400
セコム	74,100	7,927.00	587,390,700
セントラル警備保障	4,100	2,475.00	10,147,500
丹青社	14,500	1,069.00	15,500,500
メイテック	8,500	6,050.00	51,425,000
応用地質	9,000	1,453.00	13,077,000
船井総研ホールディングス	14,700	2,200.00	32,340,000
オオバ	11,300	625.00	7,062,500
ベネッセホールディングス	25,700	3,960.00	101,772,000
イオンディライト	8,500	3,920.00	33,320,000
ナック	7,400	912.00	6,748,800
ニチイ学館	13,700	1,221.00	16,727,700
ダイセキ	11,800	3,045.00	35,931,000
合計	87,786,100		185,261,262,630

(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29年 2月20日現在)	(平成30年 2月19日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	789,494,703	1,082,099,695
国債証券	163,526,437,680	152,749,085,120
地方債証券	17,280,211,396	19,316,624,612
特殊債券	27,407,081,968	25,660,169,148
社債券	10,096,415,000	7,932,157,000
未収入金	100,974,000	811,822,700
未収利息	727,362,319	676,631,920
前払費用	20,618,923	7,650,537
流動資産合計	219,948,595,989	208,236,240,732
資産合計	219,948,595,989	208,236,240,732
負債の部		
流動負債		
未払金	199,592,000	-
未払解約金	8,852,786	1,352,984,000

	（平成29年 2月20日現在）	（平成30年 2月19日現在）
未払利息	1,946	3,042
その他未払費用	2,524	1,486
流動負債合計	208,449,256	1,352,988,528
負債合計	208,449,256	1,352,988,528
純資産の部		
元本等		
元本	176,575,927,018	164,465,810,821
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	43,164,219,715	42,417,441,383
元本等合計	219,740,146,733	206,883,252,204
純資産合計	219,740,146,733	206,883,252,204
負債純資産合計	219,948,595,989	208,236,240,732

注記表

（重要な会計方針の注記）

項目	自 平成29年 2月21日 至 平成30年 2月19日
有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券は個別法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>

（貸借対照表に関する注記）

項目	（平成29年 2月20日現在）	（平成30年 2月19日現在）
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	176,575,927,018口	164,465,810,821口
2. 1単位当たり純資産の額	1.2445円 (10,000口当たりの純資産額 12,445円)	1.2579円 (10,000口当たりの純資産額 12,579円)

（金融商品に関する注記）

. 金融商品の状況に関する事項

項 目	自 平成29年 2月21日 至 平成30年 2月19日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。</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30年 2月19日現在)
1.貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1) 有価証券（国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

自 平成29年 2月21日 至 平成30年 2月19日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。

（その他の注記）

(平成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
SMAM・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
SMAM・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
SMAM・バランスファンドVA25<適格機関投資家専用>	26,518,547,564円
SMAM・バランスファンドVA37.5<適格機関投資家専用>	9,024,962,955円
SMAM・バランスファンドVA50<適格機関投資家専用>	22,153,432,312円
SMAM・バランスファンドVL30<適格機関投資家限定>	366,992,815円
SMAM・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
SMAM・バランスファンドVA75<適格機関投資家専用>	337,186,477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>	138,667,534円
SMAM・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
SMAM・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
SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用>	6,705,288,357円
SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>	13,609,804,456円
SMAM・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
SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	663,412,031円
SMAM・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
SMAM・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
SMAM・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
SMAM・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
SMAM・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
SMAM・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
SMAM・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
SMAM・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
SMAM・アセットバランスファンドVA35A2<適格機関投資家専用>	260,266,079円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A2<適格機関投資家専用>	22,401,538円
SMAM・アセットバランスファンドVA30L2<適格機関投資家専用>	411,209,300円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L2<適格機関投資家専用>	7,685,581,694円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T2<適格機関投資家専用>	335,011,843円
SMAM・FG新興国重視型バランス20VA<適格機関投資家限定>	34,418円
SMAM・FGグローバルバランス25VA<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2016-04<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2016-05<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

(平成30年 2月19日現在)

開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	176,575,927,018円
同期中における追加設定元本額	21,143,135,795円
同期中における一部解約元本額	33,253,251,992円
平成30年 2月19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)	3,664,566,217円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	6,465,117,996円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	1,422,328,882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)	364,385,712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)	55,953,172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)	151,237,500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)	250,861,290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)	164,276,895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)	67,048,802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)	149,353,233円
三井住友・DC年金バランスゼロ(債券型)	58,920,581円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	2,166,555,545円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	253,056,117円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	49,566,271円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2050	4,537,330円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	84,341円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	176,843円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	734,823円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	834,200円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	2,177,711円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	4,703,886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>	5,909,738,933円
S M A M ・ バランスファンドVA25<適格機関投資家専用>	23,274,790,915円
S M A M ・ バランスファンドVA37.5<適格機関投資家専用>	8,645,981,556円
S M A M ・ バランスファンドVA50<適格機関投資家専用>	20,885,147,427円
S M A M ・ バランスファンドVL30<適格機関投資家限定>	375,770,631円
S M A M ・ バランスファンドVL50<適格機関投資家限定>	685,324,916円
世界6資産バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	4,895,998円
S M A M ・ バランスファンドVA75<適格機関投資家専用>	311,971,836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>	133,067,534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>	2,319,278,483円

SMAM・インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用>	2,484,608,198円
SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用>	4,018,902,447円
SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>	12,894,674,328円
SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定>	130,651,018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)	6,907,531,153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)	19,511,978,163円
SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	628,764,310円
SMAM・バランスファンドVA20<適格機関投資家専用>	988,251,801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)	16,951,335,715円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>	1,039,763,060円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>	217,323,993円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用>	50,814,060円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>	2,382,442,487円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	2,947,118,912円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T<適格機関投資家専用>	2,700,565,230円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A2<適格機関投資家専用>	1,141,382,159円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A2<適格機関投資家専用>	263,939,510円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A2<適格機関投資家専用>	23,744,004円
SMAM・アセットバランスファンドVA30L2<適格機関投資家専用>	403,541,228円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L2<適格機関投資家専用>	7,393,423,289円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T2<適格機関投資家専用>	324,311,883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>	2,541,689円
SMAM・マルチアセットストラテジーファンド2016-04<適格機関投資家限定>	1,313,635,444円
SMAM・マルチアセットストラテジーファンド2016-05<適格機関投資家限定>	629,490,126円
SMAM・マルチアセットストラテジー・オープン<適格機関投資家限定>	1,272,098,065円
SMAM・マルチアセット・ダイナミックアロケーション・ストラテジー・ファンド<適格機関投資家限定>	532,973円
合計	164,465,810,821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384回利付国債(2年)	100,000,000	100,485,000	
	第123回利付国債(5年)	10,000,000	10,046,700	

第124回利付国債(5年)	240,000,000	241,231,200	
第125回利付国債(5年)	1,060,000,000	1,065,883,000	
第126回利付国債(5年)	910,000,000	915,541,900	
第127回利付国債(5年)	1,040,000,000	1,046,895,200	
第128回利付国債(5年)	2,205,000,000	2,220,809,850	
第129回利付国債(5年)	1,610,000,000	1,622,139,400	
第130回利付国債(5年)	1,000,000,000	1,007,870,000	
第131回利付国債(5年)	2,270,000,000	2,289,022,600	
第132回利付国債(5年)	855,000,000	862,609,500	
第133回利付国債(5年)	600,000,000	605,514,000	
第134回利付国債(5年)	250,000,000	252,425,000	
第1回利付国債(40年)	40,000,000	57,177,600	
第2回利付国債(40年)	287,000,000	396,872,210	
第3回利付国債(40年)	285,000,000	395,936,250	
第4回利付国債(40年)	402,000,000	560,926,680	
第5回利付国債(40年)	390,000,000	523,009,500	
第6回利付国債(40年)	415,000,000	545,256,050	
第7回利付国債(40年)	400,000,000	502,184,000	
第8回利付国債(40年)	535,000,000	621,450,650	
第9回利付国債(40年)	741,000,000	620,965,410	
第10回利付国債(40年)	575,000,000	571,693,750	
第306回利付国債(10年)	245,000,000	252,768,950	
第309回利付国債(10年)	550,000,000	565,713,500	
第310回利付国債(10年)	3,080,000,000	3,169,196,800	
第312回利付国債(10年)	2,145,000,000	2,225,308,800	
第313回利付国債(10年)	2,105,000,000	2,197,556,850	
第315回利付国債(10年)	1,800,000,000	1,879,326,000	
第317回利付国債(10年)	1,005,000,000	1,049,059,200	
第318回利付国債(10年)	895,000,000	931,014,800	
第319回利付国債(10年)	980,000,000	1,025,766,000	
第320回利付国債(10年)	960,000,000	1,001,145,600	
第321回利付国債(10年)	960,000,000	1,003,603,200	
第322回利付国債(10年)	1,065,000,000	1,109,016,450	
第323回利付国債(10年)	510,000,000	532,271,700	
第324回利付国債(10年)	790,000,000	821,062,800	
第325回利付国債(10年)	1,365,000,000	1,421,169,750	

第326回利付国債(10年)	527,000,000	547,447,600	
第327回利付国債(10年)	375,000,000	391,368,750	
第328回利付国債(10年)	380,000,000	393,463,400	
第329回利付国債(10年)	2,530,000,000	2,649,770,200	
第330回利付国債(10年)	1,335,000,000	1,400,815,500	
第332回利付国債(10年)	793,000,000	824,323,500	
第333回利付国債(10年)	1,285,000,000	1,337,106,750	
第334回利付国債(10年)	1,265,000,000	1,317,598,700	
第335回利付国債(10年)	1,450,000,000	1,503,128,000	
第336回利付国債(10年)	920,000,000	954,334,400	
第337回利付国債(10年)	420,000,000	429,920,400	
第338回利付国債(10年)	1,305,000,000	1,346,198,850	
第339回利付国債(10年)	1,835,000,000	1,892,930,950	
第340回利付国債(10年)	1,790,000,000	1,847,047,300	
第341回利付国債(10年)	1,187,000,000	1,216,295,160	
第342回利付国債(10年)	1,520,000,000	1,532,889,600	
第343回利付国債(10年)	1,860,000,000	1,874,694,000	
第344回利付国債(10年)	2,311,000,000	2,327,824,080	
第345回利付国債(10年)	1,588,000,000	1,598,480,800	
第346回利付国債(10年)	2,200,000,000	2,212,914,000	
第347回利付国債(10年)	1,520,000,000	1,527,752,000	
第348回利付国債(10年)	895,000,000	899,260,200	
第349回利付国債(10年)	640,000,000	642,809,600	
第2回利付国債(30年)	510,000,000	645,991,500	
第4回利付国債(30年)	300,000,000	401,916,000	
第5回利付国債(30年)	290,000,000	364,814,200	
第7回利付国債(30年)	474,000,000	608,459,580	
第9回利付国債(30年)	100,000,000	115,944,000	
第10回利付国債(30年)	585,000,000	652,959,450	
第11回利付国債(30年)	430,000,000	518,205,900	
第12回利付国債(30年)	590,000,000	747,494,600	
第14回利付国債(30年)	822,000,000	1,082,549,340	
第16回利付国債(30年)	465,000,000	622,132,800	
第18回利付国債(30年)	500,000,000	654,445,000	
第19回利付国債(30年)	490,000,000	642,409,600	
第21回利付国債(30年)	345,000,000	453,323,100	

第22回利付国債(30年)	335,000,000	452,430,900	
第23回利付国債(30年)	329,000,000	445,064,620	
第24回利付国債(30年)	310,000,000	420,034,500	
第25回利付国債(30年)	300,000,000	396,330,000	
第26回利付国債(30年)	383,000,000	512,840,830	
第27回利付国債(30年)	440,000,000	599,060,000	
第28回利付国債(30年)	456,000,000	622,371,600	
第29回利付国債(30年)	227,000,000	306,613,440	
第30回利付国債(30年)	572,000,000	763,923,160	
第31回利付国債(30年)	425,000,000	560,800,250	
第32回利付国債(30年)	735,000,000	988,185,450	
第33回利付国債(30年)	483,000,000	621,162,150	
第34回利付国債(30年)	737,000,000	981,964,060	
第35回利付国債(30年)	735,000,000	949,509,750	
第36回利付国債(30年)	280,000,000	362,457,200	
第37回利付国債(30年)	790,000,000	1,007,810,900	
第38回利付国債(30年)	495,000,000	621,076,500	
第39回利付国債(30年)	335,000,000	428,387,950	
第40回利付国債(30年)	455,000,000	571,634,700	
第41回利付国債(30年)	475,000,000	585,941,000	
第42回利付国債(30年)	445,000,000	549,174,500	
第43回利付国債(30年)	485,000,000	598,800,400	
第44回利付国債(30年)	520,000,000	642,283,200	
第45回利付国債(30年)	285,000,000	338,406,150	
第46回利付国債(30年)	600,000,000	712,488,000	
第47回利付国債(30年)	630,000,000	763,560,000	
第48回利付国債(30年)	615,000,000	715,337,250	
第49回利付国債(30年)	575,000,000	668,742,250	
第50回利付国債(30年)	565,000,000	571,548,350	
第51回利付国債(30年)	560,000,000	494,194,400	
第52回利付国債(30年)	633,000,000	590,196,540	
第53回利付国債(30年)	507,000,000	484,950,570	
第54回利付国債(30年)	745,000,000	750,304,400	
第55回利付国債(30年)	595,000,000	598,552,150	
第56回利付国債(30年)	320,000,000	321,536,000	
第57回利付国債(30年)	160,000,000	160,579,200	

第46回利付国債(20年)	775,000,000	817,222,000	
第48回利付国債(20年)	955,000,000	1,026,052,000	
第50回利付国債(20年)	918,000,000	975,310,740	
第52回利付国債(20年)	720,000,000	777,060,000	
第54回利付国債(20年)	965,000,000	1,050,470,050	
第56回利付国債(20年)	818,000,000	892,634,320	
第59回利付国債(20年)	1,455,000,000	1,582,036,050	
第61回利付国債(20年)	1,215,000,000	1,282,821,300	
第64回利付国債(20年)	1,025,000,000	1,138,713,500	
第65回利付国債(20年)	1,020,000,000	1,137,565,200	
第69回利付国債(20年)	1,020,000,000	1,154,303,400	
第70回利付国債(20年)	780,000,000	901,266,600	
第72回利付国債(20年)	753,000,000	859,557,030	
第74回利付国債(20年)	664,000,000	761,276,000	
第75回利付国債(20年)	490,000,000	564,386,900	
第78回利付国債(20年)	590,000,000	673,355,200	
第82回利付国債(20年)	620,000,000	719,751,800	
第84回利付国債(20年)	850,000,000	983,832,500	
第85回利付国債(20年)	645,000,000	754,662,900	
第88回利付国債(20年)	742,000,000	883,722,000	
第89回利付国債(20年)	20,000,000	23,653,600	
第90回利付国債(20年)	580,000,000	688,570,200	
第92回利付国債(20年)	734,000,000	868,145,840	
第93回利付国債(20年)	632,000,000	744,666,640	
第95回利付国債(20年)	305,000,000	369,214,700	
第97回利付国債(20年)	677,000,000	816,522,930	
第99回利付国債(20年)	693,000,000	831,925,710	
第100回利付国債(20年)	247,000,000	299,778,960	
第101回利付国債(20年)	355,000,000	437,959,950	
第102回利付国債(20年)	457,000,000	565,871,110	
第105回利付国債(20年)	390,000,000	472,383,600	
第106回利付国債(20年)	370,000,000	452,040,100	
第107回利付国債(20年)	378,000,000	459,220,860	
第108回利付国債(20年)	640,000,000	763,801,600	
第109回利付国債(20年)	410,000,000	490,290,300	
第111回利付国債(20年)	456,000,000	561,983,520	

第113回利付国債(20年)	527,000,000	645,416,900	
第114回利付国債(20年)	603,000,000	740,508,120	
第116回利付国債(20年)	805,000,000	1,000,703,550	
第118回利付国債(20年)	460,000,000	562,308,600	
第119回利付国債(20年)	425,000,000	508,941,750	
第120回利付国債(20年)	280,000,000	328,538,000	
第121回利付国債(20年)	255,000,000	309,325,200	
第122回利付国債(20年)	535,000,000	642,390,550	
第123回利付国債(20年)	380,000,000	471,181,000	
第124回利付国債(20年)	365,000,000	448,008,300	
第125回利付国債(20年)	455,000,000	571,302,550	
第126回利付国債(20年)	280,000,000	344,430,800	
第127回利付国債(20年)	335,000,000	407,815,600	
第128回利付国債(20年)	445,000,000	542,837,700	
第129回利付国債(20年)	440,000,000	531,031,600	
第130回利付国債(20年)	535,000,000	646,868,500	
第131回利付国債(20年)	460,000,000	550,118,600	
第132回利付国債(20年)	470,000,000	562,585,300	
第133回利付国債(20年)	60,000,000	72,623,400	
第134回利付国債(20年)	50,000,000	60,619,000	
第135回利付国債(20年)	345,000,000	413,572,200	
第136回利付国債(20年)	320,000,000	378,988,800	
第137回利付国債(20年)	445,000,000	533,870,950	
第138回利付国債(20年)	25,000,000	29,301,750	
第139回利付国債(20年)	280,000,000	332,049,200	
第140回利付国債(20年)	850,000,000	1,021,198,500	
第141回利付国債(20年)	445,000,000	535,339,450	
第142回利付国債(20年)	380,000,000	462,555,000	
第143回利付国債(20年)	360,000,000	428,108,400	
第144回利付国債(20年)	150,000,000	176,212,500	
第145回利付国債(20年)	485,000,000	584,488,050	
第146回利付国債(20年)	520,000,000	627,411,200	
第147回利付国債(20年)	1,075,000,000	1,281,314,000	
第148回利付国債(20年)	474,000,000	557,798,460	
第149回利付国債(20年)	1,040,000,000	1,224,704,000	
第150回利付国債(20年)	901,000,000	1,045,952,880	

	第151回利付国債(20年)	480,000,000	541,819,200	
	第152回利付国債(20年)	525,000,000	592,121,250	
	第153回利付国債(20年)	682,000,000	780,187,540	
	第154回利付国債(20年)	1,060,000,000	1,194,365,600	
	第155回利付国債(20年)	820,000,000	895,161,200	
	第156回利付国債(20年)	850,000,000	838,686,500	
	第157回利付国債(20年)	555,000,000	527,044,650	
	第158回利付国債(20年)	845,000,000	845,000,000	
	第159回利付国債(20年)	848,000,000	861,110,080	
	第160回利付国債(20年)	1,075,000,000	1,108,572,250	
	第161回利付国債(20年)	550,000,000	556,259,000	
	第162回利付国債(20年)	830,000,000	837,328,900	
	第163回利付国債(20年)	250,000,000	251,782,500	
国債証券合計		138,038,000,000	152,749,085,120	
地方債証券	第1回東京都公募公債(20年)	100,000,000	107,952,000	
	第1回東京都公募公債(30年)	100,000,000	125,242,000	
	第6回東京都公募公債(20年)	100,000,000	113,510,000	
	第7回東京都公募公債(20年)	100,000,000	115,458,000	
	第8回東京都公募公債(20年)	100,000,000	117,921,000	
	第8回東京都公募公債(30年)	400,000,000	510,088,000	
	第13回東京都公募公債(30年)	500,000,000	615,305,000	
	第668回東京都公募公債	200,000,000	203,246,000	
	第674回東京都公募公債	100,100,000	102,230,128	
	第684回東京都公募公債	100,000,000	102,850,000	
	第685回東京都公募公債	100,000,000	102,548,000	
	第688回東京都公募公債	193,500,000	198,012,420	
	第689回東京都公募公債	200,000,000	205,386,000	
	第703回東京都公募公債	100,000,000	103,653,000	
	第705回東京都公募公債	100,000,000	104,170,000	
	第710回東京都公募公債	100,000,000	103,352,000	
	平成21年度第14回北海道公募公債	100,000,000	102,996,000	
	平成24年度第1回北海道公募公債	100,000,000	103,968,000	
	平成24年度第14回北海道公募公債	100,000,000	103,733,000	
	平成25年度第15回北海道公募公債	100,000,000	103,537,000	
	平成26年度第15回北海道公募公債	100,000,000	102,285,000	
	平成29年度第6回北海道公募公債(5年)	300,000,000	299,466,000	

第1回神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	115,569,000	
第3回神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	114,589,000	
第7回神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	118,275,000	
第157回神奈川県公募公債	115,600,000	117,101,644	
第167回神奈川県公募公債	100,000,000	102,350,000	
第97回大阪府公募公債(5年)	102,000,000	102,150,960	
第326回大阪府公募公債(10年)	200,000,000	204,120,000	
第332回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	102,731,000	
第342回大阪府公募公債(10年)	200,000,000	206,074,000	
第361回大阪府公募公債(10年)	200,000,000	207,604,000	
第373回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	104,476,000	
第377回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	103,736,000	
平成20年度第3回京都府公募公債	100,000,000	101,278,000	
平成22年度第5回京都府公募公債	110,000,000	113,817,000	
平成26年度第13回京都府公募公債	100,000,000	102,734,000	
平成27年度第4回京都府公募公債	100,000,000	103,221,000	
第5回兵庫県公募公債(15年)	300,000,000	332,148,000	
平成21年度第3回兵庫県公募公債	390,000,000	397,733,700	
平成21年度第11回兵庫県公募公債	200,000,000	204,316,000	
平成22年度第1回兵庫県公募公債	100,000,000	103,066,000	
平成25年度第15回兵庫県公募公債(5年)	100,000,000	100,150,000	
第7回静岡県公募公債(30年)	100,000,000	124,889,000	
平成20年度第1回静岡県公募公債	200,000,000	230,870,000	
平成20年度第7回静岡県公募公債	100,000,000	101,293,000	
平成21年度第5回静岡県公募公債	300,000,000	306,543,000	
平成21年度第1回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	101,875,000	
平成21年度第7回愛知県公募公債(10年)	200,000,000	204,558,000	
平成21年度第8回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	102,181,000	
平成21年度第10回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	102,275,000	
平成22年度第12回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	102,914,000	
平成23年度第18回愛知県公募公債(7年)	100,000,000	100,531,000	
平成21年度第1回広島県公募公債	100,000,000	101,946,000	
平成20年度第7回埼玉県公募公債	100,000,000	101,473,000	
平成21年度第1回埼玉県公募公債	100,000,000	101,752,000	
平成21年度第2回埼玉県公募公債	100,000,000	101,941,000	

平成21年度第4回埼玉県公募公債	200,000,000	204,096,000	
平成29年度第7回埼玉県公募公債(5年)	400,000,000	399,624,000	
平成20年度第10回福岡県公募公債	100,000,000	101,493,000	
平成21年度第3回福岡県公募公債	100,000,000	102,298,000	
平成21年度第8回福岡県公募公債	100,000,000	102,406,000	
平成25年度第5回福岡県公募公債	300,000,000	300,393,000	
平成25年度第11回福岡県公募公債	100,000,000	103,740,000	
平成25年度第12回福岡県公募公債	100,000,000	100,136,000	
平成26年度第4回福岡県公募公債	100,000,000	100,159,000	
平成26年度第10回福岡県公募公債	100,000,000	102,487,000	
平成20年度第8回千葉県公募公債	100,000,000	101,469,000	
平成21年度第2回千葉県公募公債	345,000,000	351,655,050	
平成21年度第6回千葉県公募公債	100,000,000	102,195,000	
第9回群馬県公募公債(10年)	100,000,000	103,619,000	
平成21年度第1回岐阜県公募公債(10年)	200,000,000	204,434,000	
第67回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,998,000	
第68回共同発行市場公募地方債	250,000,000	253,135,000	
第69回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,294,000	
第73回共同発行市場公募地方債	400,000,000	407,320,000	
第74回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,929,000	
第75回共同発行市場公募地方債	900,000,000	919,422,000	
第76回共同発行市場公募地方債	300,000,000	305,841,000	
第77回共同発行市場公募地方債	300,000,000	306,798,000	
第79回共同発行市場公募地方債	200,000,000	204,378,000	
第81回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,369,000	
第82回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,668,000	
第91回共同発行市場公募地方債	300,000,000	306,933,000	
第110回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,637,000	
第111回共同発行市場公募地方債	300,000,000	311,121,000	
第112回共同発行市場公募地方債	150,000,000	155,337,000	
第115回共同発行市場公募地方債	600,000,000	621,300,000	
第118回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,912,000	
第137回共同発行市場公募地方債	200,000,000	206,208,000	
平成21年度第4回大阪市公募公債	300,000,000	307,122,000	
平成26年度第2回大阪市公募公債(5年)	200,000,000	200,452,000	
第1回名古屋市公募公債(20年)	200,000,000	222,372,000	

	第3回名古屋市公募公債(20年)	100,000,000	114,007,000	
	第467回名古屋市公募公債(10年)	100,000,000	102,109,000	
	第1回京都市公募公債(7年)	300,000,000	301,800,000	
	第1回京都市公募公債(30年)	100,000,000	133,346,000	
	第7回京都市公募公債(20年)	100,000,000	121,967,000	
	平成26年度第1回京都市公募公債	100,000,000	100,188,000	
	平成26年度第17回神戸市公募公債	100,000,000	101,254,000	
	第4回横浜市公募公債(20年)	100,000,000	113,641,000	
	第9回横浜市公募公債(20年)	100,000,000	118,193,000	
	第14回横浜市公募公債(20年)	100,000,000	120,756,000	
	平成20年度第6回横浜市公募公債	200,000,000	202,920,000	
	平成25年度第1回横浜市公債「八マ債5」	100,000,000	100,031,000	
	平成25年度第11回札幌市公募公債(5年)	100,000,000	100,177,000	
	平成26年度第4回札幌市公募公債(10年)	100,000,000	102,872,000	
	第2回川崎市15年公募公債	100,000,000	103,724,000	
	第4回川崎市15年公募公債	100,000,000	107,941,000	
	平成20年度第5回福岡市公募公債	100,000,000	101,041,000	
	平成23年度第9回福岡市公募公債	147,000,000	152,869,710	
	平成25年度第5回福岡市公募公債(5年)	100,000,000	100,178,000	
	平成21年度第1回千葉市公募公債	200,000,000	203,670,000	
地方債証券合計		18,403,200,000	19,316,624,612	
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	101,218,000	
	第2回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	200,000,000	202,358,000	
	第3回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	200,000,000	224,278,000	
	第5回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	101,639,000	
	第9回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	102,647,000	
	第15回政府保証日本政策投資銀行債券	100,000,000	107,778,000	
	第20回政府保証日本政策投資銀行債券	100,000,000	109,740,000	
	第23回政府保証日本政策投資銀行債券	400,000,000	403,248,000	
	第27回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	100,411,000	
	第36回日本政策投資銀行債券	100,000,000	118,368,000	
	第51回日本政策投資銀行債券	100,000,000	100,609,000	
	第2回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	315,627,000	
	第7回道路債券	100,000,000	111,382,000	
	第8回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	118,216,000	

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	105,979,000	
第9回道路債券	100,000,000	133,449,000	
第18回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	147,633,000	
第22回日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	428,304,000	
第42回道路債券	100,000,000	114,666,000	
第42回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,353,000	
第47回日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	245,708,000	
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	202,266,000	
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	101,258,000	
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	202,420,000	
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	240,838,000	
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	130,668,000	
第89回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1,251,000,000	1,277,708,850	
第90回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	362,400,000	
第95回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,277,000	
第98回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	159,000,000	163,119,690	
第99回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	122,269,000	
第103回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1,500,000,000	1,541,445,000	
第104回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	309,408,000	
第107回日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	313,368,000	
第120回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,493,000	
第120回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,745,000	
第340回政府保証道路債券	100,000,000	103,784,000	
第1回政府保証地方公営企業等金融機構債券	300,000,000	303,198,000	
第1回政府保証地方公共団体金融機構債券	300,000,000	306,015,000	

第1回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,217,000	
第2回政府保証地方公共団体金融機構債券	200,000,000	203,966,000	
第2回地方公営企業等金融機構債券(20年)	100,000,000	121,527,000	
第3回政府保証地方公営企業等金融機構債券	100,000,000	101,167,000	
第3回公営企業債券(20年)	100,000,000	104,785,000	
第3回地方公共団体金融機構債券	300,000,000	307,104,000	
第4回政府保証地方公営企業等金融機構債券	100,000,000	101,226,000	
第4回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,073,000	
第5回政府保証地方公営企業等金融機構債券	100,000,000	101,322,000	
第5回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,033,000	
第5回公営企業債券(20年)	100,000,000	111,191,000	
第6回政府保証地方公営企業等金融機構債券	100,000,000	101,411,000	
第6回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	205,344,000	
第7回政府保証地方公営企業等金融機構債券	500,000,000	508,195,000	
第8回政府保証地方公共団体金融機構債券	129,000,000	132,289,500	
第8回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,213,000	
第11回公営企業債券(20年)	100,000,000	113,909,000	
第11回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,169,000	
第14回政府保証地方公共団体金融機構債券(6年)	200,000,000	201,064,000	
第14回地方公共団体金融機構債券(5年)	200,000,000	200,326,000	
第16回政府保証地方公共団体金融機構債券	201,000,000	206,320,470	
第16回公営企業債券(20年)	100,000,000	115,046,000	
第17回公営企業債券(20年)	100,000,000	117,769,000	
第18回公営企業債券(20年)	100,000,000	119,791,000	
第22回公営企業債券(20年)	100,000,000	119,303,000	
第24回公営企業債券(20年)	200,000,000	240,382,000	
第42回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,502,000	
第45回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	207,272,000	
第61回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,570,000	
第63回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,942,000	
第65回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,705,000	
第67回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,862,000	
F74回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,704,000	
第15回首都高速道路株式会社社債	100,000,000	100,477,000	
第11回阪神高速道路株式会社社債	200,000,000	200,522,000	

第 3 4 回株式会社日本政策金融公庫社債	200,000,000	200,124,000	
第 1 9 回都市再生債券	100,000,000	100,165,000	
第 7 回本州四国連絡橋債券	100,000,000	115,345,000	
第 3 3 2 回東京交通債券	100,000,000	104,638,000	
第 3 4 2 回東京交通債券	100,000,000	109,974,000	
第 1 3 回関西国際空港株式会社社債	100,000,000	101,001,000	
第 1 6 回関西国際空港株式会社社債	100,000,000	101,539,000	
第 5 1 回政府保証関西国際空港債券	100,000,000	109,585,000	
第 1 7 回独立行政法人福祉医療機構債券	100,000,000	100,658,000	
第 1 9 9 回政府保証預金保険機構債	300,000,000	300,252,000	
第 2 0 1 回政府保証預金保険機構債	200,000,000	200,248,000	
第 2 0 3 回政府保証預金保険機構債	600,000,000	601,482,000	
第 2 0 8 回政府保証預金保険機構債	600,000,000	602,052,000	
第 2 0 9 回政府保証預金保険機構債	600,000,000	602,106,000	
第 1 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	20,030,000	20,068,858	
第 3 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	10,096,000	10,116,999	
第 3 回貸付債権担保 S 種住宅金融公庫債券	15,007,000	15,627,989	
第 4 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	10,636,000	10,731,617	
第 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	18,745,000	19,897,817	
第 5 回貸付債権担保 S 種住宅金融公庫債券	15,464,000	16,080,240	
第 6 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	24,018,000	24,584,584	
第 7 回貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券	19,808,000	21,056,498	
第 8 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	11,981,000	12,215,827	
第 9 回貸付債権担保 S 種住宅金融公庫債券	34,034,000	36,038,602	
第 9 回貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券	20,031,000	21,361,459	
第 1 0 回貸付債権担保 S 種住宅金融公庫債券	52,311,000	55,484,708	
第 1 0 回貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券	19,533,000	20,610,830	
第 1 1 回貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券	20,726,000	22,026,141	
第 1 2 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	13,603,000	14,002,656	
第 1 4 回貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券	21,479,000	22,118,859	
第 1 4 回一般担保住宅金融支援機構債券	200,000,000	200,298,000	
第 1 7 回貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券	48,670,000	50,449,861	
第 1 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	26,437,000	28,339,142	

第2 1 回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	101,117,000	
第2 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	54,724,000	59,352,008	
第2 5 回一般担保住宅金融支援機構債券	200,000,000	202,776,000	
第2 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	83,232,000	89,719,934	
第2 7 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	29,655,000	31,874,380	
第2 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	33,140,000	35,567,505	
第2 9 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	16,695,000	17,351,948	
第2 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	35,843,000	38,451,295	
第3 0 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	35,180,000	37,694,666	
第3 2 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	18,964,000	19,715,164	
第3 2 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	70,030,000	74,637,273	
第3 5 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	19,521,000	20,409,400	
第3 5 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	38,857,000	41,336,853	
第3 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	39,657,000	42,067,749	
第3 9 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	17,810,000	18,603,791	
第4 1 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	19,283,000	20,374,032	
第4 3 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	36,492,000	38,834,056	
第4 3 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	50,814,000	53,828,794	
第4 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	43,331,000	46,242,843	
第4 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	81,614,000	87,196,397	
第4 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	40,057,000	42,559,360	
第5 1 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	17,107,000	18,095,784	
第5 1 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	87,746,000	92,970,396	
第5 2 回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	119,658,000	
第5 3 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	18,564,000	19,648,323	
第5 5 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	110,814,000	116,661,654	
第5 7 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	52,890,000	55,729,135	
第5 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	55,770,000	58,686,213	
第5 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	108,396,000	114,254,803	
第6 0 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	170,001,000	178,373,549	
第6 1 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	54,536,000	57,068,106	
第6 7 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	61,005,000	63,437,879	
第6 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	125,070,000	131,371,026	
第7 0 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	112,282,000	117,562,622	
第7 3 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	62,449,000	65,735,066	
第9 5 回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	104,105,000	

第99回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	84,284,000	86,948,217	
第123回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	98,212,000	98,661,810	
第124回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	98,544,000	98,670,136	
第125回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	98,869,000	98,982,699	
第127回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	99,477,000	99,387,470	
第128回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	99,866,000	99,934,907	
第129回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	100,344,000	
第130回一般担保住宅金融支援機構債券	200,000,000	236,670,000	
第1回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	35,672,000	37,566,539	
第2回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	37,880,000	40,104,313	
第3回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	18,467,000	19,650,365	
第6回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	18,295,000	19,302,322	
第5回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	37,850,000	40,058,169	
い第758号商工債	100,000,000	100,142,000	
い第768号農林債	100,000,000	100,316,000	
第281回信金中金債(5年)	100,000,000	100,042,000	
第283回信金中金債(5年)	100,000,000	100,115,000	
第291回信金中金債(5年)	100,000,000	100,205,000	
第293回信金中金債(5年)	100,000,000	100,235,000	
第297回信金中金債(5年)	200,000,000	200,394,000	
第301回信金中金債(5年)	300,000,000	300,966,000	
第181号商工債(3年)	100,000,000	100,001,000	
第183号商工債(3年)	500,000,000	500,070,000	
第185号商工債(3年)	200,000,000	200,048,000	
第197号商工債(3年)	200,000,000	199,770,000	
第12回国際協力機構債券	100,000,000	103,611,000	
第15回政府保証東日本高速道路債券	100,000,000	101,347,000	
第28回東日本高速道路株式会社社債	100,000,000	100,415,000	
第35回東日本高速道路株式会社社債	200,000,000	200,306,000	
第5回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	101,083,000	
第6回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	101,437,000	
第25回政府保証中日本高速道路債券	200,000,000	204,010,000	
第45回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	103,645,000	
第19回政府保証西日本高速道路債券	100,000,000	101,643,000	
第20回西日本高速道路株式会社社債	100,000,000	103,429,000	
第22回西日本高速道路株式会社社債	100,000,000	103,576,000	

	第23回西日本高速道路株式会社社債	100,000,000	102,744,000	
特殊債券合計		24,471,554,000	25,660,169,148	
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	200,386,000	
	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	200,370,000	
	第13回大和ハウス工業株式会社無担保社債	100,000,000	99,905,000	
	第10回アサヒグループホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	100,043,000	
	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	102,112,000	
	第30回東レ株式会社無担保社債	100,000,000	99,143,000	
	第56回住友化学株式会社無担保社債	200,000,000	199,070,000	
	第4回花王株式会社無担保社債	100,000,000	101,142,000	
	第3回新日鐵住金株式会社無担保社債	100,000,000	99,939,000	
	第16回株式会社日立製作所無担保社債	100,000,000	103,226,000	
	第44回三菱電機株式会社無担保社債	100,000,000	100,177,000	
	第36回富士通株式会社無担保社債	100,000,000	101,257,000	
	第12回パナソニック株式会社無担保社債	200,000,000	201,160,000	
	第13回パナソニック株式会社無担保社債	200,000,000	203,016,000	
	第1回日本生命2012基金特定目的会社特定社債	100,000,000	100,353,000	
	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	100,340,000	
	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	100,420,000	
	第1回ユニー・ファミリーマートホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	100,100,000	
	第63回三井物産株式会社無担保社債	100,000,000	117,693,000	
	第47回住友商事株式会社無担保社債	100,000,000	103,172,000	
	第3回株式会社みずほコーポレート銀行無担保社債	100,000,000	100,066,000	
	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	120,986,000	
	第25回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	300,000,000	309,459,000	

第110回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	100,000,000	102,372,000	
株式会社三井住友フィナンシャル第1回無担保社債	100,000,000	102,218,000	
第4回株式会社りそな銀行無担保社債	100,000,000	103,466,000	
第9回三菱UFJ信託銀行株式会社無担保社債	100,000,000	104,598,000	
第8回住友信託銀行株式会社無担保社債	100,000,000	117,897,000	
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	102,825,000	
第20回株式会社三井住友銀行無担保社債	200,000,000	205,924,000	
第24回株式会社三井住友銀行無担保社債	100,000,000	104,472,000	
第9回株式会社みずほ銀行無担保社債	100,000,000	118,251,000	
第17回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	104,521,000	
第53回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	100,054,000	
第54回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	100,889,000	
第70回日立キャピタル株式会社無担保社債	100,000,000	99,976,000	
第48回三菱UFJリース株式会社無担保社債	100,000,000	99,882,000	
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	103,580,000	
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	200,018,000	
第58回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	131,068,000	
第38回京王電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	99,709,000	
第15回東日本旅客鉄道株式会社社債	100,000,000	106,579,000	
第34回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	114,972,000	
第110回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	119,316,000	
第41回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	119,801,000	
第42回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	200,000,000	243,236,000	
第528回東京電力株式会社社債	100,000,000	102,278,000	
第537回東京電力株式会社社債	100,000,000	103,191,000	
第544回東京電力株式会社社債	100,000,000	100,649,000	
第547回東京電力株式会社社債	100,000,000	104,105,000	
第507回中部電力株式会社社債	100,000,000	102,148,000	
第518回中部電力株式会社社債	100,000,000	99,975,000	

第467回関西電力株式会社社債	100,000,000	100,976,000	
第512回関西電力株式会社社債	100,000,000	99,921,000	
第308回北陸電力株式会社社債	100,000,000	103,266,000	
第471回東北電力株式会社社債	100,000,000	105,168,000	
第472回東北電力株式会社社債	100,000,000	103,953,000	
第476回東北電力株式会社社債	100,000,000	101,742,000	
第253回四国電力株式会社社債	100,000,000	104,172,000	
第328回北海道電力株式会社社債	100,000,000	100,828,000	
第11回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	112,128,000	
第18回大阪瓦斯株式会社無担保社債	200,000,000	213,076,000	
第27回東邦瓦斯株式会社無担保社債	100,000,000	104,916,000	
社債券合計	7,600,000,000	7,932,157,000	
合計		205,658,035,880	

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29年 2月20日現在）	（平成30年 2月19日現在）
資産の部		
流動資産		
預金	1,276,386,108	3,002,495,686
コール・ローン	184,404,868	325,047,162
株式	205,761,661,640	168,487,900,344
投資証券	5,313,704,577	3,697,373,584
派生商品評価勘定	61,997,675	119,615,357
未収入金	2,137,113,312	47,679
未収配当金	322,939,923	268,685,795
差入委託証拠金	1,576,414,906	2,233,969,543
流動資産合計	216,634,623,009	178,135,135,150
資産合計	216,634,623,009	178,135,135,150
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	3,950,426	100,663,806
前受金	53,248,749	19,927,751
未払金	17,108,010	-
未払解約金	532,193,674	58,239,069
未払利息	454	913
その他未払費用	2,105	1,581
流動負債合計	606,503,418	178,833,120

	(平成29年 2月20日現在)	(平成30年 2月19日現在)
負債合計	606,503,418	178,833,120
純資産の部		
元本等		
元本	72,540,837,139	53,426,368,221
剰余金		
剰余金又は欠損金()	143,487,282,452	124,529,933,809
元本等合計	216,028,119,591	177,956,302,030
純資産合計	216,028,119,591	177,956,302,030
負債純資産合計	216,634,623,009	178,135,135,150

注記表

(重要な会計方針の注記)

項目	自平成29年 2月21日 至平成30年 2月19日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式、投資証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額(ただし、売気配相場は使用しない)、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1) 先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場によっております。</p> <p>(2) 為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金の計上基準 受取配当金は原則として、配当落ち日において、確定配当金額または予想配当金額を計上しております。なお、配当金額が未確定の場合は、入金日基準で計上しております。</p>
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建資産等の会計処理 「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

項目	(平成29年 2月20日現在)	(平成30年 2月19日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	72,540,837,139口	53,426,368,221口
2. 1単位当たり純資産の額	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)	1口当たり純資産額 3.3309円 (10,000口当たりの純資産額 33,309円)

(金融商品に関する注記)

. 金融商品の状況に関する事項

項目	自平成29年 2月21日 至平成30年 2月19日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、株式、投資証券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。 当計算期間については、先物取引、為替予約取引を行っております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>

3.金融商品に係るリスク管理体制	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する委員会をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用グループに是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用グループは、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。その後、当該関連運用グループの対処の実施や対処方針の決定等に関し、必要に応じてリスク管理を行う部署が当該部署の担当役員、当該関連運用グループの担当役員およびリスク管理委員会へ報告を行う体制となっております。</p> <p>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する部会にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。</p>
4.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<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30年 2月19日現在)
1.貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	<p>(1) 有価証券（株式、投資証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

（デリバティブ取引に関する注記）

（平成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

（平成30年 2月19日現在）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

（単位：円）

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				

市場取引以 外の取引	買建	5,755,889,225	-	5,775,816,976	19,927,751
	SPMINI 1803	3,946,756,893	-	3,997,544,375	50,787,482
	DJ EUR 1803	1,115,064,267	-	1,095,064,713	19,999,554
	FTSE 1803	419,557,411	-	411,776,937	7,780,474
	SPI200 1803	274,510,654	-	271,430,951	3,079,703
	為替予約取引				
	買建	188,435,900	-	187,459,700	976,200
	米ドル	130,320,400	-	129,673,800	646,600
	カナダドル	9,399,500	-	9,333,500	66,000
	ユーロ	26,608,000	-	26,416,000	192,000
	英ポンド	13,463,100	-	13,434,300	28,800
	スイスフラン	4,601,200	-	4,584,000	17,200
	スウェーデンクローナ	537,200	-	534,400	2,800
	デンマーククローネ	1,428,800	-	1,418,400	10,400
	香港ドル	1,774,500	-	1,765,400	9,100
	イスラエルシケル	303,200	-	299,900	3,300
	合計	5,944,325,125	-	5,963,276,676	18,951,551

(注) 1. 時価の算定方法

(1) 株価指数先物取引の時価の算定方法について

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

2) 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

(2) 為替予約取引の時価の算定方法について

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

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

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

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

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

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

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

自 平成29年 2月21日

至 平成30年 2月19日

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

(その他の注記)

(平成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・DC外国株式インデックスファンドS	10,171,434,808円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	222,527,707円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	904,071,965円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	612,291,185円
SMAM・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・DCターゲットイヤーファンド2020(4資産タイプ)	3,182,251円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2025(4資産タイプ)	8,454,317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)	26,099,614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)	31,279,641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)	17,659,381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)	45,909,530円
外国株式指数ファンド	414,156,103円
三井住友・DC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・DCターゲットイヤーファンド2050	2,436,348円
SMAM・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VA(安定運用型) <適格機関投資家限定>	25,365,764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>	3,457,913,739円
SMAM・バランスファンドVA25 <適格機関投資家専用>	2,799,258,611円
SMAM・バランスファンドVA37.5 <適格機関投資家専用>	2,258,676,680円
SMAM・バランスファンドVA50 <適格機関投資家専用>	9,432,240,660円
SMAM・バランスファンドVL30 <適格機関投資家限定>	26,312,223円
SMAM・バランスファンドVL50 <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VA <適格機関投資家限定>	6,971,402円
SMAM・バランスファンドVA75 <適格機関投資家専用>	1,141,544,224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>	89,828,826円
SMAM・インデックス・バランスVA25 <適格機関投資家専用>	250,127,294円
SMAM・インデックス・バランスVA50 <適格機関投資家専用>	1,144,822,081円
SMAM・バランスファンドVA40 <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

(平成30年 2月19日現在)

開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	72,540,837,139円
同期中における追加設定元本額	6,255,320,431円
同期中における一部解約元本額	25,369,789,349円
平成30年 2月19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	11,984,088,205円
三井住友・ D C 年金バランス 3 0 (債券重点型)	240,357,105円
三井住友・ D C 年金バランス 5 0 (標準型)	1,036,536,616円
三井住友・ D C 年金バランス 7 0 (株式重点型)	719,814,382円
S M A M ・ グローバルバランスファンド (機動的資産配分型)	36,388,028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)	2,795,730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)	8,416,527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)	24,109,774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)	33,758,474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)	20,202,545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)	58,432,719円
外国株式指数ファンド	452,077,993円
三井住友・ D C つみたて N I S A ・ 全海外株インデックスファンド	1,703,586,717円

アセットアロケーション・ファンド(安定型)	537,094,764円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	569,058,002円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	496,687,646円
イオン・バランス戦略ファンド	8,698,025円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2050	2,541,548円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	207,870円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	932,965円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	8,365,362円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	8,252,508円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	35,740,203円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	2,292,138円
SMAM・外国株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	3,046,669,445円
バランスファンドVA(安定運用型)〈適格機関投資家限定〉	11,610,453円
SMAM・バランスファンドVA安定成長型〈適格機関投資家限定〉	1,095,506,494円
SMAM・バランスファンドVA25〈適格機関投資家専用〉	2,086,118,836円
SMAM・バランスファンドVA37.5〈適格機関投資家専用〉	1,807,060,950円
SMAM・バランスファンドVA50〈適格機関投資家専用〉	7,539,902,334円
SMAM・バランスファンドVL30〈適格機関投資家限定〉	21,950,718円
SMAM・バランスファンドVL50〈適格機関投資家限定〉	122,627,962円
世界6資産バランスファンドVA〈適格機関投資家限定〉	762,731円
SMAM・バランスファンドVA75〈適格機関投資家専用〉	972,819,415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〉	69,727,754円
SMAM・インデックス・バランスVA25〈適格機関投資家専用〉	207,996,980円
SMAM・インデックス・バランスVA50〈適格機関投資家専用〉	915,278,826円
SMAM・バランスファンドVA40〈適格機関投資家専用〉	982,941,677円
SMAM・バランスファンドVA35〈適格機関投資家専用〉	1,972,912,610円
SMAM・バランスVA株40T〈適格機関投資家限定〉	45,830,591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)	877,737,730円
三井住友・5資産バランスファンド・VAS(適格機関投資家専用)	1,148,512,276円
SMAM・グローバルバランス40VA〈適格機関投資家限定〉	170,861,880円
SMAM・バランスファンドVA20〈適格機関投資家専用〉	87,167,435円
三井住友・7資産バランスファンド・VAS(適格機関投資家専用)	1,347,887,519円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A〈適格機関投資家専用〉	28,207,014円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A〈適格機関投資家専用〉	14,896,852円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A〈適格機関投資家専用〉	7,880,402円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L〈適格機関投資家専用〉	55,314,095円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L〈適格機関投資家専用〉	135,049,724円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T〈適格機関投資家専用〉	131,160,163円
SMAM・グローバルバランスファンド(標準型)VA〈適格機関投資家限定〉	1,479,212,088円
SMAM・グローバルバランスファンド(債券重視型)VA〈適格機関投資家限定〉	213,997,375円
SMAM・世界バランスファンドVA〈適格機関投資家限定〉	7,536,838,119円
SMAM・世界バランスファンドVA2〈適格機関投資家限定〉	947,525,425円
SMAM・外国株式インデックスファンドSA〈適格機関投資家限定〉	57,073,242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〉	200,729円
SMAM・マルチアセットストラテジーファンド2016-04〈適格機関投資家限定〉	121,220,223円
SMAM・マルチアセットストラテジーファンド2016-05〈適格機関投資家限定〉	58,079,809円
SMAM・マルチアセットストラテジー・オープン〈適格機関投資家限定〉	117,363,065円

SMAM・マルチアセット・ダイナミックアロケーション・ストラテジー・ファンド<適格機関投資家限定>	29,434円
合計	53,426,368,221円

附属明細表

有価証券明細表

(a) 株式

通貨	銘柄	株数	評価額		備考
			単価	金額	
米ドル	ANADARKO PETROLEUM CORP	24,280	59.18	1,436,890.40	
	ANDEAVOR	6,701	96.15	644,301.15	
	ANTERO RESOURCES CORP	9,233	18.93	174,780.69	
	APACHE CORPORATION	16,399	38.11	624,965.89	
	BAKER HUGHES A GE CO	16,513	26.53	438,089.89	
	CABOT OIL & GAS CORPORATION	19,632	23.89	469,008.48	
	CHENIERE ENERGY INC	8,184	57.64	471,725.76	
	CHEVRON CORPORATION	82,111	112.14	9,207,927.54	
	CIMAREX ENERGY CO	4,080	98.73	402,818.40	
	CONCHO RESOURCES INC	6,589	146.52	965,420.28	
	CONOCOPHILLIPS	52,158	54.65	2,850,434.70	
	CONTINENTAL RESOURCES, INC.	4,535	53.33	241,851.55	
	DEVON ENERGY CORPORATION	22,056	34.11	752,330.16	
	DIAMONDBACK ENERGY INC	3,558	123.88	440,765.04	
	EOG RESOURCES INC	25,021	107.64	2,693,260.44	
	EQT CORPORATION	11,310	52.55	594,340.50	
	EXXON MOBIL CORPORATION	183,595	76.54	14,052,361.30	
	HALLIBURTON CO	37,125	47.50	1,763,437.50	
	HELMERICH & PAYNE INC	5,249	65.46	343,599.54	
	HESS CORPORATION	12,398	45.65	565,968.70	
	HOLLYFRONTIER CORP	6,601	46.40	306,286.40	
	KINDER MORGAN INC	85,839	17.06	1,464,413.34	
	MARATHON OIL CORP	36,817	15.65	576,186.05	
	MARATHON PETROLEUM CORPORATION	21,936	67.93	1,490,112.48	
	NATIONAL-OILWELL VARCO INC.	16,848	35.61	599,957.28	
	NEWFIELD EXPLORATION CO	8,254	25.90	213,778.60	
	NOBLE ENERGY INC	20,924	26.28	549,882.72	
	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	32,673	68.16	2,226,991.68	
ONEOK INC	16,822	56.91	957,340.02		
PARSLEY ENERGY INC-CLASS A	9,208	23.46	216,019.68		
PHILLIPS 66	19,267	91.99	1,772,371.33		

PIONEER NATURAL RESOURCES CO	7,478	178.79	1,336,991.62
PLAINS GP HOLDINGS LP-CL A	7,806	22.11	172,590.66
RANGE RESOURCES CORPORATION	12,946	13.28	171,922.88
SCHLUMBERGER LTD	60,206	66.28	3,990,453.68
TARGA RESOURCES CORP	8,672	47.91	415,475.52
TECHNIPFMC PLC	18,187	29.61	538,517.07
VALERO ENERGY CORP	19,549	93.27	1,823,335.23
WILLIAMS COS INC	34,757	28.91	1,004,824.87
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	9,243	163.63	1,512,432.09
ALBEMARLE CORPORATION	5,093	112.24	571,638.32
ARCONIC INC	16,751	25.36	424,805.36
AVERY DENNISON CORP	3,941	118.80	468,190.80
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	10,777	30.56	329,345.12
BALL CORPORATION	13,670	39.62	541,605.40
CELANESE CORPORATION	5,647	102.49	578,761.03
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	10,139	40.36	409,210.04
CHEMOURS CO	8,067	48.84	393,992.28
CROWN HOLDINGS INC	5,272	51.50	271,508.00
DOWDUPONT INC	100,775	71.95	7,250,761.25
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	5,956	100.13	596,374.28
ECOLAB INC	11,046	131.49	1,452,438.54
FMC CORPORATION	5,698	83.35	474,928.30
FREEMONT-MCMORAN INC	60,238	18.73	1,128,257.74
INTERNATIONAL PAPER CO	17,131	58.94	1,009,701.14
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	3,501	141.83	496,546.83
LYONDELLBASELL INDU-CL A	14,870	108.61	1,615,030.70
MARTIN MARIETTA MATERIALS	2,577	216.25	557,276.25
MONSANTO CO	19,036	120.79	2,299,358.44
MOSAIC CO/THE	15,550	25.43	395,436.50
NEWMONT MINING CORP	23,519	39.11	919,828.09
NUCOR CORP	14,127	68.54	968,264.58
PACKAGING CORP OF AMERICA	4,046	119.37	482,971.02
PPG INDUSTRIES INC	11,270	116.16	1,309,123.20
PRAXAIR INC	12,183	153.61	1,871,430.63
SEALED AIR CORP	9,198	42.66	392,386.68
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	3,564	402.30	1,433,797.20
STEEL DYNAMICS, INC.	10,191	49.40	503,435.40
VULCAN MATERIALS CO	5,483	126.57	693,983.31
WESTROCK CO	11,330	66.32	751,405.60
WR GRACE & CO	3,500	67.45	236,075.00
3M COMPANY	25,858	236.67	6,119,812.86
ACUITY BRANDS INC	1,884	151.14	284,747.76

AERCAP HOLDINGS NV	6,145	51.96	319,294.20
AGCO CORP	2,297	67.08	154,082.76
ALLEGION PLC	4,545	82.72	375,962.40
AMETEK INC	10,396	76.55	795,813.80
BOEING CO	24,285	355.04	8,622,146.40
CATERPILLAR INC	25,607	156.29	4,002,118.03
CUMMINS INC	6,990	165.60	1,157,544.00
DANAHER CORP	26,756	97.54	2,609,780.24
DEERE & CO	11,636	169.44	1,971,603.84
DOVER CORP	6,689	101.21	676,993.69
EATON CORP PLC	18,883	82.79	1,563,323.57
EMERSON ELECTRIC CO	27,270	72.99	1,990,437.30
FASTENAL COMPANY	12,895	54.75	706,001.25
FLOWSERVE CORPORATION	6,566	44.05	289,232.30
FLUOR CORP	5,677	57.63	327,165.51
FORTIVE CORP	13,617	75.65	1,030,126.05
GENERAL DYNAMICS CORP	11,029	224.19	2,472,591.51
GENERAL ELECTRIC CO	375,150	15.05	5,646,007.50
HD SUPPLY HOLDINGS INC	9,689	36.24	351,129.36
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	31,097	154.03	4,789,870.91
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES	1,832	265.70	486,762.40
IDEX CORP	3,078	137.35	422,763.30
ILLINOIS TOOL WORKS	13,226	162.55	2,149,886.30
INGERSOLL-RAND PLC	11,061	91.03	1,006,882.83
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	4,922	63.19	311,021.18
JARDINE MATHESON HOLDINGS LIMITED	9,400	61.98	582,612.00
JARDINE STRATEGIC HOLDINGS LIMITED	9,100	38.33	348,803.00
L3 TECHNOLOGIES INC	3,361	212.89	715,523.29
LENNOX INTERNATIONAL INC	1,823	205.74	375,064.02
LOCKHEED MARTIN CORPORATION	11,139	360.53	4,015,943.67
MASCO CORP	14,295	43.21	617,686.95
MIDDLEBY CORP	2,764	135.00	373,140.00
NORTHROP GRUMMAN CORP	7,169	356.00	2,552,164.00
OWENS CORNING	4,859	87.44	424,870.96
PACCAR INC	15,381	68.78	1,057,905.18
PARKER HANNIFIN CORPORATION	5,939	183.22	1,088,143.58
PENTAIR PLC-REGISTERED	7,006	70.83	496,234.98
RAYTHEON COMPANY	12,577	217.73	2,738,390.21
ROCKWELL AUTOMATION INC	5,618	185.56	1,042,476.08
ROCKWELL COLLINS INC	6,805	135.92	924,935.60
ROPER TECHNOLOGIES INC	4,481	276.31	1,238,145.11
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	8,127	53.86	437,720.22

SNAP-ON INC	2,448	160.88	393,834.24
SPIRIT AEROSYSTEMS HOLD CL A	5,166	92.35	477,080.10
STANLEY BLACK & DECKER INC	6,437	159.77	1,028,439.49
TEXTRON INC	12,033	60.33	725,950.89
TRANSDIGM GROUP INC	2,341	298.35	698,437.35
UNITED RENTALS INC	3,677	168.02	617,809.54
UNITED TECHNOLOGIES CORP	32,639	129.26	4,218,917.14
WABTEC CORP	4,279	77.27	330,638.33
WW GRAINGER INC	2,422	266.68	645,898.96
XYLEM INC	7,965	75.23	599,206.95
CINTAS CORP	4,082	167.12	682,183.84
EQUIFAX INC	5,368	117.46	630,525.28
IHS MARKIT LTD	18,255	46.77	853,786.35
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	39,553	38.42	1,519,626.26
MANPOWERGROUP	3,240	121.92	395,020.80
NIELSEN HOLDINGS PLC	15,136	33.68	509,780.48
REPUBLIC SERVICES INC	9,721	65.14	633,225.94
ROBERT HALF INTL INC	5,854	56.20	328,994.80
ROLLINS INC	4,301	49.89	214,576.89
STERICYCLE, INC.	4,280	76.02	325,365.60
TRANSUNION	6,673	58.45	390,036.85
VERISK ANALYTICS INC	7,039	98.79	695,382.81
WASTE CONNECTIONS INC	10,953	70.93	776,896.29
WASTE MANAGEMENT INC	18,677	85.15	1,590,346.55
AMERCO	390	349.45	136,285.50
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	5,676	51.58	292,768.08
C.H.ROBINSON WORLDWIDE, INC.	6,063	92.62	561,555.06
CSX CORPORATION	38,972	56.10	2,186,329.20
DELTA AIR LINES INC	7,251	52.85	383,215.35
EXPEDITORS INTL WASH INC	7,961	64.12	510,459.32
FEDEX CORP	10,916	244.19	2,665,578.04
J.B. HUNT TRANSPORT SERVICES INC	3,523	120.58	424,803.34
KANSAS CITY SOUTHERN	4,649	109.01	506,787.49
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	5,115	48.75	249,356.25
MACQUARIE INFRASTRUCTURE CORP	3,832	64.91	248,735.12
NORFOLK SOUTHERN CORP	12,264	142.64	1,749,336.96
OLD DOMINION FREIGHT LINE	2,639	136.64	360,592.96
SOUTHWEST AIRLINES	6,837	58.27	398,391.99
UNION PACIFIC CORP	34,434	134.27	4,623,453.18
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS INC	3,729	66.52	248,053.08
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	29,560	106.40	3,145,184.00
APTIV PLC	11,653	92.40	1,076,737.20

AUTOLIV INC	4,001	145.81	583,385.81
BORGWARNER INC	8,566	52.22	447,316.52
FORD MOTOR COMPANY	160,576	10.61	1,703,711.36
GENERAL MOTORS CO	56,075	41.09	2,304,121.75
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	10,333	29.66	306,476.78
HARLEY-DAVIDSON INC	7,347	47.16	346,484.52
LEAR CORP	3,136	189.57	594,491.52
TESLA INC	5,693	335.49	1,909,944.57
WABCO HOLDINGS INC	2,109	138.01	291,063.09
D.R.HORTON INC	15,658	45.57	713,535.06
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY	6,450	63.82	411,639.00
GARMIN LTD	5,834	65.21	380,435.14
HANESBRANDS INC	17,562	20.49	359,845.38
HASBRO INC	4,566	98.85	451,349.10
LEGGETT & PLATT INC	5,036	45.05	226,871.80
LENNAR CORP-CL A	9,166	60.86	557,842.76
LULULEMON ATHLETICA INC	4,279	81.40	348,310.60
MATTEL INC	14,058	16.55	232,659.90
MICHAEL KORS HOLDINGS LIMITED	7,155	63.90	457,204.50
MOHAWK INDUSTRIES INC	2,863	249.76	715,062.88
NEWELL BRANDS INC	22,542	28.23	636,360.66
NIKE INC -CL B	56,856	68.30	3,883,264.80
NVR INC	143	3,208.23	458,776.89
POLARIS INDUSTRIES INC	2,467	117.76	290,513.92
PULTE GROUP INC	12,930	29.74	384,538.20
PVH CORP	3,303	148.55	490,660.65
RALPH LAUREN CORPORATION	2,646	105.59	279,391.14
SMITH(A.O.) CORP	6,960	65.54	456,158.40
TAPESTRY INC	11,987	50.06	600,069.22
TOLL BROTHERS INC	7,061	47.07	332,361.27
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	11,107	17.36	192,817.52
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	11,448	15.78	180,649.44
VF CORP	14,902	74.64	1,112,285.28
WHIRLPOOL CORP	3,391	172.70	585,625.70
ARAMARK	10,783	41.98	452,670.34
CARNIVAL CORP	15,490	69.50	1,076,555.00
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	995	305.63	304,101.85
DARDEN RESTAURANTS INC	5,372	96.52	518,505.44
DOMINO'S PIZZA INC	1,940	220.74	428,235.60
H&R BLOCK INC	7,820	28.04	219,272.80
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS INC	8,498	83.27	707,628.46
LAS VEGAS SANDS CORP	17,144	75.02	1,286,142.88

MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	13,716	138.50	1,899,666.00
MCDONALD'S CORPORATION	35,097	157.79	5,537,955.63
MELCO RESORTS & ENTERTAINMENET-ADR	11,150	28.14	313,761.00
MGM MIRAGE	20,106	34.47	693,053.82
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDINGS	7,616	59.11	450,181.76
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	7,457	131.68	981,937.76
STARBUCKS CORP	62,564	56.48	3,533,614.72
VAIL RESORTS INC	1,924	216.04	415,660.96
WYNDHAM WORLDWIDE CORP	4,622	121.08	559,631.76
WYNN RESORTS LTD	3,489	164.28	573,172.92
YUM! BRANDS INC	14,192	78.25	1,110,524.00
CBS CORP-CL B	15,692	55.39	869,179.88
CHARTER COMMUNICATTIONS INC-A	8,293	365.66	3,032,418.38
COMCAST CORP-CLASS A	203,426	39.79	8,094,320.54
DISCOVERY COMMUNICATIONS INC-A	7,075	23.86	168,809.50
DISCOVERY COMMUNICATIONS INC-C	7,543	22.65	170,848.95
DISH NETWORK CORP.	9,780	45.69	446,848.20
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	15,544	25.33	393,729.52
LIBERTY BROADBAND-C	4,953	92.18	456,567.54
LIBERTY GLOBAL PLC-A	8,432	33.40	281,628.80
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	23,590	32.27	761,249.30
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	8,568	34.91	299,108.88
LIBERTY SIRIUS GROUP-C	7,648	41.64	318,462.72
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-A	4,141	42.03	174,046.23
LIVE NATION ENTERTAINMENT INC	6,065	46.95	284,751.75
NEWS CORP-CLASS A	16,662	16.26	270,924.12
OMNICOM GROUP	10,146	78.72	798,693.12
SCRIPPS NETWORKS INTERACTIVE	3,502	87.81	307,510.62
SIRIUS XM HOLDINGS INC	68,252	6.11	417,019.72
THE WALT DISNEY CO.	66,879	106.53	7,124,619.87
TIME WARNER INC	33,702	95.37	3,214,159.74
TWENTY-FIRST CE CL-A	44,723	37.46	1,675,323.58
TWENTY-FIRST CE CL-B	19,170	37.04	710,056.80
VIACOM INC-CLASS B	16,489	33.50	552,381.50
ADVANCE AUTO PARTS	3,304	107.57	355,411.28
AMAZON.COM INC	17,670	1,448.69	25,598,352.30
AUTONATION INC	2,851	53.11	151,416.61
AUTOZONE INC	1,219	714.05	870,426.95
BEST BUY COMPANY INC	11,445	73.18	837,545.10
CARMAX INC	7,453	64.43	480,196.79
DOLLAR GENERAL CORP	11,840	97.73	1,157,123.20
DOLLAR TREE INC	10,263	107.96	1,107,993.48

EXPEDIA INC	5,168	103.85	536,696.80
GAP INC/THE	9,218	33.27	306,682.86
GENUINE PARTS CO	6,648	99.83	663,669.84
HOME DEPOT INC	51,078	186.97	9,550,053.66
IAC/INTERACTIVECORP	3,231	149.09	481,709.79
KOHL'S CORP	7,962	65.61	522,386.82
L BRANDS INC	10,675	48.92	522,221.00
LIBERTY INTERACTIVE CORP QVC GROUP-A	18,982	27.95	530,546.90
LKQ CORPORATION	13,945	41.77	582,482.65
LOWE'S COMPANIES INC	36,267	96.31	3,492,874.77
MACY'S INC	13,521	26.26	355,061.46
NETFLIX INC	18,708	278.52	5,210,552.16
NORDSTROM INC	4,756	51.50	244,934.00
O'REILLY AUTOMOTIVE INC NEW	3,687	251.10	925,805.70
PRICELINE GROUP INC/THE	2,126	1,885.00	4,007,510.00
ROSS STORES INC	17,122	80.17	1,372,670.74
TARGET CORP	22,050	75.70	1,669,185.00
TIFFANY & CO	5,367	101.47	544,589.49
TJX COMPANIES INC	27,152	77.88	2,114,597.76
TRACTOR SUPPLY COMPANY	5,278	67.32	355,314.96
TRIPADVISOR INC-W/I	5,813	43.32	251,819.16
ULTA BEAUTY INC	2,623	203.15	532,862.45
COSTCO WHOLESALE CORP	18,830	191.56	3,607,074.80
CVS HEALTH CORPORATION	44,048	71.90	3,167,051.20
KROGER CO	38,882	28.69	1,115,524.58
SYSCO CORP	22,052	60.00	1,323,120.00
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	39,412	70.92	2,795,099.04
WALMART INC	64,408	104.78	6,748,670.24
ALTRIA GROUP INC	82,655	65.46	5,410,596.30
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	25,078	43.13	1,081,614.14
BROWN-FORMAN CORPORATION	9,061	69.58	630,464.38
BUNGE LIMITED	5,968	79.10	472,068.80
CAMPBELL SOUP CO	7,879	46.17	363,773.43
COCA-COLA CO/THE	174,860	44.98	7,865,202.80
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS PLC	9,352	38.97	364,447.44
CONAGRA BRANDS INC	17,122	36.25	620,672.50
CONSTELLATION BRANDS INC-A	7,451	219.45	1,635,121.95
DR.PEPPER SNAPPLE GROUP, INC	8,175	115.12	941,106.00
GENERAL MILLS INC	25,006	56.43	1,411,088.58
HORMEL FOODS CORPORATION	12,443	34.35	427,417.05
INGREDION INC	3,320	131.12	435,318.40
JM SMUCKER CO/THE-NEW COM	4,914	124.46	611,596.44

KELLOGG CO	11,216	69.66	781,306.56
KRAFT HEINZ COMPANY	25,960	70.80	1,837,968.00
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	5,606	105.50	591,433.00
MOLSON COORS BREWING COMPANY	8,674	81.47	706,670.78
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	65,326	44.14	2,883,489.64
MONSTER BEVERAGE CORPORATION	17,233	65.48	1,128,416.84
PEPSICO INC	61,487	111.06	6,828,746.22
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL INC.	67,255	104.31	7,015,369.05
THE HERSHEY COMPANY	6,522	100.71	656,830.62
TYSON FOODS INC-CL A	12,620	76.01	959,246.20
CHURCH & DWIGHT CO INC	11,613	49.78	578,095.14
CLOROX COMPANY	5,583	131.70	735,281.10
COLGATE-PALMOLIVE COMPANY	35,805	71.46	2,558,625.30
COTY INC-CL A	22,574	21.45	484,212.30
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	9,831	141.04	1,386,564.24
KIMBERLY-CLARK CORP	15,309	116.10	1,777,374.90
PROCTER & GAMBLE CO	110,103	82.60	9,094,507.80
SPECTRUM BRANDS HOLDINGS INC	942	102.54	96,592.68
ABBOTT LABORATORIES	74,741	60.17	4,497,165.97
AETNA INC	14,197	178.51	2,534,306.47
ALIGN TECHNOLOGY INC	3,299	251.50	829,698.50
AMERISOURCEBERGEN CORP	7,058	99.40	701,565.20
ANTHEM INC	11,378	235.02	2,674,057.56
BAXTER INTERNATIONAL INC	21,609	66.33	1,433,324.97
BECTON DICKINSON & CO	11,459	222.87	2,553,867.33
BOSTON SCIENTIFIC CORP	59,455	27.20	1,617,176.00
CARDINAL HEALTH INC	13,707	69.34	950,443.38
CENTENE CORP	7,473	100.22	748,944.06
CERNER CORP	13,575	64.22	871,786.50
CIGNA CORP	10,910	193.81	2,114,467.10
COOPER COMPANIES INC (THE)	2,055	232.47	477,725.85
DAVITA INC	6,953	73.65	512,088.45
DENTSPLY SIRONA INC	9,944	58.43	581,027.92
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	9,150	133.82	1,224,453.00
ENVISION HEALTHCARE CORP	6,386	37.70	240,752.20
EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO	25,001	75.23	1,880,825.23
HCA HEALTHCARE INC	12,883	101.00	1,301,183.00
HENRY SCHEIN INC	7,253	69.52	504,228.56
HOLOGIC INC	12,110	39.29	475,801.90
HUMANA INC.	6,262	269.00	1,684,478.00
IDEXX LABORATORIES INC	3,797	182.48	692,876.56
INTUITIVE SURGICAL INC	4,847	415.98	2,016,255.06

LABORATORY CRP OF AMR HLDGS	4,405	177.79	783,164.95
MCKESSON CORP	9,111	150.50	1,371,205.50
MEDTRONIC PLC	58,476	83.31	4,871,635.56
QUEST DIAGNOSTICS	5,910	104.53	617,772.30
RESMED INC	6,572	93.81	616,519.32
STRYKER CORP	14,587	159.87	2,332,023.69
TELEFLEX INC	1,951	267.89	522,653.39
TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES-SP ADR	40,020	20.90	836,418.00
UNITEDHEALTH GROUP INC	41,894	229.37	9,609,226.78
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	3,760	117.90	443,304.00
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	4,120	121.26	499,591.20
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	5,035	59.76	300,891.60
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	8,837	120.48	1,064,681.76
ABBVIE INC	69,072	118.60	8,191,939.20
AGILENT TECHNOLOGIES INC	14,256	71.97	1,026,004.32
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	9,671	120.47	1,165,065.37
ALKERMES PLC	6,413	67.26	431,338.38
ALLERGAN PLC	14,299	164.04	2,345,607.96
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	3,908	122.88	480,215.04
AMGEN INC	31,437	183.55	5,770,261.35
BIOGEN INC	9,161	291.87	2,673,821.07
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	7,516	84.98	638,709.68
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	70,549	68.96	4,865,059.04
CELGENE CORP	33,899	95.26	3,229,218.74
ELI LILLY & CO	42,935	78.97	3,390,576.95
GILEAD SCIENCES INC	56,201	80.70	4,535,420.70
ILLUMINA INC	6,326	229.20	1,449,919.20
INCYTE CORP	7,576	86.03	651,763.28
IQVIA HOLDINGS INC	6,098	101.72	620,288.56
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	2,604	145.76	379,559.04
JOHNSON & JOHNSON	116,070	133.15	15,454,720.50
MERCK & CO. INC.	118,177	56.29	6,652,183.33
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL INC	1,112	634.37	705,419.44
MYLAN NV	19,783	42.14	833,655.62
PERRIGO CO PLC	5,561	89.55	497,987.55
PFIZER INC	257,700	36.26	9,344,202.00
REGENERON PHARMACEUTICALS	3,392	332.15	1,126,652.80
SEATTLE GENETICS INC	4,290	54.48	233,719.20
TESARO INC	1,725	60.00	103,500.00
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	17,187	210.61	3,619,754.07
UNITED THERAPEUTICS CORP	2,169	134.93	292,663.17
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	11,149	160.72	1,791,867.28

WATERS CORP	3,459	206.18	713,176.62
ZOETIS INC	21,193	79.73	1,689,717.89
BANK OF AMERICA CORP	434,276	31.97	13,883,803.72
BB & T CORPORATION	35,783	54.96	1,966,633.68
CIT GROUP INC	5,683	54.05	307,166.15
CITIGROUP INC	118,055	76.82	9,068,985.10
CITIZENS FINANCIAL GROUP	21,812	45.93	1,001,825.16
COMERICA INC	7,688	97.82	752,040.16
EAST WEST BANCORP INC	6,233	66.85	416,676.05
FIFTH THIRD BANCORP	30,937	33.13	1,024,942.81
FIRST REPUBLIC BANK/CA	7,244	95.52	691,946.88
HUNTINGTON BANCSHARES INC	48,927	15.83	774,514.41
JPMORGAN CHASE & CO	152,195	114.68	17,453,722.60
KEYCORP	45,615	21.02	958,827.30
M & T BANK CORP	5,753	191.64	1,102,504.92
NEW YORK COMMUNITY BANCORP	21,911	14.17	310,478.87
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL INC	14,035	19.84	278,454.40
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	20,764	159.08	3,303,137.12
REGIONS FINANCIAL CORPORATION	51,992	19.45	1,011,244.40
SIGNATURE BANK	2,508	154.79	388,213.32
SUNTRUST BANKS INC	20,334	71.15	1,446,764.10
SVB FINANCIAL GROUP	2,333	248.81	580,473.73
US BANCORP	72,481	55.61	4,030,668.41
WELLS FARGO & COMPANY	204,334	59.95	12,249,823.30
ZIONS BANCORPORATION	8,874	55.07	488,691.18
AFFILIATED MANAGERS GROUP	2,602	191.79	499,037.58
ALLY FINANCIAL INC	20,762	28.67	595,246.54
AMERICAN EXPRESS COMPANY	32,558	96.79	3,151,288.82
AMERIPRISE FINANCIAL INC	6,298	159.81	1,006,483.38
BANK OF NEW YORK MELLON CORP(THE)	44,767	56.25	2,518,143.75
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	54,903	203.79	11,188,682.37
BLACKROCK INC	5,231	541.10	2,830,494.10
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	20,634	99.53	2,053,702.02
CBOE GLOBAL MARKETS INC	4,473	111.45	498,515.85
CME GROUP INC.	14,728	162.38	2,391,532.64
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	16,652	79.53	1,324,333.56
E*TRADE FINANCIAL CORPORATION	11,942	51.81	618,715.02
EATON VANCE CORP	5,530	55.91	309,182.30
FIRST DATA CORP-CLASS A	20,984	15.66	328,609.44
FRANKLIN RESOURCES INC	15,511	39.10	606,480.10
GOLDMAN SACHS GROUP INC	15,925	267.62	4,261,848.50
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	25,499	71.73	1,829,043.27

INVESCO LIMITED	18,328	33.92	621,685.76
LEUCADIA NATIONAL CORPORATION	15,290	24.97	381,791.30
MOODY'S CORP	7,529	168.21	1,266,453.09
MORGAN STANLEY	59,685	55.14	3,291,030.90
MSCI INC-A	3,805	145.00	551,725.00
NASDAQ INC	5,343	79.02	422,203.86
NORTHERN TRUST CORP	9,089	104.86	953,072.54
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	5,490	92.56	508,154.40
S&P GLOBAL INC	10,961	189.28	2,074,698.08
SCHWAB (CHARLES) CORP	51,609	52.17	2,692,441.53
SEI INVESTMENTS COMPANY	5,862	73.76	432,381.12
STATE STREET CORP	16,204	104.55	1,694,128.20
SYNCHRONY FINANCIAL	34,462	36.73	1,265,789.26
T ROWE PRICE GROUP INC	10,711	110.49	1,183,458.39
TD AMERITRADE HOLDING CORPORATION	11,079	56.29	623,636.91
AFLAC INC	17,125	89.65	1,535,256.25
ALLEGHANY CORPORATION	735	595.88	437,971.80
ALLSTATE CORP	15,658	95.04	1,488,136.32
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	3,539	112.12	396,792.68
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	38,618	59.47	2,296,612.46
AON PLC	11,356	140.86	1,599,606.16
ARCH CAPITAL GROUP LTD.	5,941	89.86	533,858.26
ARTHUR J GALLAGHER & CO	7,587	68.97	523,275.39
ASSURANT INC	2,198	89.92	197,644.16
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	4,807	49.29	236,937.03
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	3,961	51.47	203,872.67
BRIGHTHOUSE FINANCIAL INC	4,258	56.82	241,939.56
CHUBB LTD	20,167	147.00	2,964,549.00
CINCINNATI FINANCIAL CORP	6,311	77.19	487,146.09
EVEREST RE GROUP LTD	1,650	243.26	401,379.00
FNF GROUP	10,851	39.08	424,057.08
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	15,215	54.14	823,740.10
LINCOLN NATIONAL CORP	9,193	77.58	713,192.94
LOEWS CORPORATION	12,803	50.08	641,174.24
MARKEL CORP	629	1,130.06	710,807.74
MARSH & MCLENNAN COS	22,208	82.76	1,837,934.08
METLIFE INC	39,146	46.64	1,825,769.44
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	12,796	63.05	806,787.80
PROGRESSIVE CORP	25,621	57.35	1,469,364.35
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	18,252	109.43	1,997,316.36
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	2,972	155.51	462,175.72
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	1,504	131.29	197,460.16

TORCHMARK CORPORATION	4,615	86.65	399,889.75
TRAVELERS COS INC(THE)	12,182	141.16	1,719,611.12
UNUM GROUP	9,769	52.45	512,384.05
VOYA FINANCIAL INC	7,528	50.63	381,142.64
W.R.BERKLEY CORPORATION	3,873	69.83	270,451.59
WILLIS TOWERS WATSON PLC	5,339	159.23	850,128.97
XL GROUP LTD	11,562	43.80	506,415.60
CBRE GROUP INC-A	13,193	45.20	596,323.60
CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP	17,990	109.12	1,963,068.80
EQUINIX INC	3,303	403.30	1,332,099.90
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	52,300	6.91	361,393.00
JONES LANG LASALLE INC	2,007	158.23	317,567.61
ACCENTURE PLC-CL A	26,777	162.66	4,355,546.82
ACTIVISION BLIZZARD INC	30,617	70.19	2,149,007.23
ADOBE SYSTEMS INC	21,379	201.56	4,309,151.24
AKAMAI TECHNOLOGIES	8,040	66.89	537,795.60
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	2,222	244.68	543,678.96
ALPHABET INC-CL A	12,893	1,095.50	14,124,281.50
ALPHABET INC-CL C	13,561	1,094.80	14,846,582.80
ANSYS INC	3,662	164.14	601,080.68
AUTODESK INC	8,636	112.95	975,436.20
AUTOMATIC DATA PROCESSING	19,255	116.18	2,237,045.90
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS	5,375	98.78	530,942.50
CA INC	12,753	35.34	450,691.02
CADENCE DESIGN SYS INC	13,205	39.16	517,107.80
CDK GLOBAL INC	5,003	70.25	351,460.75
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES	5,344	103.28	551,928.32
CITRIX SYSTEMS INC	7,019	91.21	640,202.99
COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS CORPORATION	25,175	80.95	2,037,916.25
COSTAR GROUP INC	1,621	350.14	567,576.94
EBAY INC	44,058	43.34	1,909,473.72
ELECTRONIC ARTS INC	13,118	126.02	1,653,130.36
FACEBOOK INC-A	102,530	177.36	18,184,720.80
FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES	14,635	97.82	1,431,595.70
FISERV INC	9,239	142.72	1,318,590.08
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	3,824	198.60	759,446.40
FORTINET INC	6,882	48.95	336,873.90
GARTNER INC	4,011	118.04	473,458.44
GLOBAL PAYMENTS INC	7,016	114.35	802,279.60
INTL BUSINESS MACHINES CORP	38,155	156.18	5,959,047.90
INTUIT INC	10,765	171.69	1,848,242.85
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	3,649	122.08	445,469.92

LEIDOS HOLDINGS INC	6,074	66.42	403,435.08
MASTERCARD INC-CL A	40,915	175.65	7,186,719.75
MERCADOLIBRE INC	1,842	369.87	681,300.54
MICROSOFT CORP	316,697	92.00	29,136,124.00
ORACLE CORPORATION	133,780	50.71	6,783,983.80
PAYCHEX INC	13,523	66.81	903,471.63
PAYPAL HOLDINGS INC	49,495	78.37	3,878,923.15
RED HAT INC	7,442	142.71	1,062,047.82
SABRE CORP	9,850	23.26	229,111.00
SALESFORCE.COM, INC.	29,584	112.86	3,338,850.24
SERVICENOW INC	7,153	154.03	1,101,776.59
SPLUNK INC	6,247	92.64	578,722.08
SQUARE INC-A	11,069	44.11	488,253.59
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	8,124	50.00	406,200.00
SYMANTEC CORPORATION	25,429	27.55	700,568.95
SYNOPSYS INC	6,139	89.07	546,800.73
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE INC	4,808	107.04	514,648.32
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	7,179	87.08	625,147.32
TWITTER INC	27,825	33.06	919,894.50
VERISIGN INC	3,837	120.55	462,550.35
VISA INC	79,267	121.85	9,658,683.95
VMWARE INC	3,055	124.55	380,500.25
WESTERN UNION COMPANY	21,476	20.26	435,103.76
WORKDAY INC-CLASS A	5,536	124.01	686,519.36
WORLDPAY INC-CL A	13,361	76.84	1,026,659.24
ZILLOW GROUP INC-C	5,320	46.85	249,242.00
AMPHENOL CORPORATION -CL A	13,389	89.99	1,204,876.11
APPLE INC	223,610	172.43	38,557,072.30
ARISTA NETWORKS INC	1,990	249.49	496,485.10
ARROW ELECTRONICS INC	4,130	81.81	337,875.30
AVNET INC	4,559	42.26	192,663.34
CDW CORP/DE	6,951	71.46	496,718.46
CISCO SYSTEMS INC	215,863	44.33	9,569,206.79
COGNEX CORP	8,160	55.77	455,083.20
COMMSCOPE HOLDING CO INC	8,803	39.02	343,493.06
CORNING INC	40,447	29.47	1,191,973.09
DELL TECHNOLOGIES INC-CL V	8,755	69.79	611,011.45
DXC TECHNOLOGY CO	12,719	100.82	1,282,329.58
F5 NETWORKS INC	2,620	145.03	379,978.60
FLEX LTD	23,204	17.84	413,959.36
FLIR SYSTEMS INC	5,286	49.09	259,489.74
HARRIS CORP	4,981	156.66	780,323.46

HEWLETT PACKARD ENTERPRISE C	70,980	16.39	1,163,362.20
HP INC	71,437	21.40	1,528,751.80
IPG PHOTONICS CORP	1,776	239.36	425,103.36
JUNIPER NETWORKS INC	16,739	26.35	441,072.65
MOTOROLA SOLUTIONS INC	7,367	105.91	780,238.97
NETAPP INC	11,136	56.51	629,295.36
PALO ALTO NETWORKS INC	3,917	162.08	634,867.36
QORVO INC	5,998	77.31	463,705.38
QUALCOMM INC	63,958	64.85	4,147,676.30
SEAGATE TECHNOLOGY	12,422	51.42	638,739.24
SKYWORKS SOLUTIONS INC	7,938	104.11	826,425.18
TE CONNECTIVITY LTD	14,992	102.10	1,530,683.20
TRIMBLE INC	11,778	39.47	464,877.66
WESTERN DIGITAL CORP	12,396	84.91	1,052,544.36
XEROX CORP	9,697	30.55	296,243.35
AT&T INC	266,047	37.14	9,880,985.58
CENTURYLINK INC	42,717	18.93	808,632.81
SBA COMMUNICATIONS CORP	5,325	169.12	900,564.00
SPRINT CORP	36,740	5.39	198,028.60
T-MOBILE US INC	12,603	60.06	756,936.18
VERIZON COMMUNICATIONS INC	176,640	50.15	8,858,496.00
ZAYO GROUP HOLDINGS INC	7,915	37.31	295,308.65
AES CORPORATION	27,194	10.45	284,177.30
ALLIANT ENERGY CORP	9,162	39.75	364,189.50
AMEREN CORPORATION	10,336	56.32	582,123.52
AMERICAN ELECTRIC POWER	20,898	67.26	1,405,599.48
AMERICAN WATER WORKS CO INC	8,207	80.50	660,663.50
ATMOS ENERGY CORP	4,697	82.96	389,663.12
CENTERPOINT ENERGY INC	17,622	26.91	474,208.02
CMS ENERGY CORPORATION	11,464	44.20	506,708.80
CONSOLIDATED EDISON INC	13,546	77.77	1,053,472.42
DOMINION ENERGY INC	27,411	75.80	2,077,753.80
DTE ENERGY COMPANY	7,944	105.22	835,867.68
DUKE ENERGY CORP	29,901	76.70	2,293,406.70
EDISON INTERNATIONAL	14,473	61.05	883,576.65
ENERGY CORP	8,107	76.72	621,969.04
EVERSOURCE ENERGY	13,730	59.12	811,717.60
EXELON CORP	40,719	37.78	1,538,363.82
FIRSTENERGY CORP	18,217	33.03	601,707.51
NEXTERA ENERGY INC	20,117	156.05	3,139,257.85
NISOURCE INC	15,794	23.48	370,843.12
OGE ENERGY CORP	9,056	31.56	285,807.36

	P G & E CORPORATION	22,921	40.40	926,008.40
	PINNACLE WEST CAPITAL CORPORATION	5,120	78.69	402,892.80
	PPL CORPORATION	30,510	31.45	959,539.50
	PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	22,788	49.43	1,126,410.84
	SCANA CORP	6,498	37.71	245,039.58
	SEMPRA ENERGY	10,435	109.01	1,137,519.35
	SOUTHERN CO	42,572	43.93	1,870,187.96
	UGI CORPORATION	7,497	43.70	327,618.90
	VISTRA ENERGY CORP	11,939	18.83	224,811.37
	WEC ENERGY GROUP INC	13,142	61.92	813,752.64
	WESTAR ENERGY INC	6,480	50.71	328,600.80
	XCEL ENERGY INC	22,653	44.68	1,012,136.04
	ADVANCED MICRO DEVICES	32,123	11.82	379,693.86
	ANALOG DEVICES INC	15,558	86.09	1,339,388.22
	APPLIED MATERIALS INC	45,557	55.03	2,507,001.71
	BROADCOM LTD	17,618	248.89	4,384,944.02
	INTEL CORP	203,608	45.56	9,276,380.48
	KLA-TENCOR CORPORATION	6,485	107.52	697,267.20
	LAM RESEARCH CORP	7,275	187.91	1,367,045.25
	MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	18,948	22.68	429,740.64
	MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	12,942	61.26	792,826.92
	MICROCHIP TECHNOLOGY INC	10,117	83.41	843,858.97
	MICRON TECHNOLOGY INC	45,100	44.21	1,993,871.00
	NVIDIA CORP	25,859	243.84	6,305,458.56
	NXP SEMICONDUCTORS NV	14,992	118.50	1,776,552.00
	TEXAS INSTRUMENTS INC	42,899	104.47	4,481,658.53
	XILINX INC	10,296	67.09	690,758.64
	米ドル 小計	13,296,287		1,042,559,535.56 (110,824,078,630)
カナダドル	ALTAGAS LTD	6,948	26.32	182,871.36
	ARC RESOURCES LTD	17,074	12.84	219,230.16
	CAMECO CORP	16,384	11.58	189,726.72
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	46,354	39.59	1,835,154.86
	CENOVUS ENERGY INC	41,433	9.41	389,884.53
	CRESCENT POINT ENERGY CORP	22,509	8.81	198,304.29
	ENBRIDGE INC	70,409	42.95	3,024,066.55
	ENCANA CORP	41,829	13.79	576,821.91
	HUSKY ENERGY INC	14,553	16.49	239,978.97
	IMPERIAL OIL LTD	12,999	34.60	449,765.40
	INTER PIPELINE LTD	18,081	22.82	412,608.42
	KEYERA CORP	8,467	33.88	286,861.96
	PEMBINA PIPELINE CORP	21,701	41.24	894,949.24

PRAIRIESKY ROYALTY LTD	9,038	29.37	265,446.06
SEVEN GENERATIONS ENERGY-A	14,441	15.43	222,824.63
SUNCOR ENERGY INC	70,959	43.36	3,076,782.24
TOURMALINE OIL CORP	12,887	19.27	248,332.49
TRANSCANADA CORP	38,551	57.61	2,220,923.11
VERMILION ENERGY INC	5,586	42.48	237,293.28
AGNICO EAGLE MINES LIMITED	9,697	54.12	524,801.64
BARRICK GOLD CORP	50,240	16.52	829,964.80
CCL INDUSTRIES INC-CL B	5,358	56.45	302,459.10
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	31,672	20.81	659,094.32
FRANCO-NEVADA CORPORATION	8,072	92.46	746,337.12
GOLDCORP INC	40,330	16.94	683,190.20
KINROSS GOLD CORP	57,099	4.95	282,640.05
LUNDIN MINING CORP	28,209	8.47	238,930.23
METHANEX CORPORATION	4,361	71.75	312,901.75
NUTRIEN LTD	27,231	55.84	1,520,579.04
TECK RESOURCES LIMITED-CL B	23,969	37.39	896,200.91
TURQUOISE HILL RESOURCES LTD	45,107	3.60	162,385.20
WEST FRASER TIMBER CO LTD	2,873	85.48	245,584.04
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	19,578	24.73	484,163.94
BOMBARDIER INC 'B'	75,852	3.73	282,927.96
CAE INC	13,932	23.51	327,541.32
FINNING INTERNATIONAL INC	6,115	33.46	204,607.90
SNC-LAVALIN GROUP INC	8,250	53.08	437,910.00
CANADIAN NATL RAILWAY CO	32,541	95.64	3,112,221.24
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	6,397	232.91	1,489,925.27
LINAMAR CORP	2,200	69.54	152,988.00
MAGNA INTERNATIONAL INC	14,641	68.02	995,880.82
GILDAN ACTIVEWEAR INC	9,066	38.72	351,035.52
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	9,162	74.15	679,362.30
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	19,379	25.14	487,188.06
THOMSON REUTERS CORP	12,371	50.40	623,498.40
CANADIAN TIRE CORP -CL A	3,029	174.32	528,015.28
DOLLARAMA INC	4,808	158.60	762,548.80
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC-B	18,360	62.97	1,156,129.20
EMPIRE CO LTD A	7,235	23.50	170,022.50
JEAN COUTU GROUP INC A	2,801	24.32	68,120.32
LOBLAW COMPANIES LTD	9,974	65.88	657,087.12
METRO INC	9,866	40.12	395,823.92
WESTON (GEORGE) LTD	1,960	105.27	206,329.20
SAPUTO INC	9,854	41.01	404,112.54
VALEANT PHARMACEUTICALS INTERN	14,555	23.70	344,953.50

	BANK OF MONTREAL	27,699	97.61	2,703,699.39
	BANK OF NOVA SCOTIA	51,395	77.21	3,968,207.95
	CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	18,552	115.00	2,133,480.00
	NATIONAL BANK OF CANADA	14,715	61.88	910,564.20
	ROYAL BANK OF CANADA	62,868	100.48	6,316,976.64
	TORONTO-DOMINION BANK	79,318	72.55	5,754,520.90
	CI FINANCIAL CORP	11,041	28.30	312,460.30
	ELEMENT FLEET MANAGEMENT CORP	19,611	4.58	89,818.38
	IGM FINANCIAL INC	3,023	39.55	119,559.65
	ONEX CORPORATION	4,217	90.07	379,825.19
	FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	1,153	629.00	725,237.00
	GREAT-WEST LIFECO INC	14,200	33.93	481,806.00
	INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANCE AND FINANC	4,851	57.40	278,447.40
	INTACT FINANCIAL CORPORATION	6,264	98.00	613,872.00
	MANULIFE FINANCIAL CORP	87,588	24.94	2,184,444.72
	POWER CORP OF CANADA	14,595	30.23	441,206.85
	POWER FINANCIAL CORP	11,076	33.09	366,504.84
	SUN LIFE FINANCIAL INC	25,824	53.82	1,389,847.68
	BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT INC	37,852	50.59	1,914,932.68
	FIRST CAPITAL REALTY INC	6,546	19.76	129,348.96
	CGI GROUP INC - CL A	8,935	73.92	660,475.20
	CONSTELLATION SOFTWARE	848	837.68	710,352.64
	OPEN TEXT CORPORATION	11,689	44.08	515,251.12
	SHOPIFY INC-CLASS A	3,397	172.60	586,322.20
	BLACKBERRY LIMITED	23,701	15.16	359,307.16
	BCE INC	6,928	55.87	387,067.36
	ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	15,965	57.89	924,213.85
	TELUS CORPORATION	7,611	45.35	345,158.85
	ATCO LTD-CLASS I	3,030	43.32	131,259.60
	CANADIAN UTILITIES LIMITED	6,417	35.29	226,455.93
	EMERA INC	2,409	41.37	99,660.33
	FORTIS INC	17,933	42.08	754,620.64
	HYDRO ONE LTD	11,437	20.83	238,232.71
	カナダドル 小計	1,759,035		74,052,426.01 (6,284,088,871)
ユーロ	ENI SPA	108,967	13.63	1,485,438.14
	GALP ENERGIA SGPS S.A	20,924	14.78	309,256.72
	NESTE OYJ	5,632	58.92	331,837.44
	OMV AG	6,314	47.91	302,503.74
	REPSOL SA	53,823	13.89	747,601.47
	TENARIS S.A.	23,321	13.18	307,487.38
	TOTAL SA	102,359	45.90	4,698,278.10

VOPAK	3,130	39.19	122,664.70
AIR LIQUIDE SA	18,345	102.00	1,871,190.00
AKZO NOBEL	10,579	78.36	828,970.44
ARCELORMITTAL	27,846	28.43	791,801.01
ARKEMA	3,250	100.20	325,650.00
BASF SE	39,508	86.74	3,426,923.92
COVESTRO AG	6,687	90.06	602,231.22
CRH PLC	37,164	28.06	1,042,821.84
EVONIK INDUSTRIES AG	6,449	30.07	193,921.43
FUCHS PETROLUB SE-PREF	3,370	45.58	153,604.60
HEIDELBERGCEMENT AG	6,574	84.10	552,873.40
IMERYS SA	1,384	84.35	116,740.40
K+S AG	9,644	21.93	211,492.92
KONINKLIJKE DSM NV	7,986	85.06	679,289.16
LANXESS	4,159	67.58	281,065.22
LINDE AG - TENDER	7,910	186.30	1,473,633.00
SOLVAY SA	3,317	112.10	371,835.70
STORA ENSO OYJ-R SHS	21,985	14.24	313,176.32
SYMRISE AG	6,010	66.24	398,102.40
THYSSENKRUPP AG	19,367	22.85	442,535.95
UMICORE	7,630	47.08	359,220.40
UPM-KYMMENE OYJ	23,383	27.79	649,813.57
VOESTALPINE AG	5,079	47.40	240,744.60
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	11,265	28.75	323,868.75
AIRBUS SE	24,875	95.53	2,376,308.75
ALSTOM RGPT	6,452	33.68	217,303.36
ANDRITZ AG	2,690	48.30	129,927.00
BOSKALIS WESTMINSTER NV	3,784	30.71	116,206.64
BOUYGUES SA	10,290	41.78	429,916.20
BRENTAG AG	6,629	52.22	346,166.38
CNH INDUSTRIAL NV	43,160	11.62	501,735.00
COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	21,266	43.62	927,622.92
DASSAULT AVIATION SA	89	1,354.00	120,506.00
EIFFAGE SA	3,580	92.22	330,147.60
FERROVIAL SA	22,033	17.63	388,441.79
GEA GROUP AG	8,178	38.51	314,934.78
HOCHTIEF AG	825	134.20	110,715.00
KION GROUP AG	3,179	71.30	226,662.70
KONE OYJ-B	14,652	45.38	664,907.76
KONINKLIJKE PHILIPS NV	40,770	31.52	1,285,070.40
LEGRAND SA	11,992	62.88	754,056.96
LEONARDO SPA	18,310	9.06	165,925.22

MAN SE	1,403	94.75	132,934.25
METSO OYJ	5,502	26.33	144,867.66
MTU AERO ENGINES AG	2,451	141.10	345,836.10
OSRAM LICHT AG	4,588	68.08	312,351.04
PRYSMIAN SPA	9,379	26.70	250,419.30
REXEL SA	12,854	14.70	189,018.07
SAFRAN SA	14,456	89.10	1,288,029.60
SCHNEIDER ELECTRIC SE	24,254	72.16	1,750,168.64
SIEMENS AG-REG	32,917	111.18	3,659,712.06
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY	8,238	12.43	102,398.34
THALES SA	4,530	89.68	406,250.40
VINCI S.A.	21,555	83.02	1,789,496.10
WARTSILA OYJ-B SHARES	6,301	59.54	375,161.54
BIC	1,337	86.25	115,316.25
BUREAU VERITAS SA	12,626	21.50	271,459.00
EDENRED	9,497	26.31	249,866.07
PADDY POWER BETFAIR PLC	3,448	94.00	324,112.00
RANDSTAD HOLDING NV	4,694	58.92	276,570.48
TELEPERFORMANCE	2,489	114.80	285,737.20
ABERTIS INFRASTRUCTURAS SA	31,359	19.57	613,695.63
AENA SME SA	2,881	167.50	482,567.50
AEROPORTS DE PARIS (ADP)	1,346	164.40	221,282.40
ATLANTIA SPA	20,462	26.00	532,012.00
BOLLORE	39,433	4.36	172,243.34
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	9,260	26.78	247,982.80
DEUTSCHE POST AG-REG	41,384	37.26	1,541,967.84
FRAPORT AG	1,856	88.94	165,072.64
GETLINK	23,484	10.80	253,627.20
INTERNATIONAL CONSOLIDATED AIRLINES GROUP	23,274	6.87	159,985.47
RYANAIR HOLDINGS PLC	1,614	16.77	27,066.78
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	14,056	88.12	1,238,614.72
BAYERISCHE MOTOREN WERKE(BMW)AG-PFD	2,508	76.25	191,235.00
CONTINENTAL AG	4,655	230.40	1,072,512.00
DAIMLER AG	41,354	72.50	2,998,165.00
FAURECIA	3,127	68.88	215,387.76
FERRARI NV	5,067	105.00	532,035.00
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	47,196	18.15	856,890.57
MICHELIN (CGDE)-B	7,634	126.20	963,410.80
NOKIAN RENKAAT OYJ	5,507	37.94	208,935.58
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE PREF	6,624	71.56	474,013.44
PSA PEUGEOT CITROEN	26,121	18.04	471,353.44
RENAULT SA	8,755	87.80	768,689.00

SCHAEFFLER AG	9,576	13.09	125,349.84
VALEO SA	9,959	60.32	600,726.88
VOLKSWAGEN AG	1,256	171.20	215,027.20
VOLKSWAGEN AG PFD	7,890	167.28	1,319,839.20
ADIDAS AG	8,339	180.25	1,503,104.75
HERMES INTERNATIONAL	1,312	445.10	583,971.20
HUGO BOSS AG	3,149	72.94	229,688.06
KERING	3,216	392.60	1,262,601.60
LUXOTTICA GROUP SPA	7,229	50.72	366,654.88
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	11,999	248.50	2,981,751.50
SEB SA	1,032	165.10	170,383.20
ACCOR SA	7,551	46.10	348,101.10
SODEXO	3,900	100.80	393,120.00
ALTICE NV -A W/I	22,625	8.17	185,027.25
AXEL SPRINGER SE	1,698	72.20	122,595.60
EUTELSAT COMMUNICATIONS	8,726	19.03	166,055.78
JC DECAUX SA	2,828	33.04	93,437.12
LAGARDERE S.C.A.	6,108	24.94	152,333.52
PROSIEBEN SAT.1 MEDIA SE-REG	10,851	31.47	341,480.97
PUBLICIS GROUPE	9,116	62.66	571,208.56
RELX NV	43,033	16.86	725,751.54
RTL GROUP	1,615	70.05	113,130.75
SES	17,656	11.81	208,605.64
TELENET GROUP HOLDINGS NV	2,181	56.10	122,354.10
WOLTERS KLUWER-CVA	13,701	39.87	546,258.87
INDITEX	48,190	26.82	1,292,455.80
CARREFOUR SA	26,320	19.53	514,029.60
CASINO GUICHARD PERRACHON	1,833	45.76	83,878.08
COLRUYT NV	2,173	44.26	96,176.98
JERONIMO MARTINS SGPS S.A.	12,270	17.58	215,767.95
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	54,058	17.78	961,583.70
METRO AG	8,344	17.80	148,523.20
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	33,016	85.21	2,813,293.36
DANONE	26,156	65.49	1,712,956.44
DAVIDE CAMPARI-MILANO SPA	22,958	6.21	142,569.18
HEINEKEN HOLDING NV	5,292	81.70	432,356.40
HEINEKEN NV	11,685	85.96	1,004,442.60
KERRY GROUP PLC-A	6,851	86.50	592,611.50
PERNOD-RICARD SA	9,357	134.60	1,259,452.20
REMY COINTREAU	1,273	109.70	139,648.10
UNILEVER NV-CVA	70,008	43.96	3,077,901.72
BEIERSDORF AG	4,089	92.48	378,150.72

HENKEL AG & CO KGAA	4,681	99.70	466,695.70
HENKEL AG & CO KGAA	7,476	108.40	810,398.40
L'OREAL	10,810	176.80	1,911,208.00
BIOMERIEUX	1,779	71.70	127,554.30
ESSILOR INTERNATIONAL	8,802	111.00	977,022.00
FRESENIUS MEDICAL CARE AG AND CO.KGAA	9,181	87.88	806,826.28
FRESENIUS SE & CO KGAA	18,310	63.94	1,170,741.40
BAYER AG	35,571	98.54	3,505,166.34
EUROFINS SCIENTIFIC	484	490.80	237,547.20
GRIFOLS S.A.	13,951	23.60	329,243.60
IPSEN	1,807	120.00	216,840.00
MERCK KGAA	5,705	83.52	476,481.60
ORION OYJ	4,259	27.34	116,441.06
QIAGEN N.V.	10,011	27.46	274,902.06
RECORDATI SPA	4,578	31.13	142,513.14
SANOFI	48,843	64.50	3,150,373.50
UCB SA	5,753	67.70	389,478.10
ZALANDO SE	5,372	47.84	256,996.48
ABN AMRO GROUP NV-CVA	18,916	25.27	478,007.32
AIB GROUP PLC	36,918	5.36	198,065.07
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	285,334	7.05	2,014,172.70
BANCO DE SABADELL SA	235,029	1.82	428,692.89
BANCO ESPIRITO SANTO,S.A(BES)	187,906	0.01	1,879.06
BANCO SANTANDER SA	695,412	5.61	3,904,738.38
BANK OF IRELAND GROUP PLC	38,418	7.78	299,084.13
BANKIA SA	48,396	3.91	189,325.15
BANKINTER,S.A.	26,969	8.87	239,268.96
BNP PARIBAS	48,284	64.65	3,121,560.60
CAIXABANK	166,584	4.02	669,834.26
COMMERZBANK AG	46,644	12.79	596,576.76
CREDIT AGRICOLE SA	49,578	13.62	675,500.25
ERSTE GROUP BANK AG	13,095	38.90	509,395.50
INTESA SANPAOLO	584,126	3.13	1,832,695.32
INTESA SANPAOLO-RSP	32,509	3.26	106,076.86
KBC GROUPE SA	10,878	72.68	790,613.04
NATIXIS	45,362	7.07	320,890.78
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG	6,677	31.96	213,396.92
SOCIETE GENERALE	32,955	46.52	1,533,066.60
UNICREDIT SPA	85,979	17.81	1,531,973.82
AMUNDI SA	2,379	67.70	161,058.30
DEUTSCHE BANK AG -REG	87,576	12.92	1,131,657.07
DEUTSCHE BOERSE AG	8,227	105.85	870,827.95

EURAZEO	2,022	80.20	162,164.40
EXOR NV	4,683	61.00	285,663.00
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	3,375	92.64	312,660.00
ING GROEP NV-CVA	166,661	14.74	2,457,249.78
MEDIOBANCA SPA	26,782	9.88	264,659.72
WENDEL	1,082	140.60	152,129.20
AEGON NV	74,580	5.52	411,681.60
AGEAS	8,915	41.21	367,387.15
ALLIANZ SE-REG	19,345	190.60	3,687,157.00
ASSICURAZIONI GENERALI	52,488	15.50	813,826.44
AXA SA	83,032	25.22	2,094,067.04
CNP ASSURANCES	8,978	19.57	175,699.46
HANNOVER RUECKVERSICHERUNG SE	3,033	110.90	336,359.70
MAPFRE SA	46,367	2.75	127,741.08
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	6,847	182.10	1,246,838.70
NN GROUP NV	14,071	35.82	504,023.22
POSTE ITALIANE SPA	26,562	6.65	176,796.67
SAMPO OYJ-A SHS	19,358	46.98	909,438.84
SCOR SE	8,353	35.55	296,949.15
UNIPOLSAI SPA	49,963	2.02	101,125.11
DEUTSCHE WOHNEN SE	15,822	33.79	534,625.38
VONOVIA SE	21,002	37.41	785,684.82
AMADEUS IT GROUP SA	18,578	59.46	1,104,647.88
ATOS SE	4,258	123.00	523,734.00
CAPGEMINI SA	6,963	104.60	728,329.80
DASSAULT SYSTEMES SA	5,529	103.85	574,186.65
SAP SE	42,585	84.31	3,590,341.35
UBISOFT ENTERTAINMENT SA	2,839	68.00	193,052.00
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	5,981	56.18	336,012.58
WIRECARD AG	5,168	99.46	514,009.28
INGENICO S.A.	2,691	91.30	245,688.30
NOKIA OYJ	252,887	4.65	1,177,947.64
1&1 DRILLISCH AG	2,188	64.75	141,673.00
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	142,497	13.16	1,875,260.52
ELISA OYJ	5,909	35.29	208,528.61
ILIID SA	1,016	200.00	203,200.00
KONINKLIJKE KPN NV	141,551	2.59	366,758.64
ORANGE S.A.	87,968	13.64	1,200,323.36
PROXIMUS SA	6,313	26.06	164,516.78
TELECOM ITALIA SPA	494,065	0.69	343,770.42
TELECOM ITALIA-RNC	251,378	0.59	149,519.63
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	40,394	4.02	162,383.88

	TELEFONICA S.A.	193,173	7.63	1,475,069.02
	VIVENDI SA	45,432	20.86	947,711.52
	E.ON SE	97,365	8.14	792,551.10
	EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	101,010	2.80	283,636.08
	ELECTRICITE DE FRANCE(EDF)	23,877	10.60	253,096.20
	ENAGAS	10,471	20.63	216,016.73
	ENDESA S.A.	15,037	17.11	257,283.07
	ENEL SPA	347,713	4.86	1,689,885.18
	ENGIE	77,173	12.65	976,238.45
	FORTUM OYJ	19,563	17.81	348,514.84
	GAS NATURAL SDG SA	16,170	18.44	298,255.65
	IBERDROLA SA	253,332	6.12	1,550,898.50
	INNOGY SE	5,851	30.74	179,859.74
	RED ELECTRICA CORPORATION SA	18,384	16.23	298,464.24
	RWE AG	20,786	15.93	331,120.98
	SNAM SPA	99,978	3.69	369,518.68
	SUEZ	17,725	10.93	193,822.87
	TERNA SPA	66,384	4.56	302,843.80
	UNIPER SE	8,953	24.33	217,826.49
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	21,587	19.60	423,105.20
	ASML HOLDING NV	16,826	155.80	2,621,490.80
	INFINEON TECHNOLOGIES AG	48,425	22.02	1,066,318.50
	STMICROELECTRONICS NV	26,205	18.04	472,738.20
	ユーロ 小計	8,695,033		171,114,799.52 (22,600,842,720)
英債券	BP PLC	851,459	4.73	4,030,806.90
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	194,461	22.63	4,400,652.43
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	162,293	22.88	3,714,075.30
	WOOD GROUP (JOHN) PLC	32,660	6.15	201,054.96
	ANGLO AMERICAN PLC	58,674	17.48	1,025,973.56
	ANTOFAGASTA PLC	19,439	9.14	177,789.09
	BHP BILLITON PLC	89,998	15.77	1,419,628.45
	CRODA INTERNATIONAL PLC	6,223	44.53	277,110.19
	FRESNILLO PLC	8,512	14.00	119,168.00
	GLENCORE PLC	524,096	3.88	2,033,492.48
	JOHNSON MATTHEY PLC	9,426	32.26	304,082.76
	MONDI PLC	17,158	18.63	319,653.54
	RANDGOLD RESOURCES LTD	3,897	63.06	245,744.82
	RIO TINTO PLC	52,904	41.02	2,170,122.08
	ASHTREAD GROUP PLC	20,515	20.31	416,659.65
	BAE SYSTEMS PLC	141,730	5.97	847,261.94
	BUNZL PLC	13,431	20.34	273,186.54

COBHAM PLC	108,087	1.24	134,406.18
DCC PLC	3,732	67.05	250,230.60
FERGUSON PLC	11,452	52.16	597,336.32
IMI PLC	12,034	12.62	151,869.08
MEGGITT PLC	36,960	4.80	177,408.00
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	71,679	8.32	596,512.63
SMITHS GROUP PLC	18,742	15.89	297,810.38
TRAVIS PERKINS PLC	9,272	14.29	132,496.88
WEIR GROUP PLC/THE	9,222	20.60	189,973.20
BABCOCK INTERNATIONAL GROUP PLC	11,442	6.49	74,327.23
CAPITA PLC	30,870	1.90	58,807.35
EXPERIAN PLC	41,178	15.57	641,141.46
G4S PLC	74,291	2.58	192,190.81
INTERTEK GROUP PLC	6,794	49.93	339,224.42
MERLIN ENTERTAINMENTS PLC	32,557	3.42	111,475.16
EASYJET PLC	7,630	16.47	125,666.10
ROYAL MAIL PLC	36,064	5.47	197,270.08
GKN PLC	68,840	4.16	286,718.60
BURBERRY GROUP PLC	20,414	15.52	316,825.28
PERSIMMON PLC	13,916	24.23	337,184.68
TAYLOR WIMPEY PLC	129,687	1.87	243,552.18
THE BERKELEY GROUP HOLDINGS	5,336	38.00	202,768.00
CARNIVAL PLC	8,091	48.11	389,258.01
COMPASS GROUP PLC	70,275	15.47	1,087,505.62
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	7,601	47.03	357,475.03
TUI AG-DI	17,636	15.54	274,063.44
WHITBREAD PLC	7,771	39.50	306,954.50
ITV PLC	151,064	1.71	259,754.54
PEARSON PLC	38,689	7.00	271,055.13
RELX PLC	45,547	14.91	679,105.77
SKY PLC	46,118	11.01	507,759.18
WPP PLC	54,571	14.71	802,739.41
KINGFISHER PLC	100,357	3.59	360,281.63
MARKS & SPENCER GROUP PLC	71,350	2.98	213,193.80
NEXT PLC	6,971	49.21	343,042.91
SAINSBURY (J) PLC	64,136	2.50	160,917.22
TESCO PLC	373,597	2.04	764,379.46
WILLIAM MORRISON SUPERMARKETS PLC	100,809	2.20	222,586.27
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	16,771	26.62	446,444.02
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	98,884	44.51	4,401,821.26
COCA-COLA HBC AG-CDI	8,704	24.59	214,031.36
DIAGEO PLC	108,215	25.05	2,710,785.75

IMPERIAL BRANDS PLC	42,416	26.57	1,127,205.20	
UNILEVER PLC	54,125	38.01	2,057,561.87	
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	39,736	5.51	219,263.24	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	28,609	65.68	1,879,039.12	
CONVATEC GROUP PLC	61,239	2.15	131,847.56	
MEDICLINIC INTERNATIONAL PLC	19,832	5.83	115,620.56	
SMITH & NEPHEW PLC	39,633	12.79	507,104.23	
ASTRAZENECA PLC	54,368	47.39	2,576,771.36	
GLAXOSMITHKLINE PLC	211,333	13.18	2,786,636.93	
SHIRE PLC	38,624	32.02	1,236,740.48	
BARCLAYS PLC	726,257	2.00	1,452,877.12	
HSBC HOLDINGS PLC	867,821	7.60	6,602,382.16	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	3,083,540	0.67	2,088,481.64	
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	152,437	2.75	419,811.49	
STANDARD CHARTERED PLC	145,314	8.21	1,193,754.51	
3I GROUP PLC	44,300	9.05	400,915.00	
HARGREAVES LANSDOWN PLC	11,038	16.82	185,659.16	
INVESTEC PLC	33,008	6.19	204,451.55	
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP PLC	12,977	40.50	525,568.50	
SCHRODERS PLC	6,213	34.16	212,236.08	
ADMIRAL GROUP PLC	7,842	19.06	149,468.52	
AVIVA PLC	180,213	4.96	894,937.75	
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	63,289	3.85	244,168.96	
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	249,238	2.56	640,043.18	
OLD MUTUAL PLC	225,291	2.46	555,117.02	
PRUDENTIAL PLC	111,192	18.39	2,044,820.88	
RSA INSURANCE GROUP PLC	40,508	6.10	247,260.83	
ST JAMES'S PLACE PLC	21,830	11.25	245,587.50	
STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	117,114	3.64	426,529.18	
AUTO TRADER GROUP PLC	42,053	3.68	155,091.46	
MICRO FOCUS INTERNATIONAL	18,215	21.18	385,793.70	
SAGE GROUP PLC/THE	49,630	7.00	347,509.26	
BT GROUP PLC	365,274	2.28	834,285.81	
VODAFONE GROUP PLC	1,155,518	2.04	2,364,767.58	
CENTRICA PLC	224,355	1.28	287,510.93	
NATIONAL GRID PLC	145,154	7.49	1,088,074.38	
SEVERN TRENT PLC	9,868	17.38	171,505.84	
SSE PLC	44,560	12.00	534,720.00	
UNITED UTILITIES GROUP PLC	33,192	6.69	222,187.24	
英ポンド 小計	13,141,388		80,168,119.40 (11,967,496,864)	
スイスフラン	CLARIANT AG-REG	10,101	23.93	241,716.93

EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	321	633.00	203,193.00	
GIVAUDAN-REG	409	2,159.00	883,031.00	
LAFARGEHOLCIM LTD	19,169	54.82	1,050,844.58	
SIKA AG	99	7,775.00	769,725.00	
ABB LTD	78,637	23.61	1,856,619.57	
GEBERIT AG-REG	1,593	428.00	681,804.00	
SCHINDLER HOLDING AG-REG	1,025	219.80	225,295.00	
SCHINDLER HOLDING-PART CERT	1,977	226.60	447,988.20	
ADECCO GROUP AG-REG	7,019	74.78	524,880.82	
SGS SA	219	2,381.00	521,439.00	
KUEHNE&NAGEL INTL AG-REG	2,362	165.30	390,438.60	
CIE FINANCIERE RICHEMONT SA-REGD A	22,267	85.62	1,906,500.54	
THE SWATCH GROUP AG-B	1,330	415.20	552,216.00	
THE SWATCH GROUP AG-REG	2,516	78.70	198,009.20	
DUFREY AG-REG	1,650	139.50	230,175.00	
BARRY CALLEBAUT AG-REG	109	1,930.00	210,370.00	
LINDT & SPRUENGLI AG	45	5,700.00	256,500.00	
LINDT & SPRUENGLI AG-REG	4	68,100.00	272,400.00	
NESTLE SA-REGISTERED	134,465	75.74	10,184,379.10	
SONOVA HOLDING AG	2,643	147.75	390,503.25	
STRAUMANN HOLDING AG-REG	435	677.50	294,712.50	
LONZA GROUP AG-REG	3,160	246.40	778,624.00	
NOVARTIS AG-REG SHS	96,005	80.80	7,757,204.00	
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	30,306	225.50	6,834,003.00	
VIFOR PHARMA AG	2,258	136.40	307,991.20	
CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	107,601	17.38	1,870,105.38	
JULIUS BAER GROUP LTD	9,558	61.80	590,684.40	
PARGESA HOLDING SA-BR	1,867	82.50	154,027.50	
PARTNERS GROUP HOLDING AG	818	686.50	561,557.00	
UBS GROUP AG	156,902	17.80	2,792,855.60	
BALOISE HOLDING AG	1,987	147.50	293,082.50	
SWISS LIFE HOLDING AG	1,472	335.80	494,297.60	
SWISS RE AG	13,294	94.40	1,254,953.60	
ZURICH INSURANCE GROUP AG	6,458	308.20	1,990,355.60	
SWISS PRIME SITE-REG	3,061	88.45	270,745.45	
SWISSCOM AG-REG	1,163	513.80	597,549.40	
スイスフラン 小計	724,305		48,840,777.52 (5,597,153,103)	
スウェーデンク ローナ	LUNDIN PETROLEUM AB	8,864	186.85	1,656,238.40
	BOLIDEN AB	10,919	288.50	3,150,131.50
	ALFA LAVAL AB	12,041	197.95	2,383,515.95
	ASSA ABLOY AB-B	43,430	177.50	7,708,825.00

	ATLAS COPCO AB-A SHS	28,366	348.80	9,894,060.80	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	16,107	309.90	4,991,559.30	
	SANDVIK AB	50,953	148.15	7,548,686.95	
	SKANSKA AB-B SHS	15,711	164.70	2,587,601.70	
	SKF AB-B SHARES	16,642	172.10	2,864,088.20	
	VOLVO AB-B SHS	69,797	155.00	10,818,535.00	
	SECURITAS AB-B SHS	12,234	138.50	1,694,409.00	
	ELECTROLUX AB-SER B	9,796	268.30	2,628,266.80	
	HUSQVARNA AB-B SHS	18,593	87.24	1,622,053.32	
	HENNES & MAURITZ AB-B SHS	40,173	140.76	5,654,751.48	
	ICA GRUPPEN AB	3,550	297.60	1,056,480.00	
	SWEDISH MATCH AB	7,555	333.10	2,516,570.50	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	26,240	225.50	5,917,120.00	
	GETINGE AB-B SHS	9,989	102.90	1,027,868.10	
	NORDEA BANK AB	131,614	94.46	12,432,258.44	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN AB-A	63,156	97.26	6,142,552.56	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	69,942	116.20	8,127,260.40	
	SWEDBANK AB - A SHARES	39,030	206.40	8,055,792.00	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	6,266	199.70	1,251,320.20	
	INVESTOR AB-B SHS	19,895	365.00	7,261,675.00	
	KINNEVIK AB-B SHS	11,257	286.60	3,226,256.20	
	LUNDBERGS AB-B SHS	1,567	618.00	968,406.00	
	ERICSSON LM-B SHS	136,331	54.08	7,372,780.48	
	HEXAGON AB-B SHS	11,065	487.20	5,390,868.00	
	MILLICOM INTL CELLULAR-SDR	2,694	553.00	1,489,782.00	
	TELE2 AB-B SHS	18,224	96.36	1,756,064.64	
	TELIA CO AB	109,790	37.72	4,141,278.80	
	スウェーデンクローナ 小計	1,021,791		143,337,056.72 (1,914,983,077)	
ノルウェーク ローネ	STATOIL ASA	49,847	175.50	8,748,148.50	
	NORSK HYDRO ASA	60,434	57.64	3,483,415.76	
	YARA INTERNATIONAL ASA	7,492	349.00	2,614,708.00	
	SCIBSTED ASA-B SHS	3,724	207.50	772,730.00	
	MARINE HARVEST ASA	18,939	153.85	2,913,765.15	
	ORKLA ASA	33,915	85.46	2,898,375.90	
	DNB ASA	43,520	157.70	6,863,104.00	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	6,902	143.30	989,056.60	
	TELENOR ASA	33,605	176.80	5,941,364.00	
	ノルウェークローネ 小計	258,378		35,224,667.91 (482,930,197)	
デンマークク ローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	4,096	523.60	2,144,665.60	
	NOVOZYMES A/S-B SHARES	10,279	322.00	3,309,838.00	

	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	8,881	426.40	3,786,858.40
	ISS A/S	6,409	229.10	1,468,301.90
	A P MOLLER-MAERSK A/S-A	168	10,300.00	1,730,400.00
	A P MOLLER-MAERSK A/S-B	295	10,840.00	3,197,800.00
	DSV A/S	8,324	492.70	4,101,234.80
	PANDORA A/S	4,763	623.20	2,968,301.60
	CARLSBERG AS-B	4,678	733.00	3,428,974.00
	COLOPLAST-B	4,991	522.80	2,609,294.80
	WILLIAM DEMANT HOLDING	4,455	196.40	874,962.00
	GENMAB A/S	2,773	1,088.00	3,017,024.00
	H LUNDBECK A/S	3,618	324.00	1,172,232.00
	NOVO NORDISK A/S-B	80,152	313.45	25,123,644.40
	DANSKE BANK A/S	31,814	248.80	7,915,323.20
	TRYG A/S	5,005	144.80	724,724.00
	TDC A/S	37,115	49.25	1,827,913.75
	ORSTED A/S	8,516	369.00	3,142,404.00
	デンマーククローネ 小計	226,332		72,543,896.45 (1,286,203,284)
オーストラリア ドル	CALTEX AUSTRALIA LIMITED	12,579	33.13	416,742.27
	OIL SEARCH LTD	60,868	7.44	452,857.92
	ORIGIN ENERGY LIMITED	74,587	8.95	667,553.65
	SANTOS LTD	80,415	5.04	405,291.60
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	35,972	31.08	1,118,009.76
	ALUMINA LTD	106,977	2.31	247,116.87
	AMCOR LIMITED	50,321	13.85	696,945.85
	BHP BILLITON LTD	137,867	31.52	4,345,567.84
	BLUESCOPE STEEL LTD	23,089	15.17	350,260.13
	BORAL LIMITED	55,663	7.44	414,132.72
	FORTESCUE METALS GROUP LIMITED	72,860	5.35	389,801.00
	INCITEC PIVOT LTD	85,406	3.60	307,461.60
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	18,691	22.73	424,846.43
	NEWCREST MINING LIMITED	31,386	22.32	700,535.52
	ORICA LIMITED	17,981	18.57	333,907.17
	RIO TINTO LIMITED	17,862	82.48	1,473,257.76
	SOUTH32 LTD	223,474	3.32	741,933.68
	CIMIC GROUP LTD	4,062	45.21	183,643.02
	BRAMBLES LIMITED	72,482	9.63	698,001.66
	SEEK LIMITED	16,538	20.11	332,579.18
AURIZON HOLDINGS LTD	86,884	4.58	397,928.72	
ARISTOCRAT LEISURE LTD	23,822	23.68	564,104.96	
CROWN RESORTS LTD	16,521	12.58	207,834.18	
DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES LIMITED	2,137	42.50	90,822.50	

	FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD	2,650	48.58	128,737.00
	TABCORP HOLDINGS LIMITED	88,199	4.52	398,659.48
	REA GROUP LTD	1,889	77.46	146,321.94
	HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	20,543	4.33	88,951.19
	WESFARMERS LIMITED	48,322	40.67	1,965,255.74
	WOOLWORTHS GROUP LTD	55,613	27.05	1,504,331.65
	COCA-COLA AMATIL LIMITED	26,828	8.48	227,501.44
	TREASURY WINE ESTATES LTD	31,984	17.74	567,396.16
	COCHLEAR LIMITED	2,344	173.17	405,910.48
	HEALTHSCOPE LTD	76,014	1.89	144,046.53
	RAMSAY HEALTH CARE LTD	6,175	66.63	411,440.25
	SONIC HEALTHCARE LTD	17,837	23.86	425,590.82
	CSL LIMITED	19,606	153.39	3,007,364.34
	AUST AND NZ BANKING GROUP LT	125,817	27.85	3,504,003.45
	BANK OF QUEENSLAND LIMITED	17,851	12.07	215,461.57
	BENDIGO AND ADELAIDE BANK	19,841	11.03	218,846.23
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	74,517	74.02	5,515,748.34
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	114,924	29.22	3,358,079.28
	WESTPAC BANKING CORPORATION	146,383	30.22	4,423,694.26
	ASX LTD	9,287	56.11	521,093.57
	CHALLENGER FINANCIAL SERVICE	23,022	12.32	283,631.04
	MACQUARIE GROUP LTD	14,151	103.05	1,458,260.55
	AMP LIMITED	129,763	5.33	691,636.79
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP LT	112,664	7.70	867,512.80
	MEDIBANK PRIVATE LTD	128,724	3.15	405,480.60
	QBE INSURANCE GROUP LIMITED	58,227	10.46	609,054.42
	SUNCORP GROUP LTD	59,211	13.25	784,545.75
	COMPUTERSHARE LIMITED	19,458	17.56	341,682.48
	TELSTRA CORPORATION LIMITED	169,731	3.43	582,177.33
	TPG TELECOM LTD	17,758	6.00	106,548.00
	AGL ENERGY LIMITED	29,039	22.30	647,569.70
	AUSNET SERVICES	85,220	1.64	139,760.80
	オーストラリアドル 小計	3,082,036		50,057,429.97 (4,217,839,049)
ニュージーランドドル	FLETCHER BUILDING LTD	33,434	7.00	234,038.00
	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	37,455	6.46	241,959.30
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	21,979	13.09	287,705.11
	RYMAN HEALTHCARE LIMITED	19,820	10.61	210,290.20
	SPARK NEW ZEALAND LIMITED	79,808	3.45	275,337.60
	MERCURY NZ LTD	17,155	3.33	57,126.15
	MERIDIAN ENERGY LTD	70,399	2.84	199,933.16
		280,050		1,506,389.52

	ニュージーランドドル 小計			(118,537,791)
香港ドル	NWS HOLDINGS LTD	69,500	14.48	1,006,360.00
	MTR CORPORATION	59,000	40.90	2,413,100.00
	MINTH GROUP LTD	32,000	42.25	1,352,000.00
	LI & FUNG LTD	237,200	3.92	929,824.00
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	56,000	47.80	2,676,800.00
	YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	27,000	33.45	903,150.00
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LIMITED	106,000	66.70	7,070,200.00
	MGM CHINA HOLDINGS LTD	44,000	22.45	987,800.00
	SANDS CHINA LTD	107,200	44.60	4,781,120.00
	SHANGRI-LA ASIA LTD.	64,000	16.76	1,072,640.00
	SJM HOLDINGS LIMITED	80,000	7.53	602,400.00
	WYNN MACAU LTD	57,600	27.25	1,569,600.00
	WH GROUP LIMITED	397,500	8.99	3,573,525.00
	BANK OF EAST ASIA	52,820	32.85	1,735,137.00
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	170,000	39.40	6,698,000.00
	HANG SENG BANK LTD	33,100	192.30	6,365,130.00
	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	119,924	98.95	11,866,479.80
	FIRST PACIFIC COMPANY	86,000	5.24	450,640.00
	HONG KONG EXCHANGES & CLEARING LIMITED	49,800	280.00	13,944,000.00
	KINGSTON FINANCIAL GROUP LIMITED	162,000	4.83	782,460.00
	AIA GROUP LTD	519,000	63.30	32,852,700.00
	CK ASSET HOLDINGS LTD	113,924	67.25	7,661,389.00
	HANG LUNG GROUP LTD	42,000	26.70	1,121,400.00
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	98,000	18.62	1,824,760.00
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	56,020	50.10	2,806,602.00
	HYSAN DEVELOPMENT CO	29,000	43.70	1,267,300.00
	KERRY PROPERTIES LTD	27,500	35.30	970,750.00
	NEW WORLD DEVELOPMENT	261,333	11.62	3,036,689.46
	SINO LAND CO	124,200	14.00	1,738,800.00
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	64,000	125.50	8,032,000.00
	SWIRE PACIFIC LTD 'A'	18,000	74.30	1,337,400.00
	SWIRE PROPERTIES LIMITED	53,000	26.50	1,404,500.00
	WHARF HOLDINGS LTD	59,000	29.05	1,713,950.00
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	48,000	50.15	2,407,200.00
	WHEELOK&COMPANY LTD	33,000	56.55	1,866,150.00
	PCCW LIMITED	194,000	4.45	863,300.00
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD	30,000	65.35	1,960,500.00
	CLP HOLDINGS LTD	70,100	76.00	5,327,600.00
	HK ELECTRIC INVESTMENTS-SS	111,000	7.21	800,310.00
	HONG KONG & CHINA GAS	350,079	14.80	5,181,169.20
	POWER ASSETS HOLDINGS LIMITED	60,000	66.10	3,966,000.00

	ASM PACIFIC TECHNOLOGY	12,300	108.30	1,332,090.00	
	香港ドル 小計	4,384,100		160,252,925.46 (2,177,837,257)	
シンガポールドル	KEPPEL CORP LTD	58,600	7.94	465,284.00	
	SEBACORP INDUSTRIES LTD	43,720	3.22	140,778.40	
	SINGAPORE TECHNOLOGIES ENG	68,300	3.33	227,439.00	
	YANGZIJANG SHIPBUILDING HOLDINGS LTD	90,000	1.39	125,100.00	
	COMFORTDELGRO CORP LTD	107,000	2.05	219,350.00	
	SATS LTD	26,800	5.20	139,360.00	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	25,066	11.38	285,251.08	
	GENTING SINGAPORE PLC	280,700	1.24	348,068.00	
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	56,350	2.63	148,200.50	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	4,700	37.90	178,130.00	
	GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	353,600	0.36	127,296.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	69,900	3.03	211,797.00	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	76,900	28.28	2,174,732.00	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	139,100	12.78	1,777,698.00	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	56,300	27.04	1,522,352.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	35,600	7.37	262,372.00	
	CAPITALAND LTD	104,500	3.57	373,065.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	16,100	12.72	204,792.00	
	UOL GROUP LIMITED	21,700	8.34	180,978.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	355,515	3.33	1,183,864.95	
STARHUB LIMITED	12,800	2.57	32,896.00		
	シンガポールドル 小計	2,003,251		10,328,803.93 (837,665,998)	
イスラエルシュケル	FRUTAROM INDUSTRIES LTD	1,842	321.90	592,939.80	
	ISRAEL CHEMICALS LIMITED	21,574	14.57	314,333.18	
	ELBIT SYSTEMS LTD	1,198	521.30	624,517.40	
	BANK HAPOLIM BM	44,062	24.41	1,075,553.42	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	65,574	20.86	1,367,873.64	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	5,442	62.61	340,723.62	
	AZRIELI GROUP	1,304	163.60	213,334.40	
	NICE LTD	2,768	323.00	894,064.00	
	BEZEQ ISRAELI TELECOMMUNICATION CORP LTD	100,118	5.17	518,110.65	
	イスラエルシュケル 小計	243,882		5,941,450.11 (178,243,503)	
	合 計	49,115,868		168,487,900,344 (168,487,900,344)	

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

通貨	銘柄数	組入株式時価比率	合計金額に対する比率
----	-----	----------	------------

米ドル	株式	604銘柄	62.3%	65.8%
カナダドル	株式	88銘柄	3.5%	3.7%
ユーロ	株式	240銘柄	12.7%	13.4%
英ポンド	株式	98銘柄	6.7%	7.1%
スイスフラン	株式	37銘柄	3.1%	3.3%
スウェーデンクローナ	株式	31銘柄	1.1%	1.1%
ノルウェークローネ	株式	9銘柄	0.3%	0.3%
デンマーククローネ	株式	18銘柄	0.7%	0.8%
オーストラリアドル	株式	56銘柄	2.4%	2.5%
ニュージーランドドル	株式	7銘柄	0.1%	0.1%
香港ドル	株式	42銘柄	1.2%	1.3%
シンガポールドル	株式	21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	15,080	292,401.20	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITIES, INC.	4,326	530,627.16	
		AMERICAN TOWER CORP	18,369	2,572,027.38	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	46,842	500,272.56	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	6,026	979,646.82	
		BOSTON PROPERTIES INC	7,005	838,078.20	
		BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	12,150	192,577.50	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	4,242	353,613.12	
		COLONY NORTHSTAR INC-CLASS A	24,561	206,312.40	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	8,934	913,054.80	
		DUKE REALTY CORP	16,657	431,083.16	
		EQUITY RESIDENTIAL	16,005	927,809.85	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	2,713	623,094.71	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	5,405	444,291.00	
		FEDERAL REALTY INVESTMENT TRUST	3,224	368,986.80	
		GGP INC	25,302	556,644.00	
		HCP, INC.	22,100	501,228.00	
		HOST HOTELS AND RESORTS INC	32,068	637,511.84	
		HUTCHISON PORT HOLDINGS TRUST	283,000	99,050.00	
		INVITATION HOMES INC	14,734	317,075.68	
		IRON MOUNTAIN INC	12,165	403,513.05	
KIMCO REALTY CORPORATION	20,926	318,075.20			
LIBERTY PROPERTY TRUST	6,876	276,759.00			
MACERICH COMPANY/THE	5,229	317,191.14			

	MID-AMERICA APARTMENT COMMUNITIES	4,759	422,361.25
	NATIONAL RETAIL PROPERTIES	6,416	245,925.28
	PROLOGIS INC	22,515	1,395,479.70
	PUBLIC STORAGE	6,614	1,248,392.50
	REALTY INCOME CORPORATION	11,714	585,231.44
	REGENCY CENTERS CORP	6,080	352,883.20
	SIMON PROPERTY GROUP INC	13,271	2,071,470.39
	SL GREEN REALTY CORP	3,945	379,509.00
	UDR INC	10,651	368,631.11
	VENTAS INC	14,830	762,113.70
	VEREIT INC	44,740	313,180.00
	VORNADO REALTY TRUST	7,603	514,418.98
	WELLTOWER INC	15,420	860,281.80
	WEYERHAEUSER CO	33,634	1,183,244.12
米ドル 小計		816,131	24,304,047.04 (2,583,520,200)
カナダドル	H&R REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	4,197	85,786.68
	RIOCAN REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	7,441	180,593.07
	SMARTCENTRES REAL ESTATE INVESTMENT TRUS	3,585	108,267.00
カナダドル 小計		15,223	374,646.75 (31,792,523)
ユーロ	FONCIERE DES REGIONS	1,550	137,407.50
	GECINA SA	2,152	327,104.00
	ICADE	1,265	103,477.00
	KLEPIERRE	9,305	316,463.05
	UNIBAIL-RODAMCO SE	4,340	819,609.00
ユーロ 小計		18,612	1,704,060.55 (225,072,317)
英ポンド	BRITISH LAND CO PLC	42,136	273,462.64
	HAMMERSON PLC	34,414	159,233.57
	LAND SECURITIES GROUP PLC	32,703	308,650.91
	SEGRO PLC	40,873	241,641.17
英ポンド 小計		150,126	982,988.29 (146,740,491)
オーストラリアドル	APA GROUP	48,387	387,096.00
	DEXUS	47,512	442,811.84
	GOODMAN GROUP	73,252	592,608.68
	GPT GROUP	69,713	329,742.49
	LENDLEASE GROUP	25,262	393,329.34
	MIRVAC GROUP	140,993	291,855.51

	SCENTRE GROUP	234,290	883,273.30
	STOCKLAND	103,417	408,497.15
	SYDNEY AIRPORT	49,760	327,420.80
	TRANSURBAN GROUP	93,469	1,087,044.47
	VICINITY CENTRES	146,656	371,039.68
	WESTFIELD CORP	87,803	748,081.56
	オーストラリアドル 小計	1,120,514	6,262,800.82 (527,703,597)
香港ドル	HKT TRUST AND HKT LTD	182,000	1,779,960.00
	LINK REIT	92,500	5,984,750.00
	香港ドル 小計	274,500	7,764,710.00 (105,522,408)
シンガポールドル	ASCENDAS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	118,300	304,031.00
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	130,000	226,200.00
	CAPITALAND MALL TRUST	102,800	200,460.00
	SUNTEC REIT	112,900	219,026.00
	シンガポールドル 小計	464,000	949,717.00 (77,022,048)
	合計		3,697,373,584 (3,697,373,584)

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

通貨	銘柄数	組入投資証券 時価比率	合計金額に対する比率
米ドル	投資証券 38銘柄	1.5%	69.9%
カナダドル	投資証券 3銘柄	0.0%	0.9%
ユーロ	投資証券 5銘柄	0.1%	6.1%
英ポンド	投資証券 4銘柄	0.1%	4.0%
オーストラリアドル	投資証券 12銘柄	0.3%	14.3%
香港ドル	投資証券 2銘柄	0.1%	2.9%
シンガポールドル	投資証券 4銘柄	0.0%	2.1%

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29年 2月20日現在)

(平成30年 2月19日現在)

資産の部

（平成29年 2月20日現在）

（平成30年 2月19日現在）

流動資産		
預金	1,630,095,689	438,229,262
コール・ローン	420,483,961	109,160,718
国債証券	212,934,137,705	181,786,932,094
派生商品評価勘定	3,366,000	2,129,768
未収入金	-	536,414,266
未収利息	1,456,904,963	1,498,902,971
前払費用	248,360,400	32,867,925
流動資産合計	216,693,348,718	184,404,637,004
資産合計	216,693,348,718	184,404,637,004
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	-	2,051
未払解約金	184,808,571	209,915,063
未払利息	1,036	306
その他未払費用	2,223	1,961
流動負債合計	184,811,830	209,919,381
負債合計	184,811,830	209,919,381
純資産の部		
元本等		
元本	130,285,580,252	107,887,329,111
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	86,222,956,636	76,307,388,512
元本等合計	216,508,536,888	184,194,717,623
純資産合計	216,508,536,888	184,194,717,623
負債純資産合計	216,693,348,718	184,404,637,004

注記表

（重要な会計方針の注記）

項目	自平成29年 2月21日 至平成30年 2月19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	外貨建資産等の会計処理

なる重要な事項	「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。
---------	--

(貸借対照表に関する注記)

項目	(平成29年 2月20日現在)	(平成30年 2月19日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	130,285,580,252口	107,887,329,111口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.6618円 (10,000口当たりの純資産額 16,618円)	1口当たり純資産額 1.7073円 (10,000口当たりの純資産額 17,073円)

(金融商品に関する注記)

. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 平成29年 2月21日 至 平成30年 2月19日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	(1) 金融商品の内容 1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、国債証券を組み入れております。 2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。 当計算期間については、為替予約取引を行っております。 3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 (2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。

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

・金融商品の時価等に関する事項

項目	(平成30年 2月19日現在)
1.貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	<p>(1) 有価証券（国債証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

（デリバティブ取引に関する注記）

（平成29年 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

（平成30年 2月19日現在）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

（単位：円）

区 分	種 類	契 約 額 等		時 価	評 価 損 益	
			うち1年超			
市場取引以外 の取引	為替予約取引					
	買建	432,987	-	430,936	2,051	
	米ドル	30,564	-	30,523	41	
	ユーロ	292,806	-	290,980	1,826	
	英ポンド	98,441	-	98,312	129	
	オーストラリアドル	11,176	-	11,121	55	
	売建	544,569,849	-	542,440,081	2,129,768	
	米ドル	227,615,671	-	226,919,690	695,981	
	ユーロ	251,961,267	-	250,610,309	1,350,958	
	英ポンド	47,087,947	-	47,060,203	27,744	
	オーストラリアドル	17,904,964	-	17,849,879	55,085	
		合計	545,002,836	-	542,871,017	2,127,717

（注）1．時価の算定方法

(1)為替予約取引の時価の算定方法について

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

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

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

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

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

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

2.ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

自 平成29年 2月21日 至 平成30年 2月19日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。

（その他の注記）

（平成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・DC外国債券インデックスファンドS	8,358,315,433円
三井住友・DC年金バランス30（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

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 >	152,420,385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 >	1,522,471,675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 >	1,968,892,164円
S M A M ・ バランスファンドV A 4 0 < 適格機関投資家専用 >	5,027,493,405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 >	8,722,624,976円
S M A M ・ バランスV A 株 4 0 T < 適格機関投資家限定 >	147,363,511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 >	14,054,439,171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）	1,253,064,467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）	2,773,090,197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 >	248,946,684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 >	809,563,317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）	3,091,050,370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 >	183,025,865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 >	51,000,429円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 5 0 A < 適格機関投資家専用 >	17,370,270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 >	193,870,007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 >	668,513,101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 >	220,923,296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 >	201,813,759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 >	57,866,612円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 5 0 A 2 < 適格機関投資家専用 >	7,027,104円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 2 5 L 2 < 適格機関投資家専用 >	1,734,420,431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 >	25,670,897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 >	5,405,578,472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 >	2,894,723,008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 >	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

(平成30年 2月19日現在)

開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	130,285,580,252円
同期中における追加設定元本額	6,508,480,988円
同期中における一部解約元本額	28,906,732,129円
平成30年 2月19日現在における元本の内訳	

三井住友・DC外国債券インデックスファンドS	9,505,326,385円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	482,033,249円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	1,356,533,104円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	680,716,519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)	200,617,669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)	9,208,930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)	32,156,213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)	80,908,758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)	73,213,085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)	37,204,501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)	97,792,755円
三井住友・DC年金バランスゼロ(債券型)	11,259,132円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	152,612,684円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	347,704,491円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	392,288,596円
イオン・バランス戦略ファンド	10,515,823円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2050	2,053,006円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	728,193円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	2,092,772円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	8,997,336円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	6,653,417円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	8,409,160円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	4,459,793円
S M A M・年金外国債券パッシブ・ファンド<適格機関投資家限定>	1,829,683,107円
S M A M・バランスファンドVA安定成長型<適格機関投資家限定>	994,362,360円
S M A M・バランスファンドVA25<適格機関投資家専用>	14,694,956,379円
S M A M・バランスファンドVA37.5<適格機関投資家専用>	6,654,452,542円
S M A M・バランスファンドVA50<適格機関投資家専用>	15,041,192,959円
S M A M・バランスファンドVL30<適格機関投資家限定>	43,495,798円
S M A M・バランスファンドVL50<適格機関投資家限定>	117,271,531円
世界6資産バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	989,325円
S M A M・バランスファンドVA75<適格機関投資家専用>	929,198,288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>	140,411,944円
S M A M・インデックス・バランスVA25<適格機関投資家専用>	1,418,831,340円
S M A M・インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用>	1,748,624,082円
S M A M・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用>	2,929,871,193円
S M A M・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>	7,898,142,389円
S M A M・バランスVA株40T<適格機関投資家限定>	93,275,672円
S M A M・外国債券パッシブファンドVA<適格機関投資家限定>	12,591,554,333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)	1,134,143,770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)	2,276,903,513円
S M A M・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	227,593,463円
S M A M・バランスファンドVA20<適格機関投資家専用>	702,294,439円
三井住友・7資産バランスファンド・VAS(適格機関投資家専用)	2,660,961,718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>	170,058,697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>	47,031,545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>	15,695,353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>	168,163,991円

SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	620,414,441円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T<適格機関投資家専用>	191,711,885円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A2<適格機関投資家専用>	185,168,652円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A2<適格機関投資家専用>	54,863,227円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A2<適格機関投資家専用>	6,975,325円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L2<適格機関投資家専用>	1,573,385,690円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T2<適格機関投資家専用>	23,478,678円
SMAM・グローバルバランスファンド(標準型)VA<適格機関投資家限定>	4,637,499,307円
SMAM・グローバルバランスファンド(債券重視型)VA<適格機関投資家限定>	2,210,250,875円
SMAM・世界バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	7,274,876,655円
SMAM・世界バランスファンドVA2<適格機関投資家限定>	2,166,022,742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>	51,673,877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>	602,639円
SMAM・マルチアセットストラテジーファンド2016-04<適格機関投資家限定>	350,447,977円
SMAM・マルチアセットストラテジーファンド2016-05<適格機関投資家限定>	167,862,823円
SMAM・マルチアセットストラテジー・オープン<適格機関投資家限定>	339,385,086円
SMAM・マルチアセット・ダイナミックアロケーション・ストラテジー・ファンド<適格機関投資家限定>	63,930円
合計	107,887,329,111円

附属明細表

有価証券明細表

(a)株式

該当事項はありません。

(b)株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	米ドル	US TREASURY N/B 0.75	2,000,000.00	1,974,218.76	
		US TREASURY N/B 0.75	2,000,000.00	1,961,406.26	
		US TREASURY N/B 0.75	3,000,000.00	2,938,359.39	
		US TREASURY N/B 0.875	4,000,000.00	3,943,750.00	
		US TREASURY N/B 0.875	3,000,000.00	2,954,531.25	
		US TREASURY N/B 0.875	3,000,000.00	2,951,250.00	
		US TREASURY N/B 0.875	2,000,000.00	1,963,750.00	
		US TREASURY N/B 0.875	3,000,000.00	2,940,000.00	
		US TREASURY N/B 1	4,000,000.00	3,953,750.00	
		US TREASURY N/B 1	3,000,000.00	2,954,531.25	
		US TREASURY N/B 1	2,300,000.00	2,259,750.00	
		US TREASURY N/B 1	2,000,000.00	1,963,125.00	
		US TREASURY N/B 1	2,000,000.00	1,962,031.26	

US TREASURY N/B 1	2,000,000.00	1,959,218.76	
US TREASURY N/B 1	3,000,000.00	2,937,421.89	
US TREASURY N/B 1.125	3,000,000.00	2,975,390.64	
US TREASURY N/B 1.125	3,000,000.00	2,973,750.00	
US TREASURY N/B 1.125	3,000,000.00	2,971,171.89	
US TREASURY N/B 1.125	2,000,000.00	1,974,843.76	
US TREASURY N/B 1.125	3,000,000.00	2,941,171.89	
US TREASURY N/B 1.125	2,800,000.00	2,735,031.26	
US TREASURY N/B 1.125	3,000,000.00	2,925,703.14	
US TREASURY N/B 1.125	3,800,000.00	3,657,796.89	
US TREASURY N/B 1.125	3,000,000.00	2,870,625.00	
US TREASURY N/B 1.125	3,000,000.00	2,865,468.75	
US TREASURY N/B 1.125	4,000,000.00	3,815,000.00	
US TREASURY N/B 1.125	3,500,000.00	3,333,203.12	
US TREASURY N/B 1.25	2,000,000.00	1,986,718.76	
US TREASURY N/B 1.25	4,000,000.00	3,969,687.52	
US TREASURY N/B 1.25	3,000,000.00	2,971,875.00	
US TREASURY N/B 1.25	2,000,000.00	1,979,375.00	
US TREASURY N/B 1.25	2,000,000.00	1,977,656.26	
US TREASURY N/B 1.25	2,000,000.00	1,969,218.76	
US TREASURY N/B 1.25	3,000,000.00	2,944,218.75	
US TREASURY N/B 1.25	3,000,000.00	2,940,703.14	
US TREASURY N/B 1.25	3,600,000.00	3,473,437.50	
US TREASURY N/B 1.25	3,500,000.00	3,344,414.08	
US TREASURY N/B 1.25	3,000,000.00	2,781,328.14	
US TREASURY N/B 1.375	2,000,000.00	1,988,593.76	
US TREASURY N/B 1.375	2,000,000.00	1,985,937.50	
US TREASURY N/B 1.375	3,000,000.00	2,955,234.39	
US TREASURY N/B 1.375	3,000,000.00	2,953,125.00	
US TREASURY N/B 1.375	4,000,000.00	3,935,312.52	
US TREASURY N/B 1.375	3,000,000.00	2,949,609.39	
US TREASURY N/B 1.375	5,000,000.00	4,913,281.25	
US TREASURY N/B 1.375	4,000,000.00	3,926,250.00	
US TREASURY N/B 1.375	4,000,000.00	3,922,500.00	
US TREASURY N/B 1.375	3,000,000.00	2,938,125.00	
US TREASURY N/B 1.375	4,000,000.00	3,906,562.52	
US TREASURY N/B 1.375	1,900,000.00	1,855,023.44	
US TREASURY N/B 1.375	3,000,000.00	2,926,875.00	
US TREASURY N/B 1.375	3,700,000.00	3,605,187.50	
US TREASURY N/B 1.375	3,000,000.00	2,912,812.50	
US TREASURY N/B 1.375	4,000,000.00	3,869,687.52	
US TREASURY N/B 1.375	4,000,000.00	3,864,375.00	

US TREASURY N/B 1.375	3,000,000.00	2,805,234.39
US TREASURY N/B 1.375	2,500,000.00	2,330,273.45
US TREASURY N/B 1.375	3,000,000.00	2,792,812.50
US TREASURY N/B 1.5	3,700,000.00	3,682,656.25
US TREASURY N/B 1.5	2,000,000.00	1,989,375.00
US TREASURY N/B 1.5	4,000,000.00	3,976,562.52
US TREASURY N/B 1.5	3,000,000.00	2,976,796.89
US TREASURY N/B 1.5	3,000,000.00	2,965,546.89
US TREASURY N/B 1.5	5,000,000.00	4,939,453.15
US TREASURY N/B 1.5	3,000,000.00	2,946,562.50
US TREASURY N/B 1.5	1,000,000.00	982,109.38
US TREASURY N/B 1.5	2,000,000.00	1,962,031.26
US TREASURY N/B 1.5	3,000,000.00	2,882,812.50
US TREASURY N/B 1.5	3,000,000.00	2,838,515.64
US TREASURY N/B 1.5	3,000,000.00	2,835,468.75
US TREASURY N/B 1.5	6,600,000.00	5,913,703.15
US TREASURY N/B 1.625	5,000,000.00	4,973,437.50
US TREASURY N/B 1.625	4,000,000.00	3,976,562.52
US TREASURY N/B 1.625	3,000,000.00	2,979,140.64
US TREASURY N/B 1.625	2,000,000.00	1,985,000.00
US TREASURY N/B 1.625	3,000,000.00	2,975,742.18
US TREASURY N/B 1.625	4,000,000.00	3,956,875.00
US TREASURY N/B 1.625	3,500,000.00	3,444,765.62
US TREASURY N/B 1.625	3,000,000.00	2,950,546.89
US TREASURY N/B 1.625	3,500,000.00	3,430,273.45
US TREASURY N/B 1.625	3,000,000.00	2,877,421.89
US TREASURY N/B 1.625	4,000,000.00	3,833,750.00
US TREASURY N/B 1.625	3,500,000.00	3,346,328.12
US TREASURY N/B 1.625	3,000,000.00	2,849,296.89
US TREASURY N/B 1.625	3,000,000.00	2,845,781.25
US TREASURY N/B 1.625	3,000,000.00	2,829,140.64
US TREASURY N/B 1.625	6,000,000.00	5,469,843.78
US TREASURY N/B 1.625	6,300,000.00	5,723,648.46
US TREASURY N/B 1.75	4,000,000.00	3,972,187.52
US TREASURY N/B 1.75	2,300,000.00	2,263,343.75
US TREASURY N/B 1.75	2,000,000.00	1,965,312.50
US TREASURY N/B 1.75	3,000,000.00	2,915,859.39
US TREASURY N/B 1.75	3,000,000.00	2,909,062.50
US TREASURY N/B 1.75	3,500,000.00	3,390,078.12
US TREASURY N/B 1.75	3,000,000.00	2,903,203.14
US TREASURY N/B 1.75	3,000,000.00	2,902,734.39
US TREASURY N/B 1.75	3,000,000.00	2,898,984.39
US TREASURY N/B 1.75	3,000,000.00	2,896,406.25

US TREASURY N/B 1.75	3,000,000.00	2,887,968.75
US TREASURY N/B 1.75	3,000,000.00	2,876,718.75
US TREASURY N/B 1.75	5,700,000.00	5,443,500.00
US TREASURY N/B 1.875	3,000,000.00	2,970,234.39
US TREASURY N/B 1.875	3,000,000.00	2,931,562.50
US TREASURY N/B 1.875	4,000,000.00	3,898,125.00
US TREASURY N/B 1.875	4,000,000.00	3,895,312.52
US TREASURY N/B 1.875	2,000,000.00	1,945,937.50
US TREASURY N/B 1.875	3,000,000.00	2,916,328.14
US TREASURY N/B 1.875	3,000,000.00	2,915,859.39
US TREASURY N/B 1.875	700,000.00	678,726.56
US TREASURY N/B 1.875	4,000,000.00	3,875,625.00
US TREASURY N/B 1.875	3,000,000.00	2,902,265.64
US TREASURY N/B 1.875	1,800,000.00	1,702,968.75
US TREASURY N/B 2	3,000,000.00	2,976,796.89
US TREASURY N/B 2	2,300,000.00	2,279,515.62
US TREASURY N/B 2	1,600,000.00	1,584,125.00
US TREASURY N/B 2	3,000,000.00	2,968,125.00
US TREASURY N/B 2	3,000,000.00	2,964,843.75
US TREASURY N/B 2	3,000,000.00	2,957,812.50
US TREASURY N/B 2	3,000,000.00	2,949,843.75
US TREASURY N/B 2	3,000,000.00	2,945,156.25
US TREASURY N/B 2	4,300,000.00	4,220,718.75
US TREASURY N/B 2	3,500,000.00	3,430,000.00
US TREASURY N/B 2	3,100,000.00	3,037,031.25
US TREASURY N/B 2	3,000,000.00	2,925,703.14
US TREASURY N/B 2	500,000.00	486,289.06
US TREASURY N/B 2	3,000,000.00	2,916,093.75
US TREASURY N/B 2	5,500,000.00	5,335,859.37
US TREASURY N/B 2	2,000,000.00	1,912,968.76
US TREASURY N/B 2	5,000,000.00	4,778,125.00
US TREASURY N/B 2	2,500,000.00	2,386,718.75
US TREASURY N/B 2	5,600,000.00	5,309,937.52
US TREASURY N/B 2	6,300,000.00	5,944,640.62
US TREASURY N/B 2	6,200,000.00	5,773,265.65
US TREASURY N/B 2.125	3,000,000.00	2,984,062.50
US TREASURY N/B 2.125	2,700,000.00	2,679,328.12
US TREASURY N/B 2.125	1,700,000.00	1,681,539.07
US TREASURY N/B 2.125	4,000,000.00	3,951,250.00
US TREASURY N/B 2.125	3,000,000.00	2,960,156.25
US TREASURY N/B 2.125	3,000,000.00	2,954,531.25
US TREASURY N/B 2.125	3,000,000.00	2,942,343.75

US TREASURY N/B 2.125	4,000,000.00	3,907,187.52
US TREASURY N/B 2.125	4,000,000.00	3,872,500.00
US TREASURY N/B 2.125	2,000,000.00	1,931,093.76
US TREASURY N/B 2.125	4,000,000.00	3,857,500.00
US TREASURY N/B 2.125	3,500,000.00	3,364,101.58
US TREASURY N/B 2.125	6,900,000.00	6,621,304.72
US TREASURY N/B 2.125	1,800,000.00	1,724,625.00
US TREASURY N/B 2.125	6,000,000.00	5,725,781.28
US TREASURY N/B 2.25	3,000,000.00	2,984,531.25
US TREASURY N/B 2.25	2,000,000.00	1,988,750.00
US TREASURY N/B 2.25	2,800,000.00	2,778,343.76
US TREASURY N/B 2.25	3,000,000.00	2,921,484.39
US TREASURY N/B 2.25	2,000,000.00	1,945,937.50
US TREASURY N/B 2.25	1,500,000.00	1,448,789.07
US TREASURY N/B 2.25	6,300,000.00	6,084,914.09
US TREASURY N/B 2.25	3,100,000.00	2,992,953.12
US TREASURY N/B 2.25	6,500,000.00	6,229,335.97
US TREASURY N/B 2.25	7,000,000.00	6,641,250.00
US TREASURY N/B 2.25	6,600,000.00	6,243,703.15
US TREASURY N/B 2.25	6,200,000.00	5,857,546.90
US TREASURY N/B 2.25	5,000,000.00	4,162,109.40
US TREASURY N/B 2.375	2,000,000.00	1,999,687.50
US TREASURY N/B 2.375	8,000,000.00	7,804,375.04
US TREASURY N/B 2.375	6,000,000.00	5,745,000.00
US TREASURY N/B 2.5	5,000,000.00	4,950,390.65
US TREASURY N/B 2.5	7,000,000.00	6,893,359.41
US TREASURY N/B 2.5	5,100,000.00	4,509,515.62
US TREASURY N/B 2.5	5,300,000.00	4,668,968.75
US TREASURY N/B 2.5	5,000,000.00	4,400,390.65
US TREASURY N/B 2.625	4,000,000.00	4,028,750.00
US TREASURY N/B 2.625	5,500,000.00	5,537,812.50
US TREASURY N/B 2.75	3,000,000.00	3,019,921.89
US TREASURY N/B 2.75	6,200,000.00	6,212,109.40
US TREASURY N/B 2.75	5,100,000.00	5,101,992.21
US TREASURY N/B 2.75	2,000,000.00	1,877,343.76
US TREASURY N/B 2.75	5,000,000.00	4,683,203.15
US TREASURY N/B 2.75	2,400,000.00	2,219,062.51
US TREASURY N/B 2.75	1,500,000.00	1,387,382.82
US TREASURY N/B 2.875	3,000,000.00	2,869,921.89
US TREASURY N/B 2.875	4,000,000.00	3,807,500.00
US TREASURY N/B 2.875	4,300,000.00	4,083,320.33
US TREASURY N/B 3	1,800,000.00	1,767,796.88
US TREASURY N/B 3	4,000,000.00	3,906,875.00

US TREASURY N/B 3	4,000,000.00	3,905,312.52	
US TREASURY N/B 3	4,900,000.00	4,777,500.00	
US TREASURY N/B 3	2,500,000.00	2,433,593.75	
US TREASURY N/B 3	2,200,000.00	2,140,187.50	
US TREASURY N/B 3.125	2,000,000.00	2,023,906.26	
US TREASURY N/B 3.125	3,000,000.00	3,062,578.14	
US TREASURY N/B 3.125	2,000,000.00	2,007,656.26	
US TREASURY N/B 3.125	2,000,000.00	2,008,593.76	
US TREASURY N/B 3.125	1,400,000.00	1,401,421.88	
US TREASURY N/B 3.125	5,400,000.00	5,398,312.50	
US TREASURY N/B 3.375	5,000,000.00	5,099,609.40	
US TREASURY N/B 3.375	4,000,000.00	4,177,812.52	
US TREASURY N/B 3.5	4,500,000.00	4,619,179.71	
US TREASURY N/B 3.5	1,500,000.00	1,604,414.07	
US TREASURY N/B 3.625	5,000,000.00	5,105,078.15	
US TREASURY N/B 3.625	6,000,000.00	6,160,781.28	
US TREASURY N/B 3.625	5,000,000.00	5,174,609.40	
US TREASURY N/B 3.625	5,300,000.00	5,767,062.50	
US TREASURY N/B 3.625	5,000,000.00	5,444,921.90	
US TREASURY N/B 3.75	1,500,000.00	1,663,828.12	
US TREASURY N/B 3.75	4,000,000.00	4,441,250.00	
US TREASURY N/B 3.875	1,500,000.00	1,692,890.62	
US TREASURY N/B 4.25	1,000,000.00	1,186,171.88	
US TREASURY N/B 4.25	2,000,000.00	2,381,093.76	
US TREASURY N/B 4.375	500,000.00	600,859.37	
US TREASURY N/B 4.375	1,500,000.00	1,811,015.62	
US TREASURY N/B 4.375	1,400,000.00	1,693,015.63	
US TREASURY N/B 4.375	1,800,000.00	2,182,781.25	
US TREASURY N/B 4.5	1,500,000.00	1,815,585.94	
US TREASURY N/B 4.5	1,000,000.00	1,222,031.25	
US TREASURY N/B 4.5	1,000,000.00	1,226,640.63	
US TREASURY N/B 4.625	2,100,000.00	2,622,210.94	
US TREASURY N/B 4.75	1,500,000.00	1,910,742.19	
US TREASURY N/B 5	500,000.00	644,882.81	
US TREASURY N/B 5.25	500,000.00	607,890.62	
US TREASURY N/B 5.375	1,320,000.00	1,667,943.75	
US TREASURY N/B 5.5	500,000.00	617,109.37	
US TREASURY N/B 6	1,000,000.00	1,226,953.13	
US TREASURY N/B 6.125	1,000,000.00	1,275,078.13	
US TREASURY N/B 6.25	800,000.00	946,375.00	
US TREASURY N/B 6.25	500,000.00	670,585.94	
US TREASURY N/B 6.5	500,000.00	640,937.50	

	US TREASURY N/B 8	1,300,000.00	1,554,312.50
	US TREASURY N/B 8.75	1,000,000.00	1,155,000.00
	US TREASURY N/B 8.875	1,100,000.00	1,174,078.12
	米ドル 小計	729,920,000.00	717,468,148.56 (76,266,864,191)
カナダドル	CANADA-GOV'T 0.5	2,000,000.00	1,986,380.00
	CANADA-GOV'T 0.5	2,000,000.00	1,979,420.00
	CANADA-GOV'T 0.5	2,000,000.00	1,882,240.00
	CANADA-GOV'T 0.75	2,000,000.00	1,978,280.00
	CANADA-GOV'T 0.75	1,300,000.00	1,263,665.00
	CANADA-GOV'T 0.75	2,000,000.00	1,929,300.00
	CANADA-GOV'T 0.75	2,000,000.00	1,915,700.00
	CANADA-GOV'T 1	1,000,000.00	890,500.00
	CANADA-GOV'T 1.25	600,000.00	599,442.00
	CANADA-GOV'T 1.25	1,500,000.00	1,484,385.00
	CANADA-GOV'T 1.5	2,000,000.00	1,987,040.00
	CANADA-GOV'T 1.5	2,000,000.00	1,937,920.00
	CANADA-GOV'T 1.5	1,600,000.00	1,505,280.00
	CANADA-GOV'T 1.75	1,000,000.00	1,001,330.00
	CANADA-GOV'T 1.75	1,000,000.00	999,780.00
	CANADA-GOV'T 1.75	900,000.00	884,340.00
	CANADA-GOV'T 2.25	1,100,000.00	1,100,506.00
	CANADA-GOV'T 2.5	2,500,000.00	2,544,575.00
	CANADA-GOV'T 2.75	1,000,000.00	1,027,600.00
	CANADA-GOV'T 2.75	1,800,000.00	1,910,340.00
	CANADA-GOV'T 2.75	500,000.00	544,480.00
	CANADA-GOV'T 3.25	1,000,000.00	1,040,260.00
	CANADA-GOV'T 3.5	2,000,000.00	2,072,240.00
	CANADA-GOV'T 3.5	1,500,000.00	1,804,575.00
	CANADA-GOV'T 3.75	2,500,000.00	2,564,000.00
	CANADA-GOV'T 4	1,500,000.00	1,900,200.00
	CANADA-GOV'T 5	1,500,000.00	2,078,985.00
CANADA-GOV'T 5.75	800,000.00	1,066,888.00	
CANADA-GOV'T 5.75	1,500,000.00	2,134,875.00	
CANADA-GOV'T 8	500,000.00	736,065.00	
	カナダドル 小計	44,600,000.00	46,750,591.00 (3,967,255,152)
メキシコペソ	MEXICAN BONOS 10	40,000,000.00	44,989,200.00
	MEXICAN BONOS 5.75	20,000,000.00	17,705,200.00
	MEXICAN BONOS 6.5	35,000,000.00	33,562,550.00
	MEXICAN BONOS 8	50,000,000.00	50,413,500.00
	MEXICAN BONOS 8	20,000,000.00	20,324,800.00
	MEXICAN BONOS 8.5	37,000,000.00	39,091,980.00

	MEXICAN BONOS 8.5	40,000,000.00	42,618,400.00
	メキシコペソ 小計	242,000,000.00	248,705,630.00 (1,432,544,428)
ユーロ	BELGIAN 0326 4	1,000,000.00	1,371,360.00
	BELGIAN 0.8	1,300,000.00	1,321,814.00
	BELGIAN 0.8	1,800,000.00	1,793,358.00
	BELGIAN 0291 5.5	2,000,000.00	2,905,160.00
	BELGIAN 0304 5	2,000,000.00	3,139,860.00
	BELGIAN 0308 4	1,500,000.00	1,751,880.00
	BELGIAN 0315 4	1,500,000.00	1,575,810.00
	BELGIAN 0318 3.75	2,000,000.00	2,214,280.00
	BELGIAN 0320 4.25	1,700,000.00	2,611,540.00
	BELGIAN 0321 4.25	1,700,000.00	1,971,354.00
	BELGIAN 0324 4.5	1,000,000.00	1,308,700.00
	BELGIAN 0325 4.25	2,000,000.00	2,389,280.00
	BELGIAN 0327 3	1,000,000.00	1,056,120.00
	BELGIAN 0328 2.25	1,500,000.00	1,666,245.00
	BELGIAN 0332 2.6	2,000,000.00	2,275,640.00
	BELGIAN 0333 3	500,000.00	623,515.00
	BELGIAN 0338 0.5	500,000.00	500,830.00
	BELGIAN 0338 2.25	500,000.00	553,535.00
	BELGIAN 1	1,400,000.00	1,432,592.00
	BELGIAN 1	1,000,000.00	977,680.00
	BELGIAN 1.6	500,000.00	487,740.00
	BELGIAN 1.9	700,000.00	751,506.00
	BELGIAN 2.15	500,000.00	533,520.00
	BELGIAN 3.75	1,000,000.00	1,469,860.00
	BTPS 0.05	1,000,000.00	1,004,460.00
	BTPS 0.1	1,000,000.00	1,005,170.00
	BTPS 0.2	2,000,000.00	2,006,180.00
	BTPS 0.35	500,000.00	504,110.00
	BTPS 0.35	1,500,000.00	1,498,980.00
	BTPS 0.45	2,000,000.00	2,013,000.00
	BTPS 0.65	1,600,000.00	1,624,480.00
	BTPS 0.65	2,000,000.00	1,956,500.00
	BTPS 0.7	2,000,000.00	2,033,160.00
	BTPS 0.9	800,000.00	807,464.00
	BTPS 0.95	2,000,000.00	2,007,320.00
	BTPS 1.05	2,000,000.00	2,043,680.00
	BTPS 1.2	1,000,000.00	1,025,180.00
	BTPS 1.25	2,000,000.00	1,905,480.00
	BTPS 1.35	2,000,000.00	2,061,920.00
	BTPS 1.45	2,000,000.00	2,066,100.00

BTPS 1.5	2,000,000.00	2,051,980.00	
BTPS 1.5	2,000,000.00	1,993,540.00	
BTPS 1.6	2,000,000.00	1,973,820.00	
BTPS 1.65	2,000,000.00	1,824,600.00	
BTPS 1.85	1,000,000.00	1,035,170.00	
BTPS 2	2,000,000.00	2,048,300.00	
BTPS 2.05	1,000,000.00	1,006,700.00	
BTPS 2.15	2,000,000.00	2,128,860.00	
BTPS 2.2	1,000,000.00	1,021,940.00	
BTPS 2.25	1,200,000.00	1,128,552.00	
BTPS 2.45	1,000,000.00	989,530.00	
BTPS 2.5	3,000,000.00	3,101,820.00	
BTPS 2.5	600,000.00	641,886.00	
BTPS 2.7	2,000,000.00	1,883,920.00	
BTPS 2.8	1,000,000.00	902,620.00	
BTPS 2.95	1,000,000.00	1,020,280.00	
BTPS 3.25	1,500,000.00	1,576,560.00	
BTPS 3.45	500,000.00	535,155.00	
BTPS 3.5	2,300,000.00	2,585,844.00	
BTPS 3.75	2,500,000.00	2,769,500.00	
BTPS 3.75	2,000,000.00	2,222,380.00	
BTPS 3.75	3,300,000.00	3,687,156.00	
BTPS 3.75	2,000,000.00	2,300,780.00	
BTPS 4	2,500,000.00	2,750,075.00	
BTPS 4	3,000,000.00	3,581,760.00	
BTPS 4.25	3,500,000.00	3,741,395.00	
BTPS 4.25	2,300,000.00	2,503,527.00	
BTPS 4.5	2,700,000.00	2,835,135.00	
BTPS 4.5	2,700,000.00	2,944,296.00	
BTPS 4.5	2,300,000.00	2,717,565.00	
BTPS 4.5	3,000,000.00	3,573,870.00	
BTPS 4.5	2,300,000.00	2,784,886.00	
BTPS 4.75	2,600,000.00	3,001,414.00	
BTPS 4.75	2,500,000.00	3,001,800.00	
BTPS 4.75	2,100,000.00	2,619,897.00	
BTPS 4.75	1,600,000.00	2,106,944.00	
BTPS 5	2,000,000.00	2,356,380.00	
BTPS 5	2,600,000.00	3,211,728.00	
BTPS 5	2,670,000.00	3,536,842.20	
BTPS 5	2,000,000.00	2,690,200.00	
BTPS 5	1,900,000.00	2,544,974.00	
BTPS 5.25	2,700,000.00	3,537,648.00	

BTPS 5.5	2,000,000.00	2,428,940.00
BTPS 5.5	2,000,000.00	2,436,880.00
BTPS 5.75	2,200,000.00	3,089,636.00
BTPS 6	3,100,000.00	4,372,612.00
BTPS 6.5	3,360,000.00	4,704,840.00
BTPS 7.25	1,000,000.00	1,438,660.00
BTPS 9	1,000,000.00	1,438,160.00
BUNDESÖBL-169 0.5	2,000,000.00	2,026,800.00
BUNDESÖBL-170 0.25	1,000,000.00	1,014,060.00
BUNDESÖBL-171 0	2,000,000.00	2,022,360.00
BUNDESÖBL-172 0.25	2,000,000.00	2,037,100.00
BUNDESÖBL-173 0	2,500,000.00	2,526,950.00
BUNDESÖBL-174 0	3,000,000.00	3,025,980.00
DEUTSCHLAND REP 0	3,000,000.00	2,867,430.00
DEUTSCHLAND REP 0.25	3,000,000.00	2,911,050.00
DEUTSCHLAND REP 0.5	500,000.00	505,215.00
DEUTSCHLAND REP 0.5	2,800,000.00	2,806,832.00
DEUTSCHLAND REP 0.5	1,000,000.00	985,920.00
DEUTSCHLAND REP 1	2,000,000.00	2,092,480.00
DEUTSCHLAND REP 1	2,500,000.00	2,609,575.00
DEUTSCHLAND REP 1.5	2,500,000.00	2,679,050.00
DEUTSCHLAND REP 1.5	2,500,000.00	2,684,825.00
DEUTSCHLAND REP 1.5	2,000,000.00	2,149,220.00
DEUTSCHLAND REP 1.5	2,000,000.00	2,155,540.00
DEUTSCHLAND REP 1.75	2,500,000.00	2,704,425.00
DEUTSCHLAND REP 1.75	2,000,000.00	2,184,120.00
DEUTSCHLAND REP 2	2,000,000.00	2,170,520.00
DEUTSCHLAND REP 2	1,500,000.00	1,654,110.00
DEUTSCHLAND REP 2.25	1,500,000.00	1,604,115.00
DEUTSCHLAND REP 2.25	2,000,000.00	2,178,220.00
DEUTSCHLAND REP 2.5	1,500,000.00	1,625,805.00
DEUTSCHLAND REP 2.5	2,200,000.00	2,786,014.00
DEUTSCHLAND REP 2.5	2,500,000.00	3,199,200.00
DEUTSCHLAND REP 3	3,000,000.00	3,250,560.00
DEUTSCHLAND REP 3.25	3,000,000.00	3,217,260.00
DEUTSCHLAND REP 3.25	2,000,000.00	2,240,680.00
DEUTSCHLAND REP 3.25	1,500,000.00	2,126,580.00
DEUTSCHLAND REP 3.5	3,000,000.00	3,171,810.00
DEUTSCHLAND REP 4	2,700,000.00	4,026,753.00
DEUTSCHLAND REP 4.25	1,500,000.00	2,369,175.00
DEUTSCHLAND REP 4.75	1,300,000.00	1,823,913.00
DEUTSCHLAND REP 4.75	2,100,000.00	3,275,433.00
DEUTSCHLAND REP 4.75	1,700,000.00	2,884,050.00

DEUTSCHLAND REP 5.5	1,800,000.00	2,815,326.00	
DEUTSCHLAND REP 5.625	1,580,000.00	2,325,538.80	
DEUTSCHLAND REP 6.25	1,200,000.00	1,625,484.00	
DEUTSCHLAND REP 6.25	1,000,000.00	1,618,040.00	
DEUTSCHLAND REP 6.5	1,000,000.00	1,535,040.00	
FINNISH GOV'T 0.75	500,000.00	480,715.00	
FINNISH GOV'T 1.5	1,000,000.00	1,068,320.00	
FINNISH GOV'T 1.625	1,000,000.00	1,072,600.00	
FINNISH GOV'T 2	1,000,000.00	1,100,450.00	
FINNISH GOV'T 2.625	500,000.00	637,640.00	
FINNISH GOV'T 2.75	600,000.00	713,934.00	
FINNISH GOV'T 3.375	700,000.00	757,309.00	
FINNISH GOV'T 3.5	1,000,000.00	1,117,430.00	
FINNISH GOV'T 4	1,000,000.00	1,251,370.00	
FINNISH GOV'T 4.375	1,000,000.00	1,068,100.00	
FRANCE O.A.T. 0	2,000,000.00	2,012,200.00	
FRANCE O.A.T. 0	3,000,000.00	3,026,940.00	
FRANCE O.A.T. 0	2,000,000.00	2,012,200.00	
FRANCE O.A.T. 0	1,000,000.00	999,640.00	
FRANCE O.A.T. 0.25	2,300,000.00	2,333,879.00	
FRANCE O.A.T. 0.25	3,000,000.00	2,873,940.00	
FRANCE O.A.T. 0.5	3,000,000.00	3,053,670.00	
FRANCE O.A.T. 0.5	3,500,000.00	3,496,045.00	
FRANCE O.A.T. 0.5	3,000,000.00	2,960,100.00	
FRANCE O.A.T. 1	2,000,000.00	2,040,100.00	
FRANCE O.A.T. 1	2,000,000.00	2,061,500.00	
FRANCE O.A.T. 1	2,000,000.00	2,031,980.00	
FRANCE O.A.T. 1.25	2,000,000.00	1,941,160.00	
FRANCE O.A.T. 1.5	4,400,000.00	4,567,860.00	
FRANCE O.A.T. 1.75	4,000,000.00	4,330,800.00	
FRANCE O.A.T. 1.75	2,100,000.00	2,283,792.00	
FRANCE O.A.T. 1.75	1,400,000.00	1,456,378.00	
FRANCE O.A.T. 1.75	1,000,000.00	952,650.00	
FRANCE O.A.T. 2	1,000,000.00	1,054,740.00	
FRANCE O.A.T. 2.25	3,200,000.00	3,526,112.00	
FRANCE O.A.T. 2.25	5,100,000.00	5,700,066.00	
FRANCE O.A.T. 2.5	3,500,000.00	3,766,035.00	
FRANCE O.A.T. 2.5	3,500,000.00	4,057,970.00	
FRANCE O.A.T. 2.75	4,500,000.00	5,295,195.00	
FRANCE O.A.T. 3	5,000,000.00	5,635,550.00	
FRANCE O.A.T. 3.25	4,300,000.00	4,836,425.00	
FRANCE O.A.T. 3.25	2,700,000.00	3,625,803.00	

FRANCE O.A.T. 3.5	4,000,000.00	4,343,560.00
FRANCE O.A.T. 3.5	4,000,000.00	4,926,120.00
FRANCE O.A.T. 3.75	5,000,000.00	5,361,900.00
FRANCE O.A.T. 3.75	3,900,000.00	4,396,704.00
FRANCE O.A.T. 4	2,300,000.00	3,343,671.00
FRANCE O.A.T. 4	1,370,000.00	2,175,998.40
FRANCE O.A.T. 4	1,500,000.00	2,442,930.00
FRANCE O.A.T. 4.25	4,400,000.00	4,651,724.00
FRANCE O.A.T. 4.25	4,500,000.00	5,522,715.00
FRANCE O.A.T. 4.5	3,500,000.00	5,519,290.00
FRANCE O.A.T. 4.75	2,900,000.00	4,436,362.00
FRANCE O.A.T. 5.5	3,000,000.00	4,436,400.00
FRANCE O.A.T. 5.75	3,100,000.00	5,001,354.00
FRANCE O.A.T. 6	3,000,000.00	4,237,890.00
FRANCE O.A.T. 8.5	850,000.00	979,676.00
FRANCE O.A.T. 8.5	1,200,000.00	1,717,896.00
IRISH GOVT 0	400,000.00	397,052.00
IRISH GOVT 0.8	700,000.00	722,358.00
IRISH GOVT 1	1,000,000.00	1,013,790.00
IRISH GOVT 2	1,000,000.00	1,048,010.00
IRISH GOVT 2.4	1,000,000.00	1,131,340.00
IRISH GOVT 3.4	1,000,000.00	1,178,970.00
IRISH GOVT 3.9	500,000.00	593,105.00
IRISH GOVT 4.4	1,000,000.00	1,065,680.00
IRISH GOVT 4.5	990,000.00	1,095,751.80
IRISH GOVT 5	1,000,000.00	1,143,690.00
IRISH GOVT 5.4	1,200,000.00	1,595,088.00
IRISH GOVT 5.9	800,000.00	885,240.00
NETHERLANDS GOVT 0	2,000,000.00	2,010,200.00
NETHERLANDS GOVT 0.25	2,000,000.00	2,030,800.00
NETHERLANDS GOVT 0.25	2,000,000.00	1,964,580.00
NETHERLANDS GOVT 0.5	1,500,000.00	1,485,465.00
NETHERLANDS GOVT 0.75	1,400,000.00	1,399,902.00
NETHERLANDS GOVT 1.75	1,600,000.00	1,737,872.00
NETHERLANDS GOVT 2	1,000,000.00	1,105,740.00
NETHERLANDS GOVT 2.25	1,500,000.00	1,652,865.00
NETHERLANDS GOVT 2.5	1,100,000.00	1,318,504.00
NETHERLANDS GOVT 2.75	1,900,000.00	2,530,306.00
NETHERLANDS GOVT 3.25	1,500,000.00	1,680,150.00
NETHERLANDS GOVT 3.5	1,500,000.00	1,643,760.00
NETHERLANDS GOVT 3.75	1,000,000.00	1,181,780.00
NETHERLANDS GOVT 3.75	1,500,000.00	2,268,630.00
NETHERLANDS GOVT 4	1,500,000.00	1,597,860.00

NETHERLANDS GOVT 4	1,400,000.00	2,080,722.00	
NETHERLANDS GOVT 5.5	700,000.00	1,017,296.00	
REP OF AUSTRIA 0.25	1,000,000.00	1,013,060.00	
REP OF AUSTRIA 0.5	2,400,000.00	2,336,256.00	
REP OF AUSTRIA 0.75	1,900,000.00	1,905,871.00	
REP OF AUSTRIA 1.2	900,000.00	943,218.00	
REP OF AUSTRIA 1.5	500,000.00	496,130.00	
REP OF AUSTRIA 1.65	1,000,000.00	1,081,240.00	
REP OF AUSTRIA 1.75	1,000,000.00	1,084,720.00	
REP OF AUSTRIA 1.95	1,000,000.00	1,033,140.00	
REP OF AUSTRIA 2.4	800,000.00	936,512.00	
REP OF AUSTRIA 3.15	500,000.00	687,725.00	
REP OF AUSTRIA 3.4	1,000,000.00	1,158,720.00	
REP OF AUSTRIA 3.5	2,000,000.00	2,262,240.00	
REP OF AUSTRIA 3.65	1,000,000.00	1,153,340.00	
REP OF AUSTRIA 3.8	500,000.00	836,125.00	
REP OF AUSTRIA 3.9	1,500,000.00	1,654,320.00	
REP OF AUSTRIA 4.15	1,300,000.00	1,932,047.00	
REP OF AUSTRIA 4.35	1,200,000.00	1,262,928.00	
REP OF AUSTRIA 4.85	1,000,000.00	1,339,930.00	
REP OF AUSTRIA 6.25	1,000,000.00	1,502,290.00	
SPANISH GOV'T 0.4	2,000,000.00	2,010,980.00	
SPANISH GOV'T 0.75	2,000,000.00	2,048,460.00	
SPANISH GOV'T 1.15	2,000,000.00	2,062,340.00	
SPANISH GOV'T 1.3	2,000,000.00	2,002,780.00	
SPANISH GOV'T 1.4	2,000,000.00	2,062,960.00	
SPANISH GOV'T 1.45	1,000,000.00	999,490.00	
SPANISH GOV'T 1.5	1,500,000.00	1,517,175.00	
SPANISH GOV'T 1.6	2,000,000.00	2,091,400.00	
SPANISH GOV'T 1.95	2,200,000.00	2,329,096.00	
SPANISH GOV'T 1.95	2,000,000.00	2,043,880.00	
SPANISH GOV'T 2.15	2,000,000.00	2,156,440.00	
SPANISH GOV'T 2.35	1,000,000.00	1,041,920.00	
SPANISH GOV'T 2.75	3,000,000.00	3,112,500.00	
SPANISH GOV'T 2.75	2,300,000.00	2,587,362.00	
SPANISH GOV'T 2.9	1,000,000.00	1,066,400.00	
SPANISH GOV'T 3.45	1,400,000.00	1,611,008.00	
SPANISH GOV'T 3.8	2,400,000.00	2,842,920.00	
SPANISH GOV'T 4	2,500,000.00	2,728,400.00	
SPANISH GOV'T 4.2	2,050,000.00	2,692,490.50	
SPANISH GOV'T 4.3	2,000,000.00	2,155,900.00	
SPANISH GOV'T 4.4	2,000,000.00	2,426,520.00	

	SPANISH GOV'T 4.6	2,500,000.00	2,678,600.00
	SPANISH GOV'T 4.65	3,100,000.00	3,914,990.00
	SPANISH GOV'T 4.7	1,500,000.00	2,128,155.00
	SPANISH GOV'T 4.8	2,000,000.00	2,482,620.00
	SPANISH GOV'T 4.85	2,000,000.00	2,266,760.00
	SPANISH GOV'T 4.9	2,000,000.00	2,890,180.00
	SPANISH GOV'T 5.15	1,500,000.00	2,030,850.00
	SPANISH GOV'T 5.15	1,200,000.00	1,817,604.00
	SPANISH GOV'T 5.4	2,500,000.00	3,108,550.00
	SPANISH GOV'T 5.5	2,700,000.00	3,171,879.00
	SPANISH GOV'T 5.75	2,200,000.00	3,285,304.00
	SPANISH GOV'T 5.85	2,500,000.00	3,057,875.00
	SPANISH GOV'T 5.9	2,500,000.00	3,439,900.00
	SPANISH GOV'T 6	2,000,000.00	2,890,120.00
	ユーロ 小計	499,970,000.00	576,784,794.70 (76,181,735,683)
英債券	UK TSY GILT 0.5	1,200,000.00	1,171,524.00
	UK TSY GILT 1.25	1,000,000.00	969,520.00
	UK TSY GILT 1.5	2,900,000.00	2,953,447.00
	UK TSY GILT 1.5	2,500,000.00	2,504,675.00
	UK TSY GILT 1.5	1,000,000.00	894,770.00
	UK TSY GILT 1.75	3,000,000.00	3,046,440.00
	UK TSY GILT 1.75	3,000,000.00	3,092,400.00
	UK TSY GILT 1.75	600,000.00	579,210.00
	UK TSY GILT 2	2,500,000.00	2,573,000.00
	UK TSY GILT 2	2,200,000.00	2,299,550.00
	UK TSY GILT 2.25	2,700,000.00	2,854,143.00
	UK TSY GILT 2.5	1,500,000.00	1,856,085.00
	UK TSY GILT 2.75	1,700,000.00	1,856,094.00
	UK TSY GILT 3.25	2,500,000.00	3,131,625.00
	UK TSY GILT 3.5	2,500,000.00	3,279,300.00
	UK TSY GILT 3.5	2,000,000.00	3,162,080.00
	UK TSY GILT 3.75	2,000,000.00	2,094,980.00
	UK TSY GILT 3.75	2,000,000.00	2,148,860.00
	UK TSY GILT 3.75	1,400,000.00	1,539,062.00
	UK TSY GILT 3.75	1,900,000.00	2,790,549.00
	UK TSY GILT 4	1,500,000.00	1,681,245.00
	UK TSY GILT 4	2,000,000.00	3,298,940.00
	UK TSY GILT 4.25	1,300,000.00	1,613,781.00
	UK TSY GILT 4.25	1,500,000.00	1,956,165.00
	UK TSY GILT 4.25	1,900,000.00	2,576,514.00
	UK TSY GILT 4.25	1,500,000.00	2,099,970.00
	UK TSY GILT 4.25	1,600,000.00	2,265,392.00

	UK TSY GILT 4.25	1,900,000.00	2,841,640.00	
	UK TSY GILT 4.25	1,700,000.00	2,631,481.00	
	UK TSY GILT 4.25	2,100,000.00	3,477,495.00	
	UK TSY GILT 4.5	1,800,000.00	1,873,602.00	
	UK TSY GILT 4.5	1,800,000.00	2,467,386.00	
	UK TSY GILT 4.5	1,800,000.00	2,683,692.00	
	UK TSY GILT 4.75	1,700,000.00	1,839,740.00	
	UK TSY GILT 4.75	1,300,000.00	1,742,286.00	
	UK TSY GILT 4.75	1,500,000.00	2,217,420.00	
	UK TSY GILT 5	1,600,000.00	1,993,936.00	
	UK TSY GILT 6	1,100,000.00	1,575,090.00	
	UK TSY GILT 8	1,620,000.00	1,994,236.20	
	英bond 小計	71,320,000.00	87,627,325.20 (13,081,007,105)	
スイスフラン	SWISS (GOVT) 2.25	900,000.00	968,400.00	
	SWISS (GOVT) 3	500,000.00	524,450.00	
	SWISS (GOVT) 4	400,000.00	488,720.00	
	SWISS (GOVT) 4	700,000.00	971,390.00	
	スイスフラン 小計	2,500,000.00	2,952,960.00 (338,409,216)	
スウェーデンクローナ	SWEDISH GOVRNMNT 1	8,000,000.00	8,171,040.00	
	SWEDISH GOVRNMNT 1.5	7,000,000.00	7,464,100.00	
	SWEDISH GOVRNMNT 2.5	5,000,000.00	5,688,950.00	
	SWEDISH GOVRNMNT 3.5	11,000,000.00	12,634,600.00	
	SWEDISH GOVRNMNT 3.5	6,000,000.00	8,022,180.00	
	SWEDISH GOVRNMNT 4.25	10,000,000.00	10,533,900.00	
	SWEDISH GOVRNMNT 5	11,000,000.00	12,637,900.00	
	スウェーデンクローナ 小計	58,000,000.00	65,152,670.00 (870,439,671)	
ノルウェークローネ	NORWEGIAN GOV'T 1.5	5,000,000.00	4,887,000.00	
	NORWEGIAN GOV'T 1.75	5,000,000.00	5,011,000.00	
	NORWEGIAN GOV'T 2	10,000,000.00	10,285,000.00	
	NORWEGIAN GOV'T 3	4,000,000.00	4,329,600.00	
	NORWEGIAN GOV'T 3.75	9,000,000.00	9,759,600.00	
	NORWEGIAN GOV'T 4.5	6,000,000.00	6,289,200.00	
	ノルウェークローネ 小計	39,000,000.00	40,561,400.00 (556,096,794)	
デンマーククローネ	DENMARK - BULLET 0.25	4,000,000.00	4,022,800.00	
	DENMARK - BULLET 1.5	5,000,000.00	5,350,000.00	
	DENMARK - BULLET 1.75	11,000,000.00	12,019,700.00	
	DENMARK - BULLET 3	7,000,000.00	7,816,900.00	
	DENMARK - BULLET 4	8,000,000.00	8,628,800.00	

	DENMARK - BULLET 4.5	14,000,000.00	22,751,400.00
デンマーククローネ 小計		49,000,000.00	60,589,600.00 (1,074,253,608)
ポーランドズロチ	POLAND GOVT BOND 1.5	5,500,000.00	5,474,590.00
	POLAND GOVT BOND 1.75	3,000,000.00	2,956,500.00
	POLAND GOVT BOND 2	2,500,000.00	2,482,500.00
	POLAND GOVT BOND 2.5	4,000,000.00	3,772,000.00
	POLAND GOVT BOND 3.25	5,000,000.00	5,005,500.00
	POLAND GOVT BOND 4	2,000,000.00	2,108,000.00
	POLAND GOVT BOND 5.25	2,000,000.00	2,177,000.00
	POLAND GOVT BOND 5.5	4,000,000.00	4,250,000.00
	POLAND GOVT BOND 5.75	4,000,000.00	4,472,000.00
	POLAND GOVT BOND 5.75	4,200,000.00	4,782,876.00
	POLAND GOVT BOND 5.75	1,000,000.00	1,227,300.00
ポーランドズロチ 小計		37,200,000.00	38,708,266.00 (1,230,148,693)
オーストラリアドル	AUSTRALIAN GOVT. 1.75	3,000,000.00	2,970,000.00
	AUSTRALIAN GOVT. 2	1,000,000.00	989,200.00
	AUSTRALIAN GOVT. 2.25	400,000.00	396,840.00
	AUSTRALIAN GOVT. 2.25	2,100,000.00	1,982,190.00
	AUSTRALIAN GOVT. 2.75	3,000,000.00	3,040,920.00
	AUSTRALIAN GOVT. 2.75	2,500,000.00	2,518,370.00
	AUSTRALIAN GOVT. 2.75	2,000,000.00	1,981,200.00
	AUSTRALIAN GOVT. 2.75	1,500,000.00	1,472,476.50
	AUSTRALIAN GOVT. 2.75	1,000,000.00	934,700.00
	AUSTRALIAN GOVT. 3	1,000,000.00	904,090.00
	AUSTRALIAN GOVT. 3.25	2,900,000.00	3,003,530.00
	AUSTRALIAN GOVT. 3.25	2,100,000.00	2,165,730.00
	AUSTRALIAN GOVT. 3.25	1,000,000.00	984,800.00
	AUSTRALIAN GOVT. 3.75	1,200,000.00	1,274,268.00
	AUSTRALIAN GOVT. 4.25	3,300,000.00	3,654,750.00
	AUSTRALIAN GOVT. 4.5	3,000,000.00	3,155,496.00
	AUSTRALIAN GOVT. 4.5	1,600,000.00	1,869,280.00
	AUSTRALIAN GOVT. 4.75	3,200,000.00	3,682,240.00
	AUSTRALIAN GOVT. 5.25	1,300,000.00	1,346,941.70
	AUSTRALIAN GOVT. 5.5	2,500,000.00	2,866,375.00
AUSTRALIAN GOVT. 5.75	3,000,000.00	3,331,950.00	
AUSTRALIAN GOVT. 5.75	3,000,000.00	3,424,500.00	
オーストラリアドル 小計		45,600,000.00	47,949,847.20 (4,040,254,125)
シンガポールドル	SINGAPORE GOV'T 2.25	500,000.00	507,900.00
	SINGAPORE GOV'T 2.75	1,000,000.00	1,036,000.00
	SINGAPORE GOV'T 2.75	400,000.00	400,400.00

	SINGAPORE GOV'T 2.75	500,000.00	496,612.50	
	SINGAPORE GOV'T 2.875	400,000.00	416,400.00	
	SINGAPORE GOV'T 3	500,000.00	525,750.00	
	SINGAPORE GOV'T 3.125	1,000,000.00	1,053,800.00	
	SINGAPORE GOV'T 3.25	2,100,000.00	2,181,480.00	
	SINGAPORE GOV'T 3.375	500,000.00	548,572.50	
	SINGAPORE GOV'T 3.5	1,500,000.00	1,648,545.00	
	シンガポールドル 小計	8,400,000.00	8,815,460.00 (714,933,806)	
マレーシアリングット	MALAYSIA GOVT 3.418	8,000,000.00	7,884,000.00	
	MALAYSIA GOVT 3.502	9,000,000.00	8,472,132.00	
	MALAYSIA GOVT 4.378	8,000,000.00	8,140,800.00	
	MALAYSIA GOVT 4.498	4,000,000.00	4,010,800.00	
	MALAYSIA GOVT 4.736	3,000,000.00	2,934,252.00	
	マレーシアリングット 小計	32,000,000.00	31,441,984.00 (859,623,842)	
南アフリカランド	REP SOUTH AFRICA 6.5	60,000,000.00	45,036,000.00	
	REP SOUTH AFRICA 6.75	27,000,000.00	26,797,500.00	
	REP SOUTH AFRICA 7	65,000,000.00	56,543,500.00	
	南アフリカランド 小計	152,000,000.00	128,377,000.00 (1,173,365,780)	
	合計		181,786,932,094 (181,786,932,094)	

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

通貨	銘柄数	組入債券時価比率	合計金額に対する比率
米ドル	国債証券 228銘柄	41.4%	42.0%
カナダドル	国債証券 30銘柄	2.2%	2.2%
メキシコペソ	国債証券 7銘柄	0.8%	0.8%
ユーロ	国債証券 266銘柄	41.4%	41.9%
英ポンド	国債証券 39銘柄	7.1%	7.2%
スイスフラン	国債証券 4銘柄	0.2%	0.2%
スウェーデンクローナ	国債証券 7銘柄	0.5%	0.5%
ノルウェークローネ	国債証券 6銘柄	0.3%	0.3%
デンマーククローネ	国債証券 6銘柄	0.6%	0.6%
ポーランドズロチ	国債証券 11銘柄	0.7%	0.7%
オーストラリアドル	国債証券 22銘柄	2.2%	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 5銘柄	0.5%	0.5%
南アフリカランド	国債証券 3銘柄	0.6%	0.6%

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

【中間財務諸表】

- 1 . 当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和52年大蔵省令第38号)ならびに同規則第38条の3、第57条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)に基づいて作成しております。
なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
- 2 . 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第14期中間計算期間（平成30年 2月20日から平成30年 8月19日まで）の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。

【三井住友・DC年金バランス30（債券重点型）】

（1）【中間貸借対照表】

（単位：円）

第14期中間計算期間
（平成30年 8月19日現在）

資産の部	
流動資産	
金銭信託	404,970,559
コール・ローン	54,940,801
親投資信託受益証券	8,833,954,206
流動資産合計	9,293,865,566
資産合計	9,293,865,566
負債の部	
流動負債	
未払解約金	6,441,941
未払受託者報酬	1,424,657
未払委託者報酬	9,022,785
未払利息	483
その他未払費用	243,593
流動負債合計	17,133,459
負債合計	17,133,459
純資産の部	
元本等	
元本	6,359,458,272
剰余金	
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	2,917,273,835
元本等合計	9,276,732,107
純資産合計	9,276,732,107
負債純資産合計	9,293,865,566

（２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第14期中間計算期間 自 平成30年 2月20日 至 平成30年 8月19日
営業収益	
有価証券売買等損益	6,547,445
営業収益合計	6,547,445
営業費用	
支払利息	101,162
受託者報酬	1,424,657
委託者報酬	9,022,785
その他費用	356,096
営業費用合計	10,904,700
営業利益又は営業損失（ ）	17,452,145
経常利益又は経常損失（ ）	17,452,145
中間純利益又は中間純損失（ ）	17,452,145
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（ ）	1,035,681
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	2,639,173,335
剰余金増加額又は欠損金減少額	423,186,844
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	423,186,844
剰余金減少額又は欠損金増加額	126,598,518
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	126,598,518
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-
分配金	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	2,917,273,835

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針の注記)

項 目	第14期中間計算期間	
	自 平成30年 2月20日	至 平成30年 8月19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>当中間計算期間は前期末が休日のため、平成30年 2月20日から平成30年 8月19日までとなっております。</p>	

(中間貸借対照表に関する注記)

項 目	第14期中間計算期間	
	(平成30年 8月19日現在)	
1. 当中間計算期間の末日における受益権の総数		6,359,458,272口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額	1.4587円
	(10,000口当たりの純資産額	14,587円)

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項 目	第14期中間計算期間 (平成30年 8月19日現在)
1. 中間貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券（親投資信託受益証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

項 目	第14期中間計算期間 (平成30年 8月19日現在)
期首元本額	5,724,182,209円
期中追加設定元本額	909,792,161円
期中一部解約元本額	274,516,098円

【三井住友・DC年金バランス50（標準型）】

（1）【中間貸借対照表】

（単位：円）

第14期中間計算期間
（平成30年 8月19日現在）

資産の部	
流動資産	
金銭信託	1,173,426,917
コール・ローン	154,369,543
親投資信託受益証券	24,428,747,819
流動資産合計	25,756,544,279
資産合計	25,756,544,279
負債の部	
流動負債	
未払解約金	14,030,535
未払受託者報酬	3,965,179
未払委託者報酬	26,434,477
未払利息	1,357
その他未払費用	678,328
流動負債合計	45,109,876
負債合計	45,109,876
純資産の部	
元本等	
元本	16,478,274,711
剰余金	
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	9,233,159,692
元本等合計	25,711,434,403
純資産合計	25,711,434,403
負債純資産合計	25,756,544,279

（２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第14期中間計算期間 自 平成30年 2月20日 至 平成30年 8月19日
営業収益	
有価証券売買等損益	53,572,169
営業収益合計	53,572,169
営業費用	
支払利息	282,303
受託者報酬	3,965,179
委託者報酬	26,434,477
その他費用	989,837
営業費用合計	31,671,796
営業利益又は営業損失（ ）	85,243,965
経常利益又は経常損失（ ）	85,243,965
中間純利益又は中間純損失（ ）	85,243,965
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（ ）	2,899,411
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	8,428,678,511
剰余金増加額又は欠損金減少額	1,203,122,210
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	1,203,122,210
剰余金減少額又は欠損金増加額	310,497,653
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	310,497,653
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-
分配金	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	9,233,159,692

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針の注記)

項 目	第14期中間計算期間	
	自 平成30年 2月20日	至 平成30年 8月19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>当中間計算期間は前期末が休日のため、平成30年 2月20日から平成30年 8月19日までとなっております。</p>	

(中間貸借対照表に関する注記)

項 目	第14期中間計算期間	
	(平成30年 8月19日現在)	
1. 当中間計算期間の末日における受益権の総数		16,478,274,711口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額	1.5603円
	(10,000口当たりの純資産額	15,603円)

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項目	第14期中間計算期間 (平成30年 8月19日現在)
1. 中間貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券（親投資信託受益証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

項目	第14期中間計算期間 (平成30年 8月19日現在)
期首元本額	14,911,517,227円
期中追加設定元本額	2,116,161,988円
期中一部解約元本額	549,404,504円

【三井住友・DC年金バランス70（株式重点型）】

（1）【中間貸借対照表】

（単位：円）

第14期中間計算期間
（平成30年 8月19日現在）

資産の部	
流動資産	
金銭信託	601,078,622
コール・ローン	79,881,445
親投資信託受益証券	12,600,628,274
流動資産合計	13,281,588,341
資産合計	13,281,588,341
負債の部	
流動負債	
未払解約金	16,758,083
未払受託者報酬	2,054,880
未払委託者報酬	14,384,091
未払利息	702
その他未払費用	351,487
流動負債合計	33,549,243
負債合計	33,549,243
純資産の部	
元本等	
元本	8,108,347,323
剰余金	
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	5,139,691,775
元本等合計	13,248,039,098
純資産合計	13,248,039,098
負債純資産合計	13,281,588,341

（２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第14期中間計算期間 自 平成30年 2月20日 至 平成30年 8月19日
営業収益	
有価証券売買等損益	48,527,371
営業収益合計	48,527,371
営業費用	
支払利息	146,464
受託者報酬	2,054,880
委託者報酬	14,384,091
その他費用	512,942
営業費用合計	17,098,377
営業利益又は営業損失（ ）	65,625,748
経常利益又は経常損失（ ）	65,625,748
中間純利益又は中間純損失（ ）	65,625,748
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（ ）	2,608,668
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	4,715,522,149
剰余金増加額又は欠損金減少額	707,689,328
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	707,689,328
剰余金減少額又は欠損金増加額	215,285,286
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	215,285,286
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-
分配金	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	5,139,691,775

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針の注記)

項 目	第14期中間計算期間 自 平成30年 2月20日 至 平成30年 8月19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>当中間計算期間は前期末が休日のため、平成30年 2月20日から平成30年 8月19日までとなっております。</p>

(中間貸借対照表に関する注記)

項 目	第14期中間計算期間 (平成30年 8月19日現在)
1. 当中間計算期間の末日における受益権の総数	8,108,347,323口
2. 1単位当たり純資産の額	<p>1口当たり純資産額 1.6339円</p> <p>(10,000口当たりの純資産額 16,339円)</p>

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項目	第14期中間計算期間 (平成30年 8月19日現在)
1. 中間貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券（親投資信託受益証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

項目	第14期中間計算期間 (平成30年 8月19日現在)
期首元本額	7,343,316,412円
期中追加設定元本額	1,100,504,597円
期中一部解約元本額	335,473,686円

（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、中間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30年 8月19日現在）

資産の部	
流動資産	
金銭信託	2,819,635,398
コール・ローン	383,456,915
株式	169,985,524,980
派生商品評価勘定	2,082,320

(平成30年 8月19日現在)

未収配当金	231,500,216
前払金	69,920,000
差入委託証拠金	23,640,000
流動資産合計	173,515,759,829
資産合計	173,515,759,829
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	72,129,760
未払解約金	246,293,000
未払利息	1,124
その他未払費用	33,553
流動負債合計	318,457,437
負債合計	318,457,437
純資産の部	
元本等	
元本	66,236,301,149
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	106,961,001,243
元本等合計	173,197,302,392
純資産合計	173,197,302,392
負債純資産合計	173,515,759,829

注記表

(重要な会計方針の注記)

項目	自平成30年 2月20日 至平成30年 8月19日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>先物取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場によっております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金の計上基準</p> <p>受取配当金は原則として、配当落ち日において、確定配当金額または予想配当金額を計上しております。なお、配当金額が未確定の場合は、入金日基準で計上しております。</p>

（貸借対照表に関する注記）

項目	（平成30年 8月19日現在）	
1. 担保資産	代用として、担保に供している資産は次の通りであります。	
	株式	2,721,200,000円
2. 当計算期間の末日における受益権の総数		66,236,301,149口
3. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額	2.6148円
	(10,000口当たりの純資産額)	26,148円)

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

項目	（平成30年 8月19日現在）
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券（株式） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

（デリバティブ取引に関する注記）

（平成30年 8月19日現在）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

（単位：円）

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	3,325,407,440	-	3,255,360,000	70,047,440
	東証株価指数先物	3,325,407,440	-	3,255,360,000	70,047,440
	合計	3,325,407,440	-	3,255,360,000	70,047,440

（注）1. 時価の算定方法

(1) 株価指数先物取引の時価の算定方法について

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

2)株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

(その他の注記)

(平成30年 8月19日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	69,684,287,877円
同期中における追加設定元本額	5,277,816,996円
同期中における一部解約元本額	8,725,803,724円
平成30年 8月19日現在における元本の内訳	
三井住友・日本株式インデックス年金ファンド	10,070,303,018円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	703,095,491円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	3,401,849,326円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	2,513,332,777円
SMAM・グローバルバランスファンド(機動的資産配分型)	106,936,072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)	6,926,938円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2025(4資産タイプ)	22,887,909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)	55,712,963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)	78,940,972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)	45,860,477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)	115,752,681円
国内株式指数ファンド(TOPIX)	1,610,328,321円
三井住友・DCつみたてNISA・日本株インデックスファンド	6,171,749,934円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	375,764,172円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	595,686,355円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	601,589,248円
イオン・バランス戦略ファンド	16,040,053円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2050	7,183,658円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	1,994,392円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	3,077,486円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	15,144,387円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	15,125,794円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	52,149,773円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	4,182,932円
SMAM・国内株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	6,364,475,324円
バランスファンドVA(安定運用型) <適格機関投資家限定>	26,860,709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>	970,942,604円
SMAM・バランスファンドVA25 <適格機関投資家専用>	3,680,255,072円
SMAM・バランスファンドVA37.5 <適格機関投資家専用>	2,526,934,751円
SMAM・バランスファンドVA50 <適格機関投資家専用>	9,293,295,796円
SMAM・バランスファンドVL30 <適格機関投資家限定>	56,121,423円
SMAM・バランスファンドVL50 <適格機関投資家限定>	225,194,166円

世界6資産バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	779,654円
SMAM・バランスファンドVA75<適格機関投資家専用>	1,024,912,800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>	55,784,848円
SMAM・インデックス・バランスVA25<適格機関投資家専用>	380,046,357円
SMAM・インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用>	1,094,310,631円
SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用>	986,911,995円
SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>	3,183,952,332円
SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定>	9,592,797円
三井住友・5資産バランスファンド・VAS（適格機関投資家専用）	1,409,786,424円
SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	68,600,745円
SMAM・バランスファンドVA20<適格機関投資家専用>	107,674,530円
三井住友・7資産バランスファンド・VAS（適格機関投資家専用）	1,676,254,768円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>	104,572,701円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>	46,434,041円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用>	21,696,102円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>	214,366,887円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	388,485,672円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T<適格機関投資家専用>	162,473,705円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A2<適格機関投資家専用>	115,344,686円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A2<適格機関投資家専用>	59,880,359円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A2<適格機関投資家専用>	10,929,563円
SMAM・アセットバランスファンドVA30L2<適格機関投資家専用>	76,294,552円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L2<適格機関投資家専用>	969,378,872円
SMAM・国内株式インデックスファンド・VA（適格機関投資家専用）	201,851,802円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T2<適格機関投資家専用>	19,535,802円
SMAM・グローバルバランスファンド（標準型）VA<適格機関投資家限定>	1,730,910,414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>	251,652,878円
SMAM・世界バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	1,683,022,698円
SMAM・世界バランスファンドVA2<適格機関投資家限定>	166,787,326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>	11,701,536円
SMAM・マルチアセットストラテジーファンド2016-04<適格機関投資家限定>	106,098,612円
SMAM・マルチアセットストラテジーファンド2016-05<適格機関投資家限定>	50,985,351円
SMAM・マルチアセットストラテジー・オープン<適格機関投資家限定>	109,574,746円
SMAM・マルチアセット・ダイナミックアロケーション・ストラテジー・ファンド<適格機関投資家限定>	19,989円
合計	66,236,301,149円

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30年 8月19日現在）

資産の部

流動資産

金銭信託

1,130,869,964

コール・ローン

153,792,901

（平成30年 8月19日現在）

国債証券	147,465,543,780
地方債証券	18,253,514,241
特殊債証券	25,016,353,285
社債証券	7,597,884,000
未収入金	19,882,800
未収利息	608,241,984
前払費用	10,975,405
流動資産合計	200,257,058,360
資産合計	200,257,058,360
負債の部	
流動負債	
未払解約金	708,988,451
未払利息	450
その他未払費用	23,210
流動負債合計	709,012,111
負債合計	709,012,111
純資産の部	
元本等	
元本	158,836,546,855
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	40,711,499,394
元本等合計	199,548,046,249
純資産合計	199,548,046,249
負債純資産合計	200,257,058,360

注記表

（重要な会計方針の注記）

項目	自 平成30年 2月20日 至 平成30年 8月19日
有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券、地方債証券、特殊債証券、社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>

（貸借対照表に関する注記）

項目	（平成30年 8月19日現在）	
1. 当計算期間の末日における受益権の総数		158,836,546,855口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額	1.2563円
	(10,000口当たりの純資産額)	12,563円)

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

項目	（平成30年 8月19日現在）	
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券（国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。	

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

（平成30年 8月19日現在）	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	164,465,810,821円
同期中における追加設定元本額	13,977,235,528円
同期中における一部解約元本額	19,606,499,494円
平成30年 8月19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）	4,092,363,421円
三井住友・DC年金バランス50（標準型）	7,248,223,588円
三井住友・DC年金バランス70（株式重点型）	1,615,393,470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）	428,835,505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）	53,105,831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）	158,499,953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）	266,654,746円

(平成30年 8月19日現在)	
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2035(4資産タイプ)	222,118,137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)	85,646,193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)	179,940,487円
三井住友・DC年金バランスゼロ(債券型)	71,406,330円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	3,881,398,045円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	511,380,627円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	464,558,014円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2050	7,996,642円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	3,429,460円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	1,844,034円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	1,470,795円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	1,184,407円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	3,533,729円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	13,211,067円
SMAM・年金グローバル債券ファンド<適格機関投資家限定>	5,810,057,598円
SMAM・バランスファンドVA25<適格機関投資家専用>	20,945,128,495円
SMAM・バランスファンドVA37.5<適格機関投資家専用>	8,030,899,688円
SMAM・バランスファンドVA50<適格機関投資家専用>	19,681,595,178円
SMAM・バランスファンドVL30<適格機関投資家限定>	362,538,660円
SMAM・バランスファンドVL50<適格機関投資家限定>	639,651,354円
世界6資産バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	2,980,578円
SMAM・バランスファンドVA75<適格機関投資家専用>	301,054,190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>	120,214,392円
SMAM・インデックス・バランスVA25<適格機関投資家専用>	2,136,089,504円
SMAM・インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用>	2,354,397,695円
SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用>	3,127,009,772円
SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>	11,959,811,615円
SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定>	20,279,768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)	5,860,532,525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)	18,099,819,930円
SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	580,305,337円
SMAM・バランスファンドVA20<適格機関投資家専用>	936,194,936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)	16,410,847,294円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>	981,786,019円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>	202,716,913円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用>	46,907,369円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>	2,228,076,226円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	2,729,920,395円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T<適格機関投資家専用>	2,590,046,561円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A2<適格機関投資家専用>	1,083,041,690円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A2<適格機関投資家専用>	253,692,802円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A2<適格機関投資家専用>	23,156,156円
SMAM・アセットバランスファンドVA30L2<適格機関投資家専用>	382,829,104円

（平成30年 8月19日現在）	
SMAM・アセットバランスファンドVA25L2 <適格機関投資家専用>	6,923,069,679円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T2 <適格機関投資家専用>	311,416,414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>	175,126,419円
SMAM・マルチアセットストラテジーファンド2016-04 <適格機関投資家限定>	1,675,188,908円
SMAM・マルチアセットストラテジーファンド2016-05 <適格機関投資家限定>	804,090,610円
SMAM・マルチアセットストラテジー・オープン<適格機関投資家限定>	1,733,459,033円
SMAM・マルチアセット・ダイナミックアロケーション・ストラテジー・ファンド<適格機関投資家限定>	419,567円
合計	158,836,546,855円

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30年 8月19日現在）

資産の部

流動資産

預金	2,198,384,493
金銭信託	229,973,849
コール・ローン	31,275,342
株式	176,945,548,573
投資証券	4,107,625,146
派生商品評価勘定	53,578,950
未収入金	34,137
未収配当金	349,211,784
差入委託証拠金	1,882,937,607
流動資産合計	185,798,569,881

資産合計

185,798,569,881

負債の部

流動負債

派生商品評価勘定	24,560,589
前受金	29,600,174
未払解約金	351,731,322
未払利息	91
その他未払費用	5,670
流動負債合計	405,897,846

負債合計

405,897,846

純資産の部

元本等

元本	52,502,621,132
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	132,890,050,903
元本等合計	185,392,672,035

純資産合計

185,392,672,035

負債純資産合計

185,798,569,881

注記表

（重要な会計方針の注記）

項目	自 平成30年 2月20日 至 平成30年 8月19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</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>
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</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30年 8月19日現在)	
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	52,502,621,132口	
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額	3.5311円
	(10,000口当たりの純資産額)	35,311円)

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項目	(平成30年 8月19日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券(株式、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30年 8月19日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位:円)

区分	種類	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	4,215,097,639	-	4,244,697,813	29,600,174
	SPMINI 1809	2,977,561,449	-	3,028,308,316	50,746,867
	DJ EUR 1809	759,565,178	-	737,022,073	22,543,105
	FTSE 1809	278,024,427	-	277,061,896	962,531
	SPI200 1809	199,946,585	-	202,305,528	2,358,943
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	195,267,387	-	195,849,200	581,813
	米ドル	143,727,350	-	144,118,000	390,650
	カナダドル	7,567,452	-	7,582,500	15,048
	ユーロ	25,084,860	-	25,216,000	131,140
	英ポンド	5,614,880	-	5,640,400	25,520
	スイスフラン	5,564,975	-	5,557,500	7,475
	スウェーデンクローナ	1,920,560	-	1,929,600	9,040
	ノルウェークローネ	522,736	-	522,400	336
	デンマーククローネ	1,345,936	-	1,352,800	6,864
	香港ドル	2,817,298	-	2,822,000	4,702
	シンガポールドル	801,330	-	806,100	4,770
	イスラエルシェケル	300,010	-	301,900	1,890
	合計	4,410,365,026	-	4,440,547,013	29,018,361

(注) 1. 時価の算定方法

(1) 株価指数先物取引の時価の算定方法について

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

2) 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

(2) 為替予約取引の時価の算定方法について

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

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

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

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

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

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

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

(その他の注記)

(平成30年 8月19日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	53,426,368,221円
同期中における追加設定元本額	6,086,312,981円
同期中における一部解約元本額	7,010,060,070円
平成30年 8月19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	13,104,452,125円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	262,432,693円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	1,091,650,542円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	753,168,694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)	86,799,537円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2020(4資産タイプ)	2,617,655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)	7,827,465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)	21,829,082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)	39,406,911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)	25,454,168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)	65,501,038円
外国株式指数ファンド	487,114,584円
三井住友・DCつみたてNISA・全海外株インデックスファンド	2,199,048,265円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	339,131,161円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	393,118,513円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	349,816,993円
イオン・バランス戦略ファンド	61,758,999円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2050	4,489,354円

(平成30年 8月19日現在)	
三井住友・資産最適化ファンド(1 安定重視型)	1,479,343円
三井住友・資産最適化ファンド(2 やや安定型)	2,302,971円
三井住友・資産最適化ファンド(3 バランス型)	11,244,217円
三井住友・資産最適化ファンド(4 やや成長型)	11,199,434円
三井住友・資産最適化ファンド(5 成長重視型)	38,368,374円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	6,208,176円
SMAM・外国株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	2,328,710,506円
バランスファンドVA(安定運用型) < 適格機関投資家限定 >	9,822,080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 >	333,122,061円
SMAM・バランスファンドVA25 < 適格機関投資家専用 >	1,847,167,702円
SMAM・バランスファンドVA37.5 < 適格機関投資家専用 >	1,657,981,519円
SMAM・バランスファンドVA50 < 適格機関投資家専用 >	6,973,555,345円
SMAM・バランスファンドVL30 < 適格機関投資家限定 >	22,370,670円
SMAM・バランスファンドVL50 < 適格機関投資家限定 >	116,635,718円
世界6資産バランスファンドVA < 適格機関投資家限定 >	448,417円
SMAM・バランスファンドVA75 < 適格機関投資家専用 >	880,167,020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 >	63,322,997円
SMAM・インデックス・バランスVA25 < 適格機関投資家専用 >	188,955,118円
SMAM・インデックス・バランスVA50 < 適格機関投資家専用 >	839,861,789円
SMAM・バランスファンドVA40 < 適格機関投資家専用 >	736,711,020円
SMAM・バランスファンドVA35 < 適格機関投資家専用 >	1,800,787,478円
SMAM・バランスVA株40T < 適格機関投資家限定 >	7,209,212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)	771,260,219円
三井住友・5資産バランスファンド・VAS(適格機関投資家専用)	1,059,719,568円
SMAM・グローバルバランス40VA < 適格機関投資家限定 >	154,348,367円
SMAM・バランスファンドVA20 < 適格機関投資家専用 >	81,789,837円
三井住友・7資産バランスファンド・VAS(適格機関投資家専用)	1,287,996,061円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A < 適格機関投資家専用 >	26,825,416円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A < 適格機関投資家専用 >	14,274,284円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A < 適格機関投資家専用 >	7,316,492円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L < 適格機関投資家専用 >	53,839,841円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L < 適格機関投資家専用 >	124,301,066円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T < 適格機関投資家専用 >	125,464,851円
SMAM・グローバルバランスファンド(標準型)VA < 適格機関投資家限定 >	1,346,410,480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 >	192,348,541円
SMAM・世界バランスファンドVA < 適格機関投資家限定 >	6,898,665,560円
SMAM・世界バランスファンドVA2 < 適格機関投資家限定 >	416,675,660円
SMAM・外国株式インデックスファンドSA < 適格機関投資家限定 >	2,509,312,084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 >	8,741,871円
SMAM・マルチアセットストラテジーファンド2016-04 < 適格機関投資家限定 >	99,658,576円
SMAM・マルチアセットストラテジーファンド2016-05 < 適格機関投資家限定 >	47,707,397円

(平成30年 8月19日現在)	
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 >	102,699,632円
S M A M ・ マルチアセット ・ ダイナミックアロケーション ・ ストラテジー ・ ファンド < 適格機関投資家限定 >	16,383円
合計	52,502,621,132円

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30年 8月19日現在)

資産の部

流動資産

預金	457,155,399
金銭信託	136,159,772
コール・ローン	18,517,077
国債証券	171,748,257,009
派生商品評価勘定	228,985
未収入金	824,964,425
未収利息	1,224,091,947
前払費用	28,979,671
流動資産合計	174,438,354,285

資産合計

174,438,354,285

負債の部

流動負債

派生商品評価勘定	416,823
未払金	262,107,593
未払解約金	233,910,982
未払利息	54
その他未払費用	4,570
流動負債合計	496,440,022

負債合計

496,440,022

純資産の部

元本等

元本	101,635,124,672
剰余金	
剰余金又は欠損金()	72,306,789,591
元本等合計	173,941,914,263

純資産合計

173,941,914,263

負債純資産合計

174,438,354,285

注記表

(重要な会計方針の注記)

項目	自 平成30年 2月20日 至 平成30年 8月19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30年 8月19日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	101,635,124,672口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.7114円
	(10,000口当たりの純資産額 17,114円)

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項目	(平成30年 8月19日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。

項目	(平成30年 8月19日現在)
2.時価の算定方法	(1) 有価証券（国債証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(デリバティブ取引に関する注記)

(平成30年 8月19日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位：円)

区分	種類	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	262,176,788	-	262,405,773	228,985
	米ドル	210,949,618	-	211,119,107	169,489
	ユーロ	51,126,971	-	51,186,313	59,342
	英ポンド	100,199	-	100,353	154
	売建	828,939,177	-	829,356,000	416,823
	米ドル	499,385,638	-	499,714,040	328,402
	ユーロ	292,624,134	-	292,690,008	65,874
	英ポンド	36,929,405	-	36,951,952	22,547
合計		1,091,115,965	-	1,091,761,773	187,838

(注) 1. 時価の算定方法

(1) 為替予約取引の時価の算定方法について

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

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

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

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

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

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

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

(その他の注記)

(平成30年 8月19日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	107,887,329,111円
同期中における追加設定元本額	3,162,234,071円
同期中における一部解約元本額	9,414,438,510円
平成30年 8月19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	10,125,859,604円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	542,005,300円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	1,503,401,707円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	782,887,074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)	24,041,655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)	9,042,094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)	31,763,654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)	82,824,374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)	92,426,509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)	47,447,655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)	113,002,996円
三井住友・DC年金バランスゼロ(債券型)	13,945,201円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	71,212,214円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	205,063,174円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	320,148,050円
イオン・バランス戦略ファンド	75,793,790円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2050	3,793,980円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	5,574,490円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	5,412,112円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	15,416,874円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	9,704,711円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	10,276,653円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	12,859,915円
S M A M ・ 年金外国債券パッシブ・ファンド<適格機関投資家限定>	2,133,094,830円
S M A M ・ バランスファンドVA安定成長型<適格機関投資家限定>	315,409,928円
S M A M ・ バランスファンドVA25<適格機関投資家専用>	13,416,664,738円
S M A M ・ バランスファンドVA37.5<適格機関投資家専用>	6,383,884,230円
S M A M ・ バランスファンドVA50<適格機関投資家専用>	14,457,551,583円
S M A M ・ バランスファンドVL30<適格機関投資家限定>	44,184,531円
S M A M ・ バランスファンドVL50<適格機関投資家限定>	117,811,998円
世界6資産バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	600,777円
S M A M ・ バランスファンドVA75<適格機関投資家専用>	903,195,375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>	130,475,879円
S M A M ・ インデックス・バランスVA25<適格機関投資家専用>	1,371,137,002円
S M A M ・ インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用>	1,727,753,184円
S M A M ・ バランスファンドVA40<適格機関投資家専用>	2,294,811,137円
S M A M ・ バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>	7,481,569,392円

(平成30年 8月19日現在)	
S M A M ・ バランス V A 株 4 0 T < 適格機関投資家限定 >	14,855,472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 >	11,980,733,664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)	975,713,746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)	2,201,999,760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 >	212,370,026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 >	677,069,647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)	2,648,468,358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 >	165,635,787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 >	43,972,637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 >	14,667,943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 >	167,590,222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 >	603,473,732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 >	193,702,523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 >	182,591,770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 >	55,444,546円
S M A M ・ アセットバランスファンド V A 5 0 A 2 < 適格機関投資家専用 >	7,191,746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 >	1,510,794,493円
S M A M ・ アセットバランスファンド V A 2 0 T 2 < 適格機関投資家専用 >	23,493,972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 >	4,332,818,566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 >	1,976,167,252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 >	6,817,026,530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 >	1,004,801,413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 >	36,420,039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 >	37,058,251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 >	346,238,905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 >	165,761,507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 >	356,982,188円
S M A M ・ マルチアセット ・ ダイナミックアロケーション ・ ストラテジー ・ ファンド < 適格機関投資家限定 >	31,607円
合計	101,635,124,672円

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）

2018年 8月31日現在

資産総額	9,462,287,643円
負債総額	17,417,790円
純資産総額（ - ）	9,444,869,853円
発行済口数	6,422,459,455口
1口当たり純資産額（ / ）	1.4706円
（1万口当たり純資産額）	（14,706円）

三井住友・DC年金バランス50（標準型）

2018年 8月31日現在

資産総額	26,316,794,795円
負債総額	15,878,623円
純資産総額（ - ）	26,300,916,172円
発行済口数	16,641,232,979口
1口当たり純資産額（ / ）	1.5805円
（1万口当たり純資産額）	（15,805円）

三井住友・DC年金バランス70（株式重点型）

2018年 8月31日現在

資産総額	13,645,091,059円
負債総額	13,218,390円
純資産総額（ - ）	13,631,872,669円
発行済口数	8,197,982,015口
1口当たり純資産額（ / ）	1.6628円
（1万口当たり純資産額）	（16,628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

	2018年8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。

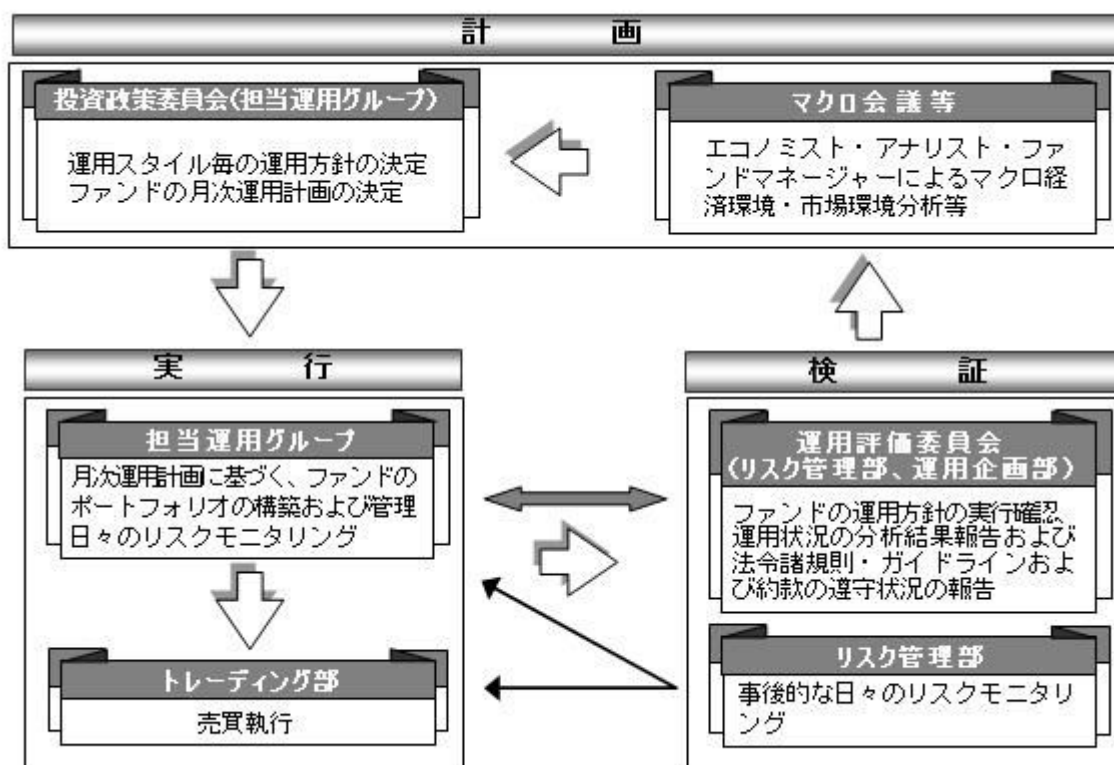
取締役の任期は、選任後1年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会の終結の時までとし、補欠または増員によって選任された取締役の任期は、他の現任取締役の任期の満了する時までとします。

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。

2018年8月31日現在、委託会社が運用を行っている投資信託（親投資信託は除きます）は、以下の通りです。

（2018年8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	91 (44)	396,177 (315,284)
	追加型	463 (196)	5,884,172 (2,767,788)
	計	554 (240)	6,280,349 (3,083,072)
公社債投資信託	単位型	109 (109)	309,136 (309,136)
	追加型	1 (0)	30,035 (0)
	計	110 (109)	339,170 (309,136)
合計		664 (349)	6,619,519 (3,392,208)

（ ）内は、私募投資信託分であり、内書き表記しております。

3【委託会社等の経理状況】

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

2 当社は、当事業年度（平成29年4月1日から平成30年3月31日まで）の財務諸表については、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、有限責任 あずさ監査法人の監査を受けております。

(1)【貸借対照表】

(単位：千円)

	前事業年度 (平成29年3月31日)	当事業年度 (平成30年3月31日)
資産の部		
流動資産		
現金及び預金	13,279,384	20,873,870
顧客分別金信託	20,008	20,010
前払費用	351,526	402,249
未収入金	40,544	39,030
未収委託者報酬	5,511,715	6,332,203
未収運用受託報酬	1,297,104	1,725,215
未収投資助言報酬	343,523	316,407
未収収益	20,789	50,321

繰延税金資産	482,535	715,988
その他の流動資産	5,560	10,891
流動資産合計	21,352,691	30,486,188
固定資産		
有形固定資産	1	
建物	198,767	185,371
器具備品	261,096	300,694
有形固定資産合計	459,864	486,065
無形固定資産		
ソフトウェア	493,806	409,765
ソフトウェア仮勘定	141,025	5,755
電話加入権	68	56
商標権	3	-
無形固定資産合計	634,903	415,576
投資その他の資産		
投資有価証券	12,098,372	10,616,594
関係会社株式	10,412,523	10,412,523
長期差入保証金	677,681	658,505
長期前払費用	61,282	69,423
会員権	7,819	7,819
繰延税金資産	871,577	678,459
投資その他の資産合計	24,129,257	22,443,325
固定資産合計	25,224,025	23,344,968
資産合計	46,576,717	53,831,157

(単位：千円)

	前事業年度 (平成29年3月31日)	当事業年度 (平成30年3月31日)
負債の部		
流動負債		
顧客からの預り金	304	84
その他の預り金	80,380	92,326
未払金		
未払収益分配金	655	649
未払償還金	140,124	137,522
未払手数料	2,424,318	2,783,763
その他未払金	52,903	236,739
未払費用	2,564,625	3,433,641
未払消費税等	160,571	547,706
未払法人税等	661,467	1,785,341
賞与引当金	1,001,068	1,507,256
その他の流動負債	445	1,408
流動負債合計	7,086,864	10,526,438
固定負債		
退職給付引当金	3,177,131	3,319,830
賞与引当金	40,167	99,721
その他の固定負債	2,174	3,363
固定負債合計	3,219,473	3,422,915
負債合計	10,306,337	13,949,354
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	23,493,074	26,561,078
利益剰余金合計	25,314,279	28,382,283
株主資本計	35,943,263	39,011,267
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	327,116	870,535
評価・換算差額等合計	327,116	870,535
純資産合計	36,270,379	39,881,802
負債・純資産合計	46,576,717	53,831,157

(2) 【損益計算書】

(単位：千円)

	前事業年度 (自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)	当事業年度 (自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	31,628,014	36,538,981
運用受託報酬	5,649,190	8,362,118
投資助言報酬	1,726,511	1,440,233
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
サービス支援手数料	61,268	128,324
その他	54,261	55,820
営業収益計	39,124,246	46,530,479
営業費用		
支払手数料	14,908,517	16,961,384
広告宣伝費	366,227	353,971
公告費	1,140	1,140
調査費		
調査費	1,325,978	1,654,233
委託調査費	4,343,104	5,972,473
営業雑経費		
通信費	46,030	40,066
印刷費	338,254	339,048
協会費	21,669	-
諸会費	20,054	45,465
情報機器関連費	2,516,497	2,582,734
販売促進費	24,896	34,333
その他	149,177	136,669
営業費用合計	24,061,549	28,121,520
一般管理費		

給料			
役員報酬		225,885	196,529
給料・手当		6,121,741	6,190,716
賞与		610,533	601,375
賞与引当金繰入額		989,925	1,566,810
交際費		23,136	25,709
事務委託費		317,928	256,413
旅費交通費		229,248	220,569
租税公課		268,527	282,036
不動産賃借料		622,662	654,286
退職給付費用		423,954	419,884
固定資産減価償却費		384,068	329,756
諸経費		335,840	285,490
一般管理費合計		10,553,451	11,029,580
営業利益		4,509,246	7,379,378
営業外収益			
受取配当金	1	106,651	51,335
受取利息	1	745	520
時効成立分配金・償還金		1,721	2,622
原稿・講演料		1,474	894
雑収入		12,592	10,669
営業外収益合計		123,184	66,042
営業外費用			
為替差損		9,737	5,125
雑損失		1,084	913
営業外費用合計		10,821	6,038
経常利益		4,621,608	7,439,383
特別利益			
投資有価証券償還益		353,462	61,842
投資有価証券売却益		2,579	30,980
特別利益合計		356,041	92,822
特別損失			
固定資産除却損	2	8,157	354,695
投資有価証券償還損		43,644	141,666
投資有価証券売却損		15,012	9,634
ゴルフ会員権売却損		3,894	-
事務所移転費用		21,175	-
特別損失合計		91,884	505,996
税引前当期純利益		4,885,765	7,026,209
法人税、住民税及び事業税		1,391,996	2,350,891
法人税等調整額		25,454	280,166
法人税等合計		1,366,541	2,070,725
当期純利益		3,519,223	4,955,483

(3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日）

（単位：千円）

	株主資本	
	資本剰余金	利益剰余金

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

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価証券 評価差額金	評価・換算差 額等合計	
当期首残高	517,775	517,775	34,952,774
当期変動額			
剰余金の配当			2,010,960
当期純利益			3,519,223
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	190,658	190,658	190,658
当期変動額合計	190,658	190,658	1,317,604
当期末残高	327,116	327,116	36,270,379

当事業年度（自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日）

（単位：千円）

	株主資本								株主資本 合計
	資本金	資本剰余金			利益剰余金				
		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			利益剰余金 合計	
					配当準備 積立金	別途積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	2,000,000	8,628,984	8,628,984	284,245	60,000	1,476,959	23,493,074	25,314,279	35,943,263
当期変動額									
剰余金の配当							1,887,480	1,887,480	1,887,480
当期純利益							4,955,483	4,955,483	4,955,483
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）									
当期変動額合計	-	-	-	-	-	-	3,068,003	3,068,003	3,068,003
当期末残高	2,000,000	8,628,984	8,628,984	284,245	60,000	1,476,959	26,561,078	28,382,283	39,011,267

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価証券 評価差額金	評価・換算差 額等合計	
当期首残高	327,116	327,116	36,270,379
当期変動額			
剰余金の配当			1,887,480
当期純利益			4,955,483

株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	543,419	543,419	543,419
当期変動額合計	543,419	543,419	3,611,423
当期末残高	870,535	870,535	39,881,802

[注記事項]

(重要な会計方針)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法

(1) 満期保有目的の債券

償却原価法

(2) 子会社株式及び関連会社株式

移動平均法による原価法

(3) その他有価証券

時価のあるもの

決算日の市場価格等に基づく時価法

（評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定）

時価のないもの

移動平均法による原価法

2. 固定資産の減価償却の方法

(1) 有形固定資産

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

なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。

建物	3～50年
器具備品	3～20年

(2) 無形固定資産

定額法によっております。

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

3. 引当金の計上基準

(1) 賞与引当金

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

(2) 退職給付引当金

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

退職給付見込額の期間帰属方法

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

数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法

過去勤務費用については、その発生時において一時に費用処理しております。

数理計算上の差異については、その発生時において一時に費用処理しております。

4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

消費税等の会計処理

消費税等の会計処理は税抜方式によっております。

(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29年3月31日)	当事業年度 (平成30年3月31日)
建物	291,976千円	312,784千円
器具備品	651,918千円	768,929千円

2 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29年3月31日)	当事業年度 (平成30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

3 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29年3月31日)	当事業年度 (平成30年3月31日)
Sumitomo Mitsui Asset Management (New York) Inc.	256,031千円	204,923千円

(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28年4月1日 至平成29年3月31日)	当事業年度 (自平成29年4月1日 至平成30年3月31日)
受取配当金	106,640千円	-千円
受取利息	18千円	-千円

2 固定資産除却損

	前事業年度 (自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)	当事業年度 (自平成29年4月1日 至平成30年3月31日)
建物	6,952千円	-千円
器具備品	1,204千円	0千円
ソフトウェア	-千円	9,000千円
ソフトウェア仮勘定	-千円	345,695千円

(株主資本等変動計算書関係)

前事業年度(自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)

1.発行済株式数に関する事項

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

2.剰余金の配当に関する事項

(1) 配当金支払額等

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

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

平成29年6月27日開催の第32回定時株主総会において次の通り付議いたします。

決議	株式の種類	配当の原資	配当金の総額 (千円)	一株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
平成29年6月27日 定時株主総会	普通株式	利益剰余金	1,887,480	107,000	平成29年 3月31日	平成29年 6月28日

当事業年度(自 平成29年4月1日 至 平成30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29年6月27日 定時株主総会	普通株式	1,887,480	107,000	平成29年 3月31日	平成29年 6月28日

(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30年6月26日開催の第33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30年6月26日 定時株主総会	普通株式	利益剰余金	2,822,400	160,000	平成30年 3月31日	平成30年 6月27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29年3月31日)	当事業年度 (平成30年3月31日)
1年以内	626,698	208,187
1年超	191,491	42,916
合計	818,190	251,104

(金融商品関係)

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

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

運用を行っています。また、資金調達及びデリバティブ取引は行っていません。

(2)金融商品の内容及びそのリスク

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

投資有価証券については、主に事業推進目的のために保有する当社が設定する投資信託等であり、市場価格の変動リスク及び発行体の信用リスクに晒されています。関係会社株式については、主に全額出資の子会社の株式及び50%出資した関連会社の株式であり、発行体の信用リスクに晒されています。また、長期差入保証金は、建物等の賃借契約に関連する敷金等であり、差入先の信用リスクに晒されています。

営業債務である未払手数料は、すべて1年以内の支払期日であります。

(3)金融商品に係るリスク管理体制

信用リスクの管理

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

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

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

市場リスクの管理

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

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

(4)金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

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

2.金融商品の時価等に関する事項

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

前事業年度（平成29年3月31日）

（単位：千円）

	貸借対照表計上額	時価	差額
(1)現金及び預金	13,279,384	13,279,384	-
(2)顧客分別金信託	20,008	20,008	-
(3)未収委託者報酬	5,511,715	5,511,715	-
(4)未収運用受託報酬	1,297,104	1,297,104	-
(5)未収投資助言報酬	343,523	343,523	-
(6)投資有価証券			
その他有価証券	12,098,074	12,098,074	-
(7)長期差入保証金	677,681	677,681	-
資産計	33,227,492	33,227,492	-

(1)顧客からの預り金	304	304	-
(2)未払手数料	2,424,318	2,424,318	-
負債計	2,424,622	2,424,622	-

当事業年度（平成30年3月31日）

（単位：千円）

	貸借対照表計上額	時価	差額
(1)現金及び預金	20,873,870	20,873,870	-
(2)顧客分別金信託	20,010	20,010	-
(3)未収委託者報酬	6,332,203	6,332,203	-
(4)未収運用受託報酬	1,725,215	1,725,215	-
(5)未収投資助言報酬	316,407	316,407	-
(6)投資有価証券 その他有価証券	10,616,296	10,616,296	-
(7)長期差入保証金	658,505	658,505	-
資産計	40,542,507	40,542,507	-
(1)顧客からの預り金	84	84	-
(2)未払手数料	2,783,763	2,783,763	-
負債計	2,783,847	2,783,847	-

（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29年3月31日）	当事業年度 （平成30年3月31日）
その他有価証券 非上場株式	298	298
合計	298	298
子会社株式及び関連会社株式 非上場株式	10,412,523	10,412,523
合計	10,412,523	10,412,523

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

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

(注3)金銭債権及び満期がある有価証券の決算日後の償還予定額
前事業年度（平成29年3月31日）

(単位：千円)

区分	1年以内	1年超5年以内	5年超10年以内	10年超
現金及び預金	13,279,384	-	-	-
顧客分別金信託	20,008	-	-	-
未収委託者報酬	5,511,715	-	-	-
未収運用受託報酬	1,297,104	-	-	-
未収投資助言報酬	343,523	-	-	-
長期差入保証金	31,201	646,480	-	-
合計	20,482,937	646,480	-	-

当事業年度（平成30年3月31日）

(単位：千円)

区分	1年以内	1年超5年以内	5年超10年以内	10年超
現金及び預金	20,873,870	-	-	-
顧客分別金信託	20,010	-	-	-
未収委託者報酬	6,332,203	-	-	-
未収運用受託報酬	1,725,215	-	-	-
未収投資助言報酬	316,407	-	-	-
長期差入保証金	602,360	56,144	-	-
合計	29,870,067	56,144	-	-

(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29年3月31日）

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

当事業年度（平成30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29年3月31日）

(単位：千円)

区分	貸借対照表計上額	取得原価	差額
(1)貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの 投資信託等	4,921,829	4,267,927	653,902
小計	4,921,829	4,267,927	653,902
(2)貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの 投資信託等	7,176,244	7,358,662	182,417
小計	7,176,244	7,358,662	182,417
合計	12,098,074	11,626,589	471,485

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

当事業年度（平成30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	7,366,669	6,046,232	1,320,437
小計	7,366,669	6,046,232	1,320,437
(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	3,249,626	3,315,328	65,701
小計	3,249,626	3,315,328	65,701
合計	10,616,296	9,361,560	1,254,735

（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.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28年4月1日 至 平成29年3月31日)

（単位：千円）

売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
228,204	2,579	15,012

当事業年度(自 平成29年4月1日 至 平成30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
532,099	30,980	9,634

(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28年4月1日 至 平成29年3月31日)	当事業年度 (自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)
退職給付債務の期首残高	3,028,212	3,177,131
勤務費用	280,524	285,715
利息費用	-	2,922
数理計算上の差異の発生額	15,494	51,212
退職給付の支払額	116,111	94,727
退職給付債務の期末残高	3,177,131	3,319,830

(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29年3月31日)	当事業年度 (平成30年3月31日)
非積立型制度の退職給付債務	3,177,131	3,319,830
未認識数理計算上の差異	-	-
未認識過去勤務費用	-	-
退職給付引当金	3,177,131	3,319,830

(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28年4月1日 至平成29年3月31日)	当事業年度 (自平成29年4月1日 至平成30年3月31日)
勤務費用	280,524	285,715
利息費用	-	2,922
数理計算上の差異の費用処理額	15,494	51,212
その他	158,924	182,458
確定給付制度に係る退職給付費用	423,954	419,884

(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28年4月1日 至平成29年3月31日)	当事業年度 (自平成29年4月1日 至平成30年3月31日)
割引率	0.092%	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137,310千円、当事業年度147,195千円であります。

(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29年3月31日)	当事業年度 (平成30年3月31日)
流動の部		
繰延税金資産		
賞与引当金	308,929	461,521
調査費	79,381	90,509
未払金	45,745	59,821
未払事業税	46,406	102,103
その他	2,071	2,032
繰延税金資産合計	482,535	715,988
固定の部		
繰延税金資産		
退職給付引当金	972,837	1,016,532
ソフトウェア償却	18,718	11,289
賞与引当金	12,299	30,534
投資有価証券評価損	95	95
その他	14,592	6,805
繰延税金資産小計	1,018,544	1,065,256
評価性引当額	2,597	2,597
繰延税金資産合計	1,015,946	1,062,659
繰延税金負債		

その他有価証券評価差額金	144,368	384,200
繰延税金負債合計	144,368	384,200
繰延税金資産の純額	1,354,113	1,394,447

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29年3月31日)	当事業年度 (平成30年3月31日)
法定実効税率	30.8%	30.8%
(調整)		
評価性引当額の増減	0.1	-
交際費等永久に損金に算入されない項目	0.2	0.2
受取配当等永久に益金に算入されない項目	0.8	-
住民税均等割等	0.1	0.1
所得税額控除による税額控除	2.2	1.9
その他	0.0	0.1
税効果会計適用後の法人税等の負担率	27.9	29.4

(セグメント情報等)

前事業年度(自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)

1. セグメント情報

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

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

2. 関連情報

(1) 製品及びサービスごとの情報

(単位：千円)

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

(2) 地域ごとの情報

営業収益

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

有形固定資産

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

(3) 主要な顧客ごとの情報

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

3. 報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

該当事項はありません。

4. 報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

該当事項はありません。

5. 報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

該当事項はありません。

当事業年度(自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)

1. セグメント情報

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

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

2. 関連情報

(1) 製品及びサービスごとの情報

(単位：千円)

	委託者報酬	運用受託報酬	投資助言報酬	その他	合計
外部顧客への営業収益	36,538,981	8,362,118	1,440,233	189,145	46,530,479

(2) 地域ごとの情報

営業収益

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

有形固定資産

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

(3) 主要な顧客ごとの情報

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

3. 報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

該当事項はありません。

4. 報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

該当事項はありません。

5. 報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

該当事項はありません。

(関連当事者情報)

前事業年度(自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)

1. 関連当事者との取引

(1) 子会社及び関連会社等

(単位：千円)

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金、出資金又は基金	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額	科目	期末残高
子会社	SumitomoMitsui AssetManagement (HongKong)Limited	Hong Kong	5,000,000 (ホンコン ドル)	投資運 用業	% (所有) 直接100	投信の助 言業務 役員の 兼任	剰余金 の配当	106,640	-	-

(注) 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

(2) 兄弟会社等

(単位：千円)

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金、出資金又は基金	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額	科目	期末残高
親会社の子会社	㈱三井住友銀行	東京都千代田区	1,770,996,505	銀行業	% -	投信の販売委託 役員の兼任	委託販売 手数料	2,737,677	未払 手数料	489,567
親会社の子会社	SMBC日興証券㈱	東京都千代田区	10,000,000	証券業	% -	投信の販売委託	委託販売 手数料	5,485,934	未払 手数料	862,697

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

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

投信の販売委託については、一般取引条件を基に、協議の上決定しております。

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

4. SMBC日興証券㈱の属性が、平成28年10月1日付けで、「その他の関係会社の子会社」より「親会社の子会社」に異動となりました。なお、取引金額の中には、「その他の関係会社の子会社」であった期間の取引金額が含まれております。

2. 親会社に関する注記

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

当事業年度(自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)

1. 関連当事者との取引

(1) 兄弟会社等

(単位：千円)

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金、出資金又は基金	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額	科目	期末残高
親会社の子会社	㈱三井住友銀行	東京都千代田区	1,770,996,505	銀行業	% -	投信の販売委託 役員の兼任	委託販売 手数料	2,761,066	未払 手数料	429,436
親会社の子会社	SMBC日興証券㈱	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	5,685,815	未払 手数料	953,752

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

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

投信の販売委託については、一般取引条件を基に、協議の上決定しております。

2. 親会社に関する注記

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

(1株当たり情報)

	前事業年度 (自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)	当事業年度 (自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)

1株当たり純資産額	2,056,143.98円	2,260,873.18円
1株当たり当期純利益金額	199,502.47円	280,923.11円

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

2. 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	前事業年度 (自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)	当事業年度 (自平成29年4月1日 至平成30年3月31日)
1株当たり当期純利益金額		
当期純利益(千円)	3,519,223	4,955,483
普通株主に帰属しない金額(千円)	-	-
普通株式に係る当期純利益金額(千円)	3,519,223	4,955,483
期中平均株式数(株)	17,640	17,640

(重要な後発事象)

前事業年度(自平成28年4月1日至平成29年3月31日)

該当事項はありません。

当事業年度(自平成29年4月1日至平成30年3月31日)

当社と大和住銀投信投資顧問株式会社との合併に関する主要株主間での基本合意について

平成30年5月11日付で当社及び大和住銀投信投資顧問株式会社の主要株主である株式会社三井住友フィナンシャルグループ、株式会社大和証券グループ本社、三井住友海上火災保険株式会社及び住友生命保険相互会社が、当社と大和住銀投信投資顧問株式会社との合併に関する基本合意書を締結しました。

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

- (イ) 三井住友アセットマネジメント株式会社は、関係当局の認可等を得ることを前提に、2019年4月1日に大和住銀投信投資顧問株式会社と合併し、商号を三井住友D Sアセットマネジメント株式会社に変更する予定です。
- (ロ) 2018年11月1日付で、発行可能株式総数を変更する定款の変更を行いました。
- 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(2018年3月末現在)
- (ハ) 事業の内容 銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

〔参考情報：再信託受託会社の概要〕

- ・ 名称 日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社
- ・ 資本金の額 51,000百万円(2018年3月末現在)
- ・ 事業の内容 銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

ロ 販売会社

(イ) 名称	(ロ) 資本金の額	(ハ) 事業の内容
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。
あかつき証券株式会社	3,067百万円	
エイチ・エス証券株式会社	3,000百万円	
株式会社S B I証券	48,323百万円	
カブドットコム証券株式会社	7,196百万円	
静岡東海証券株式会社	600百万円	
損保ジャパン日本興亜D C証券株式会社	3,000百万円	
東海東京証券株式会社	6,000百万円	
松井証券株式会社	11,945百万円	
マネックス証券株式会社	12,200百万円	
水戸証券株式会社	12,272百万円	
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	
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、2018年3月末現在。

住友生命保険相互会社の資本金の額の箇所には、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】

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

独立監査人の監査報告書

平成30年6月14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29年4月1日から平成30年3月31日までの第33期事業年度の財務諸表、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30年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

強調事項

重要な後発事象に記載されているとおり、平成30年5月11日付で会社及び大和住銀投信投資顧問株式会社の主要株主が、会社と大和住銀投信投資顧問株式会社との合併に関する基本合意書を締結した。

当該事項は、当監査法人の意見に影響を及ぼすものではない。

利害関係

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

以上

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

独立監査人の監査報告書

平成30年3月27日

三井住友アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	小澤 陽一 印
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	菅野 雅子 印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている三井住友・DC年金バランス30（債券重点型）の平成29年2月21日から平成30年2月19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30年2月19日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以上

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

独立監査人の監査報告書

平成30年3月27日

三井住友アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	小澤 陽一 印
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	菅野 雅子 印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている三井住友・DC年金バランス50（標準型）の平成29年2月21日から平成30年2月19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30年2月19日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以 上

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

独立監査人の監査報告書

平成30年3月27日

三井住友アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	小澤 陽一 印
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	菅野 雅子 印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている三井住友・DC年金バランス70（株式重点型）の平成29年2月21日から平成30年2月19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30年2月19日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以上

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

独立監査人の中間監査報告書

平成30年9月25日

三井住友アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 小澤 陽一 印指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 菅野 雅子 印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている三井住友・DC年金バランス30（債券重点型）の平成30年2月20日から平成30年8月19日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、三井住友・DC年金バランス30（債券重点型）の平成30年8月19日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（平成30年2月20日から平成30年8月19日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

利害関係

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

以上

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

独立監査人の中間監査報告書

平成30年9月25日

三井住友アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 小澤 陽 一 印指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 菅野 雅子 印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている三井住友・DC年金バランス50（標準型）の平成30年2月20日から平成30年8月19日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、三井住友・DC年金バランス50（標準型）の平成30年8月19日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（平成30年2月20日から平成30年8月19日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

利害関係

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

以上

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

独立監査人の中間監査報告書

平成30年9月25日

三井住友アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 小澤 陽一 印指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 菅野 雅子 印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている三井住友・DC年金バランス70（株式重点型）の平成30年2月20日から平成30年8月19日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、三井住友・DC年金バランス70（株式重点型）の平成30年8月19日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（平成30年2月20日から平成30年8月19日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

利害関係

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

以上

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