

【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27年7月9日提出
【発行者名】	三井住友アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 横山 邦男
【本店の所在の場所】	東京都港区愛宕二丁目5番1号
【事務連絡者氏名】	三島 克哉
【電話番号】	03-5405-0228
【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】	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)
【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27年7月10日から平成28年7月7日まで) 5兆円を上限とします。
【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】

SMAM・グローバルバランスファンド（機動的資産配分型）
（愛称として「資産配分おまかせくん」という名称を用いることがあります。）
以下「当ファンド」といいます。

（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】

5兆円を上限とします。

（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、「おまかせ」として掲載されます。

委託会社に対する照会は下記においてできます。

照会先の名称	電話番号	インターネット・ホームページ・アドレス
三井住友アセットマネジメント株式会社	0120-88-2976	http://www.smam-jp.com

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

（５）【申込手数料】

無手数料です。

（６）【申込単位】

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

(7)【申込期間】

平成27年 7月10日から平成28年 7月 7日まで

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

(8)【申込取扱場所】

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

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

(9)【払込期日】

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

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

(10)【払込取扱場所】

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

(11)【振替機関に関する事項】

当ファンドの振替機関は下記の通りです。

株式会社証券保管振替機構

(12)【その他】

イ 申込証拠金
ありません。

ロ わが国以外の地域における募集
ありません。

ハ クーリング・オフ制度(金融商品取引法第37条の6)の適用
ありません。

ニ 振替受益権について

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

(参考：投資信託振替制度)

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

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

（1）【ファンドの目的及び基本的性格】

イ 当ファンドは、国内株式インデックス・マザーファンド（B号）、国内債券パッシブ・マザーファンド、外国株式インデックス・マザーファンド、外国債券パッシブ・マザーファンドおよびマネーインカム・マザーファンドの受益証券への投資を通じて、日本を含む世界各国の株式、公社債および短期金融資産に分散投資を行うことにより、信託財産の着実な成長を目指した運用を行います。

以下、上記各マザーファンドを総称して、あるいはそれぞれを「マザーファンド」ということがあります。

ロ 委託会社は、受託会社と合意の上、金1兆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。

ハ 当ファンドが該当する商品分類、属性区分は次の通りです。

（イ）当ファンドが該当する商品分類

項目	該当する商品分類	内容
単位型・追加型	追加型投信	一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行われ従来の信託財産とともに運用されるファンドをいいます。
投資対象地域	内外	目論見書または信託約款において、国内および海外の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいいます。
投資対象資産 （収益の源泉）	資産複合	目論見書または信託約款において、株式、債券、不動産投信、その他資産のうち複数の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいいます。

（ロ）当ファンドが該当する属性区分

項目	該当する属性区分	内容
投資対象資産	その他資産（投資信託証券（資産複合（株式、債券、円短期金融資産）資産配分変更型））	目論見書または信託約款において、主として投資信託証券に投資する旨の記載があるものをいいます。「投資信託証券」以下のカッコ内は投資信託証券の先の実質投資対象について記載していません。なお、組み入れる資産そのものは投資信託証券ですが、投資信託証券の先の実質投資対象は株式、債券および円短期金融資産であり、ファンドの収益はそれぞれの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。
-------	---------	---

商品分類表

単位型・追加型	投資対象地域	投資対象資産 (収益の源泉)
単位型	国内	株式
		債券
	海外	不動産投信
追加型		その他資産 ()
	内外	資産複合

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

属性区分表

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	為替ヘッジ
株式	年1回	グローバル		
一般		(日本を含む)		
大型株	年2回	日本		
中小型株	年4回	北米		
債券			ファミリーファンド	あり
一般	年6回(隔月)	欧州		
公債		アジア		
社債	年12回(毎月)	オセアニア		
その他債券	日々	中南米		
クレジット属性 ()	その他 ()	アフリカ	ファンド・オブ・ファンズ	なし
不動産投信		中近東(中東)		
その他資産 (投資信託証券(資産複合(株式、債券、円短期金融資産)資産配分変更型))		エマージング		
資産複合 ()				
資産配分固定型				

資産配分変更				
--------	--	--	--	--

（注）当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

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

（２）【ファンドの沿革】

平成20年3月31日 信託契約締結、設定、運用開始。
 平成27年2月27日 「スミセイ・DCバランスファンド（機動的資産配分型）」から「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）」に名称を変更。

（３）【ファンドの仕組み】

イ 当ファンドの関係法人とその役割

（イ）委託会社 「三井住友アセットマネジメント株式会社」

証券投資信託契約に基づき、信託財産の運用指図、投資信託説明書（目論見書）および運用報告書の作成等を行います。

（ロ）受託会社 「三井住友信託銀行株式会社」

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

（ハ）販売会社

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

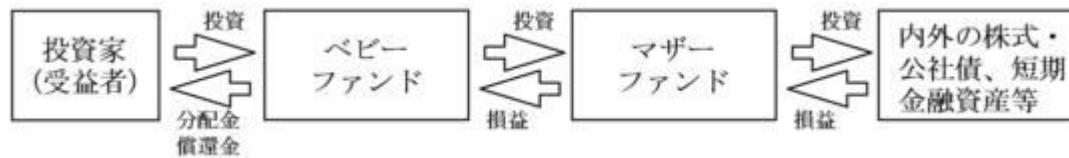
委託会社は販売会社としての役割も有します。

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。



□ 委託会社の概況

(イ) 資本金の額

2,000百万円（平成27年 5月29日現在）

(ロ) 会社の沿革

- 昭和60年 7月15日 三生投資顧問株式会社設立
- 昭和62年 2月20日 証券投資顧問業の登録
- 昭和62年 6月10日 投資一任契約にかかる業務の認可
- 平成11年 1月 1日 三井生命保険相互会社の特別勘定運用部門と統合
- 平成11年 2月 5日 三生投資顧問株式会社から三井生命グローバルアセットマネジメント株式会社へ商号変更
- 平成12年 1月27日 証券投資信託委託業の認可取得
- 平成14年12月 1日 住友ライフ・インベストメント株式会社、スミセイ グローバル投信株式会社、三井住友海上アセットマネジメント株式会社およびさくら投信投資顧問株式会社と合併し、三井住友アセットマネジメント株式会社に商号変更
- 平成25年 4月 1日 トヨタアセットマネジメント株式会社と合併

(ハ) 大株主の状況

（平成27年 5月29日現在）

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

2【投資方針】

(1)【投資方針】

イ 基本方針

当ファンドは、マザーファンドの受益証券への投資を通じて、信託財産の着実な成長を目指した運用を行います。

ロ 投資態度

(イ) 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を主要投資対象とする5つのマザーファンドに分散投資を行います。

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
短期金融資産	マネーインカム・マザーファンド

- (ロ) 委託会社が独自に作成する基本資産配分に対し一定の許容変動幅内で機動的に資産配分を変更
します。

ファンドの基本資産配分ならびに各資産の許容変動幅

資産配分					
	国内株式	国内債券	外国株式	外国債券	短期金融資産
基本	20%	50%	10%	15%	5%
上限	35%	65%	25%	30%	20%
下限	5%	35%	0%	0%	0%

(注) 基本資産配分は、5年に一回程度検証を行い、必要であれば見直しを行います。

- (ハ) 運用にあたっては、基本資産配分に基づいて、以下の指数を合成したベンチマークを上回る投資成果を目指します。

国内株式	国内債券	外国株式	外国債券	短期金融資産
TOPIX (東証株価指数、 配当込み)	NOMURA - BPI (総合)	MSCI - KOKUSAI インデックス(円ベ- ス)	シティ世界国債 インデックス (除く日本、円ベ- ス)	無担保コール 翌日物
20%	50%	10%	15%	5%

(注) 基本資産配分の見直しに伴い見直しを行います。

- (ニ) 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いません。

- (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 日本を含む世界各国の株式、公社債および短期金融資産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。

実際の運用は、各資産に投資する5つのマザーファンドへの投資を通じて行います（ファミリーファンド方式）。

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	国内債券バッシブ・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	外国債券バッシブ・マザーファンド
短期金融資産	マネーインカム・マザーファンド

ファミリーファンド方式



2 委託会社が独自に作成する基本資産配分に対し、一定の許容変動幅内で機動的に資産配分を変更します。

ファンドの基本資産配分ならびに各資産の許容変動幅

資産配分					
	国内株式	国内債券	外国株式	外国債券	短期金融資産
基本	20%	50%	10%	15%	5%
上限	35%	65%	25%	30%	20%
下限	5%	35%	0%	0%	0%

(注) 基本資産配分は、5年に一回程度検証を行い、必要であれば見直しを行います。

3 運用にあたっては、基本資産配分に基づいて、以下の指数を合成したベンチマークを上回る投資成果を目指します。

国内株式	国内債券	外国株式	外国債券	短期金融資産
TOPIX (東証株価指数、 配当込み)	NOMURA-BPI (総合)	MSCI-KOKUSAI インデックス (円ベース)	シティ 世界国債 インデックス (除く日本、 円ベース)	無担保コール 翌日物
20%	50%	10%	15%	5%

(注) 基本資産配分の見直しに伴い、ベンチマークの見直しも行います。

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いません。

※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。

- TOPIX（東証株価指数、配当込み）、NOMURA-BPI（総合）、MSCI-KOKUSAIインデックス、シティ世界国債インデックスは、それぞれ東京証券取引所、野村證券株式会社、MSCIインク、Citigroup Index LLCが公表している指数で各社の知的財産です。
- 指数を公表する各社は当ファンドの運用と何ら関係ありません。

運用（資産配分）プロセス



各マザーファンドの投資方針等

国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

- 主としてわが国の株式に投資し、TOPIX（東証株価指数、配当込み）と連動する投資成果を目指して運用を行います。
- 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、最適化法によりポートフォリオを構築します。

国内債券バッシブ・マザーファンド

- わが国の公社債および短期金融資産を主要投資対象とし、NOMURA－BPI（総合）と連動する投資成果を目指して運用を行います。
- 層化抽出法により、デュレーション[※]、満期構成、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。

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－KOKUSAIインデックス（円ベース）と連動する投資成果を目指して運用を行います。
- MSCI－KOKUSAIインデックスの中から、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、最適化法によりポートフォリオを構築します。

外国債券バッシブ・マザーファンド

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

マネーインカム・マザーファンド

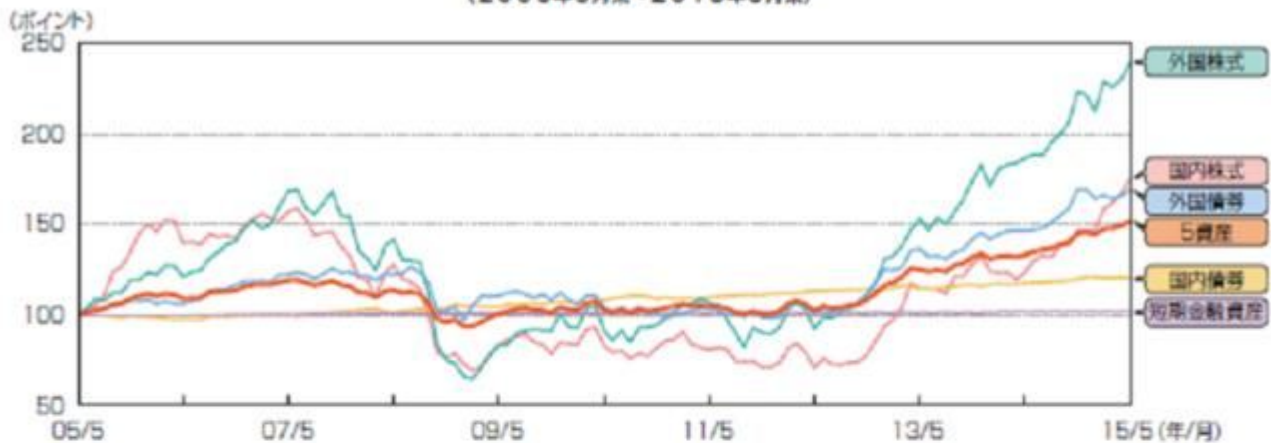
- 主として円貨建の短期公社債および短期金融商品に投資し、安定した収益の確保を目指した運用を行います。

※デュレーションとは金利変動による債券価格の変動の大きさを示す指標です。

分散投資の効果～収益（リターン）の安定化が期待できます～

各資産と「5資産」の累積投資収益率の推移

（2005年5月末～2015年5月末）



(注1) 「国内株式」はTOPIX（東証株価指数、配当込み）、「国内債券」はNOMURA-BPI（総合）、「外国株式」はMSCI-KOKUSAIインデックス（円ベース）、「外国債券」はシティ世界国債インデックス（除く日本、円ベース）、「短期金融資産」は無担保コール翌日物を使用。

(注2) 「5資産」は基本資産配分比率（国内株式：20%、国内債券：50%、外国株式：10%、外国債券：15%、短期金融資産：5%）で組み合わせたデータ。

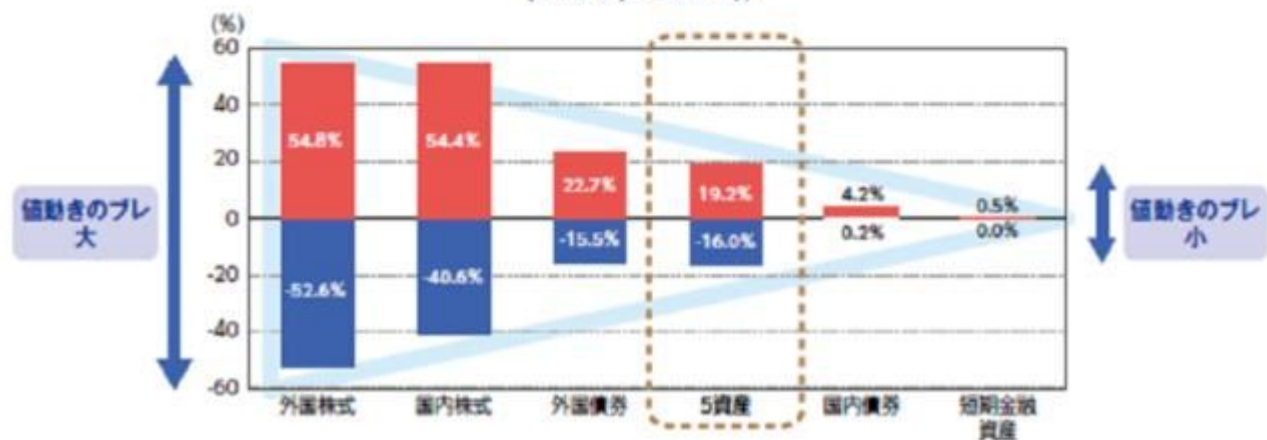
(注3) データは2005年5月末を100として指数化。

(出所) FactSetのデータを基に三井住友アセットマネジメント作成

分散投資の効果～値動き（リスク）の安定化が期待できます～

各資産と「5資産」の年間最高収益率と最低収益率

（2005年～2014年）



(注1) 「国内株式」はTOPIX（東証株価指数、配当込み）、「国内債券」はNOMURA-BPI（総合）、「外国株式」はMSCI-KOKUSAIインデックス（円ベース）、「外国債券」はシティ世界国債インデックス（除く日本、円ベース）、「短期金融資産」は無担保コール翌日物を使用。

(注2) 「5資産」は基本資産配分比率（国内株式：20%、国内債券：50%、外国株式：10%、外国債券：15%、短期金融資産：5%）で組み合わせたデータ。

(出所) FactSetのデータを基に三井住友アセットマネジメント作成

分散投資の効果～リスクを抑制し、相対的に高いリターンが期待できます～

各資産と「5資産」のリスク・リターン比較

(2005年5月末～2015年5月末)



(注1) 「国内株式」はTOPIX（東証株価指数、配当込み）、「国内債券」はNOMURA-BPI（総合）、「外国株式」はMSCI-KOKUSAIインデックス（円ベース）、「外国債券」はシディ世界国債インデックス（除く日本、円ベース）、「短期金融資産」は無担保コール翌日物を使用。

(注2) 「5資産」は基本資産配分比率（国内株式：20%、国内債券：50%、外国株式：10%、外国債券：15%、短期金融資産：5%）で組み合わせたデータ。

(注3) リターン（年率）は月次騰落率を、リスク（年率）は月次騰落率の標準偏差を、それぞれ年換算して算出。

(出所) FactSetのデータを基に三井住友アセットマネジメント作成

※グラフ・データは、過去のデータを基に委託会社が行ったシミュレーションの結果であり、当ファンドの運用実績ではありません。また、当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もありません。一定の前提条件に基づくものであり、経費等は考慮されていません。実際の運用においては、市場動向等の諸条件が異なることによりパフォーマンス等は大きく異なります。

(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．約束手形
- 4．金銭債権

(ロ) 特定資産以外の資産で、以下に掲げる資産

- 1．為替手形

ロ 投資対象とする有価証券

委託会社は、信託金を、主として、マザーファンド受益証券および次の有価証券（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す。)
 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す。)
 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。

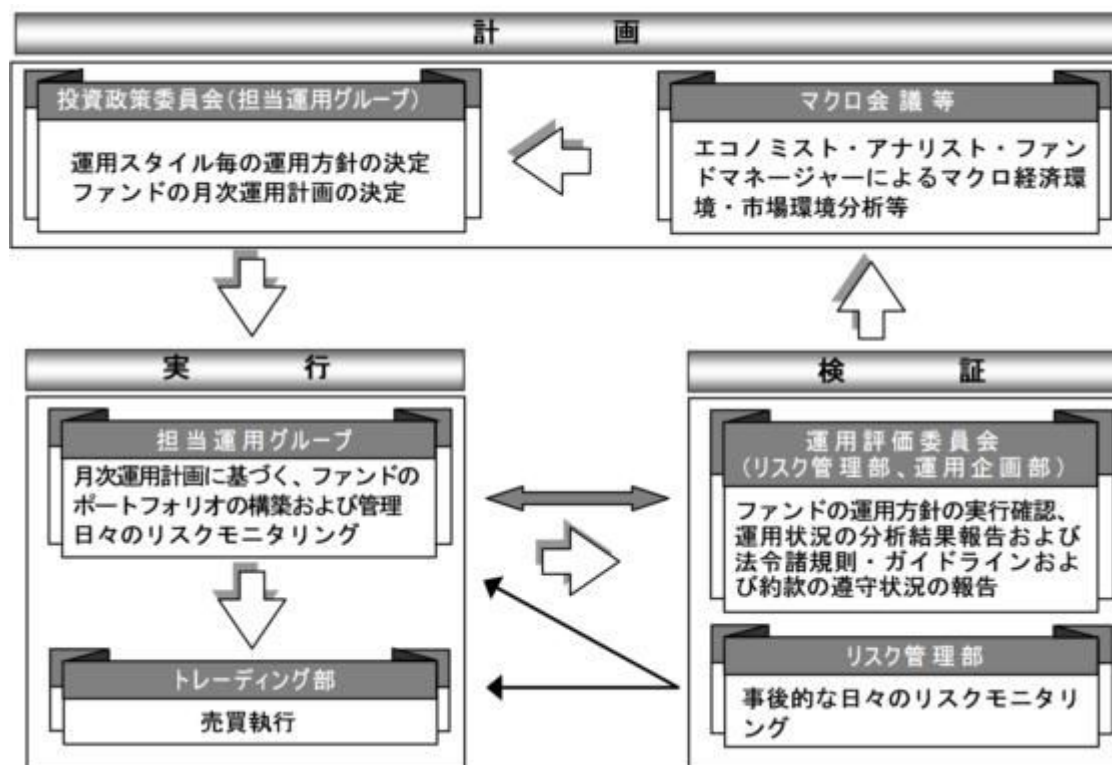
売買執行については、組織的に分離されたトレーディング部が、最良と思われる手法をもって売買を執行します。

(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9名程度、運用企画部は9名程度で構成されています。

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

ロ 委託会社によるファンドの関係法人（販売会社を除く）に対する管理体制

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

(4) 【分配方針】

毎年1回（原則として4月13日。休業日の場合は翌営業日となります。）決算を行い、原則として

以下の方針に基づき収益分配を行います。

- イ 分配対象額は、経費控除後の配当等収益と有価証券売買益（評価益を含みます。）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、市況動向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、前記「（１）投資方針」に基づいて運用を行います。

（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 株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の70%以下とします。
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%以下とします。
- ハ マザーファンド受益証券以外の投資信託証券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- 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70%以下とします。
- ホ 同一銘柄の株式への実質投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の10%以下とします。
- ヘ 同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- ト 同一銘柄の転換社債および転換社債型新株予約権付社債への実質投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の10%以下とします。

ファンドの信託約款に基づくその他の投資制限

イ 投資する株式等の範囲

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

ロ 信用取引の指図

- （イ）委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売り付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、株券の引渡または買戻しにより行うことの指図をすることができます。
- （ロ）信用取引の指図は、当該売付けにかかる建玉の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する当該売付けにかかる建玉の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- （ハ）上記（ロ）において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める当該売付けにかかる建玉の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
- （ニ）信託財産の一部解約等の事由により、上記（ロ）の売付けにかかる建玉の時価総額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。

八 先物取引等の指図

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

二 スワップ取引の指図

- (イ) 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、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限りではありません。
- (ハ) スワップ取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の合計額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記純資産総額が減少して、スワップ取引の想定元本の合計額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当するスワップ取引の一部の解約を指図するものとします。
- (ニ) スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額により行うものとします。
- (ホ) 委託会社は、スワップ取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

ホ 金利先渡取引および為替先渡取引の指図

- (イ) 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことの指図をすることができます。
- (ロ) 金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- (ハ) 金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかる金利先渡取引および為替先渡取引の想定元本の合計額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記純資産総額が減少して、金利先渡取引および為替先渡取引の想定元本の合計額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する金利先渡取引および為替先渡取引の一部の解約を指図するものとします。
- (ニ) 金利先渡取引および為替先渡取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額により行うものとします。
- (ホ) 委託会社は、金利先渡取引および為替先渡取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必

要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

- (ヘ) 「金利先渡取引」とは、当事者間において、あらかじめ将来の特定の日（以下「決済日」といいます。）における決済日から一定の期間を経過した日（以下「満期日」といいます。）までの期間にかかる国内または海外において代表的利率として公表される預金契約または金銭の貸借契約に基づく債権の利率（以下「指標利率」といいます。）の数値を取り決め、その取決めにかかる数値と決済日における当該指標利率の現実の数値との差にあらかじめ元本として定めた金額および当事者間で約定した日数を基準とした数値を乗じた額を決済日における当該指標利率の現実の数値で決済日における現在価値に割り引いた額の金銭の授受を約する取引をいいます。
- (ト) 「為替先渡取引」とは、当事者間において、あらかじめ決済日から満期日までの期間にかかる為替スワップ取引（同一の相手方との間で直物外国為替取引および当該直物外国為替取引と反対売買の関係に立つ先物外国為替取引を同時に約定する取引をいいます。以下同じ。）のスワップ幅（当該直物外国為替取引にかかる外国為替相場と当該先物外国為替取引にかかる外国為替相場との差を示す数値をいいます。以下同じ。）を取り決め、その取決めにかかるスワップ幅から決済日における当該為替スワップ取引の現実のスワップ幅を差し引いた値にあらかじめ元本として定めた金額を乗じた額を決済日における指標利率の数値で決済日における現在価値に割り引いた額の金銭またはその取決めにかかるスワップ幅から決済日における当該為替スワップ取引の現実のスワップ幅を差し引いた値にあらかじめ元本として定めた金額を乗じた金額とあらかじめ元本として定めた金額について決済日を受渡日として行った先物外国為替取引を決済日における直物外国為替取引で反対売買したときの差金にかかる決済日から満期日までの利息とを合算した額を決済日における指標利率の数値で決済日における現在価値に割り引いた額の金銭の授受を約する取引をいいます。

ヘ 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)各号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るものとします。
- (ロ) 上記(イ)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) 上記(イ)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。

(八) 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。

(二) 借入れにかかる品借料は、信託財産中から支弁します。

リ 特別の場合の外貨建有価証券への投資制限

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

ヌ 外国為替予約取引の指図

(イ) 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、ならびに信託財産に属する資産の為替変動リスクを回避するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。

(ロ) 上記(イ)の予約取引の指図は、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(マザーファンドの信託財産に属する外貨建資産のうち信託財産に属するとみなした額を含みます。)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。

(二) 上記(ロ)において、信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める当該外貨建資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

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性に資するため、一部解約に伴う支払資金の手当て(一部解約に伴う支払資金の手当てのために借り入れた資金の返済を含みます。)を目的として、または再投資にかかる収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金借入れ(コール市場を通じる場合を含みます。)の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。

(ロ) 一部解約に伴う支払資金の手当てにかかる借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は当該有価証券等の売却代金、解約代金および償還金の合計額を限度とします。

(ハ) 収益分配金の再投資にかかる借入期間は、信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。

(二) 借入金の利息は、信託財産中から支弁します。

ロ 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。

□ デリバティブ取引にかかる投資制限（金融商品取引業等に関する内閣府令第130条第1項第8号）

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

（参考情報：マザーファンドの投資方針等）

（国内株式インデックス・マザーファンド（B号））

（1）投資方針等

イ 基本方針

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

□ 投資態度

（イ）主として東京証券取引所第1部に上場している株式に投資を行い、TOPIX（東証株価指数、配当込み）と連動する投資成果を目指して運用を行います。

（ロ）株価指数先物取引等を含む株式の実質組入比率は、原則として高位を保ちます。ただし、資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

（ハ）株式以外の資産への投資割合は、原則として信託財産総額の50%以下とします。

（2）投資対象

イ 投資対象とする資産の種類

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

□ 投資対象とする有価証券

前記「2 投資方針（2）投資対象 □ 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号に掲げるものならびに短期社債等に投資します。

ハ 投資対象とする金融商品

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

（3）投資制限

イ ファンドの信託約款に基づく主要な投資制限

（イ）外貨建資産への投資は行いません。

（ロ）株式への投資割合には制限を設けません。

（国内債券パッシブ・マザーファンド）

（1）投資方針等

イ 基本方針

わが国の公社債および短期金融資産を主要投資対象とし、NOMURA-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。

□ 投資態度

（イ）NOMURA-BPI（総合）をベンチマークとし、ベンチマークと連動する投資成果を目指します。

（ロ）公社債の組入比率は原則として高位を保ちます。

（ハ）資金動向、市況動向等の急変により上記の運用が困難となった場合、暫定的に上記と異なる運用を行う場合があります。

（２）投資対象

イ 投資対象とする資産の種類

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

ロ 投資対象とする有価証券

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

ハ 投資対象とする金融商品

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

（３）投資制限

イ ファンドの信託約款に基づく主要な投資制限

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

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

（ハ）投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。

（ニ）外貨建資産への投資は行いません。

（ホ）同一銘柄の転換社債および転換社債型新株予約権付社債への投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の10%以内とします。

（外国株式インデックス・マザーファンド）

（１）投資方針等

イ 基本方針

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

ロ 投資態度

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

（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号から第21号に掲げるものに投資します（ただし、第14号に掲げるもののうち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 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。

(外国債券パッシブ・マザーファンド)

(1) 投資方針等

イ 基本方針

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

ロ 投資態度

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

(2) 投資対象

イ 投資対象とする資産の種類

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

ロ 投資対象とする有価証券

前記「2 投資方針 (2) 投資対象 ロ 投資対象とする有価証券」において記載したベビーファンドが投資対象とする有価証券の各号(第1号から第21号)に掲げるものに投資します(ただし、第14号に掲げるもののうち投資法人債券を除きます。)。

ハ 投資対象とする金融商品

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

(3) 投資制限

イ ファンドの信託約款に基づく主要な投資制限

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

(ト) 同一銘柄の転換社債および転換社債型新株予約権付社債への投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の10%以内とします。

(マネーインカム・マザーファンド)

(1) 投資方針等

イ 基本方針

円貨建の短期公社債および短期金融商品を主要投資対象とし、安定した収益の確保を目指します。

ロ 投資態度

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

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

(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)に掲げるものに投資します。

ハ 投資対象とする金融商品

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

(3) 投資制限

イ ファンドの信託約款に基づく主要な投資制限

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

(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%以下とします。

(ハ) 外貨建資産への投資は行いません。

(ニ) 同一銘柄の転換社債および転換社債型新株予約権付社債への投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の10%以下とします。

3【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、債券および短期金融資産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等の値動き、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) 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。

(二) 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。

(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) 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小さかった場合も同様です。

(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。

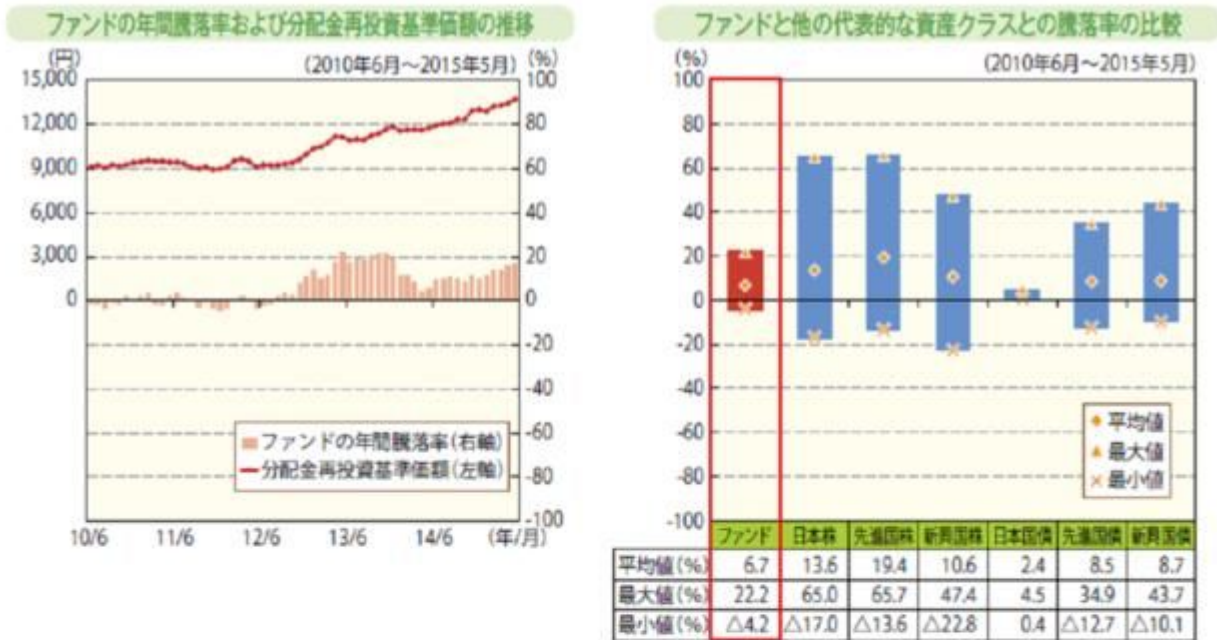
(リ) 換金制限等に関する留意点

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。

ロ 投資リスクの管理体制

リスク管理の実効性を高め、また、コンプライアンスの徹底を図るために、運用部門から独立した組織（リスク管理部および法務コンプライアンス部）を設置し、ファンドの投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる確認等を行っています。リスク管理部では、主に投資信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングを行います。また、法務コンプライアンス部では、主に法令・諸規則等の遵守状況についての確認等を行います。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価委員会、リスク管理委員会およびコンプライアンス委員会への報告が義務づけられています。

（参考情報）投資リスクの定量的比較



※左グラフは2010年6月～2015年5月の各月末におけるファンドの直近1年間の騰落率および分配金再投資基準価額の推移を表示したものです。

右グラフは同期間の各月末における直近1年間の騰落率の平均・最大・最小を、ファンドおよび他の代表的な資産クラスについて表示したものです。

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

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

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

<各資産クラスの指数>

日本株……TOPIX（配当込み）

先進国株……MSCIコクサイインデックス（グロス配当込み、円ベース）

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

日本国債……NOMURA - BPI（国債）

先進国債……シティ世界国債インデックス（除く日本、円ベース）

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

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

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

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

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

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

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

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

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

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

無手数料です。

(2)【換金（解約）手数料】

解約手数料はありません。

(3)【信託報酬等】

純資産総額に年0.6372%（税抜き0.59%）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

信託報酬の実質的配分は以下の通りです。

< 信託報酬の配分（税抜き） >

支払先	料率	役務の内容
委託会社	年0.21%	ファンド運用の指図等の対価
販売会社	年0.35%	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	年0.03%	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

上記の各支払先の料率には別途消費税等相当額がかかります。

委託会社の直接募集にかかる部分については、販売会社配分相当額を委託会社が収受します。

(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。

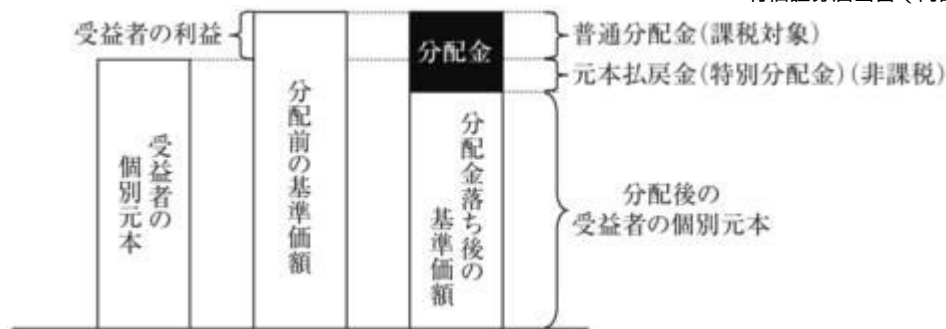
ハ 収益分配金の課税について

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。

なお、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、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。

なお、平成28年1月1日以降、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も通算が可能となる予定です。

(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）」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の適用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。

当ファンドは、受取配当にかかる益金不算入制度、配当控除の適用はありません。

少額投資非課税制度「NISA（ニーサ）」をご利用の場合、毎年、年間100万円（平成28年1月1日から年間120万円となる予定です。）の範囲で新たに購入した公募株式投資信託等から生じる配当所得および譲渡所得が5年間非課税となります。ご利用になれるのは、満20歳以上の方で、販売会社で非課税口座を開設する等、一定の条件に該当する方が対象となります。また、0歳から19歳の方を対象とした「ジュニアNISA」が新たに創設され、平成28年4月1日より年間80万円の範囲で新たに購入した公募株式投資信託等から生じる配当所得および譲渡所得が5年間非課税となる予定です。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

当ファンドの外貨建資産割合および非株式割合

外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の70%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）。

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

上記「(5)課税上の取扱い」ほか税制に関する本書の記載は、平成27年5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】

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)

平成27年 5月29日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
親投資信託受益証券	日本	749,023,335	100.08
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		578,048	0.08
合計(純資産総額)		748,445,287	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。

(2)【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

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)

イ 主要投資銘柄

平成27年 5月29日現在

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	投資 比率 (%)
日本	親投資信託受益証券	国内債券パッシブ・マザーファンド	263,218,376	1.2009	316,098,948	1.1978	315,282,970	42.13
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)	101,002,982	2.2916	231,458,434	2.4162	244,043,405	32.61
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	35,035,921	2.9392	102,977,580	3.0584	107,153,860	14.32
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	44,855,505	1.7918	80,372,094	1.8402	82,543,100	11.03

以上が、当ファンドが保有する有価証券のすべてです。

ロ 種類別の投資比率

平成27年 5月29日現在

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	100.08
合計	100.08

【投資不動産物件】

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）

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

S M A M ・ グローバルバランスファンド（機動的資産配分型）

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

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）

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1期 (平成21年 4月13日)	16,686,392	16,686,392	8,941	8,941
第2期 (平成22年 4月13日)	68,468,980	68,468,980	9,680	9,680
第3期 (平成23年 4月13日)	128,503,036	128,503,036	9,450	9,450
第4期 (平成24年 4月13日)	220,003,408	220,003,408	9,507	9,507
第5期 (平成25年 4月15日)	344,598,682	344,598,682	11,105	11,105
第6期 (平成26年 4月14日)	505,145,631	505,145,631	11,474	11,474
第7期 (平成27年 4月13日)	715,784,521	715,784,521	13,405	13,405
平成26年 5月末日	533,861,619		11,744	
6月末日	557,991,102		11,931	
7月末日	572,019,440		12,047	
8月末日	582,083,391		12,080	
9月末日	609,298,753		12,348	
10月末日	618,466,873		12,343	
11月末日	655,047,818		12,942	
12月末日	664,784,941		13,024	
平成27年 1月末日	666,506,416		12,904	
2月末日	680,456,262		13,243	
3月末日	708,640,783		13,293	
4月末日	726,999,335		13,434	
5月末日	748,445,287		13,730	

【分配の推移】

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）

	計算期間	1万口当たり分配金（円）
第1期	平成20年 3月31日～平成21年 4月13日	0
第2期	平成21年 4月14日～平成22年 4月13日	0
第3期	平成22年 4月14日～平成23年 4月13日	0
第4期	平成23年 4月14日～平成24年 4月13日	0
第5期	平成24年 4月14日～平成25年 4月15日	0
第6期	平成25年 4月16日～平成26年 4月14日	0
第7期	平成26年 4月15日～平成27年 4月13日	0

【収益率の推移】

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）

	収益率（％）
第1期	10.6
第2期	8.3
第3期	2.4
第4期	0.6
第5期	16.8
第6期	3.3
第7期	16.8

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

（４）【設定及び解約の実績】

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）

	設定口数（口）	解約口数（口）
第1期	19,697,539	1,034,910
第2期	55,385,703	3,317,301
第3期	74,934,583	9,676,704
第4期	108,988,282	13,561,540
第5期	106,946,027	28,043,591
第6期	160,191,612	30,265,804
第7期	136,804,546	43,095,045

（注）本邦外における設定および解約の実績はありません。

（参考）

（１）投資状況

国内株式インデックス・マザーファンド（Ｂ号）

平成27年 5月29日現在

資産の種類	国／地域	時価合計 （円）	投資比率 （％）
株式	日本	270,593,578,370	98.76
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		3,400,958,654	1.24
合計(純資産総額)		273,994,537,024	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	3,191,610,000	1.16
合計	買建		3,191,610,000	1.16

国内債券パッシブ・マザーファンド

平成27年 5月29日現在

資産の種類	国／地域	時価合計 （円）	投資比率 （％）
国債証券	日本	226,867,534,600	76.31
地方債証券	日本	21,367,185,100	7.19
特殊債券	日本	28,563,127,820	9.61
社債券	日本	16,058,206,000	5.40
	アメリカ	1,018,516,000	0.34
	オランダ	908,560,000	0.31
	オーストラリア	705,699,000	0.24
	小計	18,690,981,000	6.29
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1,810,184,788	0.60
合計(純資産総額)		297,299,013,308	100.00

外国株式インデックス・マザーファンド

平成27年 5月29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	117,993,764,849	56.81
	イギリス	16,816,513,845	8.10
	スイス	8,678,861,573	4.18
	カナダ	8,111,184,796	3.91
	フランス	7,812,250,961	3.76
	ドイツ	7,791,724,134	3.75
	オーストラリア	5,236,996,791	2.52
	オランダ	3,519,372,001	1.69
	アイルランド	3,518,353,563	1.69
	スペイン	3,020,962,203	1.45
	スウェーデン	2,595,891,858	1.25
	香港	2,124,564,250	1.02
	イタリア	1,862,943,530	0.90
	デンマーク	1,470,772,253	0.71
	シンガポール	1,335,886,232	0.64
	ジャージー	1,303,631,542	0.63
	ベルギー	1,120,429,768	0.54
	キュラソー	748,205,233	0.36
	フィンランド	717,408,855	0.35
	バミューダ	680,516,891	0.33
	ノルウェー	548,122,123	0.26
	ケイマン諸島	527,447,362	0.25
	イスラエル	496,647,898	0.24
	ルクセンブルグ	331,272,282	0.16
	オーストリア	175,493,536	0.08
	ポルトガル	136,165,151	0.07
	ニュージーランド	119,814,921	0.06
	リベリア	80,218,910	0.04
	英ヴァージン諸島	62,472,220	0.03
	マン島	27,208,320	0.01
モーリシャス	14,442,378	0.01	
小計		198,979,540,229	95.81

投資証券	アメリカ	3,114,080,242	1.50
	オーストラリア	698,667,658	0.34
	イギリス	294,636,473	0.14
	フランス	273,362,061	0.13
	シンガポール	107,268,994	0.05
	香港	103,273,808	0.05
	カナダ	43,425,107	0.02
	小計	4,634,714,343	2.23
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		4,072,419,111	1.96
合計(純資産総額)		207,686,673,683	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	2,690,808,895	1.29
	買建	ドイツ	785,287,675	0.37
	買建	イギリス	346,372,825	0.16
	買建	オーストラリア	203,730,401	0.09
合計	買建		4,026,199,796	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	買建		199,574,100	0.09

外国債券パッシブ・マザーファンド

平成27年 5月29日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
国債証券	アメリカ	95,094,129,308	41.34
	イタリア	21,921,937,440	9.53
	フランス	21,212,886,516	9.22
	イギリス	19,043,816,273	8.28
	ドイツ	17,107,857,473	7.44
	スペイン	12,018,813,234	5.23

	ベルギー	5,766,601,801	2.51
	オランダ	5,697,470,668	2.48
	カナダ	5,281,912,887	2.30
	オーストラリア	3,943,745,090	1.71
	オーストリア	3,559,965,238	1.55
	メキシコ	2,373,621,523	1.03
	アイルランド	1,847,112,077	0.80
	デンマーク	1,586,527,513	0.69
	フィンランド	1,315,036,614	0.57
	ポーランド	1,311,663,274	0.57
	南アフリカ	1,213,849,543	0.53
	スウェーデン	1,102,158,817	0.48
	マレーシア	1,072,029,039	0.47
	シンガポール	868,069,959	0.38
	スイス	742,190,677	0.32
	ノルウェー	644,520,375	0.28
	小計	224,725,915,339	97.70
	現金・預金・その他の資産(負債控除後)	5,282,726,197	2.30
	合計(純資産総額)	230,008,641,536	100.00

マネーインカム・マザーファンド

平成27年 5月29日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
国債証券	日本	1,467,463,740	98.05
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		29,127,640	1.95
合計(純資産総額)		1,496,591,380	100.00

(2) 投資資産

投資有価証券の主要銘柄

国内株式インデックス・マザーファンド(B号)

イ 主要投資銘柄(上位30銘柄)

平成27年 5月29日現在

国/地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	投資 比率 (%)
日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	1,523,600	7,429.00	11,318,824,400	8,604.00	13,109,054,400	4.78
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	8,742,400	690.00	6,032,256,000	921.20	8,053,498,880	2.94

日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	824,300	4,477.50	3,690,803,250	5,670.00	4,673,781,000	1.71
日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	576,300	7,966.00	4,590,805,800	7,447.00	4,291,706,100	1.57
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	993,600	3,595.50	3,572,488,800	4,261.00	4,233,729,600	1.55
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	15,195,600	204.30	3,104,461,080	274.60	4,172,711,760	1.52
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	426,500	6,230.00	2,657,095,000	8,669.00	3,697,328,500	1.35
日本	株式	ファナック	電気機器	115,000	20,260.00	2,329,900,000	27,540.00	3,167,100,000	1.16
日本	株式	日本たばこ産業	食料品	686,000	3,798.00	2,605,428,000	4,540.00	3,114,440,000	1.14
日本	株式	KDDI	情報・通信業	1,107,400	2,514.66	2,784,734,484	2,811.00	3,112,901,400	1.14
日本	株式	ソニー	電気機器	721,700	2,640.00	1,905,288,000	3,862.00	2,787,205,400	1.02
日本	株式	キヤノン	電気機器	640,100	3,906.00	2,500,230,600	4,292.00	2,747,309,200	1.00
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	433,400	5,015.00	2,173,501,000	6,040.00	2,617,736,000	0.96
日本	株式	パナソニック	電気機器	1,345,600	1,554.00	2,091,062,400	1,831.00	2,463,793,600	0.90
日本	株式	アステラス製薬	医薬品	1,316,500	1,713.50	2,255,822,750	1,812.00	2,385,498,000	0.87
日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	456,000	4,456.00	2,031,936,000	5,157.00	2,351,592,000	0.86
日本	株式	村田製作所	電気機器	115,800	12,980.00	1,503,084,000	20,235.00	2,343,213,000	0.86
日本	株式	三菱商事	卸売業	835,300	2,222.00	1,856,036,600	2,787.00	2,327,981,100	0.85
日本	株式	東日本旅客鉄道	陸運業	202,400	8,954.00	1,812,289,600	11,365.00	2,300,276,000	0.84
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	441,500	3,970.50	1,752,975,750	5,144.00	2,271,076,000	0.83
日本	株式	日立製作所	電気機器	2,652,000	920.10	2,440,105,200	850.00	2,254,200,000	0.82
日本	株式	三菱地所	不動産業	811,000	2,685.00	2,177,535,000	2,779.00	2,253,769,000	0.82
日本	株式	東海旅客鉄道	陸運業	98,900	17,515.00	1,732,233,500	21,625.00	2,138,712,500	0.78
日本	株式	三井不動産	不動産業	578,000	3,430.00	1,982,540,000	3,626.50	2,096,117,000	0.77
日本	株式	日産自動車	輸送用機器	1,549,200	1,105.00	1,711,866,000	1,300.50	2,014,734,600	0.74
日本	株式	三菱電機	電気機器	1,104,000	1,438.50	1,588,104,000	1,705.00	1,882,320,000	0.69
日本	株式	NTTドコモ	情報・通信業	841,000	1,866.00	1,569,306,000	2,236.00	1,880,476,000	0.69
日本	株式	ブリヂストン	ゴム製品	362,800	4,122.00	1,495,461,600	5,176.00	1,877,852,800	0.69
日本	株式	野村ホールディングス	証券、商品先物取引業	2,223,200	718.80	1,598,036,160	823.60	1,831,027,520	0.67
日本	株式	デンソー	輸送用機器	272,500	5,683.00	1,548,617,500	6,511.00	1,774,247,500	0.65

□ 種別・業種別の投資比率

平成27年 5月29日現在

種類	国内 / 外国	業種	投資比率 (%)
株式	国内	水産・農林業	0.07
		鉱業	0.41
		建設業	2.56
		食料品	3.98
		繊維製品	0.74
		パルプ・紙	0.23

化学	5.79
医薬品	4.55
石油・石炭製品	0.47
ゴム製品	0.93
ガラス・土石製品	0.93
鉄鋼	1.50
非鉄金属	0.97
金属製品	0.61
機械	5.03
電気機器	12.93
輸送用機器	11.43
精密機器	1.29
その他製品	1.50
電気・ガス業	2.10
陸運業	3.87
海運業	0.30
空運業	0.60
倉庫・運輸関連業	0.20
情報・通信業	6.54
卸売業	4.12
小売業	4.30
銀行業	9.65
証券、商品先物取引業	1.35
保険業	2.63
その他金融業	1.27
不動産業	2.88
サービス業	3.02
合計	98.76

国内債券パッシブ・マザーファンド

イ 主要投資銘柄（上位30銘柄）

平成27年 5月29日現在

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
日本	国債証券	第286回利付国債(10年)	5,220,000,000	103.70	5,413,505,400	103.69	5,413,087,800	1.800	2017/6/20	1.82
日本	国債証券	第305回利付国債(10年)	4,635,000,000	105.53	4,891,338,650	105.60	4,894,699,050	1.300	2019/12/20	1.65
日本	国債証券	第303回利付国債(10年)	4,495,000,000	105.70	4,751,304,900	105.74	4,753,372,600	1.400	2019/9/20	1.60
日本	国債証券	第299回利付国債(10年)	4,445,000,000	104.77	4,657,337,650	104.83	4,659,960,200	1.300	2019/3/20	1.57
日本	国債証券	第289回利付国債(10年)	4,289,000,000	103.85	4,454,126,500	103.83	4,453,654,710	1.500	2017/12/20	1.50

日本	国債証券	第290回利付国債(10年)	4,277,000,000	103.93	4,445,471,030	103.93	4,445,086,100	1.400	2018/3/20	1.50
日本	国債証券	第285回利付国債(10年)	4,213,000,000	103.09	4,343,181,700	103.07	4,342,465,490	1.700	2017/3/20	1.46
日本	国債証券	第329回利付国債(10年)	4,050,000,000	103.93	4,209,448,500	104.25	4,222,408,500	0.800	2023/6/20	1.42
日本	国債証券	第296回利付国債(10年)	3,713,000,000	104.88	3,894,528,570	104.93	3,896,199,420	1.500	2018/9/20	1.31
日本	国債証券	第301回利付国債(10年)	3,585,000,000	105.86	3,795,116,850	105.90	3,796,586,700	1.500	2019/6/20	1.28
日本	国債証券	第333回利付国債(10年)	3,520,000,000	102.13	3,595,222,400	102.39	3,604,304,000	0.600	2024/3/20	1.21
日本	国債証券	第293回利付国債(10年)	3,360,000,000	105.50	3,544,867,200	105.50	3,544,934,400	1.800	2018/6/20	1.19
日本	国債証券	第310回利付国債(10年)	3,360,000,000	104.64	3,516,206,400	104.71	3,518,524,800	1.000	2020/9/20	1.18
日本	国債証券	第123回利付国債(5年)	3,400,000,000	100.00	3,400,014,000	100.07	3,402,414,000	0.100	2020/3/20	1.14
日本	国債証券	第315回利付国債(10年)	3,145,000,000	106.34	3,344,487,350	106.42	3,346,971,900	1.200	2021/6/20	1.13
日本	国債証券	第335回利付国債(10年)	3,260,000,000	101.03	3,293,708,400	101.30	3,302,543,000	0.500	2024/9/20	1.11
日本	国債証券	第288回利付国債(10年)	3,155,000,000	103.94	3,279,307,000	103.92	3,278,802,200	1.700	2017/9/20	1.10
日本	国債証券	第298回利付国債(10年)	3,070,000,000	104.52	3,208,917,500	104.57	3,210,544,600	1.300	2018/12/20	1.08
日本	国債証券	第325回利付国債(10年)	2,890,000,000	104.06	3,007,449,600	104.35	3,015,859,500	0.800	2022/9/20	1.01
日本	国債証券	第313回利付国債(10年)	2,810,000,000	106.72	2,998,832,000	106.76	3,000,012,200	1.300	2021/3/20	1.01
日本	国債証券	第334回利付国債(10年)	2,860,000,000	102.06	2,918,973,200	102.32	2,926,552,200	0.600	2024/6/20	0.98
日本	国債証券	第330回利付国債(10年)	2,700,000,000	103.93	2,806,137,000	104.21	2,813,886,000	0.800	2023/9/20	0.95
日本	国債証券	第338回利付国債(10年)	2,810,000,000	99.99	2,809,800,900	100.09	2,812,641,400	0.400	2025/3/20	0.95
日本	国債証券	第312回利付国債(10年)	2,400,000,000	105.91	2,542,038,400	105.98	2,543,616,000	1.200	2020/12/20	0.86
日本	国債証券	第332回利付国債(10年)	2,290,000,000	102.24	2,341,502,100	102.50	2,347,272,900	0.600	2023/12/20	0.79
日本	国債証券	第297回利付国債(10年)	2,143,000,000	104.88	2,247,599,830	104.93	2,248,714,190	1.400	2018/12/20	0.76
日本	国債証券	第306回利付国債(10年)	2,080,000,000	106.22	2,209,521,600	106.30	2,211,206,400	1.400	2020/3/20	0.74
日本	国債証券	第328回利付国債(10年)	2,150,000,000	102.44	2,202,589,000	102.75	2,209,232,500	0.600	2023/3/20	0.74
日本	国債証券	第321回利付国債(10年)	1,930,000,000	105.55	2,037,194,200	105.75	2,041,052,200	1.000	2022/3/20	0.69
日本	国債証券	第337回利付国債(10年)	2,040,000,000	99.03	2,020,252,800	99.30	2,025,883,200	0.300	2024/12/20	0.68

□ 種類別の投資比率

平成27年 5月29日現在

種類	投資比率(%)
国債証券	76.31
地方債証券	7.19
特殊債券	9.61
社債券	6.29

合計	99.39
----	-------

外国株式インデックス・マザーファンド

イ 主要投資銘柄（上位30銘柄）

平成27年 5月29日現在

国/ 地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	投資 比率 (%)
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	305,555	14,707.78	4,494,037,276	16,305.13	4,982,116,869	2.40
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・ サービス	407,399	5,900.68	2,403,932,639	5,870.98	2,391,834,844	1.15
アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORPORATION	エネルギー	220,494	11,197.56	2,468,995,897	10,530.66	2,321,947,412	1.12
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	145,567	13,376.45	1,947,169,741	12,515.28	1,821,813,147	0.88
アメリカ	株式	GENERAL ELECTRIC CO	資本財	522,187	3,270.18	1,707,647,520	3,418.65	1,785,179,757	0.86
アメリカ	株式	WELLS FARGO & COMPANY	銀行	256,352	6,735.86	1,726,751,491	6,954.86	1,782,893,117	0.86
スイス	株式	NESTLE SA-REGISTERED	食品・飲料・タ バコ	168,068	9,511.41	1,598,564,143	9,676.73	1,626,349,918	0.78
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	194,333	7,431.22	1,444,132,014	8,190.92	1,591,767,222	0.77
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	119,731	12,257.63	1,467,619,279	12,917.62	1,546,640,099	0.74
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	327,417	3,855.42	1,262,332,276	4,261.26	1,395,209,358	0.67
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パー ソナル用品	140,438	11,175.29	1,569,435,882	9,815.50	1,378,469,315	0.66
スイス	株式	ROCHE HOLDING AG- GENUSSCHEIN	医薬品・バイオ テクノロジー・ ライフサイエン ス	36,618	37,881.63	1,387,149,861	37,066.82	1,357,312,998	0.65
アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS INC	電気通信サービ ス	215,836	6,248.36	1,348,622,108	6,129.58	1,322,984,935	0.64
アメリカ	株式	CHEVRON CORPORATION	エネルギー	98,223	13,458.11	1,321,896,145	12,773.88	1,254,689,326	0.60
イギリス	株式	HSBC HOLDINGS PLC	銀行	996,836	1,205.66	1,201,850,475	1,182.15	1,178,418,169	0.57

アメリカ	株式	AT&T INC	電気通信サービス	269,436	4,370.14	1,177,474,011	4,305.80	1,160,138,607	0.56
アメリカ	株式	THE WALT DISNEY CO.	メディア	83,786	11,446.26	959,036,533	13,675.87	1,145,847,022	0.55
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	546,093	2,103.40	1,148,657,477	2,062.57	1,126,360,008	0.54
アメリカ	株式	GILEAD SCIENCES INC	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	78,329	12,417.54	972,653,710	13,962.93	1,093,702,383	0.53
アメリカ	株式	MERCK & CO. INC.	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	148,038	7,475.76	1,106,697,536	7,386.68	1,093,509,482	0.53
アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	小売	20,434	41,824.45	854,640,850	52,779.50	1,078,496,428	0.52
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	各種金融	59,978	18,385.04	1,102,697,971	17,908.68	1,074,126,821	0.52
アメリカ	株式	CITIGROUP INC	銀行	157,286	6,657.91	1,047,196,236	6,749.47	1,061,597,374	0.51
アメリカ	株式	INTEL CORP	半導体・半導体製造装置	250,945	4,600.28	1,154,417,616	4,208.05	1,055,990,939	0.51
アメリカ	株式	COCA-COLA CO/THE	食品・飲料・タバコ	204,598	5,538.15	1,133,095,396	5,090.25	1,041,455,420	0.50
アメリカ	株式	INTL BUSINESS MACHINES CORP	ソフトウェア・サービス	48,809	20,034.36	977,857,155	21,245.67	1,036,980,312	0.50
アメリカ	株式	FACEBOOK INC-A	ソフトウェア・サービス	103,840	9,610.10	997,913,729	9,916.34	1,029,712,834	0.50
アメリカ	株式	GOOGLE INC-CL A	ソフトウェア・サービス	14,780	67,838.68	1,002,655,756	68,568.69	1,013,445,259	0.49
アメリカ	株式	GOOGLE INC-CL C	ソフトウェア・サービス	15,004	66,768.41	1,001,793,372	66,786.97	1,002,071,839	0.48
アメリカ	株式	ORACLE CORPORATION	ソフトウェア・サービス	183,965	5,247.38	965,335,972	5,426.79	998,340,857	0.48

□ 種類別・業種別の投資比率

平成27年 5月29日現在

種類	国内 / 外国	業種	投資比率 (%)
株式	外国	エネルギー	7.89
		素材	4.99
		資本財	6.94
		商業・専門サービス	0.90

	運輸	1.83
	自動車・自動車部品	1.74
	耐久消費財・アパレル	1.63
	消費者サービス	1.64
	メディア	3.11
	小売	3.45
	食品・生活必需品小売り	2.07
	食品・飲料・タバコ	6.09
	家庭用品・パーソナル用品	1.68
	ヘルスケア機器・サービス	3.61
	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	10.11
	銀行	9.09
	各種金融	4.43
	保険	4.16
	不動産	0.72
	ソフトウェア・サービス	7.12
	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	4.66
	電気通信サービス	3.09
	公益事業	3.12
	半導体・半導体製造装置	1.73
投資証券		2.23
合計		98.04

外国債券パッシブ・マザーファンド

イ 主要投資銘柄（上位30銘柄）

平成27年 5月29日現在

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.75	13,000,000	12,480.29	1,622,438,633	11,990.21	1,558,727,341	2.750	2042/11/15	0.68
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.5	9,000,000	12,854.38	1,156,894,833	12,790.58	1,151,152,988	2.500	2024/5/15	0.50
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.75	8,200,000	13,134.71	1,077,046,451	13,072.84	1,071,973,521	2.750	2023/11/15	0.47
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 4.25	6,400,000	15,973.90	1,022,330,159	15,803.98	1,011,455,322	4.250	2019/4/25	0.44
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2	8,000,000	12,378.81	990,305,247	12,221.23	977,698,999	2.000	2025/2/15	0.43
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.625	7,500,000	12,986.81	974,011,264	13,012.91	975,968,706	2.625	2020/11/15	0.42
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 3.625	7,000,000	13,712.76	959,893,474	13,685.69	957,998,858	3.625	2021/2/15	0.42

フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 5.5	4,500,000	21,074.47	948,351,242	21,151.09	951,799,126	5.500	2029/4/25	0.41
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 3.625	7,000,000	13,573.56	950,149,736	13,528.13	946,969,493	3.625	2019/8/15	0.41
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2	7,500,000	12,417.46	931,309,909	12,415.53	931,164,914	2.000	2023/2/15	0.40
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.75	7,000,000	13,134.71	919,429,897	13,054.48	913,813,719	2.750	2024/2/15	0.40
イギリス	国債証券	TREASURY 4.5	4,200,000	21,658.37	909,651,645	21,391.45	898,441,233	4.500	2019/3/7	0.39
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.375	7,000,000	12,707.45	889,522,036	12,651.39	885,597,475	2.375	2024/8/15	0.39
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 3	7,000,000	13,126.01	918,820,918	12,617.56	883,229,210	3.000	2042/5/15	0.38
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.125	7,000,000	12,599.19	881,943,573	12,615.62	883,093,880	2.125	2021/8/15	0.38
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 4.25	5,000,000	17,707.27	885,363,787	17,615.73	880,786,950	4.250	2023/10/25	0.38
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.25	7,000,000	12,659.13	886,139,139	12,503.49	875,244,758	2.250	2024/11/15	0.38
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 0.625	7,000,000	12,403.93	868,275,275	12,406.83	868,478,274	0.625	2016/8/15	0.38
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 3.625	6,000,000	14,691.00	881,460,253	14,142.91	848,575,143	3.625	2043/8/15	0.37
イタリア	国債証券	BTPS 6	4,100,000	19,291.87	790,967,022	20,005.59	820,229,355	6.000	2031/5/1	0.36
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 3.625	6,000,000	13,638.33	818,299,958	13,591.93	815,516,033	3.625	2020/2/15	0.35
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 1.375	6,500,000	12,412.63	806,821,101	12,484.16	811,470,643	1.375	2018/9/30	0.35
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 3.875	6,000,000	13,505.90	810,354,169	13,433.40	806,004,290	3.875	2018/5/15	0.35
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 3	5,000,000	16,002.65	800,132,902	15,947.05	797,352,897	3.000	2022/4/25	0.35
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 3.5	5,000,000	15,881.96	794,098,257	15,786.76	789,338,346	3.500	2020/4/25	0.34
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 3.75	5,000,000	15,879.65	793,982,989	15,757.88	787,894,100	3.750	2019/10/25	0.34
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 3.25	4,800,000	16,139.35	774,688,940	16,059.34	770,848,465	3.250	2021/10/25	0.34
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 3.75	4,700,000	16,425.76	772,010,779	16,332.86	767,644,815	3.750	2021/4/25	0.33
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 1.875	6,000,000	12,691.02	761,461,489	12,696.82	761,809,480	1.875	2017/10/31	0.33
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 1.875	6,000,000	12,689.09	761,345,492	12,691.99	761,519,484	1.875	2017/9/30	0.33

ロ 種類別の投資比率

平成27年 5月29日現在

種類	投資比率（％）
国債証券	97.70
合計	97.70

マネーインカム・マザーファンド

イ 主要投資銘柄

平成27年 5月29日現在

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	利率 (％)	償還期限	投資 比率 (％)
日本	国債証券	第272回利付国債(10年)	560,000,000	100.50	562,805,600	100.42	562,368,800	1.400	2015/9/20	37.58

日本	国債証券	第273回利付国債(10年)	218,000,000	100.64	219,395,200	100.45	218,987,540	1.500	2015/9/20	14.63
日本	国債証券	第338回利付国債(2年)	215,000,000	100.09	215,195,650	100.08	215,176,300	0.100	2016/3/15	14.38
日本	国債証券	第276回利付国債(10年)	200,000,000	101.09	202,182,000	100.88	201,766,000	1.600	2015/12/20	13.48
日本	国債証券	第280回利付国債(10年)	190,000,000	102.10	193,991,900	101.99	193,798,100	1.900	2016/6/20	12.95
日本	国債証券	第98回利付国債(5年)	50,000,000	100.35	50,177,000	100.32	50,160,000	0.300	2016/6/20	3.35
日本	国債証券	第274回利付国債(10年)	25,000,000	101.02	25,255,750	100.82	25,207,000	1.500	2015/12/20	1.68

以上が、当ファンドが保有する有価証券のすべてです。

□ 種類別の投資比率

平成27年 5月29日現在

種類	投資比率(%)
国債証券	98.05
合計	98.05

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。

マネーインカム・マザーファンド

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

国内株式インデックス・マザーファンド(B号)

平成27年 5月29日現在

種類	取引所等	名称	買建/ 売建	数量	通貨	簿価 (円)	時価 (円)	投資 比率 (%)
株価指数先物 取引	大阪取引所	東証株価指数先物	買建	191	日本円	3,135,265,000	3,191,610,000	1.16

（注）主たる取引所の発表する清算値段または最終相場で評価しております。

国内債券パッシブ・マザーファンド

該当事項はありません。

外国株式インデックス・マザーファンド

平成27年 5月29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 1506	買建	205	米ドル	21,742,462.5	2,690,194,885	21,747,425	2,690,808,895	1.29
	ドイツ	ユーレック ス・ドイツ 金融先物取 引所	DJ EUR 1506	買建	159	ユーロ	5,811,708	788,125,721	5,790,780	785,287,675	0.37
	オースト ラリア	シドニー先 物取引所	SPI200 1506	買建	15	オーストラ リアドル	2,132,117.5	202,188,702	2,148,375	203,730,401	0.09
	イギリス	ロンドン国 際金融先物 オプション 取引所	FTSE 1506	買建	26	英ポンド	1,814,382	343,952,395	1,827,150	346,372,825	0.16

（注）主たる取引所の発表する清算値段または最終相場で評価しております。

平成27年 5月29日現在

種類	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	米ドル	買建	1,110,000.00	137,259,714	137,329,200	0.06
	カナダドル	買建	40,000.00	3,972,856	3,984,000	0.00
	ユーロ	買建	200,000.00	26,988,860	27,120,000	0.01
	英ポンド	買建	90,000.00	17,088,372	17,059,500	0.00
	スイスフラン	買建	30,000.00	3,909,534	3,936,300	0.00
	スウェーデンクローナ	買建	120,000.00	1,744,890	1,754,400	0.00
	ノルウェークローネ	買建	20,000.00	318,556	317,200	0.00
	デンマーククローネ	買建	60,000.00	1,086,216	1,090,800	0.00
	オーストラリアドル	買建	40,000.00	3,831,168	3,792,000	0.00

香港ドル	買建	180,000.00	2,871,000	2,871,000	0.00
イスラエルシェケル	買建	10,000.00	320,300	319,700	0.00

(注) わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しております。

外国債券パッシブ・マザーファンド

該当事項はありません。

マネーインカム・マザーファンド

該当事項はありません。

参考情報

基準日2015年5月29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



※基準価額は、1万口当たり、信託報酬控除後です。

基準価額	13,730円
純資産総額	7億円

分配の推移

決算期	分配金
2015年4月	0円
2014年4月	0円
2013年4月	0円
2012年4月	0円
2011年4月	0円
設定来累計	0円

※分配金は1万口当たり、税引前です。
 ※直近5計算期間を記載しています。

年間収益率の推移（暦年ベース）



※ 2008年のファンドの収益率は、ファンドの設定日(2008年3月31日)から年末までの騰落率を表示しています。

※ 2015年の収益率は、年初から2015年5月29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。

(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

お申込価額、申込単位の詳細についての委託会社に対する照会は下記においてできます。

照会先の名称	電話番号	インターネット・ ホームページ・アドレス
三井住友アセットマネジメント株式会社	0120-88-2976	http://www.smam-jp.com

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

ヘ 申込取扱場所・払込取扱場所

販売会社において申込み・払込みを取り扱います。

ト 払込期日

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

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

2【換金（解約）手続等】

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

お買付けの販売会社にお申し出ください。

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

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

一部解約金は、解約請求受付日から起算して5営業日目からお支払いします。

一部解約価額は、解約請求受付日の翌営業日の基準価額となります。

一部解約価額は、委託会社の営業日において日々算出されますので、委託会社（電話：0120-88-2976）にお問い合わせいただければ、いつでもお知らせします。

委託会社は、取引所等における取引の停止、決済機能の停止、その他やむを得ない事情があるときは、一部解約の実行の請求の受け付けを中止すること、および既に受け付けた一部解約の実行請求を取り消すことがあります。この場合、受益者は当該受付中止以前に行った当日の一部解約の実行の請求を撤回できます。受益者がその一部解約の実行の請求を撤回しない場合には、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に一部解約の実行の請求を受け付けたものとして、上記に準じた取扱いとなります。

3【資産管理等の概要】

（1）【資産の評価】

イ 基準価額の算出方法

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

ロ 基準価額の算出頻度・照会方法

基準価額は、委託会社の営業日において日々算出されます。

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

委託会社に対する照会は下記においてできます。

照会先の名称	電話番号	インターネット・ホームページ・アドレス
三井住友アセットマネジメント株式会社	0120-88-2976	http://www.smam-jp.com

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

(2) 【保管】

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

(3) 【信託期間】

平成20年3月31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4月14日から翌年4月13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、残存口数が1億口を下回ることとなったとき、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、書面による決議(以下「書面決議」といいます。)を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに信託契約の解約の理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、当ファンドの知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。
- c. 書面決議において、受益者(委託会社等を除きます。)は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行行使することができます。なお、知れている受益者が議決権を行行使しないときは、当該知れている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
- d. 書面決議は議決権を行行使することができる受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います。
- e. 上記b～dまでの取扱いは、委託会社が信託契約の解約について提案をした場合において、当該提案につき、当ファンドのすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。また、信託財産の状況に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、上記b～dまでの取扱いを行うことが困難な場合も同様とします。

(ロ) 信託契約に関する監督官庁の命令

委託会社は、監督官庁より当ファンドの信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令に従い信託契約を解約し、信託を終了させます。

(ハ) 委託会社の登録取消等に伴う取扱い

委託会社が、監督官庁より登録の取消しを受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託会社は当ファンドの信託契約を解約し、信託を終了させます。ただし、監督官庁が

当ファンドに関する委託会社の業務を他の委託会社に引継ぐことを命じたときは、当ファンドは、その委託会社と受託会社との間において存続します。

(二) 受託会社の辞任および解任に伴う取扱い

- a. 受託会社は、委託会社の承諾を受けてその任務を辞任することができます。また、受託会社はその任務に違反して信託財産に著しい損害を与えたこと、その他重要な事由があるときは、委託会社または受益者は、裁判所に受託会社の解任を申し立てることができます。
- 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。

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 信託約款の変更等

(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、または当ファンドと他のファンドとの併合（投資信託及び投資法人に関する法律第16条第2号に規定する「委託者指図型投資信託の併合」をいいます。）を行うことができるものとし、あらかじめ、変更または併合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）の事項（変更についてはその内容が重大なものに該当する場合に限り、併合にあつては、その併合が受益者の利益に及ぼす影響が軽微なものに該当する場合を除きます。以下、合わせて「重大な信託約款の変更等」といいます。）について、書面決議を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに重大な信託約款の変更等の内容およびその理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、当ファンドの知っている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。

(ハ) 上記（ロ）の書面決議において、受益者（委託会社等を除きます。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、知っている受益者が議決権を行使しないときは、当該知っている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。

(ニ) 書面決議は議決権を行使することができる受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います（書面決議は、当ファンドのすべての受益者に対してその効力を生じます。）。

(ホ) 上記（ロ）から（ニ）までの取扱いは、委託会社が重大な信託約款の変更等について提案をした場合において、当該提案につき、当ファンドのすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。

(ヘ) 上記にかかわらず、当ファンドと他のファンドとの併合の場合は、当ファンドにおいて併合の書面決議が可決された場合にあつても、相手方となる他のファンドにおいて当該併合の書面決議が否決された場合は、併合を行うことはできません。

二 反対受益者の受益権買取請求の不適用

当ファンドは、受益者が一部解約の実行の請求を行ったときは、委託会社が信託契約の一部解約をすることにより当該請求に応じ、当該受益権の公正な価格が当該受益者に一部解約金として支払われることとなる委託者指図型投資信託に該当するため、信託契約の解約または重大な信託約款の変更等を行う場合において、投資信託及び投資法人に関する法律第18条第1項に定める反対受益者による受益権の買取請求の規定の適用を受けません。

ホ 販売会社との契約の更改等

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

ヘ 委託会社の事業の譲渡および承継に伴う取扱い

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

ト 公告

委託会社が受益者に対してする公告は、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。

当ファンドは、現時点では、分配金自動再投資コースのみの取扱いしかありませんので、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て）に支払われます。

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

ハ 一部解約実行請求権

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

二 書面決議における議決権

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等を行うおとす場合において、受益者は、それぞれの書面決議手続きにお

いて、受益権の口数に応じて議決権を有しこれを行使することができます。

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7期（平成26年 4月15日から平成27年 4月13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】

【SMAM・グローバルバランスファンド（機動的資産配分型）】

（１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第6期 （平成26年 4月14日現在）	第7期 （平成27年 4月13日現在）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	1,295,165	2,132,884
親投資信託受益証券	505,140,363	715,768,476
未収入金	300,000	2,490,000
流動資産合計	506,735,528	720,391,360
資産合計	506,735,528	720,391,360
負債の部		
流動負債		
未払解約金	142,739	2,501,853
未払受託者報酬	72,977	106,144
未払委託者報酬	1,362,081	1,981,211
その他未払費用	12,100	17,631
流動負債合計	1,589,897	4,606,839
負債合計	1,589,897	4,606,839
純資産の部		
元本等		
元本	440,243,896	533,953,397
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	64,901,735	181,831,124
元本等合計	505,145,631	715,784,521
純資産合計	505,145,631	715,784,521
負債純資産合計	506,735,528	720,391,360

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第6期		第7期	
	自	平成25年 4月16日 至 平成26年 4月14日	自	平成26年 4月15日 至 平成27年 4月13日
営業収益				
受取利息		99		41
有価証券売買等損益		13,864,371		98,479,752
営業収益合計		13,864,470		98,479,793
営業費用				
受託者報酬		131,727		196,688
委託者報酬		2,458,662		3,671,214
その他費用		21,831		32,650
営業費用合計		2,612,220		3,900,552
営業利益又は営業損失（ ）		11,252,250		94,579,241
経常利益又は経常損失（ ）		11,252,250		94,579,241
当期純利益又は当期純損失（ ）		11,252,250		94,579,241
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（ ）		585,641		4,120,484
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		34,280,594		64,901,735
剰余金増加額又は欠損金減少額		23,405,798		33,204,683
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		23,405,798		33,204,683
剰余金減少額又は欠損金増加額		3,451,266		6,734,051
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		3,451,266		6,734,051
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（ ）		64,901,735		181,831,124

(3) 【注記表】

(重要な会計方針の注記)

項 目	第7期	
	自 平成26年 4月15日 至 平成27年 4月13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が休日のため、平成26年 4月15日から平成27年 4月13日までとなっております。</p>	

(追加情報)

第7期	
自 平成26年 4月15日 至 平成27年 4月13日	
<p>スミセイ・DCバランスファンド（機動的資産配分型）は、DC（確定拠出年金）向け以外にも販売を拡大するため、平成27年2月27日付けでファンドの名称を「SMAM・グローバルバランスファンド（機動的資産配分型）」に変更しております。</p>	

(貸借対照表に関する注記)

項 目	第6期		第7期	
	(平成26年 4月14日現在)		(平成27年 4月13日現在)	
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	440,243,896口		533,953,397口	
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額	1.1474円	1口当たり純資産額	1.3405円
	(10,000口当たりの純資産額	11,474円)	(10,000口当たりの純資産額	13,405円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第6期	第7期
	自 平成25年 4月16日 至 平成26年 4月14日	自 平成26年 4月15日 至 平成27年 4月13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（6,638,326円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（4,028,283円）、収益調整金（64,823,630円）、および分配準備積立金（50,041,685円）より、分配対象収益は125,531,924円（1万口当たり2,851.41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（11,202,427円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（79,256,330円）、収益調整金（96,859,729円）、および分配準備積立金（55,605,219円）より、分配対象収益は242,923,705円（1万口当たり4,549.52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7期
	自 平成26年 4月15日 至 平成27年 4月13日
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2.金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>(1)金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、親投資信託受益証券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2)金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>

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

・金融商品の時価等に関する事項

項目	第7期 (平成27年 4月13日現在)
1.貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	<p>(1) 有価証券（親投資信託受益証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

第6期（自 平成25年 4月16日 至 平成26年 4月14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	12,670,473円
合計	12,670,473円

第7期（自 平成26年 4月15日 至 平成27年 4月13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	70,712,436円
合計	70,712,436円

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

項 目	第6期 （平成26年 4月14日現在）	第7期 （平成27年 4月13日現在）
期首元本額	310,318,088円	440,243,896円
期中追加設定元本額	160,191,612円	136,804,546円
期中一部解約元本額	30,265,804円	43,095,045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）	88,887,349	203,400,920	
	外国株式インデックス・マザーファンド	25,026,205	73,486,948	
	外国債券パッシブ・マザーファンド	57,426,161	102,878,967	
	国内債券パッシブ・マザーファンド	271,301,932	325,915,010	
	マネーインカム・マザーファンド	9,965,058	10,086,631	
合計		452,606,705	715,768,476	

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

(参考)

S M A M ・ グローバルバランスファンド（機動的資産配分型）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」、「外国債券パッシブ・マザーファンド」および「マネーインカム・マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同マザーファンドの受益証券です。

なお、以下に記載した状況は、監査の対象外です。

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26年 4月14日現在）	（平成27年 4月13日現在）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	2,224,725,941	2,749,242,256
株式	267,960,518,480	270,575,807,620
派生商品評価勘定	1,007,720	73,126,120
未収入金	-	10,561,520
未収配当金	2,791,728,914	2,169,589,215
未収利息	1,219	753
前払金	293,344,000	-
流動資産合計	273,271,326,274	275,578,327,484
資産合計	273,271,326,274	275,578,327,484
負債の部		

流動負債		
派生商品評価勘定	294,534,030	-
前受金	-	73,300,000
未払金	25,000,000	18,225,000
未払解約金	9,919,995	1,005,258,972
流動負債合計	329,454,025	1,096,783,972
負債合計	329,454,025	1,096,783,972
純資産の部		
元本等		
元本	170,120,276,178	119,948,691,565
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	102,821,596,071	154,532,851,947
元本等合計	272,941,872,249	274,481,543,512
純資産合計	272,941,872,249	274,481,543,512
負債純資産合計	273,271,326,274	275,578,327,484

注記表

（重要な会計方針の注記）

項目	自 平成26年 4月15日 至 平成27年 4月13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26年 4月14日現在）	（平成27年 4月13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 9,738,000,000円	株式 4,124,000,000円
2. 当計算期間の末日における受益権の総数	170,120,276,178口	119,948,691,565口
3. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.6044円 (10,000口当たりの純資産額 16,044円)	1口当たり純資産額 2.2883円 (10,000口当たりの純資産額 22,883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26年 4月15日 至 平成27年 4月13日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、株式を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。当計算期間については、先物取引を行っております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>

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

・金融商品の時価等に関する事項

項目	(平成27年 4月13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26年 4月14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	5,296,671,310	-	5,003,145,000	293,526,310
	東証株価指数先物	5,296,671,310	-	5,003,145,000	293,526,310
合計		5,296,671,310	-	5,003,145,000	293,526,310

（平成27年 4月13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	3,423,773,880	-	3,496,900,000	73,126,120
	東証株価指数先物	3,423,773,880	-	3,496,900,000	73,126,120
合計		3,423,773,880	-	3,496,900,000	73,126,120

（注）1．時価の算定方法

(1) 株価指数先物取引の時価の算定方法について

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

2) 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

2．ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

（平成26年 4月14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	218,473,743,709円
同期中における追加設定元本額	12,059,025,307円
同期中における一部解約元本額	60,412,492,838円

平成26年 4月14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	9,481,228,263円
三井住友・DC年金バランス30（債券重点型）	450,756,286円
三井住友・DC年金バランス50（標準型）	2,322,813,391円
三井住友・DC年金バランス70（株式重点型）	1,692,753,648円
スミセイ・DCバランスファンド（機動的資産配分型）	61,156,687円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2020	5,148,645円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2025	10,029,609円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2030	9,152,329円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2035	11,954,310円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2040	3,409,787円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2045	8,610,688円
国内株式指数ファンド（TOPIX）	2,012,546,606円
三井住友・DC日本株式インデックスファンドS	160,686,009円
SMAM・国内株式パッシブ・ファンド（適格機関投資家専用）	36,476,924,392円
バランスファンドVA（安定運用型）＜適格機関投資家限定＞	393,140,804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＞	34,631,342,478円
SMAM・バランスファンドVA25＜適格機関投資家専用＞	12,359,652,211円
SMAM・バランスファンドVA37.5＜適格機関投資家専用＞	5,284,110,350円
SMAM・バランスファンドVA50＜適格機関投資家専用＞	19,535,190,432円
SMAM・バランスファンドVL30＜適格機関投資家限定＞	122,181,510円
SMAM・バランスファンドVL50＜適格機関投資家限定＞	442,949,146円
世界6資産バランスファンドVA＜適格機関投資家限定＞	52,697,235円
SMAM・バランスファンドVA75＜適格機関投資家専用＞	2,120,089,421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＞	106,803,060円
SMAM・インデックス・バランスVA25＜適格機関投資家専用＞	715,717,580円
SMAM・インデックス・バランスVA50＜適格機関投資家専用＞	2,257,922,948円
SMAM・バランスファンドVA40＜適格機関投資家専用＞	3,913,762,216円
SMAM・バランスファンドVA35＜適格機関投資家専用＞	7,062,296,189円
SMAM・バランスVA株40T＜適格機関投資家限定＞	769,684,349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）	5,972,746,694円
SMAM・グローバルバランス40VA＜適格機関投資家限定＞	136,689,498円
SMAM・バランスファンドVA20＜適格機関投資家専用＞	950,535,404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）	15,370,084,658円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A＜適格機関投資家専用＞	205,630,392円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A＜適格機関投資家専用＞	105,788,071円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A＜適格機関投資家専用＞	42,602,564円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L＜適格機関投資家専用＞	498,332,273円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L＜適格機関投資家専用＞	887,123,373円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T＜適格機関投資家専用＞	345,486,158円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A2＜適格機関投資家専用＞	232,755,536円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A2＜適格機関投資家専用＞	118,320,231円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A2＜適格機関投資家専用＞	20,171,277円
SMAM・アセットバランスファンドVA30L2＜適格機関投資家専用＞	215,156,020円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L2＜適格機関投資家専用＞	2,090,292,655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）	375,437,293円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T2＜適格機関投資家専用＞	72,744,416円
SMAM・FG新興国重視型バランス20VA＜適格機関投資家限定＞	1,168,479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 >	4,500,607円
合計	170,120,276,178円

(平成27年 4月13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	170,120,276,178円
同期中における追加設定元本額	6,090,838,418円
同期中における一部解約元本額	56,262,423,031円
平成27年 4月13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	9,501,464,484円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	411,643,949円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	2,226,830,830円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	1,636,897,512円
S M A M ・ グローバルバランスファンド(機動的資産配分型)	88,887,349円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2020	6,444,037円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2025	13,236,159円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2030	12,902,943円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2035	20,008,717円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2040	11,014,352円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2045	24,579,485円
国内株式指数ファンド(T O P I X)	1,473,520,942円
三井住友・DC日本株式インデックスファンドS	657,013,950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)	21,230,364,361円
バランスファンドVA(安定運用型)<適格機関投資家限定>	257,931,324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>	27,959,022,858円
S M A M ・ バランスファンドVA25<適格機関投資家専用>	9,178,823,798円
S M A M ・ バランスファンドVA37.5<適格機関投資家専用>	4,124,609,025円
S M A M ・ バランスファンドVA50<適格機関投資家専用>	15,704,187,582円
S M A M ・ バランスファンドVL30<適格機関投資家限定>	86,404,685円
S M A M ・ バランスファンドVL50<適格機関投資家限定>	362,793,124円
世界6資産バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	36,137,871円
S M A M ・ バランスファンドVA75<適格機関投資家専用>	1,730,112,656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>	86,914,341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>	569,450,705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>	1,776,734,844円
S M A M ・ バランスファンドVA40<適格機関投資家専用>	3,079,414,930円
S M A M ・ バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>	5,486,370,606円
S M A M ・ バランスVA株40T<適格機関投資家限定>	208,693,845円
三井住友・5資産バランスファンド・VAS(適格機関投資家専用)	4,265,385,668円
S M A M ・ グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	109,807,951円
S M A M ・ バランスファンドVA20<適格機関投資家専用>	199,145,930円
三井住友・7資産バランスファンド・VAS(適格機関投資家専用)	3,546,691,199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>	156,513,366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>	80,901,550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>	35,922,212円

SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>	371,101,767円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	647,766,670円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T<適格機関投資家専用>	260,921,413円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A2<適格機関投資家専用>	177,772,117円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A2<適格機関投資家専用>	91,382,372円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A2<適格機関投資家専用>	12,893,608円
SMAM・アセットバランスファンドVA30L2<適格機関投資家専用>	133,810,834円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L2<適格機関投資家専用>	1,560,572,845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）	291,893,914円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T2<適格機関投資家専用>	39,049,444円
SMAM・FG新興国重視型バランス20VA<適格機関投資家限定>	402,843円
SMAM・FGグローバルバランス25VA<適格機関投資家限定>	3,054,653円
SMAM・グローバル・マルチアセット・グロース・ファンド（安定成長型）<適格機関投資家限定>	1,289,945円
合計	119,948,691,565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	55,000	279.00	15,345,000	
日本水産	160,600	363.00	58,297,800	
マルハニチロ	25,800	1,683.00	43,421,400	
サカタのタネ	20,700	2,098.00	43,428,600	
ホクト	14,300	2,135.00	30,530,500	
住石ホールディングス	42,000	121.00	5,082,000	
日鉄鉱業	35,000	458.00	16,030,000	
三井松島産業	88,000	130.00	11,440,000	
国際石油開発帝石	688,800	1,403.00	966,386,400	
日本海洋掘削	4,100	4,030.00	16,523,000	
石油資源開発	18,400	4,370.00	80,408,000	
K&Oエナジーグループ	8,900	1,500.00	13,350,000	
ショーボンドホールディングス	12,400	5,390.00	66,836,000	
ミライト・ホールディングス	39,800	1,394.00	55,481,200	
タマホーム	12,000	575.00	6,900,000	
安藤・間	86,700	655.00	56,788,500	

東急建設	46,700	705.00	32,923,500
コムシスホールディングス	58,400	1,605.00	93,732,000
ミサワホーム	15,500	1,053.00	16,321,500
高松コンストラクショングループ	9,700	2,700.00	26,190,000
東建コーポレーション	4,700	6,200.00	29,140,000
ヤマウラ	9,400	421.00	3,957,400
大成建設	677,000	671.00	454,267,000
大林組	391,000	815.00	318,665,000
清水建設	399,000	831.00	331,569,000
長谷工コーポレーション	164,000	1,224.00	200,736,000
松井建設	16,000	694.00	11,104,000
銭高組	22,000	363.00	7,986,000
鹿島建設	574,000	556.00	319,144,000
不動テトラ	97,300	231.00	22,476,300
鉄建建設	80,000	408.00	32,640,000
日鉄住金テックスエンジニア	26,000	556.00	14,456,000
西松建設	142,000	414.00	58,788,000
三井住友建設	532,300	163.00	86,764,900
大豊建設	36,000	631.00	22,716,000
前田建設工業	87,000	843.00	73,341,000
佐田建設	55,000	137.00	7,535,000
ナカノフドー建設	13,800	413.00	5,699,400
奥村組	125,000	579.00	72,375,000
大和小田急建設	8,300	1,060.00	8,798,000
東鉄工業	15,500	2,662.00	41,261,000
イチケン	18,000	311.00	5,598,000
戸田建設	165,000	529.00	87,285,000
熊谷組	164,000	368.00	60,352,000
青木あすなろ建設	9,600	873.00	8,380,800
北野建設	33,000	340.00	11,220,000
植木組	23,000	252.00	5,796,000
三井ホーム	18,000	517.00	9,306,000
矢作建設工業	17,700	784.00	13,876,800
ピーエス三菱	16,600	414.00	6,872,400
東日本ハウス	18,500	582.00	10,767,000
大東建託	49,700	14,040.00	697,788,000

新日本建設	18,600	470.00	8,742,000	
N I P P O	30,000	1,919.00	57,570,000	
東亜道路工業	27,000	404.00	10,908,000	
前田道路	41,000	1,945.00	79,745,000	
日本道路	38,000	589.00	22,382,000	
東亜建設工業	98,000	200.00	19,600,000	
若築建設	82,000	181.00	14,842,000	
東洋建設	36,700	464.00	17,028,800	
五洋建設	145,300	458.00	66,547,400	
大林道路	17,000	650.00	11,050,000	
世紀東急工業	21,400	540.00	11,556,000	
福田組	21,000	761.00	15,981,000	
住友林業	96,200	1,360.00	130,832,000	
日本基礎技術	18,200	444.00	8,080,800	
日成ビルド工業	39,000	298.00	11,622,000	
ヤマダ・エスパイエルホーム	71,000	96.00	6,816,000	
巴コーポレーション	19,900	439.00	8,736,100	
パナホーム	47,000	879.00	41,313,000	
大和ハウス工業	382,300	2,683.50	1,025,902,050	
ライト工業	21,200	956.00	20,267,200	
積水ハウス	406,200	1,844.00	749,032,800	
日特建設	20,300	523.00	10,616,900	
ユアテック	21,000	876.00	18,396,000	
西部電気工業	15,000	454.00	6,810,000	
四電工	14,000	466.00	6,524,000	
中電工	18,600	2,411.00	44,844,600	
関電工	59,000	684.00	40,356,000	
きんでん	87,000	1,579.00	137,373,000	
東京エネシス	16,000	1,050.00	16,800,000	
トーエネック	20,000	589.00	11,780,000	
住友電設	11,000	1,396.00	15,356,000	
日本電設工業	21,000	1,783.00	37,443,000	
協和エクシオ	55,600	1,366.00	75,949,600	
新日本空調	12,700	1,007.00	12,788,900	
N D S	27,000	303.00	8,181,000	
九電工	24,000	1,327.00	31,848,000	

三機工業	26,500	937.00	24,830,500	
日揮	132,000	2,425.50	320,166,000	
中外炉工業	46,000	277.00	12,742,000	
ヤマト	16,000	431.00	6,896,000	
太平電業	19,000	952.00	18,088,000	
高砂熱学工業	36,200	1,524.00	55,168,800	
朝日工業社	18,000	441.00	7,938,000	
明星工業	24,400	660.00	16,104,000	
大気社	18,900	3,105.00	58,684,500	
ダイダン	19,000	865.00	16,435,000	
日比谷総合設備	17,000	1,590.00	27,030,000	
東芝プラントシステム	21,200	1,673.00	35,467,600	
OSJBホールディングス	22,400	249.00	5,577,600	
東洋エンジニアリング	61,000	313.00	19,093,000	
千代田化工建設	95,000	1,030.00	97,850,000	
新興プランテック	26,900	901.00	24,236,900	
日本製粉	76,000	594.00	45,144,000	
日清製粉グループ本社	143,000	1,493.00	213,499,000	
日東富士製粉	18,000	338.00	6,084,000	
昭和産業	52,000	483.00	25,116,000	
鳥越製粉	14,600	719.00	10,497,400	
中部飼料	14,700	661.00	9,716,700	
フィード・ワンホールディングス	94,800	115.00	10,902,000	
日本甜菜製糖	73,000	196.00	14,308,000	
三井製糖	51,000	433.00	22,083,000	
森永製菓	119,000	440.00	52,360,000	
中村屋	30,000	499.00	14,970,000	
江崎グリコ	30,300	5,760.00	174,528,000	
名糖産業	8,500	1,200.00	10,200,000	
不二家	88,000	198.00	17,424,000	
山崎製パン	96,000	2,218.00	212,928,000	
モロゾフ	31,000	379.00	11,749,000	
亀田製菓	7,300	4,960.00	36,208,000	
寿スピリッツ	3,900	2,753.00	10,736,700	
カルビー	48,400	5,420.00	262,328,000	
森永乳業	119,000	463.00	55,097,000	

ヤクルト本社	70,100	8,690.00	609,169,000	
明治ホールディングス	38,700	15,350.00	594,045,000	
雪印メグミルク	30,900	1,465.00	45,268,500	
プリマハム	73,000	360.00	26,280,000	
日本ハム	96,000	2,856.00	274,176,000	
伊藤ハム	71,000	697.00	49,487,000	
林兼産業	53,000	101.00	5,353,000	
丸大食品	66,000	416.00	27,456,000	
米久	4,900	1,829.00	8,962,100	
S Foods	8,400	2,267.00	19,042,800	
サッポロホールディングス	215,000	486.00	104,490,000	
アサヒグループホールディングス	263,000	4,115.00	1,082,245,000	
キリンホールディングス	530,000	1,619.50	858,335,000	
宝ホールディングス	103,500	961.00	99,463,500	
オエノンホールディングス	42,000	224.00	9,408,000	
養命酒製造	10,000	990.00	9,900,000	
コカ・コーラウエスト	44,100	2,087.00	92,036,700	
コカ・コーライーストジャパン	39,900	2,536.00	101,186,400	
サントリー食品インターナショナル	78,300	5,250.00	411,075,000	
ダイドードリンコ	6,500	4,965.00	32,272,500	
伊藤園	39,000	2,667.00	104,013,000	
キーコーヒー	11,000	1,808.00	19,888,000	
日清オイリオグループ	60,000	442.00	26,520,000	
不二製油	35,200	1,889.00	66,492,800	
J - オイルミルズ	54,000	403.00	21,762,000	
キッコーマン	107,000	4,025.00	430,675,000	
味の素	302,000	2,720.00	821,440,000	
キュービー	66,500	3,400.00	226,100,000	
ハウス食品グループ本社	48,300	2,632.00	127,125,600	
カゴメ	50,500	1,869.00	94,384,500	
焼津水産化学工業	9,200	1,010.00	9,292,000	
アリアケジャパン	11,900	4,345.00	51,705,500	
ニチレイ	140,000	646.00	90,440,000	
東洋水産	68,300	4,185.00	285,835,500	
日清食品ホールディングス	55,200	5,840.00	322,368,000	
永谷園	15,000	1,141.00	17,115,000	

フジッコ	13,000	2,005.00	26,065,000	
ロック・フィールド	6,500	2,601.00	16,906,500	
日本たばこ産業	724,800	4,089.00	2,963,707,200	
ケンコーマヨネーズ	5,500	1,679.00	9,234,500	
わらべや日洋	7,600	2,671.00	20,299,600	
なとり	7,700	1,502.00	11,565,400	
ユーグレナ	28,700	1,996.00	57,285,200	
ミヨシ油脂	56,000	145.00	8,120,000	
理研ビタミン	3,400	4,055.00	13,787,000	
片倉工業	15,900	1,282.00	20,383,800	
ゲンゼ	96,000	318.00	30,528,000	
東洋紡	488,000	165.00	80,520,000	
ユニチカ	367,000	58.00	21,286,000	
富士紡ホールディングス	62,000	301.00	18,662,000	
日清紡ホールディングス	79,000	1,183.00	93,457,000	
倉敷紡績	124,000	212.00	26,288,000	
シキボウ	84,000	122.00	10,248,000	
日本毛織	38,000	868.00	32,984,000	
ガイドーリミテッド	20,400	507.00	10,342,800	
帝国繊維	13,300	1,741.00	23,155,300	
帝人	501,000	428.00	214,428,000	
東レ	948,000	1,003.00	950,844,000	
サカイオーベックス	39,000	202.00	7,878,000	
住江織物	36,000	322.00	11,592,000	
イチカワ	18,000	301.00	5,418,000	
日本バイリーン	20,000	593.00	11,860,000	
芦森工業	34,000	165.00	5,610,000	
アツギ	115,000	123.00	14,145,000	
ダイニック	35,000	184.00	6,440,000	
セーレン	30,700	1,075.00	33,002,500	
小松精練	23,800	561.00	13,351,800	
ワコールホールディングス	74,000	1,337.00	98,938,000	
ホギメディカル	7,600	6,100.00	46,360,000	
T S Iホールディングス	55,500	828.00	45,954,000	
三陽商会	66,000	302.00	19,932,000	
オンワードホールディングス	90,000	806.00	72,540,000	

ルック	26,000	229.00	5,954,000	
ゴールドウイン	29,000	831.00	24,099,000	
デサント	27,900	1,606.00	44,807,400	
特種東海製紙	73,000	271.00	19,783,000	
王子ホールディングス	498,000	517.00	257,466,000	
日本製紙	57,400	1,910.00	109,634,000	
三菱製紙	192,000	90.00	17,280,000	
北越紀州製紙	77,200	626.00	48,327,200	
中越パルプ工業	49,000	244.00	11,956,000	
巴川製紙所	23,000	253.00	5,819,000	
大王製紙	54,000	1,088.00	58,752,000	
レンゴー	108,000	499.00	53,892,000	
トーモク	43,000	280.00	12,040,000	
ザ・パック	8,600	2,596.00	22,325,600	
クラレ	207,500	1,660.00	344,450,000	
旭化成	762,000	1,147.00	874,014,000	
共和レザー	9,200	793.00	7,295,600	
昭和電工	812,000	151.00	122,612,000	
住友化学	898,000	647.00	581,006,000	
住友精化	25,000	897.00	22,425,000	
日産化学工業	80,200	2,433.00	195,126,600	
ラサ工業	51,000	141.00	7,191,000	
クレハ	85,000	521.00	44,285,000	
テイカ	23,000	430.00	9,890,000	
石原産業	200,000	119.00	23,800,000	
片倉チッカリン	11,000	292.00	3,212,000	
日本曹達	78,000	765.00	59,670,000	
東ソー	305,000	648.00	197,640,000	
トクヤマ	192,000	283.00	54,336,000	
セントラル硝子	125,000	569.00	71,125,000	
東亜合成	153,000	549.00	83,997,000	
ダイソー	48,000	421.00	20,208,000	
関東電化工業	30,000	804.00	24,120,000	
電気化学工業	253,000	501.00	126,753,000	
信越化学工業	219,100	7,746.00	1,697,148,600	
日本カーバイド工業	46,000	232.00	10,672,000	

堺化学工業	49,000	398.00	19,502,000	
エア・ウォーター	108,000	2,160.00	233,280,000	
大陽日酸	157,000	1,620.00	254,340,000	
日本化学工業	49,000	266.00	13,034,000	
日本パーカライジング	57,400	1,445.00	82,943,000	
高压ガス工業	19,000	628.00	11,932,000	
チタン工業	18,000	239.00	4,302,000	
四国化成工業	18,000	1,006.00	18,108,000	
戸田工業	27,000	415.00	11,205,000	
ステラ ケミファ	6,900	1,345.00	9,280,500	
保土谷化学工業	42,000	204.00	8,568,000	
日本触媒	96,000	1,715.00	164,640,000	
大日精化工業	49,000	624.00	30,576,000	
カネカ	164,000	849.00	139,236,000	
三菱瓦斯化学	210,000	583.00	122,430,000	
三井化学	555,000	391.00	217,005,000	
J S R	120,800	2,195.00	265,156,000	
東京応化工業	25,500	3,850.00	98,175,000	
三菱ケミカルホールディングス	763,500	718.00	548,193,000	
日本合成化学工業	29,000	848.00	24,592,000	
ダイセル	171,800	1,416.00	243,268,800	
住友ベークライト	114,000	531.00	60,534,000	
積水化学工業	282,000	1,669.00	470,658,000	
日本ゼオン	105,000	1,139.00	119,595,000	
アイカ工業	36,800	2,748.00	101,126,400	
宇部興産	613,000	190.00	116,470,000	
積水樹脂	18,700	1,658.00	31,004,600	
タキロン	28,000	547.00	15,316,000	
旭有機材工業	48,000	270.00	12,960,000	
日立化成	60,400	2,527.00	152,630,800	
ニチバン	15,000	456.00	6,840,000	
リケンテクノス	22,000	439.00	9,658,000	
大倉工業	33,000	367.00	12,111,000	
積水化成品工業	37,000	470.00	17,390,000	
群栄化学工業	36,000	341.00	12,276,000	
タイガースポリマー	7,400	821.00	6,075,400	

ミライアル	4,900	1,495.00	7,325,500
ダイキョーニシカワ	3,200	3,635.00	11,632,000
日本化薬	79,000	1,506.00	118,974,000
カーリットホールディングス	11,400	634.00	7,227,600
日本精化	10,700	933.00	9,983,100
A D E K A	56,400	1,603.00	90,409,200
日油	102,000	922.00	94,044,000
新日本理化	22,800	224.00	5,107,200
ハリマ化成グループ	12,200	480.00	5,856,000
花王	328,700	6,122.00	2,012,301,400
第一工業製薬	30,000	385.00	11,550,000
三洋化成工業	38,000	958.00	36,404,000
大日本塗料	79,000	157.00	12,403,000
日本ペイントホールディングス	105,800	4,230.00	447,534,000
関西ペイント	148,000	2,229.00	329,892,000
中国塗料	35,000	1,094.00	38,290,000
日本特殊塗料	10,900	805.00	8,774,500
藤倉化成	17,300	562.00	9,722,600
太陽ホールディングス	9,900	4,285.00	42,421,500
D I C	489,000	372.00	181,908,000
サカタインクス	25,000	1,088.00	27,200,000
東洋インキ S C ホールディングス	118,000	548.00	64,664,000
T & K T O K A	4,300	2,474.00	10,638,200
富士フイルムホールディングス	279,600	4,620.50	1,291,891,800
資生堂	217,900	2,398.50	522,633,150
ライオン	141,000	760.00	107,160,000
高砂香料工業	40,000	535.00	21,400,000
マンダム	12,200	4,890.00	59,658,000
ミルボン	7,100	3,940.00	27,974,000
ファンケル	28,500	1,565.00	44,602,500
コーセー	19,800	7,470.00	147,906,000
ドクターシーラボ	8,200	4,495.00	36,859,000
ポーラ・オルビスホールディングス	14,600	7,030.00	102,638,000
ノエビアホールディングス	7,400	2,727.00	20,179,800
エステー	9,400	1,041.00	9,785,400
アグロ カネショウ	4,700	865.00	4,065,500

コニシ	9,400	2,076.00	19,514,400	
長谷川香料	15,300	1,733.00	26,514,900	
星光PMC	7,900	1,020.00	8,058,000	
小林製薬	20,000	8,770.00	175,400,000	
荒川化学工業	11,100	1,286.00	14,274,600	
メック	10,800	818.00	8,834,400	
日本高純度化学	3,600	2,497.00	8,989,200	
JCU	3,400	5,210.00	17,714,000	
新田ゼラチン	8,600	837.00	7,198,200	
アース製薬	8,500	4,285.00	36,422,500	
イハラケミカル工業	19,000	1,842.00	34,998,000	
北興化学工業	15,000	433.00	6,495,000	
大成ラミック	3,700	2,775.00	10,267,500	
クミアイ化学工業	25,300	1,023.00	25,881,900	
日本農薬	28,100	1,222.00	34,338,200	
アキレス	103,000	150.00	15,450,000	
有沢製作所	20,900	997.00	20,837,300	
日東電工	94,500	7,971.00	753,259,500	
レック	4,500	1,476.00	6,642,000	
きもと	25,900	293.00	7,588,700	
藤森工業	10,500	3,775.00	39,637,500	
前澤化成工業	9,200	1,242.00	11,426,400	
JSP	9,200	2,279.00	20,966,800	
エフピコ	10,800	4,585.00	49,518,000	
天馬	9,200	1,952.00	17,958,400	
信越ポリマー	25,500	624.00	15,912,000	
東リ	35,000	276.00	9,660,000	
ニフコ	27,400	4,445.00	121,793,000	
日本バルカー工業	52,000	311.00	16,172,000	
ユニ・チャーム	247,700	3,155.50	781,617,350	
協和発酵キリン	146,000	1,741.00	254,186,000	
武田薬品工業	458,100	6,079.00	2,784,789,900	
アステラス製薬	1,392,300	1,939.50	2,700,365,850	
大日本住友製薬	86,700	1,447.00	125,454,900	
塩野義製薬	190,700	4,275.00	815,242,500	
田辺三菱製薬	141,700	2,036.00	288,501,200	

わかもと製薬	20,000	314.00	6,280,000	
あすか製薬	15,000	1,236.00	18,540,000	
日本新薬	28,000	4,340.00	121,520,000	
中外製薬	121,600	3,935.00	478,496,000	
科研製薬	42,000	4,635.00	194,670,000	
エーザイ	161,300	8,330.00	1,343,629,000	
ロート製薬	55,800	1,715.00	95,697,000	
小野薬品工業	55,500	13,070.00	725,385,000	
久光製薬	34,300	5,120.00	175,616,000	
有機合成薬品工業	16,000	277.00	4,432,000	
持田製薬	8,800	8,050.00	70,840,000	
参天製薬	224,500	1,715.00	385,017,500	
扶桑薬品工業	47,000	312.00	14,664,000	
日本ケミファ	18,000	598.00	10,764,000	
ツムラ	38,700	2,900.00	112,230,000	
日医工	28,900	2,901.00	83,838,900	
キッセイ薬品工業	22,800	3,850.00	87,780,000	
生化学工業	23,500	2,130.00	50,055,000	
栄研化学	10,700	2,343.00	25,070,100	
鳥居薬品	8,200	3,365.00	27,593,000	
JCRファーマ	9,400	2,725.00	25,615,000	
東和薬品	6,300	6,810.00	42,903,000	
富士製薬工業	4,100	2,237.00	9,171,700	
沢井製薬	19,400	6,970.00	135,218,000	
ゼリア新薬工業	25,100	1,951.00	48,970,100	
第一三共	411,000	1,938.50	796,723,500	
キョーリン製薬ホールディングス	32,600	2,868.00	93,496,800	
大幸薬品	6,000	1,912.00	11,472,000	
ダイト	6,050	2,363.00	14,296,150	
大塚ホールディングス	242,500	3,833.50	929,623,750	
大正製薬ホールディングス	29,300	8,740.00	256,082,000	
日本コークス工業	120,200	116.00	13,943,200	
昭和シェル石油	109,600	1,069.00	117,162,400	
コスモ石油	340,000	175.00	59,500,000	
ニチレキ	15,000	1,059.00	15,885,000	
東燃ゼネラル石油	183,000	1,100.00	201,300,000	

ユシロ化学工業	7,000	1,609.00	11,263,000	
ビーピー・カストロール	5,300	1,371.00	7,266,300	
富士石油	30,000	402.00	12,060,000	
MORESCO	3,500	2,096.00	7,336,000	
出光興産	57,300	2,211.00	126,690,300	
JXホールディングス	1,354,700	487.40	660,280,780	
横浜ゴム	136,000	1,275.00	173,400,000	
東洋ゴム工業	55,500	2,347.00	130,258,500	
ブリヂストン	382,800	5,028.00	1,924,718,400	
住友ゴム工業	95,000	2,216.00	210,520,000	
藤倉ゴム工業	12,200	745.00	9,089,000	
オカモト	42,000	473.00	19,866,000	
フコク	6,500	1,161.00	7,546,500	
ニッタ	12,100	3,290.00	39,809,000	
住友理工	22,100	1,134.00	25,061,400	
三ツ星ベルト	29,000	950.00	27,550,000	
バンドー化学	45,000	476.00	21,420,000	
日東紡績	90,000	465.00	41,850,000	
旭硝子	600,000	788.00	472,800,000	
日本板硝子	594,000	124.00	73,656,000	
石塚硝子	20,000	236.00	4,720,000	
日本山村硝子	56,000	173.00	9,688,000	
日本電気硝子	235,000	665.00	156,275,000	
住友大阪セメント	228,000	394.00	89,832,000	
太平洋セメント	762,000	369.00	281,178,000	
デイ・シイ	14,900	452.00	6,734,800	
日本ヒューム	14,500	879.00	12,745,500	
日本コンクリート工業	23,300	476.00	11,090,800	
三谷セキサン	6,700	1,798.00	12,046,600	
ジャパンパイル	17,900	679.00	12,154,100	
東海カーボン	105,000	346.00	36,330,000	
日本カーボン	66,000	432.00	28,512,000	
東洋炭素	7,200	2,358.00	16,977,600	
ノリタケカンパニーリミテド	68,000	285.00	19,380,000	
TOTO	180,000	1,687.00	303,660,000	
日本碍子	154,000	2,631.00	405,174,000	

日本特殊陶業	105,300	3,155.00	332,221,500	
MARUWA	4,000	2,910.00	11,640,000	
品川リフラクトリーズ	35,000	303.00	10,605,000	
黒崎播磨	31,000	262.00	8,122,000	
ニッカトー	11,600	403.00	4,674,800	
フジミインコーポレーテッド	12,100	2,195.00	26,559,500	
ニチアス	53,000	700.00	37,100,000	
ニチハ	16,500	1,384.00	22,836,000	
新日鐵住金	5,166,000	305.00	1,575,630,000	
神戸製鋼所	2,107,000	230.00	484,610,000	
中山製鋼所	103,000	95.00	9,785,000	
合同製鐵	66,000	176.00	11,616,000	
ジェイ エフ イー ホールディングス	311,500	2,708.00	843,542,000	
日新製鋼	51,900	1,640.00	85,116,000	
東京製鐵	62,300	825.00	51,397,500	
共英製鋼	13,000	2,005.00	26,065,000	
大和工業	27,700	2,971.00	82,296,700	
東京鐵鋼	25,000	501.00	12,525,000	
大阪製鐵	7,600	2,145.00	16,302,000	
淀川製鋼所	87,000	480.00	41,760,000	
東洋鋼鈹	29,100	543.00	15,801,300	
丸一鋼管	37,200	2,849.00	105,982,800	
モリ工業	23,000	421.00	9,683,000	
大同特殊鋼	205,000	531.00	108,855,000	
日本高周波鋼業	60,000	114.00	6,840,000	
日本冶金工業	96,300	244.00	23,497,200	
山陽特殊製鋼	72,000	542.00	39,024,000	
愛知製鋼	71,000	594.00	42,174,000	
日立金属	124,000	1,792.00	222,208,000	
大平洋金属	78,000	330.00	25,740,000	
新日本電工	73,700	291.00	21,446,700	
栗本鐵工所	66,000	236.00	15,576,000	
虹技	22,000	216.00	4,752,000	
三菱製鋼	77,000	270.00	20,790,000	
日亜鋼業	21,000	336.00	7,056,000	
日本精線	11,000	632.00	6,952,000	

シンニッタン	14,800	588.00	8,702,400
新家工業	30,000	188.00	5,640,000
大紀アルミニウム工業所	25,000	342.00	8,550,000
日本軽金属ホールディングス	297,400	184.00	54,721,600
三井金属鉱業	335,000	264.00	88,440,000
東邦亜鉛	70,000	416.00	29,120,000
三菱マテリアル	765,000	403.00	308,295,000
住友金属鉱山	338,000	1,690.00	571,220,000
D O W Aホールディングス	147,000	1,027.00	150,969,000
古河機械金属	190,000	211.00	40,090,000
大阪チタニウムテクノロジーズ	12,400	2,804.00	34,769,600
東邦チタニウム	22,400	1,088.00	24,371,200
U A C J	139,000	346.00	48,094,000
古河電気工業	359,000	206.00	73,954,000
住友電気工業	460,400	1,618.50	745,157,400
フジクラ	171,000	557.00	95,247,000
昭和電線ホールディングス	147,000	92.00	13,524,000
タツタ電線	25,100	531.00	13,328,100
沖電線	17,000	326.00	5,542,000
リョービ	68,000	370.00	25,160,000
アーレスティ	12,000	822.00	9,864,000
アサヒホールディングス	18,300	2,180.00	39,894,000
稲葉製作所	5,800	1,398.00	8,108,400
宮地エンジニアリンググループ	40,000	197.00	7,880,000
トーカロ	7,800	2,417.00	18,852,600
アルファC o	5,000	1,316.00	6,580,000
S U M C O	84,400	2,085.00	175,974,000
川田テクノロジーズ	2,600	3,700.00	9,620,000
東洋製罐グループホールディングス	86,300	1,816.00	156,720,800
ホッカンホールディングス	31,000	283.00	8,773,000
コロナ	6,900	1,158.00	7,990,200
横河ブリッジホールディングス	23,100	1,269.00	29,313,900
駒井ハルテック	26,000	261.00	6,786,000
三和ホールディングス	115,100	907.00	104,395,700
文化シャッター	34,000	1,156.00	39,304,000
三協立山	15,600	2,143.00	33,430,800

アルインコ	6,300	1,135.00	7,150,500	
LIXILグループ	181,300	2,732.00	495,311,600	
日本フィルコン	11,400	517.00	5,893,800	
ノーリツ	24,100	1,960.00	47,236,000	
長府製作所	12,700	2,943.00	37,376,100	
リンナイ	22,700	8,930.00	202,711,000	
ダイニチ工業	8,200	783.00	6,420,600	
日東精工	21,000	376.00	7,896,000	
三洋工業	21,000	217.00	4,557,000	
岡部	24,300	1,091.00	26,511,300	
ジーテクト	8,700	1,160.00	10,092,000	
東プレ	23,300	1,882.00	43,850,600	
高周波熱錬	21,000	905.00	19,005,000	
東京製綱	87,000	185.00	16,095,000	
パイオラックス	6,100	5,350.00	32,635,000	
日本発條	106,100	1,291.00	136,975,100	
中央発條	18,000	340.00	6,120,000	
アドバネクス	29,000	184.00	5,336,000	
三益半導体工業	9,700	1,441.00	13,977,700	
日本製鋼所	176,000	523.00	92,048,000	
三浦工業	54,900	1,347.00	73,950,300	
タクマ	39,000	926.00	36,114,000	
ツガミ	36,000	752.00	27,072,000	
オークマ	80,000	1,159.00	92,720,000	
東芝機械	66,000	529.00	34,914,000	
アマダホールディングス	181,800	1,204.00	218,887,200	
アイダエンジニアリング	26,600	1,437.00	38,224,200	
滝澤鉄工所	41,000	232.00	9,512,000	
富士機械製造	40,000	1,460.00	58,400,000	
牧野フライス製作所	61,000	1,037.00	63,257,000	
オーエスジー	55,800	2,577.00	143,796,600	
ダイジェット工業	18,000	223.00	4,014,000	
旭ダイヤモンド工業	33,400	1,443.00	48,196,200	
D M G 森精機	77,400	1,975.00	152,865,000	
ディスコ	14,300	12,710.00	181,753,000	
日東工器	7,500	2,303.00	17,272,500	

パンチ工業	3,700	1,316.00	4,869,200	
豊和工業	7,300	745.00	5,438,500	
大阪機工	53,000	161.00	8,533,000	
津田駒工業	36,000	153.00	5,508,000	
島精機製作所	17,200	2,082.00	35,810,400	
日阪製作所	15,700	1,134.00	17,803,800	
やまびこ	4,800	5,580.00	26,784,000	
ペガサスマシン製造	12,700	613.00	7,785,100	
ナブテスコ	74,400	3,400.00	252,960,000	
三井海洋開発	12,200	1,940.00	23,668,000	
レオン自動機	12,000	478.00	5,736,000	
S M C	36,600	37,125.00	1,358,775,000	
新川	10,700	831.00	8,891,700	
ホソカワミクロン	22,000	621.00	13,662,000	
ユニオンツール	5,900	3,870.00	22,833,000	
オイレス工業	15,200	2,271.00	34,519,200	
日精エー・エス・ビー機械	4,300	2,364.00	10,165,200	
サトーホールディングス	15,200	2,889.00	43,912,800	
日精樹脂工業	9,600	1,278.00	12,268,800	
小松製作所	605,700	2,530.50	1,532,723,850	
住友重機械工業	334,000	827.00	276,218,000	
日立建機	54,500	2,198.00	119,791,000	
日工	19,000	453.00	8,607,000	
巴工業	5,300	1,803.00	9,555,900	
井関農機	124,000	233.00	28,892,000	
T O W A	9,000	715.00	6,435,000	
丸山製作所	33,000	228.00	7,524,000	
北川鉄工所	60,000	250.00	15,000,000	
クボタ	589,000	1,938.00	1,141,482,000	
三菱化工機	41,000	419.00	17,179,000	
月島機械	21,100	1,242.00	26,206,200	
帝国電機製作所	9,300	1,119.00	10,406,700	
新東工業	27,900	974.00	27,174,600	
澁谷工業	10,400	2,382.00	24,772,800	
アイチ コーポレーション	18,900	616.00	11,642,400	
小森コーポレーション	29,800	1,526.00	45,474,800	

鶴見製作所	9,400	1,752.00	16,468,800	
住友精密工業	22,000	462.00	10,164,000	
酒井重工業	28,000	290.00	8,120,000	
荏原製作所	254,000	518.00	131,572,000	
石井鐵工所	21,000	220.00	4,620,000	
西島製作所	13,100	912.00	11,947,200	
北越工業	10,200	963.00	9,822,600	
ダイキン工業	170,000	8,050.00	1,368,500,000	
オルガノ	25,000	528.00	13,200,000	
トーヨーカネツ	70,000	224.00	15,680,000	
栗田工業	69,000	3,080.00	212,520,000	
椿本チエイン	62,000	1,009.00	62,558,000	
大同工業	28,000	262.00	7,336,000	
日本コンベヤ	42,000	206.00	8,652,000	
木村化工機	13,500	541.00	7,303,500	
アネスト岩田	19,800	792.00	15,681,600	
ダイフク	57,400	1,659.00	95,226,600	
加藤製作所	26,000	789.00	20,514,000	
油研工業	26,000	258.00	6,708,000	
タダノ	57,000	1,596.00	90,972,000	
フジテック	33,900	1,250.00	42,375,000	
C K D	32,600	1,096.00	35,729,600	
キトー	13,700	1,167.00	15,987,900	
平和	25,000	2,392.00	59,800,000	
理想科学工業	14,100	2,002.00	28,228,200	
SANKYO	35,300	4,485.00	158,320,500	
日本金銭機械	10,900	1,755.00	19,129,500	
マースエンジニアリング	7,000	2,120.00	14,840,000	
福島工業	6,800	1,873.00	12,736,400	
ダイコク電機	5,300	1,719.00	9,110,700	
アマノ	38,300	1,504.00	57,603,200	
JUKI	88,000	368.00	32,384,000	
サンデンホールディングス	71,000	540.00	38,340,000	
蛇の目マシン工業	120,000	135.00	16,200,000	
マックス	18,000	1,380.00	24,840,000	
グローリー	37,400	3,275.00	122,485,000	

新晃工業	9,000	1,224.00	11,016,000	
大和冷機工業	17,900	800.00	14,320,000	
セガサミーホールディングス	125,200	1,832.00	229,366,400	
日本ピストンリング	49,000	244.00	11,956,000	
リケン	49,000	465.00	22,785,000	
T P R	13,000	3,195.00	41,535,000	
ホシザキ電機	25,500	8,000.00	204,000,000	
大豊工業	10,000	1,451.00	14,510,000	
日本精工	239,000	1,803.00	430,917,000	
N T N	270,000	638.00	172,260,000	
ジェイテクト	124,000	1,814.00	224,936,000	
不二越	109,000	693.00	75,537,000	
日本トムソン	40,000	670.00	26,800,000	
T H K	77,600	3,175.00	246,380,000	
ユーシン精機	5,700	2,450.00	13,965,000	
前澤給装工業	5,000	1,500.00	7,500,000	
イーグル工業	16,000	2,504.00	40,064,000	
日本ピラー工業	13,900	1,042.00	14,483,800	
キッツ	52,700	592.00	31,198,400	
日立工機	30,000	980.00	29,400,000	
マキタ	76,100	6,290.00	478,669,000	
日立造船	92,300	619.00	57,133,700	
三菱重工業	1,955,000	659.90	1,290,104,500	
I H I	840,000	538.00	451,920,000	
イビデン	76,700	2,037.00	156,237,900	
コニカミノルタ	277,800	1,329.00	369,196,200	
ブラザー工業	150,700	1,935.00	291,604,500	
ミネベア	174,000	1,815.00	315,810,000	
日立製作所	2,801,000	810.40	2,269,930,400	
東芝	2,456,000	484.80	1,190,668,800	
三菱電機	1,167,000	1,509.50	1,761,586,500	
富士電機	324,000	572.00	185,328,000	
東洋電機製造	27,000	437.00	11,799,000	
安川電機	138,900	1,804.00	250,575,600	
シンフォニアテクノロジー	83,000	208.00	17,264,000	
明電舎	110,000	390.00	42,900,000	

オリジン電気	20,000	505.00	10,100,000	
山洋電気	26,000	893.00	23,218,000	
デンヨー	10,100	1,872.00	18,907,200	
東芝テック	84,000	725.00	60,900,000	
芝浦メカトロニクス	23,000	294.00	6,762,000	
マブチモーター	35,700	6,680.00	238,476,000	
日本電産	126,300	8,111.00	1,024,419,300	
東光高岳	6,400	1,571.00	10,054,400	
ダイヘン	65,000	588.00	38,220,000	
JVCケンウッド	86,500	394.00	34,081,000	
第一精工	4,600	2,430.00	11,178,000	
日新電機	28,000	800.00	22,400,000	
大崎電気工業	20,000	792.00	15,840,000	
オムロン	126,000	5,490.00	691,740,000	
日東工業	18,600	2,230.00	41,478,000	
I D E C	15,600	1,089.00	16,988,400	
ジーエス・ユアサ コーポレーション	226,000	553.00	124,978,000	
サクサホールディングス	33,000	226.00	7,458,000	
メルコホールディングス	6,800	2,241.00	15,238,800	
日本電気	1,509,000	384.00	579,456,000	
富士通	1,126,000	835.70	940,998,200	
沖電気工業	406,000	248.00	100,688,000	
岩崎通信機	64,000	96.00	6,144,000	
電気興業	34,000	563.00	19,142,000	
サンケン電気	59,000	842.00	49,678,000	
アイホン	7,500	1,944.00	14,580,000	
ルネサスエレクトロニクス	60,800	898.00	54,598,400	
セイコーエプソン	159,200	2,190.00	348,648,000	
ワコム	93,300	605.00	56,446,500	
アルバック	19,800	1,856.00	36,748,800	
アクセル	6,200	1,570.00	9,734,000	
E I Z O	10,700	2,659.00	28,451,300	
ジャパンディスプレイ	180,600	490.00	88,494,000	
日本信号	31,900	1,151.00	36,716,900	
京三製作所	31,000	394.00	12,214,000	
能美防災	15,500	1,559.00	24,164,500	

ホーチキ	10,000	832.00	8,320,000	
エレコム	4,000	2,674.00	10,696,000	
日本無線	27,000	439.00	11,853,000	
パナソニック	1,422,300	1,561.50	2,220,921,450	
シャープ	933,000	250.00	233,250,000	
アンリツ	71,000	834.00	59,214,000	
富士通ゼネラル	36,000	1,670.00	60,120,000	
日立国際電気	31,000	1,589.00	49,259,000	
ソニー	762,900	3,670.00	2,799,843,000	
T D K	70,400	8,560.00	602,624,000	
帝国通信工業	32,000	243.00	7,776,000	
ミツミ電機	41,400	984.00	40,737,600	
タムラ製作所	46,000	497.00	22,862,000	
アルプス電気	92,200	3,175.00	292,735,000	
池上通信機	44,000	189.00	8,316,000	
パイオニア	175,000	235.00	41,125,000	
日本電波工業	12,000	1,030.00	12,360,000	
日本トリム	3,200	3,460.00	11,072,000	
ローランド ディー . ジー .	4,900	3,270.00	16,023,000	
フォスター電機	12,200	3,075.00	37,515,000	
クラリオン	63,000	326.00	20,538,000	
S M K	36,000	523.00	18,828,000	
ヨコオ	11,300	766.00	8,655,800	
東光	32,000	356.00	11,392,000	
ティアック	85,000	58.00	4,930,000	
ホシデン	35,200	714.00	25,132,800	
ヒロセ電機	20,055	16,360.00	328,099,800	
日本航空電子工業	34,000	2,869.00	97,546,000	
T O A	13,200	1,182.00	15,602,400	
日立マクセル	17,400	1,968.00	34,243,200	
古野電気	14,500	1,117.00	16,196,500	
ユニデン	37,000	219.00	8,103,000	
アルパイン	27,600	2,222.00	61,327,200	
スミダコーポレーション	12,600	675.00	8,505,000	
アイコム	6,500	3,100.00	20,150,000	
リオン	4,300	1,576.00	6,776,800	

船井電機	11,800	1,366.00	16,118,800	
横河電機	117,000	1,385.00	162,045,000	
新電元工業	46,000	592.00	27,232,000	
アズビル	38,000	3,260.00	123,880,000	
日本光電工業	49,800	3,300.00	164,340,000	
チノー	5,700	1,182.00	6,737,400	
共和電業	18,700	489.00	9,144,300	
堀場製作所	21,700	4,740.00	102,858,000	
アドバンテスト	80,100	1,538.00	123,193,800	
小野測器	7,500	997.00	7,477,500	
エスベック	13,300	1,319.00	17,542,700	
パナソニック デバイスSUNX	11,900	885.00	10,531,500	
キーエンス	26,400	65,890.00	1,739,496,000	
日置電機	7,100	2,000.00	14,200,000	
シスメックス	90,400	7,070.00	639,128,000	
メガチップス	12,400	1,400.00	17,360,000	
OBARA GROUP	7,600	7,560.00	57,456,000	
コーセル	16,900	1,410.00	23,829,000	
オブテックス	8,300	2,803.00	23,264,900	
千代田インテグレ	5,500	3,190.00	17,545,000	
レーザーテック	12,400	1,571.00	19,480,400	
スタンレー電気	83,800	2,749.00	230,366,200	
岩崎電気	44,000	233.00	10,252,000	
ウシオ電機	71,200	1,587.00	112,994,400	
ヘリオス テクノ ホールディング	13,200	497.00	6,560,400	
日本セラミック	7,400	1,740.00	12,876,000	
遠藤照明	6,300	1,444.00	9,097,200	
日本デジタル研究所	10,200	1,700.00	17,340,000	
古河電池	10,000	901.00	9,010,000	
双信電機	8,500	409.00	3,476,500	
山一電機	14,600	986.00	14,395,600	
図研	9,600	1,103.00	10,588,800	
日本電子	50,000	637.00	31,850,000	
カシオ計算機	117,100	2,249.00	263,357,900	
ファナック	121,500	26,970.00	3,276,855,000	
日本シイエムケイ	33,700	313.00	10,548,100	

エンプラス	5,300	5,070.00	26,871,000
大真空	25,000	333.00	8,325,000
ローム	57,500	8,050.00	462,875,000
浜松ホトニクス	97,200	3,750.00	364,500,000
三井ハイテック	16,400	906.00	14,858,400
新光電気工業	44,100	848.00	37,396,800
京セラ	191,400	7,022.00	1,344,010,800
太陽誘電	61,400	1,823.00	111,932,200
村田製作所	122,400	17,405.00	2,130,372,000
ユーシン	17,300	814.00	14,082,200
双葉電子工業	19,900	2,041.00	40,615,900
北陸電気工業	56,000	189.00	10,584,000
ニチコン	36,600	1,168.00	42,748,800
日本ケミコン	95,000	370.00	35,150,000
K O A	16,200	1,198.00	19,407,600
市光工業	32,000	269.00	8,608,000
小糸製作所	69,900	3,615.00	252,688,500
ミツバ	21,500	2,691.00	57,856,500
スター精密	22,400	1,704.00	38,169,600
S C R E E Nホールディングス	111,000	882.00	97,902,000
キャノン電子	10,100	2,474.00	24,987,400
キャノン	676,700	4,478.00	3,030,262,600
リコー	351,100	1,342.50	471,351,750
M U T O Hホールディングス	18,000	438.00	7,884,000
東京エレクトロン	98,300	8,254.00	811,368,200
トヨタ紡織	41,100	1,538.00	63,211,800
鬼怒川ゴム工業	29,000	537.00	15,573,000
ユニプレス	22,700	2,435.00	55,274,500
豊田自動織機	105,900	7,100.00	751,890,000
モリタホールディングス	20,900	1,153.00	24,097,700
三櫻工業	16,400	885.00	14,514,000
デンソー	288,100	5,577.00	1,606,733,700
東海理化電機製作所	30,900	2,876.00	88,868,400
三井造船	455,000	196.00	89,180,000
川崎重工業	848,000	613.00	519,824,000
名村造船所	32,900	1,115.00	36,683,500

日本車輛製造	44,000	352.00	15,488,000	
ニチユ三菱フォークリフト	15,000	683.00	10,245,000	
近畿車輛	22,000	380.00	8,360,000	
日産自動車	1,637,400	1,263.00	2,068,036,200	
いすゞ自動車	369,400	1,565.00	578,111,000	
トヨタ自動車	1,610,100	8,248.00	13,280,104,800	代用有価証券 500,000株
日野自動車	166,500	1,628.00	271,062,000	
三菱自動車工業	427,700	1,060.00	453,362,000	
エフテック	7,900	1,189.00	9,393,100	
武蔵精密工業	12,500	2,547.00	31,837,500	
日産車体	51,600	1,586.00	81,837,600	
新明和工業	47,000	1,216.00	57,152,000	
極東開発工業	21,700	1,379.00	29,924,300	
日信工業	21,900	1,862.00	40,777,800	
トピー工業	96,000	283.00	27,168,000	
ティラド	50,000	257.00	12,850,000	
曙ブレーキ工業	51,000	431.00	21,981,000	
タチエス	18,500	1,888.00	34,928,000	
NOK	56,500	3,685.00	208,202,500	
フタバ産業	35,700	563.00	20,099,100	
カヤバ工業	129,000	444.00	57,276,000	
シロキ工業	30,000	338.00	10,140,000	
大同メタル工業	16,600	1,330.00	22,078,000	
プレス工業	58,000	487.00	28,246,000	
カルソニックカンセイ	89,000	831.00	73,959,000	
太平洋工業	24,200	1,008.00	24,393,600	
ケーヒン	27,000	1,875.00	50,625,000	
河西工業	15,700	1,002.00	15,731,400	
アイシン精機	106,400	4,520.00	480,928,000	
富士機工	15,500	546.00	8,463,000	
マツダ	348,000	2,316.50	806,142,000	
ダイハツ工業	139,000	1,767.00	245,613,000	
今仙電機製作所	10,600	1,405.00	14,893,000	
本田技研工業	1,050,200	4,065.50	4,269,588,100	
スズキ	244,100	3,725.50	909,394,550	

富士重工業	397,000	3,994.50	1,585,816,500	
ヤマハ発動機	177,600	3,015.00	535,464,000	
ショーワ	27,600	1,224.00	33,782,400	
T B K	17,800	627.00	11,160,600	
エクセディ	16,000	2,903.00	46,448,000	
豊田合成	37,700	2,740.00	103,298,000	
愛三工業	18,200	1,101.00	20,038,200	
ヨロズ	11,000	2,416.00	26,576,000	
エフ・シー・シー	17,000	1,887.00	32,079,000	
シマノ	50,400	17,750.00	894,600,000	
タカタ	21,800	1,300.00	28,340,000	
テイ・エス テック	24,700	3,250.00	80,275,000	
テルモ	178,500	3,285.00	586,372,500	
日機装	37,600	1,120.00	42,112,000	
島津製作所	139,000	1,464.00	203,496,000	
J M S	25,000	296.00	7,400,000	
長野計器	9,900	744.00	7,365,600	
ブイ・テクノロジー	2,700	2,922.00	7,889,400	
東京計器	44,000	266.00	11,704,000	
愛知時計電機	20,000	325.00	6,500,000	
東京精密	20,800	2,792.00	58,073,600	
マニー	3,100	8,730.00	27,063,000	
ニコン	217,400	1,696.00	368,710,400	
トプコン	35,200	3,140.00	110,528,000	
オリンパス	173,800	4,460.00	775,148,000	
理研計器	11,200	1,415.00	15,848,000	
タムロン	8,800	2,740.00	24,112,000	
H O Y A	277,700	4,942.50	1,372,532,250	
ノーリツ鋼機	11,600	697.00	8,085,200	
エー・アンド・デイ	12,900	485.00	6,256,500	
シチズンホールディングス	143,700	920.00	132,204,000	
リズム時計工業	56,000	161.00	9,016,000	
大研医器	9,100	1,340.00	12,194,000	
松風	6,700	1,386.00	9,286,200	
セイコーホールディングス	83,000	585.00	48,555,000	
ニプロ	74,400	1,194.00	88,833,600	

パラマウントベッドホールディングス	12,300	3,190.00	39,237,000	
前田工織	12,300	1,089.00	13,394,700	
永大産業	19,000	455.00	8,645,000	
アートネイチャー	9,700	1,127.00	10,931,900	
ダンロップスポーツ	8,800	1,253.00	11,026,400	
バンダイナムコホールディングス	128,900	2,524.00	325,343,600	
共立印刷	25,400	298.00	7,569,200	
フランスベッドホールディングス	88,000	179.00	15,752,000	
パイロットコーポレーション	10,200	6,740.00	68,748,000	
トッパン・フォームズ	20,300	1,443.00	29,292,900	
フジシールインターナショナル	14,200	3,530.00	50,126,000	
タカラトミー	42,600	830.00	35,358,000	
廣済堂	12,700	607.00	7,708,900	
アーク	42,200	138.00	5,823,600	
プロネクサス	13,800	788.00	10,874,400	
ウッドワン	26,000	273.00	7,098,000	
大建工業	52,000	270.00	14,040,000	
凸版印刷	326,000	976.00	318,176,000	
大日本印刷	355,000	1,226.00	435,230,000	
図書印刷	22,000	331.00	7,282,000	
共同印刷	39,000	370.00	14,430,000	
日本写真印刷	19,800	2,271.00	44,965,800	
光村印刷	14,000	268.00	3,752,000	
アシックス	116,000	3,240.00	375,840,000	
ツツミ	6,100	3,005.00	18,330,500	
小松ウオール工業	3,300	2,525.00	8,332,500	
ヤマハ	85,800	2,360.00	202,488,000	
河合楽器製作所	4,600	2,346.00	10,791,600	
クリナップ	11,700	924.00	10,810,800	
ピジョン	22,100	10,230.00	226,083,000	
キングジム	10,900	835.00	9,101,500	
リンテック	27,900	2,995.00	83,560,500	
T A S A K I	2,600	2,900.00	7,540,000	
イトーキ	25,100	759.00	19,050,900	
任天堂	71,900	19,765.00	1,421,103,500	
三菱鉛筆	9,600	4,530.00	43,488,000	

タカスタンダード	47,000	994.00	46,718,000	
コクヨ	60,700	1,185.00	71,929,500	
ナカバヤシ	30,000	224.00	6,720,000	
グロープライド	63,000	204.00	12,852,000	
岡村製作所	44,700	945.00	42,241,500	
美津濃	62,000	613.00	38,006,000	
アデランス	14,100	1,363.00	19,218,300	
東京電力	990,000	458.00	453,420,000	
中部電力	357,800	1,441.50	515,768,700	
関西電力	477,100	1,141.00	544,371,100	
中国電力	161,300	1,624.00	261,951,200	
北陸電力	114,700	1,615.00	185,240,500	
東北電力	291,300	1,366.00	397,915,800	
四国電力	105,700	1,521.00	160,769,700	
九州電力	258,000	1,109.00	286,122,000	
北海道電力	110,500	959.00	105,969,500	
沖縄電力	7,700	4,320.00	33,264,000	
電源開発	81,800	4,030.00	329,654,000	
東京瓦斯	1,420,000	758.20	1,076,644,000	
大阪瓦斯	1,210,000	498.70	603,427,000	
東邦瓦斯	298,000	689.00	205,322,000	
北海道瓦斯	30,000	284.00	8,520,000	
西部瓦斯	131,000	265.00	34,715,000	
静岡ガス	34,000	797.00	27,098,000	
メタウォーター	5,800	2,668.00	15,474,400	
SBSホールディングス	9,700	951.00	9,224,700	
東武鉄道	619,000	574.00	355,306,000	
相鉄ホールディングス	200,000	574.00	114,800,000	
東京急行電鉄	630,000	765.00	481,950,000	
京浜急行電鉄	320,000	957.00	306,240,000	
小田急電鉄	372,000	1,241.00	461,652,000	
京王電鉄	324,000	950.00	307,800,000	
京成電鉄	175,000	1,491.00	260,925,000	
富士急行	33,000	1,169.00	38,577,000	
新京成電鉄	21,000	416.00	8,736,000	
東日本旅客鉄道	213,800	10,220.00	2,185,036,000	

西日本旅客鉄道	112,300	6,534.00	733,768,200	
東海旅客鉄道	104,500	21,920.00	2,290,640,000	
西武ホールディングス	93,000	3,585.00	333,405,000	
鴻池運輸	14,400	1,258.00	18,115,200	
西日本鉄道	150,000	533.00	79,950,000	
ハマキョウレックス	3,900	4,475.00	17,452,500	
サカイ引越センター	2,300	3,895.00	8,958,500	
近鉄グループホールディングス	1,171,000	427.00	500,017,000	
阪急阪神ホールディングス	779,000	734.00	571,786,000	
南海電気鉄道	263,000	536.00	140,968,000	
京阪電気鉄道	262,000	709.00	185,758,000	
神戸電鉄	36,000	365.00	13,140,000	
名糖運輸	9,100	742.00	6,752,200	
名古屋鉄道	424,000	477.00	202,248,000	
山陽電気鉄道	43,000	474.00	20,382,000	
日本通運	460,000	700.00	322,000,000	
ヤマトホールディングス	205,200	2,793.50	573,226,200	
山九	143,000	549.00	78,507,000	
丸運	13,600	259.00	3,522,400	
丸全昭和運輸	38,000	420.00	15,960,000	
センコー	49,000	783.00	38,367,000	
トナミホールディングス	26,000	448.00	11,648,000	
日本梱包運輸倉庫	38,100	2,076.00	79,095,600	
日本石油輸送	21,000	243.00	5,103,000	
福山通運	71,000	658.00	46,718,000	
セイノーホールディングス	90,500	1,299.00	117,559,500	
神奈川中央交通	16,000	588.00	9,408,000	
日立物流	23,800	1,994.00	47,457,200	
日本郵船	993,000	346.00	343,578,000	
商船三井	618,000	398.00	245,964,000	
川崎汽船	518,000	308.00	159,544,000	
N S ユナイテッド海運	57,000	288.00	16,416,000	
飯野海運	63,300	647.00	40,955,100	
日本航空	223,400	3,730.00	833,282,000	
A N A ホールディングス	2,294,000	329.70	756,331,800	
パスコ	11,000	340.00	3,740,000	

トランコム	3,500	5,710.00	19,985,000
日新	47,000	306.00	14,382,000
三菱倉庫	76,000	1,855.00	140,980,000
三井倉庫ホールディングス	67,000	394.00	26,398,000
住友倉庫	86,000	677.00	58,222,000
澁澤倉庫	34,000	354.00	12,036,000
東陽倉庫	27,000	294.00	7,938,000
乾汽船	9,500	993.00	9,433,500
日本トランスシティ	31,000	390.00	12,090,000
安田倉庫	10,700	1,010.00	10,807,000
東洋埠頭	44,000	200.00	8,800,000
宇徳	11,400	582.00	6,634,800
上組	138,000	1,192.00	164,496,000
サンリツ	11,100	550.00	6,105,000
郵船ロジスティクス	10,600	1,547.00	16,398,200
近鉄エクスプレス	10,400	5,710.00	59,384,000
東海運	14,100	290.00	4,089,000
エーアイティー	6,300	1,211.00	7,629,300
N E C ネットズエスアイ	14,200	2,464.00	34,988,800
システナ	13,100	891.00	11,672,100
デジタルアーツ	7,300	1,247.00	9,103,100
新日鉄住金ソリューションズ	9,500	3,860.00	36,670,000
コア	8,100	864.00	6,998,400
I T ホールディングス	38,400	2,389.00	91,737,600
電算システム	5,300	1,611.00	8,538,300
グリー	70,600	842.00	59,445,200
コーエーテクモホールディングス	26,100	1,887.00	49,250,700
三菱総合研究所	4,900	2,718.00	13,318,200
ファインデックス	5,400	1,785.00	9,639,000
K L a b	12,600	1,442.00	18,169,200
ポルトゥウィン・ピットクルーホールディングス	8,800	1,100.00	9,680,000
ネクソン	109,900	1,503.00	165,179,700
エイチーム	1,600	5,610.00	8,976,000
e n i s h	3,700	1,521.00	5,627,700
コロプラ	20,500	2,580.00	52,890,000
モバイルクリエイト	8,800	774.00	6,811,200

ブロードリーフ	9,800	2,370.00	23,226,000	
ハーツユナイテッドグループ	3,900	1,850.00	7,215,000	
ティーガイア	11,600	1,714.00	19,882,400	
豆蔵ホールディングス	10,800	618.00	6,674,400	
GMOペイメントゲートウェイ	10,300	3,380.00	34,814,000	
インターネットイニシアティブ	18,800	2,046.00	38,464,800	
ビットアイル	16,100	520.00	8,372,000	
SRAホールディングス	7,400	1,640.00	12,136,000	
朝日ネット	19,000	528.00	10,032,000	
gumi	9,100	1,490.00	13,559,000	
パナソニック インフォメーションシステムズ	3,400	3,885.00	13,209,000	
フェイス	4,900	1,531.00	7,501,900	
野村総合研究所	65,200	4,585.00	298,942,000	
サイバネットシステム	13,200	485.00	6,402,000	
インテージホールディングス	7,600	2,158.00	16,400,800	
ソースネクスト	7,500	773.00	5,797,500	
クレスコ	3,500	1,892.00	6,622,000	
フジ・メディア・ホールディングス	119,900	1,789.00	214,501,100	
オービック	39,800	5,550.00	220,890,000	
ジャストシステム	17,200	792.00	13,622,400	
TDCソフトウェアエンジニアリング	4,900	1,110.00	5,439,000	
ヤフー	826,400	532.00	439,644,800	
トレンドマイクロ	61,100	4,130.00	252,343,000	
日本オラクル	18,600	5,420.00	100,812,000	
アルファシステムズ	4,900	1,717.00	8,413,300	
フューチャーアーキテクト	14,600	723.00	10,555,800	
CAC Holdings	9,200	1,129.00	10,386,800	
オービックビジネスコンサルタント	7,400	4,735.00	35,039,000	
伊藤忠テクノソリューションズ	26,400	2,559.00	67,557,600	
アイティフォー	18,100	465.00	8,416,500	
大塚商会	31,000	5,370.00	166,470,000	
サイボウズ	22,100	378.00	8,353,800	
ソフトブレーン	21,600	193.00	4,168,800	
電通国際情報サービス	8,300	1,224.00	10,159,200	
ウェザーニューズ	4,100	3,720.00	15,252,000	
CIJ	16,400	499.00	8,183,600	

日本エンタープライズ	9,900	346.00	3,425,400	
WOWOW	5,600	4,165.00	23,324,000	
フュージョンパートナー	6,200	876.00	5,431,200	
ネットワンシステムズ	46,800	827.00	38,703,600	
アルゴグラフィックス	5,900	1,833.00	10,814,700	
マーベラス	19,800	1,659.00	32,848,200	
エイベックス・グループ・ホールディングス	23,000	1,879.00	43,217,000	
日本ユニシス	31,700	1,174.00	37,215,800	
兼松エレクトロニクス	8,100	1,764.00	14,288,400	
東京放送ホールディングス	69,000	1,623.00	111,987,000	
日本テレビホールディングス	105,100	2,156.00	226,595,600	
朝日放送	12,700	1,225.00	15,557,500	
テレビ朝日ホールディングス	31,700	2,213.00	70,152,100	
スカパーJ S A Tホールディングス	86,600	804.00	69,626,400	
テレビ東京ホールディングス	9,600	2,246.00	21,561,600	
コネクシオ	9,200	1,216.00	11,187,200	
日本電信電話	450,600	8,031.00	3,618,768,600	
K D D I	1,169,700	2,839.00	3,320,778,300	
光通信	10,400	8,770.00	91,208,000	
N T T ドコモ	948,600	2,224.00	2,109,686,400	
G M O インターネット	38,800	1,652.00	64,097,600	
K A D O K A W A ・ D W A N G O	27,900	1,884.00	52,563,600	
学研ホールディングス	44,000	257.00	11,308,000	
ゼンリン	15,700	1,446.00	22,702,200	
アイネット	9,200	948.00	8,721,600	
松竹	77,000	1,161.00	89,397,000	
東宝	81,900	3,160.00	258,804,000	
東映	43,000	937.00	40,291,000	
A O I P r o .	8,400	912.00	7,660,800	
エヌ・ティ・ティ・データ	71,000	5,460.00	387,660,000	
D T S	12,000	2,280.00	27,360,000	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	44,600	2,574.00	114,800,400	
シーイーシー	8,900	892.00	7,938,800	
カブコン	29,800	2,407.00	71,728,600	
ジャステック	9,600	906.00	8,697,600	
S C S K	27,300	3,630.00	99,099,000	

日本システムウエア	5,700	871.00	4,964,700
アイネス	17,100	975.00	16,672,500
T K C	9,600	2,641.00	25,353,600
富士ソフト	15,900	2,458.00	39,082,200
N S D	26,800	1,745.00	46,766,000
コナミ	47,000	2,308.00	108,476,000
J B C Cホールディングス	12,200	786.00	9,589,200
ミロク情報サービス	10,900	688.00	7,499,200
ソフトバンク	609,100	7,353.00	4,478,712,300
高千穂交易	6,400	1,015.00	6,496,000
伊藤忠食品	3,000	4,190.00	12,570,000
エレマテック	5,700	3,030.00	17,271,000
J A L U X	4,100	2,300.00	9,430,000
あらた	29,000	321.00	9,309,000
双日	767,600	204.00	156,590,400
アルフレッサホールディングス	135,900	1,772.00	240,814,800
横浜冷凍	27,800	818.00	22,740,400
神栄	27,000	203.00	5,481,000
アルコニックス	7,600	1,825.00	13,870,000
神戸物産	3,900	5,370.00	20,943,000
あいホールディングス	18,800	2,210.00	41,548,000
ダイワボウホールディングス	104,000	197.00	20,488,000
マクニカ・富士エレホールディングス	21,850	1,479.00	32,316,150
バイタルケーエスケー・ホールディングス	21,400	895.00	19,153,000
U K Cホールディングス	7,800	2,139.00	16,684,200
T O K A Iホールディングス	57,900	506.00	29,297,400
三洋貿易	8,300	1,414.00	11,736,200
ウイン・パートナーズ	4,600	1,408.00	6,476,800
シップヘルスケアホールディングス	21,200	2,950.00	62,540,000
協栄産業	22,000	209.00	4,598,000
小野建	11,300	1,052.00	11,887,600
佐鳥電機	11,400	864.00	9,849,600
コンドーテック	9,000	779.00	7,011,000
ナガイレーベン	17,100	2,272.00	38,851,200
三菱食品	12,300	2,502.00	30,774,600
松田産業	9,200	1,600.00	14,720,000

メディバルホールディングス	115,000	1,636.00	188,140,000	
アドヴァン	6,300	1,525.00	9,607,500	
S P K	3,200	2,236.00	7,155,200	
萩原電気	4,100	1,844.00	7,560,400	
アズワン	8,500	3,655.00	31,067,500	
尾家産業	5,300	883.00	4,679,900	
シモジマ	8,700	1,079.00	9,387,300	
ドウシシャ	15,100	1,866.00	28,176,600	
小津産業	2,500	2,432.00	6,080,000	
高速	7,800	895.00	6,981,000	
たけびし	5,200	1,073.00	5,579,600	
黒田電気	19,600	2,070.00	40,572,000	
丸文	12,600	799.00	10,067,400	
ハピネット	7,700	1,435.00	11,049,500	
橋本総業	2,800	1,422.00	3,981,600	
エクセル	6,100	1,345.00	8,204,500	
マルカキカイ	4,700	2,033.00	9,555,100	
ガリバーインターナショナル	35,400	1,010.00	35,754,000	
日本エム・ディ・エム	11,400	586.00	6,680,400	
進和	7,700	1,658.00	12,766,600	
ダイトエレクトロン	8,000	684.00	5,472,000	
シークス	7,500	3,200.00	24,000,000	
田中商事	4,800	688.00	3,302,400	
オーハシテクニカ	8,400	1,493.00	12,541,200	
白銅	4,600	1,368.00	6,292,800	
伊藤忠商事	964,200	1,342.00	1,293,956,400	
丸紅	1,007,900	699.10	704,622,890	
高島	28,000	264.00	7,392,000	
長瀬産業	70,200	1,580.00	110,916,000	
蝶理	8,200	1,809.00	14,833,800	
豊田通商	127,700	3,230.00	412,471,000	
三共生興	20,500	502.00	10,291,000	
兼松	227,000	179.00	40,633,000	
三井物産	976,100	1,586.00	1,548,094,600	
日本紙パルプ商事	59,000	329.00	19,411,000	
日立ハイテクノロジーズ	40,100	3,625.00	145,362,500	

カメイ	15,800	904.00	14,283,200	
スターゼン	46,000	379.00	17,434,000	
山善	44,200	1,005.00	44,421,000	
椿本興業	16,000	310.00	4,960,000	
住友商事	680,100	1,315.00	894,331,500	
内田洋行	32,000	371.00	11,872,000	
三菱商事	882,400	2,444.00	2,156,585,600	
第一実業	29,000	608.00	17,632,000	
キヤノンマーケティングジャパン	33,000	2,417.00	79,761,000	
西華産業	44,000	341.00	15,004,000	
佐藤商事	12,600	805.00	10,143,000	
菱洋エレクトロ	13,600	1,500.00	20,400,000	
東京産業	13,200	487.00	6,428,400	
ユアサ商事	10,000	2,546.00	25,460,000	
神鋼商事	32,000	265.00	8,480,000	
阪和興業	116,000	479.00	55,564,000	
カナデン	12,000	855.00	10,260,000	
菱電商事	20,000	852.00	17,040,000	
フルサト工業	7,300	1,688.00	12,322,400	
岩谷産業	129,000	815.00	105,135,000	
すてきナイスグループ	54,000	194.00	10,476,000	
昭光通商	52,000	151.00	7,852,000	
三愛石油	30,000	814.00	24,420,000	
稲畑産業	27,100	1,239.00	33,576,900	
明和産業	12,500	443.00	5,537,500	
ワキタ	24,800	1,196.00	29,660,800	
東邦ホールディングス	40,100	2,234.00	89,583,400	
サンゲツ	41,600	1,880.00	78,208,000	
ミツウロコグループホールディングス	20,900	582.00	12,163,800	
シナネン	29,000	459.00	13,311,000	
伊藤忠エネクス	25,100	1,024.00	25,702,400	
サンリオ	32,700	3,375.00	110,362,500	
サンワテクノス	9,000	1,206.00	10,854,000	
リョーサン	19,800	2,955.00	58,509,000	
新光商事	14,000	1,211.00	16,954,000	
トーヨー	29,000	458.00	13,282,000	

三信電気	17,200	984.00	16,924,800	
東陽テクニカ	17,700	1,161.00	20,549,700	
モスフードサービス	15,100	2,498.00	37,719,800	
加賀電子	10,800	1,444.00	15,595,200	
ソーダニッカ	13,000	543.00	7,059,000	
立花エレクトック	9,480	1,485.00	14,077,800	
P a l t a c	18,200	1,761.00	32,050,200	
太平洋興発	50,000	96.00	4,800,000	
ヤマタネ	68,000	181.00	12,308,000	
日鉄住金物産	74,000	397.00	29,378,000	
トラスコ中山	14,400	3,845.00	55,368,000	
オートバックスセブン	42,800	1,951.00	83,502,800	
加藤産業	16,400	2,509.00	41,147,600	
イノテック	14,800	487.00	7,207,600	
イエローハット	11,000	2,622.00	28,842,000	
J Kホールディングス	13,800	586.00	8,086,800	
日伝	5,400	2,688.00	14,515,200	
北沢産業	19,200	185.00	3,552,000	
杉本商事	7,200	1,229.00	8,848,800	
因幡電機産業	16,900	4,390.00	74,191,000	
ミスミグループ本社	43,200	4,720.00	203,904,000	
タキヒヨー	22,000	463.00	10,186,000	
スズケン	52,470	3,870.00	203,058,900	
ジェコス	8,900	1,334.00	11,872,600	
ルネサスイーストン	7,600	612.00	4,651,200	
ローソン	43,600	8,340.00	363,624,000	
サンエー	8,600	4,880.00	41,968,000	
カワチ薬品	8,600	2,119.00	18,223,400	
エービーシー・マート	16,500	7,070.00	116,655,000	
ハードオフコーポレーション	7,400	1,191.00	8,813,400	
アスクル	12,100	2,831.00	34,255,100	
ゲオホールディングス	21,600	1,309.00	28,274,400	
アダストリアホールディングス	9,900	3,470.00	34,353,000	
くらコーポレーション	6,900	4,895.00	33,775,500	
キャンドウ	7,600	1,595.00	12,122,000	
パル	6,900	3,550.00	24,495,000	

エディオン	52,500	876.00	45,990,000
サーラコーポレーション	13,400	597.00	7,999,800
あみやき亭	2,500	4,860.00	12,150,000
ひらまつ	19,400	644.00	12,493,600
ゲンキー	1,300	12,170.00	15,821,000
大黒天物産	3,000	5,430.00	16,290,000
ハニーズ	11,300	994.00	11,232,200
アルペン	9,700	1,903.00	18,459,100
クオール	12,800	1,074.00	13,747,200
ジェイアイエヌ	8,000	4,610.00	36,880,000
ビックカメラ	50,100	1,204.00	60,320,400
D C Mホールディングス	55,200	911.00	50,287,200
Monotaro	22,600	4,550.00	102,830,000
アークランドサービス	1,600	5,250.00	8,400,000
J.フロント リテイリング	145,600	2,007.00	292,219,200
ドトール・日レスホールディングス	19,900	2,135.00	42,486,500
マツモトキヨシホールディングス	25,800	4,560.00	117,648,000
ブロンコピラー	2,400	4,750.00	11,400,000
スタートトゥデイ	36,200	3,205.00	116,021,000
物語コーポレーション	3,800	4,240.00	16,112,000
ココカラファイン	11,800	3,620.00	42,716,000
三越伊勢丹ホールディングス	228,600	2,280.00	521,208,000
ウエルシアホールディングス	10,400	4,725.00	49,140,000
クリエイティブSDホールディングス	5,600	5,450.00	30,520,000
チムニー	2,700	3,035.00	8,194,500
ジョイフル本田	6,400	4,675.00	29,920,000
麒麟堂ホールディングス	6,700	825.00	5,527,500
すかいらーく	42,400	1,536.00	65,126,400
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	37,000	1,100.00	40,700,000
ブックオフコーポレーション	8,900	910.00	8,099,000
あさひ	8,900	1,080.00	9,612,000
日本調剤	1,600	6,330.00	10,128,000
コスモス薬品	5,800	16,920.00	98,136,000
セブン&アイ・ホールディングス	481,800	5,390.00	2,596,902,000
クリエイティブ・レストランツ・ホールディングス	8,700	1,750.00	15,225,000
ツルハホールディングス	24,600	9,320.00	229,272,000

サンマルクホールディングス	8,200	4,055.00	33,251,000	
トリドール	12,900	1,705.00	21,994,500	
クスリのアオキ	4,600	10,180.00	46,828,000	
メディカルシステムネットワーク	13,100	500.00	6,550,000	
総合メディカル	5,800	3,450.00	20,010,000	
はるやま商事	6,500	795.00	5,167,500	
カップ・クリエイトホールディングス	19,100	1,132.00	21,621,200	
ライトオン	10,300	872.00	8,981,600	
良品計画	14,300	19,550.00	279,565,000	
三城ホールディングス	18,100	486.00	8,796,600	
コナカ	14,800	751.00	11,114,800	
ヒマラヤ	5,000	1,062.00	5,310,000	
コーナン商事	16,900	1,379.00	23,305,100	
ワタミ	14,000	1,194.00	16,716,000	
ドンキホーテホールディングス	37,200	10,790.00	401,388,000	
西松屋チェーン	22,900	1,067.00	24,434,300	
ゼンショーホールディングス	59,900	1,150.00	68,885,000	
幸楽苑	10,000	1,557.00	15,570,000	
サイゼリヤ	17,200	2,468.00	42,449,600	
ユナイテッドアローズ	15,200	3,965.00	60,268,000	
ハイデイ日高	9,000	3,060.00	27,540,000	
京都きもの友禅	11,000	999.00	10,989,000	
コロワイド	38,500	1,662.00	63,987,000	
壱番屋	5,300	5,390.00	28,567,000	
スギホールディングス	20,700	5,990.00	123,993,000	
ヨンドシーホールディングス	9,000	2,516.00	22,644,000	
ファミリーマート	39,000	5,570.00	217,230,000	
木曽路	14,100	2,041.00	28,778,100	
サトレストランシステムズ	14,200	1,069.00	15,179,800	
千趣会	19,500	878.00	17,121,000	
ケーヨー	25,400	558.00	14,173,200	
上新電機	25,000	942.00	23,550,000	
日本瓦斯	18,700	3,045.00	56,941,500	
ベスト電器	42,800	154.00	6,591,200	
ロイヤルホールディングス	19,000	2,245.00	42,655,000	
東天紅	19,000	195.00	3,705,000	

いなげや	12,800	1,382.00	17,689,600
島忠	27,900	3,105.00	86,629,500
チヨダ	13,600	2,569.00	34,938,400
ライフコーポレーション	7,700	2,095.00	16,131,500
リンガーハット	11,900	2,307.00	27,453,300
テンアライド	14,100	382.00	5,386,200
A O K Iホールディングス	26,400	1,745.00	46,068,000
オークワ	18,000	965.00	17,370,000
コメリ	19,900	2,863.00	56,973,700
青山商事	29,000	4,165.00	120,785,000
しまむら	13,400	12,190.00	163,346,000
C F Sコーポレーション	9,600	986.00	9,465,600
高島屋	167,000	1,243.00	207,581,000
松屋	23,700	1,861.00	44,105,700
エイチ・ツー・オー リテイリング	54,500	2,324.00	126,658,000
近鉄百貨店	49,000	334.00	16,366,000
ニッセンホールディングス	31,500	262.00	8,253,000
パルコ	11,400	1,124.00	12,813,600
丸井グループ	138,800	1,486.00	206,256,800
アクシアル リテイリング	9,000	3,550.00	31,950,000
イオン	475,000	1,556.00	739,100,000
ユニーグループ・ホールディングス	110,300	716.00	78,974,800
イズミ	25,800	4,860.00	125,388,000
東武ストア	23,000	329.00	7,567,000
平和堂	23,100	3,075.00	71,032,500
フジ	12,700	2,110.00	26,797,000
ヤオコー	13,000	4,555.00	59,215,000
ゼビオ	15,500	2,097.00	32,503,500
ケーズホールディングス	26,600	3,915.00	104,139,000
O l y m p i cグループ	9,400	808.00	7,595,200
日産東京販売ホールディングス	23,100	314.00	7,253,400
アインファーマシーズ	14,000	4,865.00	68,110,000
元気寿司	4,500	2,449.00	11,020,500
ヤマダ電機	455,400	504.00	229,521,600
アーランドサカモト	8,400	2,830.00	23,772,000
ニトリホールディングス	49,800	9,130.00	454,674,000

グルメ杵屋	9,000	962.00	8,658,000	
愛眼	22,200	249.00	5,527,800	
吉野家ホールディングス	33,900	1,332.00	45,154,800	
松屋フーズ	6,600	2,360.00	15,576,000	
サガミチェーン	16,000	1,174.00	18,784,000	
王将フードサービス	8,600	4,270.00	36,722,000	
プレナス	12,800	2,295.00	29,376,000	
ミニストップ	8,900	1,750.00	15,575,000	
アークス	19,700	2,815.00	55,455,500	
パロー	24,700	2,740.00	67,678,000	
ベルク	5,200	3,580.00	18,616,000	
大庄	8,100	1,450.00	11,745,000	
ファーストリテイリング	23,100	50,150.00	1,158,465,000	
サンドラッグ	24,400	6,430.00	156,892,000	
サックスパー ホールディングス	8,900	2,200.00	19,580,000	
ヤマザワ	3,400	1,712.00	5,820,800	
ペルーナ	28,300	592.00	16,753,600	
島根銀行	2,700	1,490.00	4,023,000	
じもとホールディングス	84,700	226.00	19,142,200	
足利ホールディングス	73,300	484.00	35,477,200	
東京ＴＹフィナンシャルグループ	15,100	3,325.00	50,207,500	
新生銀行	1,096,000	240.00	263,040,000	
あおぞら銀行	777,000	432.00	335,664,000	
三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	9,243,100	771.40	7,130,127,340	
りそなホールディングス	1,345,700	608.30	818,589,310	
三井住友トラスト・ホールディングス	2,543,000	499.00	1,268,957,000	
三井住友フィナンシャルグループ	871,100	4,730.50	4,120,738,550	
第四銀行	144,000	424.00	61,056,000	
北越銀行	128,000	232.00	29,696,000	
西日本シティ銀行	404,000	355.00	143,420,000	
千葉銀行	442,000	920.00	406,640,000	
横浜銀行	770,000	733.60	564,872,000	
常陽銀行	413,000	621.00	256,473,000	
群馬銀行	272,000	818.00	222,496,000	
武蔵野銀行	18,300	4,155.00	76,036,500	
千葉興業銀行	24,200	814.00	19,698,800	

筑波銀行	48,800	389.00	18,983,200	
七十七銀行	194,000	676.00	131,144,000	
青森銀行	92,000	377.00	34,684,000	
秋田銀行	78,000	353.00	27,534,000	
山形銀行	70,000	506.00	35,420,000	
岩手銀行	8,200	5,200.00	42,640,000	
東邦銀行	104,000	490.00	50,960,000	
東北銀行	67,000	165.00	11,055,000	
みちのく銀行	60,000	206.00	12,360,000	
ふくおかフィナンシャルグループ	466,000	625.00	291,250,000	
静岡銀行	336,000	1,219.00	409,584,000	
十六銀行	143,000	447.00	63,921,000	
スルガ銀行	121,600	2,697.00	327,955,200	
八十二銀行	206,000	870.00	179,220,000	
山梨中央銀行	74,000	523.00	38,702,000	
大垣共立銀行	143,000	395.00	56,485,000	
福井銀行	101,000	264.00	26,664,000	
北國銀行	129,000	421.00	54,309,000	
清水銀行	4,000	3,005.00	12,020,000	
滋賀銀行	115,000	594.00	68,310,000	
南都銀行	112,000	417.00	46,704,000	
百五銀行	108,000	558.00	60,264,000	
京都銀行	220,000	1,273.00	280,060,000	
紀陽銀行	45,600	1,664.00	75,878,400	
三重銀行	53,000	269.00	14,257,000	
ほくほくフィナンシャルグループ	778,000	270.00	210,060,000	
広島銀行	339,000	655.00	222,045,000	
山陰合同銀行	70,000	987.00	69,090,000	
中国銀行	81,600	1,791.00	146,145,600	
鳥取銀行	40,000	246.00	9,840,000	
伊予銀行	121,900	1,427.00	173,951,300	
百十四銀行	126,000	398.00	50,148,000	
四国銀行	92,000	248.00	22,816,000	
阿波銀行	94,000	686.00	64,484,000	
鹿児島銀行	79,000	803.00	63,437,000	
大分銀行	72,000	457.00	32,904,000	

宮崎銀行	78,000	453.00	35,334,000
肥後銀行	93,000	729.00	67,797,000
佐賀銀行	70,000	301.00	21,070,000
十八銀行	73,000	359.00	26,207,000
沖縄銀行	9,300	5,030.00	46,779,000
琉球銀行	24,200	1,748.00	42,301,600
セブン銀行	390,100	602.00	234,840,200
みずほフィナンシャルグループ	15,993,800	213.30	3,411,477,540
高知銀行	50,000	176.00	8,800,000
山口フィナンシャルグループ	115,000	1,432.00	164,680,000
長野銀行	40,000	197.00	7,880,000
名古屋銀行	105,000	408.00	42,840,000
北洋銀行	172,400	448.00	77,235,200
愛知銀行	4,200	5,820.00	24,444,000
第三銀行	70,000	188.00	13,160,000
中京銀行	50,000	211.00	10,550,000
東日本銀行	48,000	392.00	18,816,000
大光銀行	40,000	230.00	9,200,000
愛媛銀行	71,000	241.00	17,111,000
トマト銀行	49,000	194.00	9,506,000
みなと銀行	107,000	280.00	29,960,000
京葉銀行	95,000	702.00	66,690,000
関西アーバン銀行	16,500	1,245.00	20,542,500
栃木銀行	59,000	603.00	35,577,000
北日本銀行	3,800	3,360.00	12,768,000
東和銀行	170,000	97.00	16,490,000
福島銀行	150,000	92.00	13,800,000
大東銀行	71,000	169.00	11,999,000
トモニホールディングス	89,100	548.00	48,826,800
フィデアホールディングス	69,200	218.00	15,085,600
池田泉州ホールディングス	95,100	554.00	52,685,400
F P G	30,300	1,525.00	46,207,500
S B Iホールディングス	138,400	1,617.00	223,792,800
ジャフコ	16,000	4,635.00	74,160,000
大和証券グループ本社	1,075,000	977.10	1,050,382,500
野村ホールディングス	2,350,600	728.10	1,711,471,860

岡三証券グループ	98,000	977.00	95,746,000
丸三証券	37,300	1,230.00	45,879,000
東洋証券	50,000	385.00	19,250,000
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	132,800	960.00	127,488,000
光世証券	35,000	235.00	8,225,000
水戸証券	38,900	470.00	18,283,000
いちよし証券	25,300	1,352.00	34,205,600
松井証券	59,400	1,111.00	65,993,400
マネックスグループ	138,100	329.00	45,434,900
カブドットコム証券	52,600	880.00	46,288,000
極東証券	16,300	1,811.00	29,519,300
岩井コスモホールディングス	12,500	1,725.00	21,562,500
マネースクウェアHD	4,400	1,430.00	6,292,000
マネーパートナーズグループ	15,300	374.00	5,722,200
損保ジャパン日本興亜ホールディングス	255,700	3,718.00	950,692,600
アニコムホールディングス	5,200	2,450.00	12,740,000
MS&ADインシュアランスグループホールディングス	367,000	3,306.00	1,213,302,000
ソニーフィナンシャルホールディングス	110,700	2,050.00	226,935,000
第一生命保険	737,700	1,830.00	1,349,991,000
東京海上ホールディングス	474,100	4,690.00	2,223,529,000
T&Dホールディングス	419,700	1,668.50	700,269,450
全国保証	30,000	4,765.00	142,950,000
クレディセゾン	94,000	2,218.00	208,492,000
芙蓉総合リース	12,100	5,120.00	61,952,000
興銀リース	21,700	2,645.00	57,396,500
東京センチュリーリース	26,800	3,905.00	104,654,000
日本証券金融	55,900	810.00	45,279,000
アイフル	194,100	408.00	79,192,800
ポケットカード	10,400	508.00	5,283,200
リコーリース	9,200	3,650.00	33,580,000
イオンフィナンシャルサービス	75,600	3,105.00	234,738,000
アコム	233,000	393.00	91,569,000
ジャックス	64,000	622.00	39,808,000
オリエントコーポレーション	267,100	192.00	51,283,200
日立キャピタル	22,800	2,727.00	62,175,600
アプラスフィナンシャル	61,200	136.00	8,323,200

オリックス	814,700	1,823.00	1,485,198,100
三菱UFJリース	290,900	647.00	188,212,300
日本取引所グループ	169,300	3,795.00	642,493,500
イー・ギャランティ	4,500	1,958.00	8,811,000
NECキャピタルソリューション	4,900	1,887.00	9,246,300
日本駐車場開発	131,700	205.00	26,998,500
ヒューリック	195,000	1,420.00	276,900,000
野村不動産ホールディングス	69,700	2,483.00	173,065,100
日本商業開発	4,100	1,980.00	8,118,000
プレサンスコーポレーション	4,300	3,995.00	17,178,500
常和ホールディングス	5,000	4,735.00	23,675,000
日本管理センター	6,300	1,742.00	10,974,600
フージャースホールディングス	20,400	624.00	12,729,600
オープンハウス	7,500	3,160.00	23,700,000
東急不動産ホールディングス	303,100	893.00	270,668,300
飯田グループホールディングス	73,200	1,646.00	120,487,200
パーク24	58,400	2,512.00	146,700,800
三井不動産	611,000	3,620.00	2,211,820,000
三菱地所	857,000	2,885.00	2,472,445,000
平和不動産	21,900	1,730.00	37,887,000
東京建物	255,000	900.00	229,500,000
ダイビル	30,000	1,272.00	38,160,000
京阪神ビルディング	22,600	721.00	16,294,600
住友不動産	276,000	4,640.00	1,280,640,000
大京	182,000	182.00	33,124,000
テーオーシー	40,500	1,016.00	41,148,000
東京楽天地	26,000	491.00	12,766,000
レオパレス21	127,000	698.00	88,646,000
スターツコーポレーション	13,400	1,895.00	25,393,000
フジ住宅	18,500	665.00	12,302,500
空港施設	17,300	683.00	11,815,900
住友不動産販売	8,400	3,385.00	28,434,000
ゴールドクレスト	10,800	2,237.00	24,159,600
日神不動産	19,000	477.00	9,063,000
タカラレーベン	52,000	744.00	38,688,000
サンヨーハウジング名古屋	8,300	1,254.00	10,408,200

イオンモール	74,800	2,407.00	180,043,600	
トーセイ	17,200	872.00	14,998,400	
エヌ・ティ・ティ都市開発	72,600	1,300.00	94,380,000	
サンフロンティア不動産	13,100	1,205.00	15,785,500	
エフ・ジェー・ネクスト	11,500	534.00	6,141,000	
日本空港ビルデング	40,000	7,730.00	309,200,000	
日本工営	42,000	500.00	21,000,000	
ネクスト	15,100	1,227.00	18,527,700	
日本M&Aセンター	19,100	4,300.00	82,130,000	
アコーディア・ゴルフ	46,100	1,181.00	54,444,100	
タケエイ	13,200	1,086.00	14,335,200	
パソナグループ	10,400	781.00	8,122,400	
G C A サヴィアン	10,400	1,469.00	15,277,600	
エス・エム・エス	14,200	1,655.00	23,501,000	
テンプホールディングス	24,200	3,960.00	95,832,000	
クックパッド	7,900	6,320.00	49,928,000	
エスクリ	5,700	1,421.00	8,099,700	
学情	5,700	1,376.00	7,843,200	
スタジオアリス	6,200	2,292.00	14,210,400	
シミックホールディングス	5,500	1,690.00	9,295,000	
総合警備保障	40,800	4,350.00	177,480,000	
カカコム	81,100	1,990.00	161,389,000	
ルネサンス	8,300	1,273.00	10,565,900	
ディップ	2,800	8,320.00	23,296,000	
新日本科学	12,900	809.00	10,436,100	
ツクイ	15,900	882.00	14,023,800	
キャリアデザインセンター	5,000	1,033.00	5,165,000	
エムスリー	105,900	2,523.00	267,185,700	
ツカダ・グローバルホールディング	11,100	798.00	8,857,800	
アウトソーシング	5,300	1,657.00	8,782,100	
ウェルネット	3,700	2,897.00	10,718,900	
ディー・エヌ・エー	60,400	2,607.00	157,462,800	
博報堂D Yホールディングス	168,900	1,361.00	229,872,900	
ぐるなび	14,400	2,540.00	36,576,000	
エスアールジータカミヤ	11,100	802.00	8,902,200	
一休	10,100	2,709.00	27,360,900	

ファンコミュニケーションズ	21,800	1,050.00	22,890,000	
P G Mホールディングス	17,300	1,300.00	22,490,000	
バリューコマース	12,200	656.00	8,003,200	
J Pホールディングス	36,300	359.00	13,031,700	
E P Sホールディングス	15,800	1,516.00	23,952,800	
プレステージ・インターナショナル	11,200	868.00	9,721,600	
アミューズ	4,100	3,380.00	13,858,000	
ドリームインキュベータ	4,500	2,698.00	12,141,000	
ケネディクス	174,200	489.00	85,183,800	
電通	135,800	5,760.00	782,208,000	
テイクアンドギヴ・ニーズ	6,100	952.00	5,807,200	
ぴあ	4,900	2,325.00	11,392,500	
イオンファンタジー	4,500	1,983.00	8,923,500	
みらかホールディングス	32,200	5,830.00	187,726,000	
アルプス技研	5,600	2,372.00	13,283,200	
サニックス	17,000	382.00	6,494,000	
オリエンタルランド	132,000	8,855.00	1,168,860,000	
ダスキン	34,600	2,093.00	72,417,800	
明光ネットワークジャパン	14,100	1,379.00	19,443,900	
ファルコホールディングス	7,400	1,353.00	10,012,200	
ラウンドワン	35,400	645.00	22,833,000	
リゾートトラスト	45,300	3,340.00	151,302,000	
ビー・エム・エル	7,300	3,480.00	25,404,000	
もしもしホットライン	22,700	1,396.00	31,689,200	
ユー・エス・エス	147,900	2,194.00	324,492,600	
サイバーエージェント	22,500	6,780.00	152,550,000	
楽天	530,500	2,319.00	1,230,229,500	
セントラルスポーツ	5,600	2,255.00	12,628,000	
フルキャストホールディングス	13,800	802.00	11,067,600	
リゾートソリューション	25,000	255.00	6,375,000	
テクノプロ・ホールディングス	13,200	3,525.00	46,530,000	
リブセンス	9,000	637.00	5,733,000	
ジャパンマテリアル	5,800	1,691.00	9,807,800	
ベクトル	2,800	1,576.00	4,412,800	
リクルートホールディングス	138,300	4,000.00	553,200,000	
リロ・ホールディング	4,200	11,450.00	48,090,000	

東祥	3,200	2,830.00	9,056,000	
エイチ・アイ・エス	19,900	4,200.00	83,580,000	
共立メンテナンス	7,320	6,020.00	44,066,400	
イチネンホールディングス	14,600	1,077.00	15,724,200	
建設技術研究所	8,300	1,271.00	10,549,300	
燦ホールディングス	3,800	1,759.00	6,684,200	
東京テアトル	64,000	141.00	9,024,000	
よみうりランド	28,000	464.00	12,992,000	
東京都競馬	85,000	293.00	24,905,000	
常磐興産	57,000	153.00	8,721,000	
カナモト	17,100	3,520.00	60,192,000	
東京ドーム	84,000	507.00	42,588,000	
西尾レントオール	9,900	3,335.00	33,016,500	
トランス・コスモス	15,900	2,644.00	42,039,600	
乃村工藝社	24,400	1,336.00	32,598,400	
藤田観光	46,000	496.00	22,816,000	
KNT - CTホールディングス	64,000	167.00	10,688,000	
日本管財	6,000	2,801.00	16,806,000	
トーカイ	5,400	4,025.00	21,735,000	
白洋舎	28,000	259.00	7,252,000	
セコム	118,500	8,633.00	1,023,010,500	
セントラル警備保障	7,200	1,382.00	9,950,400	
丹青社	15,300	862.00	13,188,600	
メイテック	16,900	4,050.00	68,445,000	
アサツー ディ・ケイ	23,100	3,340.00	77,154,000	
応用地質	12,900	1,567.00	20,214,300	
船井総研ホールディングス	16,100	1,232.00	19,835,200	
進学会	10,500	535.00	5,617,500	
ベネッセホールディングス	44,700	3,685.00	164,719,500	
イオンディライト	11,700	3,210.00	37,557,000	
ナック	9,900	1,030.00	10,197,000	
ニチイ学館	24,200	1,129.00	27,321,800	
ダイセキ	19,900	2,213.00	44,038,700	
合 計	194,206,125		270,575,807,620	

(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26年 4月14日現在）	（平成27年 4月13日現在）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	1,432,737,846	924,821,897
国債証券	295,284,242,050	226,539,397,100
地方債証券	26,051,137,019	21,574,445,069
特殊債券	37,574,062,716	30,412,475,093
社債券	28,292,330,000	19,333,642,000
未収入金	1,580,784,300	106,399,000
未収利息	1,075,935,233	751,469,926
前払費用	17,585,622	12,822,583
流動資産合計	391,308,814,786	299,655,472,668
資産合計	391,308,814,786	299,655,472,668
負債の部		
流動負債		
未払金	-	100,000,000
未払解約金	1,755,433,402	83,539,217
流動負債合計	1,755,433,402	183,539,217
負債合計	1,755,433,402	183,539,217
純資産の部		
元本等		
元本	333,804,192,306	249,296,427,435
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	55,749,189,078	50,175,506,016
元本等合計	389,553,381,384	299,471,933,451
純資産合計	389,553,381,384	299,471,933,451
負債純資産合計	391,308,814,786	299,655,472,668

注記表

（重要な会計方針の注記）

項 目	自 平成26年 4月15日 至 平成27年 4月13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26年 4月14日現在)	(平成27年 4月13日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	333,804,192,306口	249,296,427,435口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.1670円 (10,000口当たりの純資産額 11,670円)	1口当たり純資産額 1.2013円 (10,000口当たりの純資産額 12,013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26年 4月15日 至 平成27年 4月13日
1. 金融商品に対する取組方針	<p>当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。</p>
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいておりません。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク</p>

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

・金融商品の時価等に関する事項

項目	(平成27年 4月13日現在)
1.貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	<p>(1) 有価証券（国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

（平成26年 4月14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	424,319,458,526円
同期中における追加設定元本額	13,288,591,732円
同期中における一部解約元本額	103,803,857,952円
平成26年 4月14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）	1,777,957,905円
三井住友・DC年金バランス50（標準型）	3,294,248,393円
三井住友・DC年金バランス70（株式重点型）	733,582,831円
スミセイ・DCバランスファンド（機動的資産配分型）	201,285,795円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2020	23,661,203円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2025	32,088,694円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2030	17,096,324円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2035	14,563,174円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2040	3,545,868円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2045	7,689,362円
SMAM・年金グローバル債券ファンド<適格機関投資家限定>	8,270,209,753円
SMAM・バランスファンドVA25<適格機関投資家専用>	47,368,355,910円
SMAM・バランスファンドVA37.5<適格機関投資家専用>	11,629,006,063円
SMAM・バランスファンドVA50<適格機関投資家専用>	28,261,114,240円
SMAM・バランスファンドVL30<適格機関投資家限定>	536,820,482円
SMAM・バランスファンドVL50<適格機関投資家限定>	846,772,156円
世界6資産バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	134,105,024円
SMAM・バランスファンドVA75<適格機関投資家専用>	432,381,453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>	155,445,069円
SMAM・インデックス・バランスVA25<適格機関投資家専用>	2,838,819,813円
SMAM・インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用>	3,260,710,375円
SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用>	8,414,630,895円
SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>	18,091,354,067円
SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定>	1,127,488,024円

三井住友・国内債券インデックスファンド・V A S（適格機関投資家専用）	9,239,400,001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）	53,631,262,645円
S M A M・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	839,474,034円
S M A M・バランスファンドVA20<適格機関投資家専用>	5,759,136,677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）	100,219,596,368円
S M A M・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>	1,320,766,011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>	306,580,645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>	60,544,929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>	3,542,201,692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>	4,223,202,530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>	3,778,238,003円
S M A M・アセットバランスファンドVA20A2<適格機関投資家専用>	1,489,962,413円
S M A M・アセットバランスファンドVA35A2<適格機関投資家専用>	331,605,878円
S M A M・アセットバランスファンドVA50A2<適格機関投資家専用>	28,598,396円
S M A M・アセットバランスファンドVA30L2<適格機関投資家専用>	714,911,949円
S M A M・アセットバランスファンドVA25L2<適格機関投資家専用>	10,026,652,510円
S M A M・アセットバランスファンドVA20T2<適格機関投資家専用>	796,621,203円
S M A M・F G新興国重視型バランス20VA<適格機関投資家限定>	1,702,524円
S M A M・F Gグローバルバランス25VA<適格機関投資家限定>	12,911,515円
S M A M・グローバル・マルチアセット・グロース・ファンド（安定成長型）<適格機関投資家限定>	3,467,685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>	4,421,825円
合計	333,804,192,306円

（平成27年 4月13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	333,804,192,306円
同期中における追加設定元本額	11,022,799,855円
同期中における一部解約元本額	95,530,564,726円
平成27年 4月13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）	2,116,281,256円
三井住友・DC年金バランス50（標準型）	4,124,956,960円
三井住友・DC年金バランス70（株式重点型）	914,322,288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）	271,301,932円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2020	43,286,868円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2025	63,187,940円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2030	36,200,643円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2035	33,403,130円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2040	15,787,737円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2045	28,733,313円
三井住友・DC年金バランスゼロ（債券型）	62,710円
S M A M・年金グローバル債券ファンド<適格機関投資家限定>	6,105,326,703円
S M A M・バランスファンドVA25<適格機関投資家専用>	46,204,449,037円
S M A M・バランスファンドVA37.5<適格機関投資家専用>	11,669,726,446円

S M A M ・ バランスファンド V A 5 0 < 適格機関投資家専用 >	28,586,629,341円
S M A M ・ バランスファンド V L 3 0 < 適格機関投資家限定 >	478,024,861円
S M A M ・ バランスファンド V L 5 0 < 適格機関投資家限定 >	884,002,141円
世界6資産バランスファンド V A < 適格機関投資家限定 >	117,284,750円
S M A M ・ バランスファンド V A 7 5 < 適格機関投資家専用 >	460,536,168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 >	160,703,477円
S M A M ・ インデックス・バランス V A 2 5 < 適格機関投資家専用 >	2,773,183,505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 >	3,304,895,415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 >	8,671,882,295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 >	17,892,859,968円
S M A M ・ バランス V A 株 4 0 T < 適格機関投資家限定 >	395,164,688円
三井住友・国内債券インデックスファンド・ V A S (適格機関投資家専用)	8,917,921,846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)	48,137,643,593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 >	798,888,943円
S M A M ・ バランスファンド V A 2 0 < 適格機関投資家専用 >	1,487,265,935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)	29,710,107,076円
S M A M ・ アセットバランスファンド V A 2 0 A < 適格機関投資家専用 >	1,248,536,514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 >	298,624,568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 >	66,149,894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 >	3,345,254,425円
S M A M ・ アセットバランスファンド V A 2 5 L < 適格機関投資家専用 >	3,883,429,380円
S M A M ・ アセットバランスファンド V A 2 0 T < 適格機関投資家専用 >	3,505,127,124円
S M A M ・ アセットバランスファンド V A 2 0 A 2 < 適格機関投資家専用 >	1,436,559,661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 >	343,161,478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 >	23,823,592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 >	584,638,115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 >	9,610,855,658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 >	531,205,904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 >	730,429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 >	11,128,718円
S M A M ・ グローバル・マルチアセット・グロース・ファンド(安定成長型) < 適格機関投資家限定 >	955,982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 >	2,225,028円
合計	249,296,427,435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350回利付国債（2年）	250,000,000	250,452,500	
	第111回利付国債（5年）	100,000,000	101,127,000	
	第122回利付国債（5年）	1,450,000,000	1,451,000,500	
	第123回利付国債（5年）	1,800,000,000	1,800,882,000	
	第1回利付国債（40年）	120,000,000	149,917,200	
	第2回利付国債（40年）	442,000,000	530,041,980	
	第3回利付国債（40年）	420,000,000	504,138,600	
	第4回利付国債（40年）	610,000,000	732,780,800	
	第5回利付国債（40年）	570,000,000	652,456,200	
	第6回利付国債（40年）	590,000,000	658,186,300	
	第7回利付国債（40年）	620,000,000	654,496,800	
	第280回利付国債（10年）	72,000,000	73,614,960	
	第282回利付国債（10年）	1,020,000,000	1,044,837,000	
	第284回利付国債（10年）	2,417,000,000	2,486,102,030	
	第285回利付国債（10年）	5,063,000,000	5,228,965,140	
	第286回利付国債（10年）	5,320,000,000	5,528,810,000	
	第288回利付国債（10年）	3,155,000,000	3,285,080,650	
	第289回利付国債（10年）	4,289,000,000	4,460,345,550	
	第290回利付国債（10年）	4,277,000,000	4,450,389,580	
	第291回利付国債（10年）	300,000,000	311,283,000	
	第293回利付国債（10年）	3,510,000,000	3,708,595,800	
	第296回利付国債（10年）	3,713,000,000	3,899,503,990	
	第297回利付国債（10年）	2,143,000,000	2,250,150,000	
	第298回利付国債（10年）	3,070,000,000	3,212,202,400	
	第299回利付国債（10年）	4,565,000,000	4,789,643,650	
	第300回利付国債（10年）	1,200,000,000	1,268,472,000	
	第301回利付国債（10年）	3,635,000,000	3,854,081,450	
	第303回利付国債（10年）	4,495,000,000	4,759,171,150	
	第305回利付国債（10年）	4,425,000,000	4,676,782,500	
	第306回利付国債（10年）	2,180,000,000	2,320,697,200	
第307回利付国債（10年）	1,000,000,000	1,059,630,000		
第308回利付国債（10年）	1,205,000,000	1,280,179,950		
第309回利付国債（10年）	1,450,000,000	1,525,516,000		

第310回利付国債(10年)	3,360,000,000	3,524,337,600	
第312回利付国債(10年)	2,320,000,000	2,464,884,000	
第313回利付国債(10年)	2,810,000,000	3,009,622,400	
第315回利付国債(10年)	3,145,000,000	3,357,507,650	
第317回利付国債(10年)	1,240,000,000	1,318,826,800	
第318回利付国債(10年)	1,330,000,000	1,406,049,400	
第319回利付国債(10年)	1,370,000,000	1,459,967,900	
第320回利付国債(10年)	1,450,000,000	1,535,593,500	
第321回利付国債(10年)	1,890,000,000	2,004,288,300	
第322回利付国債(10年)	1,630,000,000	1,717,351,700	
第323回利付国債(10年)	630,000,000	663,799,500	
第324回利付国債(10年)	1,900,000,000	1,988,426,000	
第325回利付国債(10年)	2,910,000,000	3,045,664,200	
第326回利付国債(10年)	1,200,000,000	1,246,800,000	
第327回利付国債(10年)	1,170,000,000	1,224,498,600	
第328回利付国債(10年)	2,180,000,000	2,248,037,800	
第329回利付国債(10年)	4,120,000,000	4,313,763,600	
第330回利付国債(10年)	2,700,000,000	2,827,305,000	
第332回利付国債(10年)	2,290,000,000	2,358,104,600	
第333回利付国債(10年)	3,560,000,000	3,663,987,600	
第334回利付国債(10年)	2,860,000,000	2,941,910,400	
第335回利付国債(10年)	3,260,000,000	3,321,320,600	
第336回利付国債(10年)	1,320,000,000	1,342,941,600	
第337回利付国債(10年)	2,040,000,000	2,036,164,800	
第338回利付国債(10年)	400,000,000	402,496,000	
第2回利付国債(30年)	510,000,000	630,028,500	
第4回利付国債(30年)	300,000,000	393,099,000	
第5回利付国債(30年)	290,000,000	349,887,900	
第7回利付国債(30年)	549,000,000	669,823,920	
第9回利付国債(30年)	100,000,000	107,299,000	
第10回利付国債(30年)	585,000,000	596,612,250	
第11回利付国債(30年)	570,000,000	636,273,900	
第12回利付国債(30年)	620,000,000	732,412,200	
第14回利付国債(30年)	960,000,000	1,179,542,400	
第16回利付国債(30年)	465,000,000	578,957,550	
第18回利付国債(30年)	510,000,000	616,074,900	

第19回利付国債(30年)	505,000,000	609,605,700	
第21回利付国債(30年)	405,000,000	488,531,250	
第22回利付国債(30年)	365,000,000	453,862,900	
第23回利付国債(30年)	369,000,000	458,530,470	
第24回利付国債(30年)	400,000,000	497,124,000	
第25回利付国債(30年)	420,000,000	506,016,000	
第26回利付国債(30年)	583,000,000	713,743,580	
第27回利付国債(30年)	570,000,000	709,746,900	
第28回利付国債(30年)	546,000,000	680,976,660	
第29回利付国債(30年)	642,000,000	789,396,780	
第30回利付国債(30年)	760,000,000	920,550,000	
第31回利付国債(30年)	800,000,000	952,944,000	
第32回利付国債(30年)	890,000,000	1,080,967,300	
第33回利付国債(30年)	1,130,000,000	1,298,550,800	
第34回利付国債(30年)	1,050,000,000	1,252,681,500	
第35回利付国債(30年)	1,040,000,000	1,196,156,000	
第36回利付国債(30年)	915,000,000	1,051,133,700	
第37回利付国債(30年)	910,000,000	1,025,588,200	
第38回利付国債(30年)	740,000,000	815,805,600	
第39回利付国債(30年)	720,000,000	810,770,400	
第40回利付国債(30年)	710,000,000	782,881,500	
第41回利付国債(30年)	720,000,000	776,109,600	
第42回利付国債(30年)	570,000,000	613,416,900	
第43回利付国債(30年)	470,000,000	505,494,400	
第44回利付国債(30年)	960,000,000	1,031,856,000	
第45回利付国債(30年)	890,000,000	912,481,400	
第46回利付国債(30年)	180,000,000	184,573,800	
第35回利付国債(20年)	170,000,000	180,818,800	
第37回利付国債(20年)	302,000,000	324,734,560	
第39回利付国債(20年)	458,000,000	492,730,140	
第40回利付国債(20年)	390,000,000	420,357,600	
第42回利付国債(20年)	480,000,000	528,096,000	
第43回利付国債(20年)	1,120,000,000	1,260,347,200	
第46回利付国債(20年)	775,000,000	859,630,000	
第48回利付国債(20年)	955,000,000	1,085,166,500	
第50回利付国債(20年)	918,000,000	1,016,069,940	

第52回利付国債(20年)	720,000,000	812,073,600	
第54回利付国債(20年)	965,000,000	1,099,144,650	
第56回利付国債(20年)	818,000,000	926,164,140	
第59回利付国債(20年)	1,455,000,000	1,621,961,250	
第61回利付国債(20年)	1,205,000,000	1,280,734,250	
第64回利付国債(20年)	1,025,000,000	1,166,593,500	
第65回利付国債(20年)	1,020,000,000	1,164,493,200	
第69回利付国債(20年)	1,020,000,000	1,184,801,400	
第70回利付国債(20年)	800,000,000	953,080,000	
第72回利付国債(20年)	753,000,000	879,752,490	
第74回利付国債(20年)	664,000,000	777,185,440	
第75回利付国債(20年)	490,000,000	574,760,200	
第78回利付国債(20年)	590,000,000	680,901,300	
第82回利付国債(20年)	640,000,000	752,729,600	
第84回利付国債(20年)	890,000,000	1,039,066,100	
第85回利付国債(20年)	860,000,000	1,014,679,600	
第88回利付国債(20年)	887,000,000	1,067,930,260	
第90回利付国債(20年)	930,000,000	1,111,191,900	
第92回利付国債(20年)	929,000,000	1,101,571,040	
第93回利付国債(20年)	947,000,000	1,113,170,090	
第95回利付国債(20年)	570,000,000	691,370,100	
第97回利付国債(20年)	987,000,000	1,186,176,600	
第99回利付国債(20年)	998,000,000	1,188,428,380	
第100回利付国債(20年)	537,000,000	646,682,250	
第101回利付国債(20年)	505,000,000	620,761,150	
第102回利付国債(20年)	872,000,000	1,072,891,360	
第105回利付国債(20年)	520,000,000	620,427,600	
第106回利付国債(20年)	400,000,000	482,252,000	
第107回利付国債(20年)	908,000,000	1,083,634,440	
第108回利付国債(20年)	280,000,000	326,849,600	
第109回利付国債(20年)	1,020,000,000	1,190,442,000	
第111回利付国債(20年)	846,000,000	1,021,561,920	
第113回利付国債(20年)	1,222,000,000	1,459,642,340	
第114回利付国債(20年)	1,163,000,000	1,389,017,420	
第116回利付国債(20年)	1,310,000,000	1,582,008,400	
第118回利付国債(20年)	350,000,000	412,720,000	

第119回利付国債(20年)	420,000,000	483,394,800	
第120回利付国債(20年)	880,000,000	987,324,800	
第121回利付国債(20年)	700,000,000	815,290,000	
第122回利付国債(20年)	790,000,000	908,500,000	
第123回利付国債(20年)	660,000,000	787,782,600	
第124回利付国債(20年)	600,000,000	707,220,000	
第125回利付国債(20年)	550,000,000	663,943,500	
第126回利付国債(20年)	300,000,000	353,106,000	
第127回利付国債(20年)	560,000,000	651,168,000	
第128回利付国債(20年)	520,000,000	604,110,000	
第129回利付国債(20年)	650,000,000	745,251,000	
第130回利付国債(20年)	730,000,000	836,017,900	
第131回利付国債(20年)	760,000,000	858,716,400	
第132回利付国債(20年)	450,000,000	507,739,500	
第133回利付国債(20年)	960,000,000	1,098,057,600	
第134回利付国債(20年)	580,000,000	662,522,400	
第135回利付国債(20年)	480,000,000	540,777,600	
第136回利付国債(20年)	360,000,000	399,956,400	
第137回利付国債(20年)	260,000,000	292,471,400	
第138回利付国債(20年)	280,000,000	305,908,400	
第139回利付国債(20年)	530,000,000	587,828,300	
第140回利付国債(20年)	1,550,000,000	1,739,472,000	
第141回利付国債(20年)	730,000,000	817,833,600	
第142回利付国債(20年)	700,000,000	795,494,000	
第143回利付国債(20年)	740,000,000	815,554,000	
第144回利付国債(20年)	340,000,000	369,212,800	
第145回利付国債(20年)	1,050,000,000	1,172,083,500	
第146回利付国債(20年)	1,170,000,000	1,303,555,500	
第147回利付国債(20年)	1,650,000,000	1,805,826,000	
第148回利付国債(20年)	1,470,000,000	1,580,691,000	
第149回利付国債(20年)	1,280,000,000	1,373,056,000	
第150回利付国債(20年)	1,640,000,000	1,727,051,200	
第151回利付国債(20年)	1,510,000,000	1,531,940,300	
第152回利付国債(20年)	250,000,000	253,050,000	
国債証券合計	208,044,000,000	226,539,397,100	
地方債証券	第1回東京都公募公債(20年)	100,000,000	110,215,000

第1回東京都公募公債(30年)	100,000,000	117,265,000	
第6回東京都公募公債(20年)	100,000,000	115,559,000	
第7回東京都公募公債(20年)	100,000,000	117,630,000	
第8回東京都公募公債(20年)	100,000,000	120,088,000	
第8回東京都公募公債(30年)	400,000,000	464,272,000	
第13回東京都公募公債(30年)	500,000,000	548,460,000	
第628回東京都公募公債	100,000,000	101,036,000	
第629回東京都公募公債	100,000,000	100,941,000	
第634回東京都公募公債	106,000,000	108,260,980	
第642回東京都公募公債	300,000,000	308,976,000	
第643回東京都公募公債	100,000,000	103,155,000	
第646回東京都公募公債	100,000,000	104,214,000	
第652回東京都公募公債	200,000,000	208,690,000	
第653回東京都公募公債	200,000,000	207,886,000	
第660回東京都公募公債	700,000,000	733,481,000	
第662回東京都公募公債	100,000,000	105,433,000	
第668回東京都公募公債	200,000,000	211,284,000	
平成17年度第4回北海道公募公債	100,000,000	100,251,000	
平成17年度第9回北海道公募公債	100,000,000	100,959,000	
平成19年度第2回北海道公募公債	100,000,000	103,667,000	
平成19年度第7回北海道公募公債	100,000,000	104,119,000	
平成20年度第4回北海道公募公債	100,000,000	105,841,000	
平成20年度第12回北海道公募公債	100,000,000	105,786,000	
第1回神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	119,954,000	
第3回神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	116,793,000	
第7回神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	119,299,000	
第49回神奈川県公募公債(5年)	100,000,000	100,445,000	
第143回神奈川県公募公債	100,000,000	102,883,000	
第144回神奈川県公募公債	300,000,000	308,952,000	
第147回神奈川県公募公債	100,000,000	104,192,000	
第149回神奈川県公募公債	200,000,000	208,716,000	
第157回神奈川県公募公債	115,600,000	121,954,532	
第77回大阪府公募公債(5年)	100,000,000	100,500,000	
第299回大阪府公募公債(10年)	200,000,000	206,762,000	
第303回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	104,044,000	
第306回大阪府公募公債(10年)	200,000,000	208,506,000	

第313回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	104,709,000	
第361回大阪府公募公債(10年)	200,000,000	209,710,000	
平成19年度第1回京都府公募公債	130,260,000	135,829,917	
第5回兵庫県公募公債(15年)	300,000,000	323,931,000	
平成17年度第6回兵庫県公募公債	1,000,000	1,003,540	
平成20年度第5回兵庫県公募公債	100,000,000	105,795,000	
平成21年度第3回兵庫県公募公債	200,000,000	212,128,000	
平成21年度第11回兵庫県公募公債	200,000,000	212,642,000	
平成21年度第23回兵庫県公募公債	200,000,000	210,850,000	
第7回静岡県公募公債(30年)	100,000,000	110,765,000	
平成18年度第2回静岡県公募公債	100,000,000	102,336,000	
平成18年度第5回静岡県公募公債	100,000,000	102,748,000	
平成19年度第7回静岡県公募公債	100,000,000	104,576,000	
平成20年度第1回静岡県公募公債	200,000,000	235,544,000	
平成20年度第7回静岡県公募公債	100,000,000	105,836,000	
平成21年度第5回静岡県公募公債	300,000,000	316,431,000	
平成18年度第4回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	102,629,000	
平成19年度第3回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	104,281,000	
平成21年度第1回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	106,063,000	
平成21年度第7回愛知県公募公債(10年)	200,000,000	212,346,000	
平成19年度第3回広島県公募公債	200,000,000	208,646,000	
平成20年度第1回広島県公募公債	100,000,000	105,334,000	
平成17年度第6回埼玉県公募公債	100,000,000	100,953,000	
平成18年度第7回埼玉県公募公債	100,000,000	103,355,000	
平成19年度第2回埼玉県公募公債	100,000,000	104,125,000	
平成21年度第1回埼玉県公募公債	100,000,000	105,714,000	
平成21年度第4回埼玉県公募公債	200,000,000	211,492,000	
平成18年度第1回福岡県公募公債	100,000,000	102,814,000	
平成19年度第2回福岡県公募公債	100,000,000	104,257,000	
平成18年度第1回千葉県公募公債	200,000,000	204,324,000	
平成18年度第4回千葉県公募公債	200,000,000	205,334,000	
平成19年度第1回千葉県公募公債	100,000,000	103,612,000	
平成21年度第2回千葉県公募公債	345,000,000	365,693,100	
平成19年度第1回岐阜県公募公債(10年)	200,000,000	209,116,000	
第31回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,758,000	
第32回共同発行市場公募地方債	300,000,000	302,850,000	

第33回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,072,000	
第35回共同発行市場公募地方債	400,000,000	405,364,000	
第36回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,463,000	
第38回共同発行市場公募地方債	200,000,000	204,324,000	
第40回共同発行市場公募地方債	300,000,000	307,839,000	
第46回共同発行市場公募地方債	200,000,000	206,190,000	
第55回共同発行市場公募地方債	200,000,000	209,032,000	
第56回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,322,000	
第57回共同発行市場公募地方債	300,000,000	312,777,000	
第62回共同発行市場公募地方債	200,000,000	210,348,000	
第64回共同発行市場公募地方債	300,000,000	316,692,000	
第65回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,166,000	
第73回共同発行市場公募地方債	300,000,000	317,889,000	
第75回共同発行市場公募地方債	900,000,000	957,564,000	
第77回共同発行市場公募地方債	200,000,000	212,324,000	
第115回共同発行市場公募地方債	600,000,000	625,332,000	
平成18年度第2回大阪市公募公債	200,000,000	204,546,000	
平成18年度第3回大阪市公募公債	100,000,000	102,585,000	
平成18年度第6回大阪市公募公債	300,000,000	308,793,000	
平成19年度第5回大阪市公募公債	100,000,000	104,288,000	
平成19年度第10回大阪市公募公債	100,000,000	104,405,000	
平成21年度第4回大阪市公募公債	300,000,000	319,074,000	
第1回名古屋市公募公債(20年)	200,000,000	228,328,000	
第3回名古屋市公募公債(20年)	100,000,000	116,010,000	
第455回名古屋市公募公債(10年)	100,000,000	102,175,000	
第1回京都市公募公債(30年)	100,000,000	121,948,000	
第7回京都市公募公債(20年)	100,000,000	121,761,000	
平成18年度第3回京都市公募公債	200,000,000	206,858,000	
平成19年度第10回神戸市公募公債	100,000,000	104,505,000	
第4回横浜市公募公債(20年)	100,000,000	115,846,000	
第9回横浜市公募公債(20年)	100,000,000	120,230,000	
第14回横浜市公募公債(20年)	100,000,000	121,068,000	
平成17年度第4回横浜市公募公債	200,000,000	202,008,000	
平成17年度第3回横浜市公募公債	100,000,000	100,674,000	
平成18年度第4回横浜市公募公債	300,000,000	310,101,000	
平成18年度第1回横浜市公募公債	100,000,000	101,726,000	

	平成18年度第3回横浜市公募公債	200,000,000	206,086,000	
	平成20年度第6回横浜市公募公債	200,000,000	210,760,000	
	平成18年度第4回札幌市公募公債	200,000,000	204,986,000	
	第2回川崎市15年公募公債	100,000,000	107,679,000	
	第4回川崎市15年公募公債	100,000,000	112,975,000	
	平成19年度第2回北九州市公募公債	100,000,000	104,148,000	
	平成18年度第4回福岡市公募公債	100,000,000	102,668,000	
	平成20年度第5回福岡市公募公債	100,000,000	105,192,000	
	平成19年度第1回広島市公募公債	100,000,000	104,434,000	
	平成21年度第1回千葉市公募公債	200,000,000	211,890,000	
	地方債証券合計	20,397,860,000	21,574,445,069	
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	105,462,000	
	第2回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	200,000,000	209,690,000	
	第3回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	200,000,000	230,950,000	
	第5回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	105,228,000	
	第10回政府保証日本政策投資銀行債券	100,000,000	100,506,000	
	第15回政府保証日本政策投資銀行債券	100,000,000	112,294,000	
	第20回政府保証日本政策投資銀行債券	100,000,000	113,455,000	
	第20回日本政策投資銀行債券	100,000,000	108,031,000	
	第23回政府保証日本政策投資銀行債券	400,000,000	420,472,000	
	第24回日本政策投資銀行債券	100,000,000	100,662,000	
	第27回日本政策投資銀行債券	100,000,000	102,692,000	
	第30回日本政策投資銀行債券	100,000,000	106,982,000	
	第36回日本政策投資銀行債券	100,000,000	118,756,000	
	第51回日本政策投資銀行債券	100,000,000	105,459,000	
	第1回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	144,000,000	145,458,720	
	第2回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	218,856,000	
	第5回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	158,000,000	160,145,640	
	第7回道路債券	100,000,000	117,213,000	
	第8回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,473,000	
	第8回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	120,274,000	
	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	110,421,000	
	第9回道路債券	100,000,000	128,821,000	
	第12回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,211,000	
	第17回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	102,000,000	104,757,060	
	第18回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	127,276,000	

第2 1 回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,219,000	
第2 2 回日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	366,765,000	
第2 5 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	309,456,000	
第2 7 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	500,000,000	516,475,000	
第3 0 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	206,468,000	
第3 4 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,501,000	
第3 6 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	653,000,000	679,453,030	
第3 7 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	312,792,000	
第3 7 回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	121,497,000	
第4 0 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	313,242,000	
第4 0 回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,983,000	
第4 1 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	400,000,000	416,216,000	
第4 2 回道路債券	200,000,000	234,004,000	
第4 4 回日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	210,866,000	
第4 5 回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,965,000	
第4 7 回日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	243,194,000	
第4 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	104,043,000	
第5 2 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	208,882,000	
第5 6 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	208,076,000	
第5 8 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	500,000,000	525,605,000	
第6 0 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,575,000	
第6 2 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,381,000	
第6 7 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	210,802,000	
第6 9 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,500,000	
第8 1 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	237,534,000	
第8 8 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	119,645,000	
第9 0 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	356,085,000	
第9 9 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	120,116,000	
第3 3 9 回政府保証道路債券	100,000,000	100,057,000	
第3 4 0 回政府保証道路債券	100,000,000	107,889,000	
第3 4 1 回政府保証道路債券	100,000,000	100,160,000	
第3 4 6 回政府保証道路債券	1,000,000	1,005,060	
第1 回政府保証地方公営企業等金融機構債券	300,000,000	316,014,000	
第1 回政府保証地方公共団体金融機構債券	300,000,000	317,505,000	
第2 回地方公営企業等金融機構債券(20年)	100,000,000	120,017,000	
第3 回公営企業債券(20年)	100,000,000	105,620,000	

第3回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	106,117,000	
第5回公営企業債券(20年)	100,000,000	114,570,000	
第6回政府保証地方公営企業等金融機構債券	100,000,000	104,747,000	
第6回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	106,164,000	
第7回政府保証地方公営企業等金融機構債券	500,000,000	526,140,000	
第7回地方公営企業等金融機構債券(5年)	100,000,000	100,454,000	
第11回公営企業債券(20年)	100,000,000	116,022,000	
第11回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	106,339,000	
第16回公営企業債券(20年)	100,000,000	116,400,000	
第17回公営企業債券	100,000,000	100,651,000	
第17回公営企業債券(20年)	100,000,000	119,675,000	
第18回公営企業債券(20年)	100,000,000	121,901,000	
第20回公営企業債券	100,000,000	102,304,000	
第22回公営企業債券(20年)	100,000,000	119,864,000	
第24回公営企業債券	100,000,000	103,091,000	
第24回公営企業債券(20年)	200,000,000	239,696,000	
第30回公営企業債券	100,000,000	105,871,000	
第45回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	207,480,000	
第858回政府保証公営企業債券	200,000,000	202,040,000	
第861回政府保証公営企業債券	300,000,000	304,329,000	
第863回政府保証公営企業債券	100,000,000	102,183,000	
第865回政府保証公営企業債券	300,000,000	307,416,000	
第866回政府保証公営企業債券	200,000,000	205,254,000	
第875回政府保証公営企業債券	200,000,000	206,944,000	
第883回政府保証公営企業債券	100,000,000	103,936,000	
第884回政府保証公営企業債券	300,000,000	312,081,000	
第885回政府保証公営企業債券	200,000,000	210,170,000	
第886回政府保証公営企業債券	200,000,000	211,056,000	
第33回株式会社日本政策金融公庫社債	100,000,000	100,006,000	
第34回株式会社日本政策金融公庫社債	200,000,000	201,068,000	
第21回国際協力銀行債券	100,000,000	100,631,000	
第27回国際協力銀行債券	100,000,000	103,200,000	
第8回都市再生債券	200,000,000	200,540,000	
第19回都市再生債券	100,000,000	105,629,000	
第7回本州四国連絡橋債券	100,000,000	117,400,000	
第332回東京交通債券	100,000,000	111,213,000	

第342回東京交通債券	100,000,000	115,061,000	
第13回関西国際空港株式会社社債	100,000,000	105,334,000	
第16回関西国際空港株式会社社債	100,000,000	106,160,000	
第51回政府保証関西国際空港債券	100,000,000	113,866,000	
第14回独立行政法人福祉医療機構債券	200,000,000	208,222,000	
第17回独立行政法人福祉医療機構債券	100,000,000	105,935,000	
第199回政府保証預金保険機構債	300,000,000	300,264,000	
第1回貸付債権担保住宅金融公庫債券	30,200,000	31,448,770	
第3回貸付債権担保住宅金融公庫債券	15,464,000	16,190,962	
第3回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	22,927,000	24,439,264	
第4回貸付債権担保住宅金融公庫債券	15,906,000	16,598,229	
第4回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	34,701,000	37,709,923	
第5回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	23,596,000	25,092,694	
第6回貸付債権担保住宅金融公庫債券	34,392,000	36,114,351	
第7回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	29,916,000	32,136,963	
第8回貸付債権担保住宅金融公庫債券	17,909,000	18,699,861	
第8回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	103,952,000	
第9回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	50,424,000	54,641,463	
第9回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	30,964,000	33,311,690	
第10回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	77,991,000	84,419,798	
第10回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	31,779,000	33,834,783	
第11回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	34,066,000	36,532,719	
第12回貸付債権担保住宅金融公庫債券	20,933,000	21,928,782	
第14回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	38,470,000	40,413,504	
第14回一般担保住宅金融支援機構債券	200,000,000	210,204,000	
第17回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	83,852,000	88,468,891	
第19回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	45,598,000	49,366,218	
第21回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	106,126,000	
第24回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	92,660,000	101,307,957	
第25回一般担保住宅金融支援機構債券	200,000,000	211,232,000	
第26回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	135,126,000	146,434,694	
第27回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	48,183,000	51,984,638	
第28回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	53,143,000	57,208,970	
第29回貸付債権担保住宅金融公庫債券	32,223,000	34,369,696	
第29回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	54,684,000	58,780,925	
第30回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	55,622,000	59,815,898	

第3 2 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	37,390,000	39,715,658	
第3 2 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	111,054,000	118,516,828	
第3 5 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	37,113,000	39,620,725	
第3 5 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	64,916,000	69,469,208	
第3 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	66,241,000	70,801,692	
第3 9 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	33,409,000	35,722,573	
第4 1 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	35,512,000	38,425,404	
第4 3 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	66,100,000	72,265,808	
第4 3 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	78,634,000	83,546,265	
第4 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	76,135,000	81,986,736	
第4 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	150,796,000	162,666,661	
第4 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	75,543,000	80,869,536	
第5 1 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	32,830,000	35,780,432	
第5 1 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	159,108,000	169,313,187	
第5 2 回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	115,880,000	
第5 3 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	33,953,000	36,812,521	
第5 5 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	168,748,000	177,359,210	
第5 7 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	83,990,000	88,433,910	
第5 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	84,381,000	88,627,051	
第5 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	169,386,000	178,339,743	
第6 0 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	255,075,000	267,096,684	
第6 1 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	85,297,000	88,816,354	
第6 7 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	89,576,000	92,221,179	
第6 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	180,158,000	188,027,301	
第7 0 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	178,324,000	185,788,642	
第7 3 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	91,210,000	95,353,670	
第1 3 0 回一般担保住宅金融支援機構債券	200,000,000	221,262,000	
第1 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	67,644,000	72,972,317	
第2 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	70,128,000	75,891,820	
第3 回貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券	27,835,000	30,098,542	
第6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	33,839,000	36,534,953	
第5 回貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券	57,600,000	61,660,800	
第1 0 回農林漁業金融公庫債券	100,000,000	102,541,000	
い第7 2 2 号商工債	100,000,000	100,113,000	
い第7 2 3 号商工債	100,000,000	100,145,000	
い第7 2 5 号商工債	200,000,000	200,252,000	

い第727号商工債	200,000,000	200,742,000	
い第733号商工債	500,000,000	502,495,000	
い第723号農林債	200,000,000	200,308,000	
い第728号農林債	400,000,000	401,280,000	
い第735号農林債	400,000,000	401,556,000	
い第749号農林債	200,000,000	200,656,000	
い第752号農林債	300,000,000	301,038,000	
第281回信金中金債(5年)	100,000,000	100,332,000	
第283回信金中金債(5年)	100,000,000	100,621,000	
第149号商工債(3年)	200,000,000	200,056,000	
第156号商工債(3年)	600,000,000	600,402,000	
第165号商工債(3年)	200,000,000	200,198,000	
第171号商工債(3年)	300,000,000	300,396,000	
第1回政府保証東日本高速道路債券	137,000,000	138,313,830	
第3回政府保証東日本高速道路債券	100,000,000	102,168,000	
第1回政府保証中日本高速道路債券	250,000,000	252,397,500	
第3回政府保証中日本高速道路債券	163,000,000	165,185,830	
第5回中日本高速道路株式会社社債	200,000,000	211,770,000	
第6回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	105,797,000	
第10回政府保証中日本高速道路債券	100,000,000	102,797,000	
第12回政府保証中日本高速道路債券	103,000,000	106,206,390	
第14回政府保証中日本高速道路債券	100,000,000	104,031,000	
第19回政府保証中日本高速道路債券	124,000,000	128,974,880	
第21回政府保証中日本高速道路債券	200,000,000	210,162,000	
第25回政府保証中日本高速道路債券	200,000,000	211,670,000	
第46回中日本高速道路株式会社社債	200,000,000	201,196,000	
第8回政府保証西日本高速道路債券	233,000,000	241,085,100	
第15回政府保証西日本高速道路債券	100,000,000	105,509,000	
第19回政府保証西日本高速道路債券	100,000,000	105,231,000	
第5回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	200,000,000	200,474,000	
第3回東京地下鉄株式会社社債	200,000,000	205,156,000	
特殊債券合計	28,780,654,000	30,412,475,093	
社債券			
第23回ゼネラル・エレクトリック・キャピタル・コーポレーション	200,000,000	200,816,000	
第2回ジェー・ピー・モルガン・チェース・アンド・カンパニー	100,000,000	101,004,000	
第3回ジェー・ピー・モルガン・チェース・アンド・カンパニー	100,000,000	103,792,000	

第10回ジェー・ピー・モルガン・チェース・アンド・カンパニー	100,000,000	100,290,000	
第11回ジェー・ピー・モルガン・チェース・アンド・カンパニー	200,000,000	202,144,000	
第9回ザ・ゴールドマン・サックス・グループ・インク	100,000,000	103,146,000	
第17回シティグループ・インク円貨債券	100,000,000	107,511,000	
第5回オーストラリア・コモンウェルス銀行円貨社債(2011)	300,000,000	302,565,000	
第7回オーストラリア・コモンウェルス銀行円貨社債(2013)	100,000,000	100,239,000	
第8回ウエストバック・バンキング・コーポレーション円貨社債	300,000,000	303,387,000	
第20回コーペラティブ・セントラル・ライファイゼン・ボエレンリーバンク・ビー・エー	100,000,000	100,339,000	
第21回コーペラティブ・セントラル・ライファイゼン・ボエレンリーバンク・ビー・エー	200,000,000	202,392,000	
第10回コーペラティブ・セントラル・ライファイゼン・ボエレンリーバンク・ビー・エー	300,000,000	302,163,000	
第18回コーペラティブ・セントラル・ライファイゼン・ボエレンリーバンク・ビー・エー	300,000,000	303,720,000	
第4回ウォルマート・ストアーズ・インク円貨社債(2010)	100,000,000	100,244,000	
H S B C 銀行 P L C 第2回円貨社債	100,000,000	100,348,000	
第18回 積水ハウス株式会社無担保社債	100,000,000	99,962,000	
第7回キリンホールディングス株式会社無担保社債	200,000,000	212,440,000	
第8回株式会社セブン&アイ・ホールディングス無担保社債	100,000,000	100,904,000	
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	102,799,000	
第38回住友化学株式会社無担保社債	100,000,000	104,582,000	
第48回住友化学株式会社無担保社債	100,000,000	101,213,000	
第35回三菱化学株式会社無担保社債	100,000,000	103,129,000	
第8回株式会社三菱ケミカルホールディングス無担保社債	100,000,000	102,997,000	
第4回花王株式会社無担保社債	100,000,000	102,020,000	
第14回武田薬品工業株式会社無担保社債	100,000,000	101,329,000	
第64回新日本製鐵株式会社無担保社債	100,000,000	105,901,000	
第15回株式会社豊田自動織機無担保社債	100,000,000	100,662,000	
第18回株式会社豊田自動織機無担保社債	100,000,000	107,598,000	
第13回株式会社クボタ無担保社債	100,000,000	101,282,000	
第16回株式会社日立製作所無担保社債	100,000,000	103,287,000	
第55回株式会社東芝無担保社債	100,000,000	101,499,000	
第44回三菱電機株式会社無担保社債	100,000,000	100,327,000	
日本電産株式会社第1回無担保社債	100,000,000	100,547,000	
第36回富士通株式会社無担保社債	100,000,000	100,947,000	
第11回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	102,594,000	

第12回パナソニック株式会社無担保社債	200,000,000	199,924,000	
第13回パナソニック株式会社無担保社債	200,000,000	200,446,000	
第1回日本生命2011基金特定目的会社特定社債 第1回 - B	200,000,000	203,740,000	
第1回住友生命第4回基金流動化特定目的会社特定社債	100,000,000	101,099,000	
第1回日本生命2012基金特定目的会社特定社債	100,000,000	101,711,000	
第1回明治安田生命2013基金特定目的会社特定社債	100,000,000	101,471,000	
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	100,337,000	
第70回伊藤忠商事株式会社無担保社債	100,000,000	100,218,000	
第89回丸紅株式会社無担保社債	100,000,000	102,154,000	
第63回三井物産株式会社無担保社債	100,000,000	119,054,000	
第47回住友商事株式会社無担保社債	100,000,000	101,520,000	
第69回三菱商事株式会社無担保社債	100,000,000	105,619,000	
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	105,540,000	
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	120,721,000	
第8回株式会社東京三菱銀行無担保社債	100,000,000	100,397,000	
第9回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	100,000,000	111,835,000	
株式会社三菱東京UFJ銀行第12回無担保社債	200,000,000	208,898,000	
第25回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	300,000,000	315,771,000	
第110回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	100,000,000	105,696,000	
株式会社三井住友フィナンシャル第1回無担保社債	200,000,000	202,640,000	
第2回株式会社りそな銀行無担保社債	100,000,000	101,170,000	
第4回株式会社りそな銀行無担保社債	100,000,000	109,875,000	
第9回三菱UFJ信託銀行株式会社無担保社債	100,000,000	107,807,000	
第7回住友信託銀行株式会社無担保社債	100,000,000	103,475,000	
第8回住友信託銀行株式会社無担保社債	100,000,000	118,518,000	
第6回株式会社セブン銀行無担保社債	200,000,000	201,122,000	
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	200,000,000	203,030,000	
第9回株式会社三井住友銀行無担保社債	100,000,000	100,535,000	
第20回株式会社三井住友銀行無担保社債	200,000,000	216,090,000	
第24回株式会社三井住友銀行無担保社債	100,000,000	107,412,000	
第8回株式会社みずほ銀行無担保社債	200,000,000	206,910,000	
第9回株式会社みずほ銀行無担保社債	100,000,000	118,602,000	
第16回株式会社日産フィナンシャルサービス無担保社債	100,000,000	100,569,000	
第22回株式会社日産フィナンシャルサービス無担保社債	200,000,000	200,186,000	
第17回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	109,013,000	
第21回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	102,352,000	

第53回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	100,637,000	
第54回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	101,501,000	
第46回日立キャピタル株式会社無担保社債	100,000,000	100,793,000	
第113回オリックス株式会社無担保社債	100,000,000	104,001,000	
第162回オリックス株式会社無担保社債	100,000,000	101,513,000	
第165回オリックス株式会社無担保社債	100,000,000	101,385,000	
第22回三菱UFJリース株式会社無担保社債	200,000,000	200,148,000	
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	106,951,000	
第38回野村ホールディングス株式会社無担保社債	200,000,000	200,662,000	
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	203,200,000	
第34回三井不動産株式会社無担保社債	100,000,000	107,438,000	
第58回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	127,454,000	
第110回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	101,557,000	
第88回住友不動産株式会社無担保社債	100,000,000	100,749,000	
第63回東京急行電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	106,242,000	
第41回小田急電鉄株式会社無担保社債	200,000,000	205,630,000	
第7回東日本旅客鉄道株式会社社債	200,000,000	215,080,000	
第9回東日本旅客鉄道株式会社社債	100,000,000	108,423,000	
第15回東日本旅客鉄道株式会社社債	100,000,000	112,858,000	
第34回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	119,137,000	
第52回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	104,449,000	
第3回西日本旅客鉄道株式会社社債	200,000,000	211,270,000	
第5回西日本旅客鉄道株式会社社債	200,000,000	216,058,000	
第3回東海旅客鉄道株式会社普通社債	100,000,000	106,911,000	
第21回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	101,474,000	
第28回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	102,990,000	
第41回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	118,222,000	
第42回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	200,000,000	240,420,000	
第45回阪急阪神ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	101,450,000	
第51回日本電信電話株式会社電信電話債券	300,000,000	306,948,000	
第53回日本電信電話株式会社電信電話債券	300,000,000	311,493,000	
第15回KDDI株式会社無担保社債	100,000,000	107,215,000	
第15回株式会社エヌ・ティ・ティ・ドコモ無担保社債	200,000,000	211,368,000	
第516回東京電力株式会社社債	100,000,000	100,024,000	
第522回東京電力株式会社社債	300,000,000	303,489,000	
第524回東京電力株式会社社債	100,000,000	101,105,000	

第526回東京電力株式会社社債	300,000,000	303,615,000	
第528回東京電力株式会社社債	100,000,000	101,588,000	
第532回東京電力株式会社社債	100,000,000	101,314,000	
第537回東京電力株式会社社債	100,000,000	101,060,000	
第544回東京電力株式会社社債	100,000,000	102,029,000	
第547回東京電力株式会社社債	100,000,000	101,769,000	
第486回中部電力株式会社社債	200,000,000	209,648,000	
第440回関西電力株式会社社債	100,000,000	102,228,000	
第444回関西電力株式会社社債	100,000,000	100,831,000	
第449回関西電力株式会社社債	100,000,000	102,421,000	
第451回関西電力株式会社社債	100,000,000	102,241,000	
第453回関西電力株式会社社債	100,000,000	102,522,000	
第467回関西電力株式会社社債	100,000,000	104,360,000	
第472回関西電力株式会社社債	100,000,000	104,856,000	
第376回中国電力株式会社社債	100,000,000	101,167,000	
第286回北陸電力株式会社社債	100,000,000	106,964,000	
第303回北陸電力株式会社社債	100,000,000	101,828,000	
第431回東北電力株式会社社債	100,000,000	105,226,000	
第445回東北電力株式会社社債	100,000,000	105,388,000	
第471回東北電力株式会社社債	100,000,000	104,740,000	
第472回東北電力株式会社社債	100,000,000	102,893,000	
第253回四国電力株式会社社債	100,000,000	103,813,000	
第268回四国電力株式会社社債	100,000,000	104,139,000	
第346回九州電力株式会社社債	100,000,000	105,761,000	
第384回九州電力株式会社社債	100,000,000	102,651,000	
第394回九州電力株式会社社債	100,000,000	103,910,000	
第400回九州電力株式会社社債	100,000,000	106,631,000	
第405回九州電力株式会社社債	100,000,000	105,125,000	
第11回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	112,228,000	
第17回東京瓦斯株式会社無担保社債	200,000,000	215,642,000	
第18回大阪瓦斯株式会社無担保社債	200,000,000	217,754,000	
第22回大阪瓦斯株式会社無担保社債	100,000,000	102,838,000	
第27回東邦瓦斯株式会社無担保社債	100,000,000	106,313,000	
第30回東邦瓦斯株式会社無担保社債	100,000,000	102,328,000	
社債券合計	18,600,000,000	19,333,642,000	
合計		297,859,959,262	

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26年 4月14日現在）	（平成27年 4月13日現在）
資産の部		
流動資産		
預金	1,308,469,660	2,910,943,638
コール・ローン	83,171,775	163,933,162
株式	201,006,483,532	194,942,978,250
投資証券	4,403,932,965	4,676,552,833
派生商品評価勘定	619,710	95,328,325
未収入金	3,588,526	5,734,068
未収配当金	336,289,608	305,560,499
未収利息	45	44
差入委託証拠金	1,232,933,842	1,322,688,796
流動資産合計	208,375,489,663	204,423,719,615
資産合計	208,375,489,663	204,423,719,615
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	91,618,073	30,653
前受金	-	95,325,855
未払解約金	19,175,462	95,117,535
流動負債合計	110,793,535	190,474,043
負債合計	110,793,535	190,474,043
純資産の部		
元本等		
元本	92,648,572,780	69,552,562,996
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	115,616,123,348	134,680,682,576
元本等合計	208,264,696,128	204,233,245,572
純資産合計	208,264,696,128	204,233,245,572
負債純資産合計	208,375,489,663	204,423,719,615

注記表

（重要な会計方針の注記）

項 目	自 平成26年 4月15日 至 平成27年 4月13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26年 4月14日現在)	(平成27年 4月13日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	92,648,572,780口	69,552,562,996口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 2.2479円 (10,000口当たりの純資産額 22,479円)	1口当たり純資産額 2.9364円 (10,000口当たりの純資産額 29,364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26年 4月15日 至 平成27年 4月13日
----	--------------------------------

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

金融商品の時価等に関する事項

項目	(平成27年 4月13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26年 4月14日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	2,981,962,394	-	2,890,964,031	90,998,363
	SP500 1406	1,911,202,020	-	1,838,150,819	73,051,201
	SPI200 1406	167,321,700	-	167,941,410	619,710
	FTSE 1406	280,235,905	-	276,036,820	4,199,085
	DJ EUR 1406	623,202,769	-	608,834,982	14,367,787
	合計	2,981,962,394	-	2,890,964,031	90,998,363

(平成27年 4月13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	4,891,203,827	-	4,986,529,682	95,325,855
	SPMINI 1506	3,296,174,528	-	3,337,953,382	41,778,854

市場取引以外の取引	DJ EUR 1506	944,931,631	-	980,416,231	35,484,600
	FTSE 1506	407,277,286	-	421,411,196	14,133,910
	SPI200 1506	242,820,382	-	246,748,873	3,928,491
	為替予約取引				
	買建				
	米ドル	294,526,953	-	294,496,300	30,653
	カナダドル	170,710,838	-	170,698,200	12,638
	ユーロ	31,533,942	-	31,531,500	2,442
	ユーロ	40,854,688	-	40,854,400	288
	英ポンド	29,914,220	-	29,913,200	1,020
	スイスフラン	6,143,450	-	6,143,000	450
	ノルウェークローネ	2,227,365	-	2,226,000	1,365
	香港ドル	11,632,500	-	11,625,000	7,500
	イスラエルシェケル	1,509,950	-	1,505,000	4,950
	売建				
	スウェーデンクローナ	43,031,570	-	43,029,100	2,470
	デンマーククローネ	3,549,039	-	3,549,000	39
	デンマーククローネ	9,735,885	-	9,735,600	285
	オーストラリアドル	14,735,776	-	14,734,400	1,376
ニュージーランドドル	1,811,620	-	1,811,600	20	
シンガポールドル	13,199,250	-	13,198,500	750	
合計	5,228,762,350	-	5,324,055,082	95,297,672	

(注) 1. 時価の算定方法

(1) 株価指数先物取引の時価の算定方法について

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

2) 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

(2) 為替予約取引の時価の算定方法について

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

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

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

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

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

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

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

(平成26年 4月14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	134,912,911,626円
同期中における追加設定元本額	2,599,756,303円
同期中における一部解約元本額	44,864,095,149円
平成26年 4月14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	6,030,191,619円
三井住友・DC年金バランス30（債券重点型）	165,878,208円
三井住友・DC年金バランス50（標準型）	723,581,464円
三井住友・DC年金バランス70（株式重点型）	492,695,144円
スミセイ・DCバランスファンド（機動的資産配分型）	40,150,746円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2020	1,665,787円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2025	3,633,959円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2030	4,270,775円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2035	6,233,060円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2040	1,847,039円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2045	4,997,396円
外国株式指数ファンド	267,622,796円
三井住友・DC全海外株式インデックスファンド	22,868,934円
SMAM・外国株式パッシブ・ファンド（適格機関投資家専用）	17,312,208,084円
バランスファンドVA（安定運用型）＜適格機関投資家限定＞	142,769,242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＞	12,919,741,545円
SMAM・バランスファンドVA25＜適格機関投資家専用＞	6,045,323,536円
SMAM・バランスファンドVA37.5＜適格機関投資家専用＞	3,413,344,536円
SMAM・バランスファンドVA50＜適格機関投資家専用＞	14,371,447,186円
SMAM・バランスファンドVL30＜適格機関投資家限定＞	45,178,569円
SMAM・バランスファンドVL50＜適格機関投資家限定＞	216,935,060円
世界6資産バランスファンドVA＜適格機関投資家限定＞	28,785,480円
SMAM・バランスファンドVA75＜適格機関投資家専用＞	1,768,060,567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＞	118,331,282円
SMAM・インデックス・バランスVA25＜適格機関投資家専用＞	354,482,905円
SMAM・インデックス・バランスVA50＜適格機関投資家専用＞	1,662,624,971円
SMAM・バランスファンドVA40＜適格機関投資家専用＞	2,930,875,055円
SMAM・バランスファンドVA35＜適格機関投資家専用＞	3,871,551,330円
SMAM・バランスVA株40T＜適格機関投資家限定＞	561,605,304円
三井住友・外国株式インデックスファンド・VAS（適格機関投資家専用）	1,594,413,323円
三井住友・5資産バランスファンド・VAS（適格機関投資家専用）	4,505,451,053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 >	322,447,491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 >	738,407,413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）	11,182,162,972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 >	51,522,856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 >	31,255,672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 >	13,620,367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 >	122,713,273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 >	284,533,795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 >	265,678,413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 >	920,858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 >	6,543,715円
合計	92,648,572,780円

(平成27年 4月13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	92,648,572,780円
同期中における追加設定元本額	5,510,215,181円
同期中における一部解約元本額	28,606,224,965円
平成27年 4月13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	7,536,872,456円
三井住友・D C 年金バランス 3 0（債券重点型）	162,631,572円
三井住友・D C 年金バランス 5 0（標準型）	738,732,534円
三井住友・D C 年金バランス 7 0（株式重点型）	513,535,259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）	25,026,205円
スミセイ・D C ターゲットイヤーファンド 2 0 2 0	2,487,376円
スミセイ・D C ターゲットイヤーファンド 2 0 2 5	5,119,215円
スミセイ・D C ターゲットイヤーファンド 2 0 3 0	6,440,950円
スミセイ・D C ターゲットイヤーファンド 2 0 3 5	11,222,861円
スミセイ・D C ターゲットイヤーファンド 2 0 4 0	6,545,571円
スミセイ・D C ターゲットイヤーファンド 2 0 4 5	14,783,806円
外国株式指数ファンド	355,983,276円
三井住友・D C 全海外株式インデックスファンド	59,207,547円
S M A M ・ 外国株式パッシブ・ファンド（適格機関投資家専用）	10,531,630,246円
バランスファンド V A（安定運用型）< 適格機関投資家限定 >	99,636,896円
S M A M ・ バランスファンド V A 安定成長型 < 適格機関投資家限定 >	10,784,829,076円
S M A M ・ バランスファンド V A 2 5 < 適格機関投資家専用 >	4,778,672,948円
S M A M ・ バランスファンド V A 3 7 . 5 < 適格機関投資家専用 >	2,819,741,804円
S M A M ・ バランスファンド V A 5 0 < 適格機関投資家専用 >	12,316,408,076円
S M A M ・ バランスファンド V L 3 0 < 適格機関投資家限定 >	33,293,747円
S M A M ・ バランスファンド V L 5 0 < 適格機関投資家限定 >	186,251,779円
世界 6 資産バランスファンド V A < 適格機関投資家限定 >	20,581,778円
S M A M ・ バランスファンド V A 7 5 < 適格機関投資家専用 >	1,552,629,156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 >	100,458,682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 >	301,622,546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 >	1,388,864,087円

S M A M ・ バランスファンド V A 4 0 < 適格機関投資家専用 >	2,429,381,760円
S M A M ・ バランスファンド V A 3 5 < 適格機関投資家専用 >	3,199,142,106円
S M A M ・ バランス V A 株 4 0 T < 適格機関投資家限定 >	162,766,711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 ）	1,318,349,149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 ）	3,351,983,630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 >	248,652,715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 >	154,509,215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 ）	2,733,922,578円
S M A M ・ アセットバランスファンド V A 2 0 A < 適格機関投資家専用 >	41,820,504円
S M A M ・ アセットバランスファンド V A 3 5 A < 適格機関投資家専用 >	25,845,812円
S M A M ・ アセットバランスファンド V A 5 0 A < 適格機関投資家専用 >	11,292,400円
S M A M ・ アセットバランスファンド V A 2 0 L < 適格機関投資家専用 >	100,030,538円
S M A M ・ アセットバランスファンド V A 2 5 L < 適格機関投資家専用 >	219,965,788円
S M A M ・ アセットバランスファンド V A 2 0 T < 適格機関投資家専用 >	200,839,597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 >	307,726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 >	4,620,979円
S M A M ・ グローバル・マルチアセット・グロース・ファンド（安定成長型）< 適格機関投資家限定 >	73,792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 >	995,848,547円
合計	69,552,562,996円

附属明細表

有価証券明細表

(a) 株式

通貨	銘柄	株数	評価額		備考
			単価	金額	
米ドル	ANADARKO PETROLEUM CORP	26,674	90.10	2,403,327.40	
	ANTERO RESOURCES CORP	2,800	37.35	104,580.00	
	APACHE CORPORATION	20,288	67.84	1,376,337.92	
	BAKER HUGHES INC	23,134	66.54	1,539,336.36	
	CABOT OIL & GAS CORPORATION	22,293	31.00	691,083.00	
	CAMERON INTERNATIONAL CORP	9,764	48.18	470,429.52	
	CHENIERE ENERGY INC	12,235	78.86	964,852.10	
	CHESAPEAKE ENERGY CORPORATION	29,438	14.93	439,509.34	
	CHEVRON CORPORATION	99,868	106.91	10,676,887.88	
	CIMAREX ENERGY CO	4,508	125.01	563,545.08	
	COBALT INTERNATIONAL ENERGY	17,725	10.13	179,554.25	
	CONCHO RESOURCES INC	6,189	120.91	748,311.99	

CONOCOPHILLIPS	64,852	66.53	4,314,603.56
CONSOL ENERGY INC	12,655	28.71	363,325.05
CONTINENTAL RESOURCES, INC.	4,214	49.96	210,531.44
CORE LABORATORIES N.V.	2,101	118.52	249,010.52
DEVON ENERGY CORPORATION	20,088	64.86	1,302,907.68
DIAMOND OFFSHORE DRILLING, INC.	3,594	29.61	106,418.34
ENERGEN CORPORATION	3,391	67.51	228,926.41
ENSCO PLC-CL A	12,455	23.66	294,685.30
EOG RESOURCES INC	28,750	96.59	2,776,962.50
EQT CORPORATION	7,621	84.66	645,193.86
EXXON MOBIL CORPORATION	224,394	85.56	19,199,150.64
FMC TECHNOLOGIES INC	13,132	38.87	510,440.84
HALLIBURTON CO	44,409	46.26	2,054,360.34
HELMERICH & PAYNE INC	6,052	73.08	442,280.16
HESS CORPORATION	13,823	73.12	1,010,737.76
HOLLYFRONTIER CORP	9,973	37.44	373,389.12
KINDER MORGAN INC	94,869	42.93	4,072,726.17
MARATHON OIL CORP	36,135	29.18	1,054,419.30
MARATHON PETROLEUM CORPORATION	15,084	100.42	1,514,735.28
MURPHY OIL CORPORATION	9,071	49.38	447,925.98
NABORS INDUSTRIES LTD	15,776	14.80	233,484.80
NATIONAL-OILWELL VARCO INC.	23,274	54.43	1,266,803.82
NOBLE CORPORATION PLC	13,895	16.23	225,515.85
NOBLE ENERGY INC	19,568	50.92	996,402.56
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	41,413	78.45	3,248,849.85
OCEANEERING INTL INC	5,931	57.75	342,515.25
ONEOK INC	11,351	48.25	547,685.75
PHILLIPS 66	29,268	78.34	2,292,855.12
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	7,623	172.52	1,315,119.96
QEP RESOURCES INC	9,623	22.41	215,651.43
RANGE RESOURCES CORPORATION	8,475	55.25	468,243.75
SCHLUMBERGER LTD	68,504	89.11	6,104,391.44
SOUTHWESTERN ENERGY COMPANY	19,747	24.26	479,062.22
SPECTRA ENERGY CORPORATION	36,292	37.11	1,346,796.12
SUPERIOR ENERGY SERVICES INC	8,900	24.13	214,757.00

TESORO CORPORATION	6,406	85.98	550,787.88
VALERO ENERGY CORP	27,439	59.73	1,638,931.47
WEATHERFORD INTL PLC	42,360	13.82	585,415.20
WHITING PETROLEUM CORP	9,005	35.26	317,516.30
WILLIAMS COS INC	38,024	50.88	1,934,661.12
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	11,203	151.92	1,701,959.76
AIRGAS INC	3,636	106.57	387,488.52
ALBEMARLE CORPORATION	5,355	58.75	314,606.25
ALCOA INC	64,192	13.15	844,124.80
ASHLAND INC	3,213	129.50	416,083.50
AVERY DENNISON CORP	4,362	54.04	235,722.48
BALL CORPORATION	7,163	72.42	518,744.46
CELANESE CORPORATION	7,717	58.92	454,685.64
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	2,703	284.52	769,057.56
CROWN HOLDINGS INC	7,579	54.72	414,722.88
DOW CHEMICAL	62,773	48.39	3,037,585.47
DU PONT (E.I.) DE NEMOURS	48,200	72.23	3,481,486.00
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	7,839	72.30	566,759.70
ECOLAB INC	14,408	116.36	1,676,514.88
FMC CORPORATION	6,826	58.38	398,501.88
FREEMPORT-MCMORAN INC	55,368	18.30	1,013,234.40
INTERNATIONAL PAPER CO	20,738	56.28	1,167,134.64
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	4,523	118.97	538,101.31
LYONDELLBASELL INDU-CL A	22,771	91.41	2,081,497.11
MARTIN MARIETTA MATERIALS	2,750	138.54	380,985.00
MEADWESTVACO CORP	8,309	49.07	407,722.63
MONSANTO CO	25,505	120.14	3,064,170.70
MOSAIC CO/THE	17,488	45.85	801,824.80
NEWMONT MINING CORP	26,108	22.33	582,991.64
NUCOR CORP	17,399	48.22	838,979.78
OWENS-ILLINOIS INC	8,965	24.42	218,925.30
PPG INDUSTRIES INC	7,181	229.50	1,648,039.50
PRAXAIR INC	15,675	122.36	1,917,993.00
ROCK-TENN COMPANY CL A	7,410	63.37	469,571.70
SEALED AIR CORP	11,262	46.30	521,430.60

SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	4,203	290.65	1,221,601.95
SIGMA-ALDRICH	6,398	138.45	885,803.10
VULCAN MATERIALS CO	7,064	83.34	588,713.76
WESTLAKE CHEMICAL CORP	2,815	75.48	212,476.20
3M COMPANY	32,063	167.07	5,356,765.41
AGCO CORP	4,954	47.72	236,404.88
AMETEK INC	13,343	53.52	714,117.36
BE AEROSPACE INC	5,746	63.59	365,388.14
BOEING CO	36,153	154.38	5,581,300.14
CATERPILLAR INC	30,108	82.60	2,486,920.80
CHICAGO BRIDGE & IRON COMPANY NV	5,371	49.62	266,509.02
CUMMINS INC	8,962	136.55	1,223,761.10
DANAHER CORP	33,122	84.98	2,814,707.56
DEERE & CO	18,419	89.07	1,640,580.33
DOVER CORP	8,770	69.40	608,638.00
EATON CORP PLC	24,685	68.69	1,695,612.65
EMERSON ELECTRIC CO	36,517	56.85	2,075,991.45
FASTENAL COMPANY	15,385	40.01	615,553.85
FLOWSERVE CORPORATION	7,650	55.78	426,717.00
FLUOR CORP	8,596	59.13	508,281.48
GENERAL DYNAMICS CORP	14,772	135.91	2,007,662.52
GENERAL ELECTRIC CO	531,625	28.51	15,156,628.75
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	39,180	104.70	4,102,146.00
ILLINOIS TOOL WORKS	19,345	97.54	1,886,911.30
INGERSOLL-RAND PLC	14,598	68.59	1,001,276.82
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	7,290	46.60	339,714.00
JOY GLOBAL INC	4,635	39.30	182,155.50
L-3 COMMUNICATIONS HLDGS INC	4,436	126.04	559,113.44
LOCKHEED MARTIN CORPORATION	14,166	200.40	2,838,866.40
MASCO CORP	19,452	26.57	516,839.64
NORTHROP GRUMMAN CORP	9,973	165.35	1,649,035.55
PACCAR INC	18,990	63.23	1,200,832.65
PALL CORPORATION	6,006	99.36	596,756.16
PARKER HANNIFIN CORPORATIOM	8,049	120.53	970,145.97
PENTAIR PLC-REGISTERED	9,406	62.66	589,379.96

PRECISION CASTPARTS CORP	7,398	213.00	1,575,774.00	
QUANTA SERVICES INC	10,839	28.62	310,212.18	
RAYTHEON COMPANY	16,156	109.96	1,776,513.76	
ROCKWELL AUTOMATION INC	7,074	111.55	789,104.70	
ROCKWELL COLLINS INC.	6,635	98.28	652,087.80	
ROPER INDUSTRIES INC	5,376	170.31	915,586.56	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	9,135	58.48	534,214.80	
SNAP-ON INC	3,055	148.36	453,239.80	
SPX CORP	1,648	82.86	136,553.28	
STANLEY BLACK & DECKER INC	8,107	96.50	782,325.50	
TEXTRON INC	14,093	46.12	649,969.16	
TRANSDIGM GROUP INC	2,733	223.20	610,005.60	
UNITED RENTALS INC	5,162	95.96	495,345.52	
UNITED TECHNOLOGIES CORP	45,923	118.46	5,440,038.58	
WABTEC CORP	5,100	95.80	488,580.00	
WW GRAINGER INC	3,149	234.71	739,101.79	
XYLEM INC	9,969	35.20	350,908.80	
CINTAS CORP	5,399	82.32	444,472.67	
DUN & BRADSTREET CORP	1,961	130.91	256,714.51	
EQUIFAX INC	6,645	93.41	620,709.45	
IHS INC-CLASS A	3,519	123.44	434,385.36	
MANPOWERGROUP	4,458	84.59	377,102.22	
NIELSEN NV	17,675	46.01	813,226.75	
REPUBLIC SERVICES INC	15,678	41.02	643,111.56	
ROBERT HALF INTL INC	7,741	59.50	460,589.50	
STERICYCLE, INC.	4,628	141.93	656,852.04	
THE ADT CORPORATION	9,496	41.91	397,977.36	
TOWERS WATSON & CO-CL A	3,710	134.15	497,696.50	
TYCO INTERNATIONAL PLC	22,745	43.45	988,270.25	
VERISK ANALYTICS INC-CLASS A	8,004	72.86	583,171.44	
WASTE MANAGEMENT INC	22,441	55.14	1,237,396.74	
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	8,772	47.73	418,687.56	
C.H.ROBINSON WORLDWIDE, INC.	7,839	72.06	564,878.34	
CSX CORPORATION	51,811	33.75	1,748,621.25	
DELTA AIR LINES INC	11,501	43.23	497,188.23	

EXPEDITORS INTL WASH INC	10,140	46.87	475,261.80	
FEDEX CORP	14,315	174.37	2,496,106.55	
HERTZ GLOBAL HOLDINGS INC	23,601	20.56	485,236.56	
J.B. HUNT TRANSPORT SERVICES INC	4,585	87.66	401,944.02	
KANSAS CITY SOUTHERN	6,021	106.33	640,212.93	
NORFOLK SOUTHERN CORP	16,090	106.35	1,711,171.50	
SOUTHWEST AIRLINES	9,271	42.82	396,984.22	
UNION PACIFIC CORP	47,411	111.42	5,282,533.62	
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS INC	5,097	61.05	311,171.85	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	37,207	96.79	3,601,265.53	
AUTOLIV INC	4,744	120.38	571,082.72	
BORGWARNER INC	11,568	61.31	709,234.08	
DELPHI AUTOMOTIVE PLC	15,483	84.71	1,311,564.93	
FORD MOTOR COMPANY	190,154	16.03	3,048,168.62	
GENERAL MOTORS CO	68,495	36.57	2,504,862.15	
HARLEY-DAVIDSON INC	11,382	62.51	711,488.82	
JOHNSON CONTROLS INC	35,663	50.09	1,786,359.67	
TESLA MOTORS INC	4,449	210.90	938,294.10	
TRW AUTOMOTIVE HOLDINGS CORP	5,615	105.08	590,024.20	
COACH INC	13,743	43.03	591,361.29	
D.R.HORTON INC	17,613	28.61	503,907.93	
FOSSIL GROUP INC	2,431	85.36	207,510.16	
GARMIN LTD	5,408	46.66	252,337.28	
HANESBRANDS INC	22,132	34.50	763,554.00	
HASBRO INC	6,173	64.21	396,399.19	
JARDEN CORP	9,645	53.71	518,032.95	
LEGGETT & PLATT INC	7,490	45.27	339,072.30	
LENNAR CORP-CL A	8,712	50.50	439,956.00	
LULULEMON ATHLETICA INC	5,461	68.86	376,044.46	
MATTEL INC	18,436	24.23	446,704.28	
MICHAEL KORS HOLDINGS LIMITED	11,029	64.60	712,473.40	
MOHAWK INDUSTRIES INC	3,089	183.86	567,943.54	
NEWELL RUBBERMAID INC	13,702	40.04	548,628.08	
NIKE INC -CL B	36,345	99.97	3,633,409.65	
POLARIS INDUSTRIES INC	3,113	143.54	446,840.02	

PULTE GROUP INC	16,249	22.32	362,677.68	
PVH CORP	4,700	110.38	518,786.00	
RALPH LAUREN CORPORATION	3,332	138.12	460,215.84	
TOLL BROTHERS INC	9,216	39.68	365,690.88	
UNDER ARMOUR INC	9,441	83.75	790,683.75	
VF CORP	17,872	75.58	1,350,765.76	
WHIRLPOOL CORP	3,951	195.67	773,092.17	
CARNIVAL CORP	20,261	48.33	979,214.13	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	1,693	683.02	1,156,352.86	
DARDEN RESTAURANTS INC	7,021	68.78	482,904.38	
H&R BLOCK INC	13,674	31.79	434,696.46	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS INC	21,492	30.95	665,177.40	
LAS VEGAS SANDS CORP	20,656	59.29	1,224,694.24	
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	11,607	80.32	932,274.24	
MCDONALD'S CORPORATION	51,822	97.80	5,068,191.60	
MGM MIRAGE	21,220	22.55	478,511.00	
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDINGS	5,213	54.51	284,160.63	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	8,495	81.24	690,133.80	
STARBUCKS CORP	39,548	48.17	1,905,027.16	
STARBUCKS CORP-NEW	39,548	48.17	1,905,027.16	
STARWOOD HOTELS & RESORTS	9,045	84.35	762,945.75	
WYNDHAM WORLDWIDE CORP	6,945	90.90	631,300.50	
WYNN RESORTS LTD	4,424	136.02	601,752.48	
YUM! BRANDS INC	23,554	80.02	1,884,791.08	
CABLEVISION SYSTEMS-NY GRP-A	9,712	18.31	177,826.72	
CBS CORP-CL B	25,343	61.60	1,561,128.80	
CHARTER COMMUNICATTION-A	4,051	191.81	777,022.31	
COMCAST CORP-CL A	113,643	59.81	6,796,987.83	
COMCAST CORP-SPECIAL CL A	22,196	59.53	1,321,327.88	
DIRECTV	24,960	87.32	2,179,507.20	
DISCOVERY COMMUNICATIONS INC-A	8,023	33.04	265,079.92	
DISCOVERY COMMUNICATIONS INC-C	15,914	31.82	506,383.48	
DISH NETWORK CORP.	12,039	71.83	864,761.37	
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	21,848	21.81	476,504.88	
LIBERTY GLOBAL PLC-A	12,509	52.55	657,347.95	

LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	33,994	50.49	1,716,357.06
LIBERTY MEDIA CORP-A	5,806	39.39	228,698.34
LIBERTY MEDIA CORP-C	11,612	39.06	453,564.72
NEWS CORP-CLASS A	20,668	15.92	329,034.56
OMNICOM GROUP	13,706	78.62	1,077,565.72
SCRIPPS NETWORKS INTERACTIVE	4,192	69.01	289,289.92
SIRIUS XM HOLDINGS INC	126,880	3.94	500,541.60
THE WALT DISNEY CO.	85,313	106.95	9,124,225.35
TIME WARNER CABLE, INC.	14,596	160.81	2,347,182.76
TIME WARNER INC	44,034	85.49	3,764,466.66
TWENTY-FIRST CE CL-A	72,983	34.34	2,506,236.22
TWENTY-FIRST CE CL-B	23,396	33.37	780,724.52
VIACOM INC-CLASS B	19,216	69.26	1,330,996.24
ADVANCE AUTO PARTS	3,928	150.20	589,985.60
AMAZON.COM INC	20,779	382.65	7,951,084.35
AUTONATION INC	4,300	65.46	281,478.00
AUTOZONE INC	1,646	701.73	1,155,047.58
BED BATH & BEYOND INC	9,378	73.43	688,626.54
BEST BUY COMPANY INC	15,681	38.58	604,972.98
CARMAX INC	11,964	73.19	875,645.16
DICK'S SPORTING GOODS INC	5,100	58.65	299,115.00
DOLLAR GENERAL CORP	16,556	76.07	1,259,414.92
DOLLAR TREE INC	10,488	82.87	869,140.56
EXPEDIA INC	5,056	99.19	501,529.92
FAMILY DOLLAR STORES	5,804	79.74	462,810.96
FOOT LOCKER INC	7,571	62.02	469,553.42
GAMESTOP CORP-CL A	6,747	40.40	272,578.80
GAP INC/THE	12,463	41.14	512,727.82
GENUINE PARTS CO	8,219	93.27	766,586.13
HOME DEPOT INC	69,757	115.24	8,038,796.68
KOHL'S CORP	10,719	78.40	840,369.60
L BRANDS INC	13,442	94.68	1,272,688.56
LIBERTY INTERACTIVE CORPORATION-A	24,098	29.40	708,481.20
LKQ CORPORATION	16,516	25.84	426,856.02
LOWE'S COMPANIES INC	51,990	74.90	3,894,051.00

MACY'S INC	18,683	69.16	1,292,116.28
NETFLIX INC	3,093	454.57	1,405,985.01
NORDSTROM INC	7,535	80.24	604,608.40
O'REILLY AUTOMOTIVE INC NEW	5,427	220.01	1,194,021.40
PRICELINE GROUP INC/THE	2,757	1,189.50	3,279,451.50
ROSS STORES INC	11,444	103.45	1,183,939.02
SIGNET JEWELERS LTD	4,054	137.02	555,479.08
STAPLES INC	34,362	16.72	574,532.64
TARGET CORP	32,066	83.57	2,679,755.62
TIFFANY & CO	7,034	89.45	629,191.30
TJX COMPANIES INC	36,285	68.53	2,486,611.05
TRACTOR SUPPLY COMPANY	7,513	87.28	655,734.64
TRIPADVISOR INC-W/I	6,384	82.93	529,425.12
ULTA SALON COSMETICS & FRAGRANCE INC	3,420	151.68	518,745.60
URBAN OUTFITTERS, INC.	5,837	43.85	255,952.45
COSTCO WHOLESALE CORP	22,984	149.63	3,439,210.84
CVS HEALTH CORPORATION	60,426	102.54	6,196,082.04
KROGER CO	25,126	77.07	1,936,460.82
SYSCO CORP	31,258	38.17	1,193,117.86
WAL-MART STORES INC	85,190	80.65	6,870,573.50
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	45,794	92.02	4,213,963.88
WHOLE FOODS MARKET INC	19,016	51.53	979,894.48
ALTRIA GROUP INC	104,694	52.51	5,497,481.94
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	34,387	47.96	1,649,200.52
BROWN-FORMAN CORPORATION	6,092	93.60	570,211.20
BUNGE LIMITED	7,962	84.91	676,053.42
CAMPBELL SOUP CO	10,096	45.82	462,598.72
COCA-COLA CO/THE	208,798	40.88	8,535,662.24
COCA-COLA ENTERPRISES INC	12,958	45.72	592,439.76
CONAGRA FOODS INC	22,612	37.85	855,864.20
CONSTELLATION BRANDS INC-A	8,880	121.70	1,080,696.00
DR.PEPPER SNAPPLE GROUP, INC	9,814	78.72	772,558.08
GENERAL MILLS INC	31,370	56.49	1,772,091.30
HORMEL FOODS CORPORATION	8,006	57.96	464,027.76
JM SMUCKER CO/THE-NEW COM	5,227	116.75	610,252.25

KELLOGG CO	14,388	65.73	945,723.24	
KEURIG GREEN MOUNTAIN INC	6,718	116.54	782,915.72	
KRAFT FOODS GROUP INC	30,683	89.27	2,739,071.41	
LORILLARD INC	19,578	70.51	1,380,444.78	
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	6,282	77.75	488,425.50	
MEAD JOHNSON NUTRITION COMPANY	10,770	102.68	1,105,863.60	
MOLSON COORS BREWING COMPANY	8,238	77.90	641,740.20	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	88,598	37.40	3,313,565.20	
MONSTER BEVERAGE CORPORATION	7,792	138.34	1,077,945.28	
PEPSICO INC	79,644	96.20	7,661,752.80	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL INC.	82,598	77.90	6,434,384.20	
REYNOLDS AMERICAN INC	16,981	74.36	1,262,707.16	
THE HERSHEY COMPANY	8,367	100.09	837,453.03	
TYSON FOODS INC-CL A	15,863	39.38	624,684.94	
AVON PRODUCTS INC	24,724	7.90	195,319.60	
CHURCH & DWIGHT CO INC	7,120	85.90	611,608.00	
CLOROX COMPANY	6,694	110.67	740,824.98	
COLGATE-PALMOLIVE COMPANY	48,105	69.61	3,348,589.05	
ENERGIZER HOLDINGS INC	3,347	140.64	470,722.08	
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	11,856	83.44	989,264.64	
KIMBERLY-CLARK CORP	20,111	106.86	2,149,061.46	
PROCTER & GAMBLE CO	143,338	83.35	11,947,222.30	
ABBOTT LABORATORIES	79,142	47.15	3,731,545.30	
AETNA INC	18,890	107.91	2,038,419.90	
AMERISOURCEBERGEN CORP	11,953	115.35	1,378,778.55	
ANTHEM INC	14,609	153.92	2,248,617.28	
BARD(C.R.) INC	4,173	170.48	711,413.04	
BAXTER INTERNATIONAL INC	28,855	70.57	2,036,297.35	
BECTON DICKINSON & CO	10,800	143.21	1,546,668.00	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	70,119	18.10	1,269,153.90	
CARDINAL HEALTH INC	17,165	90.52	1,553,775.80	
CERNER CORP	16,750	75.00	1,256,250.00	
CIGNA CORP	13,861	133.31	1,847,809.91	
COOPER COMPANIES INC (THE)	2,544	187.25	476,364.00	
DAVITA HEALTHCARE PARTNERS INC	9,154	81.90	749,712.60	

DENTSPLY INTERNATIONAL INC	7,135	51.70	368,879.50	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	5,929	141.68	840,020.72	
EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO	39,125	88.85	3,476,256.25	
HCA HOLDINGS, INC.	16,517	78.24	1,292,290.08	
HENRY SCHEIN INC	4,519	141.85	641,042.74	
HOLOGIC INC	11,900	33.30	396,270.00	
HUMANA INC.	8,217	178.48	1,466,570.16	
INTUITIVE SURGICAL INC	1,962	530.36	1,040,566.32	
LABORATORY CRP OF AMR HLDGS	5,101	126.07	643,083.07	
MALLINCKRODT PLC	6,202	129.09	800,616.18	
MCKESSON CORP	12,331	224.34	2,766,336.54	
MEDTRONIC PLC	74,813	77.93	5,830,177.09	
OMNICARE INC	5,368	78.71	422,515.28	
PATTERSON COS INC	5,002	48.33	241,746.66	
QUEST DIAGNOSTICS	7,894	76.24	601,838.56	
QUINTILES TRANSNATIONAL HOLDINGS INC	3,573	67.63	241,641.99	
RESMED INC	8,017	74.82	599,831.94	
ST JUDE MEDICAL INC	15,166	68.17	1,033,866.22	
STRYKER CORP	18,151	93.74	1,701,474.74	
UNITEDHEALTH GROUP INC	50,767	119.00	6,041,273.00	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	4,894	118.44	579,645.36	
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	5,543	94.39	523,203.77	
ZIMMER HOLDINGS INC	8,998	117.45	1,056,815.10	
ABBVIE INC	84,003	62.00	5,208,186.00	
ACTAVIS PLC	19,965	294.79	5,885,482.35	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	18,186	43.55	792,000.30	
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	10,538	182.68	1,925,081.84	
ALKERMES PLC	7,277	63.52	462,235.04	
AMGEN INC	40,147	163.38	6,559,216.86	
BIOGEN INC	12,465	425.65	5,305,727.25	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	8,437	122.20	1,031,001.40	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	87,537	64.64	5,658,391.68	
CELGENE CORP	42,205	117.07	4,940,939.35	
ELI LILLY & CO	52,897	73.92	3,910,146.24	
ENDO INTERNATIONAL PLC	8,752	94.46	826,713.92	

GILEAD SCIENCES INC	79,882	101.77	8,129,591.14
HOSPIRA INC	9,208	87.75	808,002.00
ILLUMINA INC	7,426	188.16	1,397,276.16
INCYTE CORP	8,151	93.81	764,645.31
ISIS PHARMACEUTICALS INC	5,769	65.70	379,023.30
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	3,229	183.96	594,006.84
JOHNSON & JOHNSON	147,998	102.06	15,104,675.88
MEDIVATION INC	4,057	132.44	537,309.08
MERCK & CO. INC.	150,501	57.25	8,616,182.25
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL INC	1,429	331.15	473,213.35
MYLAN NV	19,926	70.24	1,399,602.24
PERRIGO CO PLC	7,239	198.55	1,437,303.45
PFIZER INC	333,881	35.44	11,832,742.64
PHARMACYCLICS INC	3,386	258.35	874,773.10
REGENERON PHARMACEUTICALS	4,223	461.39	1,948,449.97
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	21,274	133.73	2,844,972.02
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	12,879	128.47	1,654,565.13
WATERS CORP	4,743	125.77	596,527.11
ZOETIS INC	26,591	47.17	1,254,297.47
BANK OF AMERICA CORP	556,636	15.72	8,750,317.92
BB & T CORPORATION	38,515	39.04	1,503,625.60
CIT GROUP INC	9,868	47.20	465,769.60
CITIGROUP INC	160,378	52.43	8,408,618.54
COMERICA INC	9,522	45.60	434,203.20
FIFTH THIRD BANCORP	44,440	19.05	846,582.00
FIRST REPUBLIC BANK/CA	7,100	57.00	404,700.00
HUDSON CITY BANCORP INC	24,896	9.58	238,503.68
HUNTINGTON BANCSHARES INC	40,118	11.05	443,303.90
JPMORGAN CHASE & CO	198,147	61.70	12,225,669.90
KEYCORP	43,541	14.06	612,186.46
M & T BANK CORP	6,067	124.39	754,674.13
NEW YORK COMMUNITY BANCORP	21,566	17.00	366,622.00
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL INC	18,000	15.07	271,260.00
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	27,928	93.48	2,610,709.44
REGIONS FINANCIAL CORPORATION	71,995	9.59	690,432.05

SUNTRUST BANKS INC	27,050	41.50	1,122,575.00	
US BANCORP	95,006	43.75	4,156,512.50	
WELLS FARGO & COMPANY	261,227	54.32	14,189,850.64	
AFFILIATED MANAGERS GROUP	3,032	217.70	660,066.40	
ALLY FINANCIAL INC	23,374	20.75	485,010.50	
AMERICAN EXPRESS COMPANY	49,664	79.59	3,952,757.76	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	9,779	124.53	1,217,778.87	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP(THE)	59,314	40.86	2,423,570.04	
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	61,214	143.50	8,784,209.00	
BLACKROCK INC	6,966	369.45	2,573,588.70	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	29,429	80.61	2,372,271.69	
CME GROUP INC.	16,615	92.27	1,533,066.05	
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	23,482	57.96	1,361,016.72	
EATON VANCE CORP	5,530	41.92	231,817.60	
FRANKLIN RESOURCES INC	21,850	51.73	1,130,300.50	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	20,890	195.64	4,086,919.60	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	5,886	231.91	1,365,022.26	
INVESCO LIMITED	22,740	40.00	909,600.00	
LEGG MASON INC	5,828	54.43	317,218.04	
LEUCADIA NATIONAL CORPORATION	15,223	23.07	351,194.61	
MCGRAW HILL FINANCIAL INC	14,059	105.11	1,477,741.49	
MOODY'S CORP	10,029	105.73	1,060,366.17	
MORGAN STANLEY	77,328	36.24	2,802,366.72	
NASDAQ STOCK MARKET INC	6,446	50.58	326,038.68	
NAVIENT CORPORATION	22,825	20.26	462,434.50	
NORTHERN TRUST CORP	11,922	70.86	844,792.92	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	6,761	55.89	377,872.29	
SCHWAB (CHARLES) CORP	62,897	30.70	1,930,937.90	
SEI INVESTMENTS COMPANY	6,961	43.49	302,733.89	
STATE STREET CORP	22,124	76.35	1,689,167.40	
SYNCHRONY FINANCIAL	8,299	30.59	253,866.41	
T ROWE PRICE GROUP INC	14,150	80.98	1,145,867.00	
TD AMERITRADE HOLDING CORPORATION	15,306	37.44	573,056.64	
ACE LIMITED	17,452	111.90	1,952,878.80	
AFLAC INC	23,877	64.52	1,540,544.04	

ALLEGHANY CORPORATION	917	485.88	445,551.96
ALLSTATE CORP	21,817	72.03	1,571,478.51
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	74,505	56.59	4,216,237.95
AON PLC	14,714	98.25	1,445,650.50
ARCH CAPITAL GROUP LTD.	7,373	62.93	463,982.89
ASSURANT INC	3,895	61.79	240,672.05
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	5,460	52.32	285,667.20
CHUBB CORP	12,364	100.51	1,242,705.64
CINCINNATI FINANCIAL CORP	8,693	53.52	465,249.36
EVEREST RE GROUP LTD	2,388	179.96	429,744.48
FNF GROUP	12,345	37.19	459,110.55
GENWORTH FINANCIAL INC-CL A	29,830	7.73	230,585.90
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	23,643	42.56	1,006,246.08
LINCOLN NATIONAL CORP	13,994	56.81	794,999.14
LOEWS CORPORATION	17,058	41.17	702,277.86
MARSH & MCLENNAN COS	29,131	57.12	1,663,962.72
METLIFE INC	50,976	50.82	2,590,600.32
PARTNERRE LTD	2,297	118.67	272,584.99
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	15,657	50.28	787,233.96
PROGRESSIVE CORP	30,356	26.90	816,576.40
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	23,755	80.34	1,908,476.70
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	2,159	102.06	220,347.54
TORCHMARK CORPORATION	6,511	55.86	363,704.46
TRAVELERS COS INC(THE)	17,251	107.65	1,857,070.15
UNUM GROUP	13,692	33.88	463,884.96
VOYA FINANCIAL INC	10,875	43.83	476,651.25
W.R.BERKLEY CORPORATION	6,084	50.41	306,694.44
WILLIS GROUP HOLDINGS PLC	8,004	49.33	394,837.32
XL GROUP PLC	13,675	37.86	517,735.50
CBRE GROUP INC-A	16,260	38.51	626,172.60
CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP	17,363	84.69	1,470,472.47
REALOGY HOLDINGS CORP	7,236	47.11	340,887.96
WEYERHAEUSER CO	28,486	32.25	918,673.50
ACCENTURE PLC-CL A	33,117	94.69	3,135,848.73
ACTIVISION BLIZZARD INC	28,083	22.92	643,802.77

ADOBE SYSTEMS INC	25,320	76.53	1,937,739.60
AKAMAI TECHNOLOGIES	9,769	71.45	697,995.05
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	3,459	300.82	1,040,536.38
ANSYS INC	5,145	88.56	455,641.20
AUTODESK INC	12,252	62.74	768,690.48
AUTOMATIC DATA PROCESSING	25,852	86.34	2,232,061.68
CA INC	16,710	31.54	527,116.95
CITRIX SYSTEMS INC	8,604	63.80	548,935.20
COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS CORPORATION	32,603	62.80	2,047,468.40
COMPUTER SCIENCES CORP	7,396	65.85	487,026.60
EBAY INC	58,718	57.34	3,366,890.12
ELECTRONIC ARTS INC	16,331	58.35	952,995.50
EQUINIX INC	2,917	239.65	699,059.05
FACEBOOK INC-A	105,640	82.04	8,666,705.60
FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES	15,204	65.50	995,862.00
FIREEYE INC	4,072	43.24	176,073.28
FISERV INC	12,506	79.05	988,661.83
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	4,015	157.85	633,767.75
GOOGLE INC-CL A	15,060	548.54	8,261,012.40
GOOGLE INC-CL C	15,213	540.01	8,215,172.13
INTL BUSINESS MACHINES CORP	49,619	162.86	8,080,950.34
INTUIT INC	14,367	98.89	1,420,752.63
LINKEDIN CORP-A	5,685	265.35	1,508,514.75
MASTERCARD INC-CL A	52,953	88.57	4,690,047.21
MICROSOFT CORP	415,099	41.72	17,317,930.28
NETSUITE INC	2,000	96.03	192,060.00
NUANCE COMMUNICATIONS INC	15,621	14.22	222,130.62
ORACLE CORPORATION	188,565	43.51	8,204,463.15
PAYCHEX INC	17,968	49.28	885,463.04
RACKSPACE HOSTING INC	6,279	52.94	332,410.26
RED HAT INC	10,431	75.75	790,148.25
SALESFORCE.COM, INC.	31,496	67.64	2,130,389.44
SERVICENOW INC	6,613	82.34	544,514.42
SYMANTEC CORPORATION	36,626	25.58	936,893.08
SYNOPSYS INC	7,563	47.80	361,511.40

TERADATA CORP	8,411	44.86	377,317.46	
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	9,245	38.26	353,713.70	
TWITTER INC	20,164	51.94	1,047,318.16	
VANTIV INC-CL A	7,426	39.34	292,138.84	
VERISIGN INC	6,641	67.75	449,927.75	
VISA INC	104,576	66.34	6,937,571.84	
VMWARE INC	4,729	83.38	394,304.02	
WESTERN UNION COMPANY	29,091	20.62	599,856.42	
WORKDAY INC-CLASS A	5,247	88.70	465,408.90	
XEROX CORP	56,002	13.26	742,586.52	
YAHOO! INC	46,923	45.18	2,119,981.14	
ZILLOW GROUP INC	2,592	97.64	253,095.84	
AMPHENOL CORPORATION -CL A	16,748	59.54	997,175.92	
APPLE INC	310,555	127.10	39,471,540.50	
ARROW ELECTRONICS INC	5,088	61.21	311,436.48	
AVNET INC	6,544	45.03	294,676.32	
CISCO SYSTEMS INC	270,941	28.04	7,597,185.64	
CORNING INC	68,857	22.42	1,543,773.94	
EMC CORP/MASS	106,540	25.83	2,751,928.20	
F5 NETWORKS INC	3,788	113.82	431,150.16	
FLEXTRONICS INTL LTD	27,993	12.84	359,430.12	
FLIR SYSTEMS INC	8,521	31.19	265,812.59	
HARRIS CORP	5,694	81.00	461,214.00	
HEWLETT-PACKARD CO	98,531	32.11	3,163,830.41	
JUNIPER NETWORKS INC	19,267	23.77	457,976.59	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	12,148	62.53	759,614.44	
NETAPP INC	17,007	35.47	603,238.29	
PALO ALTO NETWORKS INC	3,533	147.97	522,778.01	
QORVO INC	7,825	73.58	575,763.50	
QUALCOMM INC	88,567	69.16	6,125,293.72	
SANDISK CORP	12,150	70.68	858,762.00	
SEAGATE TECHNOLOGY	17,364	55.58	965,091.12	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	10,252	99.64	1,021,509.28	
TE CONNECTIVITY LTD	21,812	71.00	1,548,652.00	
TRIMBLE NAVIGATION LTD	14,945	25.76	384,983.20	

WESTERN DIGITAL CORP	11,843	95.89	1,135,625.27
AT&T INC	274,536	32.77	8,996,544.72
CENTURYLINK INC	29,871	35.82	1,069,979.22
FRONTIER COMMUNICATIONS CORPORATION	56,000	7.43	416,080.00
LEVEL 3 COMMUNICATIONS INC	15,558	53.68	835,153.44
SBA COMMUNICATIONS CORP-CL A	7,040	117.67	828,396.80
SPRINT CORP	44,034	4.97	218,848.98
T-MOBILE US INC	12,874	32.06	412,740.44
VERIZON COMMUNICATIONS INC	219,336	49.22	10,795,717.92
WINDSTREAM HOLDINGS INC	28,542	7.99	228,050.58
AES CORPORATION	35,828	13.20	472,929.60
ALLIANT ENERGY CORP	6,174	63.14	389,826.36
AMEREN CORPORATION	13,289	42.12	559,732.68
AMERICAN ELECTRIC POWER	26,097	56.39	1,471,609.83
AMERICAN WATER WORKS CO INC	8,931	54.18	483,881.58
CALPINE CORP	16,738	22.90	383,300.20
CENTERPOINT ENERGY INC	20,341	20.76	422,279.16
CMS ENERGY CORPORATION	15,072	34.84	525,108.48
CONSOLIDATED EDISON INC	15,819	60.86	962,744.34
DOMINION RESOURCES INC/VA	30,528	71.90	2,194,963.20
DTE ENERGY COMPANY	9,659	81.73	789,430.07
DUKE ENERGY CORP	37,308	77.84	2,904,054.72
EDISON INTERNATIONAL	16,752	63.79	1,068,610.08
ENTERGY CORP	9,620	78.09	751,225.80
EVERSOURCE ENERGY	16,201	50.50	818,150.50
EXELON CORP	45,650	33.38	1,523,797.00
FIRSTENERGY CORP	22,617	36.25	819,866.25
INTEGRYS ENERGY GROUP, INC.	4,300	72.71	312,653.00
MDU RESOURCES GROUP INC	9,220	22.66	208,925.20
NEXTERA ENERGY INC	23,489	104.90	2,463,996.10
NISOURCE INC	17,471	43.88	766,627.48
NRG ENERGY INC	19,084	24.57	468,893.88
OGE ENERGY CORP	11,302	32.07	362,455.14
P G & E CORPORATION	25,080	53.04	1,330,243.20
PEPCO HOLDINGS INC	12,800	26.75	342,400.00

	PINNACLE WEST CAPITAL CORPORATION	5,542	63.78	353,468.76	
	PPL CORPORATION	35,940	34.05	1,223,757.00	
	PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	26,793	41.67	1,116,464.31	
	SCANA CORP	7,515	55.15	414,452.25	
	SEMPRA ENERGY	12,111	107.85	1,306,171.35	
	SOUTHERN CO	46,912	44.62	2,093,213.44	
	WISCONSIN ENERGY CORP	11,648	49.65	578,323.20	
	XCEL ENERGY INC	25,935	34.67	899,166.45	
	ALTERA CORPORATION	17,205	44.52	765,966.60	
	ANALOG DEVICES INC	16,738	64.23	1,075,165.43	
	APPLIED MATERIALS INC	65,106	22.50	1,464,885.00	
	AVAGO TECHNOLOGIES LTD.	13,057	126.82	1,655,888.74	
	BROADCOM CORP-CL A	28,821	44.23	1,274,752.83	
	CREE INC	5,487	35.28	193,581.36	
	INTEL CORP	255,245	31.93	8,149,972.85	
	KLA-TENCOR CORPORATION	9,042	59.12	534,563.04	
	LAM RESEARCH CORP	8,229	73.10	601,539.90	
	LINEAR TECHNOLOGY CORP	12,013	46.49	558,544.43	
	MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	18,071	15.27	275,944.17	
	MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	15,785	35.16	555,079.52	
	MICROCHIP TECHNOLOGY INC	11,206	50.00	560,300.00	
	MICRON TECHNOLOGY INC	57,505	28.02	1,611,290.10	
	NVIDIA CORP	27,294	22.76	621,211.44	
	TEXAS INSTRUMENTS INC	56,049	57.70	3,234,027.30	
	XILINX INC	14,302	43.83	626,856.66	
	米ドル 小計	16,553,402		1,015,828,962.09 (122,122,957,822)	
カナダドル	ALTAGAS LTD	7,500	41.51	311,325.00	
	ARC RESOURCES LTD	18,047	22.44	404,974.68	
	BAYTEX ENERGY CORPORATION	10,179	22.14	225,363.06	
	CAMECO CORP	19,538	19.14	373,957.32	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	57,209	40.65	2,325,545.85	
	CANADIAN OIL SANDS LTD	24,518	11.56	283,428.08	
	CENOVUS ENERGY INC	39,619	22.13	876,768.47	
	CRESCENT POINT ENERGY CORP	22,786	30.76	700,897.36	

ENBRIDGE INC	45,496	63.34	2,881,716.64
ENCANA CORP	37,043	14.56	539,346.08
ENERPLUS CORP	13,590	14.59	198,278.10
HUSKY ENERGY INC	18,209	27.32	497,469.88
IMPERIAL OIL LTD	15,062	53.55	806,570.10
INTER PIPELINE LTD	16,480	30.97	510,385.60
KEYERA CORP	9,206	45.39	417,860.34
MEG ENERGY CORPORATION	8,587	22.37	192,091.19
PARAMOUNT RESOURCES LTD	3,281	32.67	107,190.27
PEMBINA PIPELINE CORP	18,218	40.94	745,844.92
PEYTO EXPLORATION & DEV CORP	8,690	34.53	300,065.70
PRAIRIESKY ROYALTY LTD	7,411	32.78	242,932.58
SUNCOR ENERGY INC	76,826	39.68	3,048,455.68
TALISMAN ENERGY INC	52,153	9.90	516,314.70
TOURMALINE OIL CORP	9,005	40.61	365,693.05
TRANSCANADA CORP	37,040	55.47	2,054,608.80
VERMILION ENERGY INC	5,586	55.12	307,900.32
AGNICO EAGLE MINES LIMITED	11,631	37.36	434,534.16
AGRIUM INC	7,300	134.51	981,923.00
BARRICK GOLD CORP	62,601	15.95	998,485.95
ELDORADO GOLD CORPORATION	38,218	6.10	233,129.80
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	32,770	16.19	530,546.30
FRANCO-NEVADA CORPORATION	8,768	62.42	547,298.56
GOLDCORP INC	42,650	24.29	1,035,968.50
KINROSS GOLD CORP	51,579	2.90	149,579.10
METHANEX CORPORATION	4,920	69.97	344,252.40
NEW GOLD INC	27,084	4.42	119,711.28
POTASH CORP OF SASKATCHEWAN	43,983	41.25	1,814,298.75
SILVER WHEATON CORPORATION	20,420	24.66	503,557.20
TECK RESOURCES LIMITED-CL B	29,597	17.30	512,028.10
TURQUOISE HILL RESOURCES LTD	36,017	4.76	171,440.92
WEST FRASER TIMBER CO LTD	3,673	61.56	226,109.88
YAMANA GOLD INC	51,365	4.88	250,661.20
BOMBARDIER INC 'B'	80,493	2.64	212,501.52
CAE INC	14,432	14.74	212,727.68

FINNING INTERNATIONAL INC	9,139	24.68	225,550.52
SNC-LAVALIN GROUP INC	7,437	41.22	306,553.14
CANADIAN NATL RAILWAY CO	43,248	84.38	3,649,266.24
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	9,021	237.45	2,142,036.45
MAGNA INTERNATIONAL INC	22,272	68.31	1,521,400.32
GILDAN ACTIVEWEAR INC	11,600	39.22	454,952.00
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	10,312	49.08	506,112.96
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	19,516	29.30	571,818.80
THOMSON REUTERS CORP	19,564	52.70	1,031,022.80
CANADIAN TIRE CORP -CL A	4,045	135.99	550,079.55
DOLLARAMA INC	6,930	72.36	501,454.80
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC-B	21,838	50.41	1,100,853.58
EMPIRE CO LTD A	2,745	94.03	258,112.35
JEAN COUTU GROUP INC A	2,884	27.53	79,396.52
LOBLAW COMPANIES LTD	12,325	64.95	800,508.75
METRO INC	14,499	36.56	530,083.44
WESTON (GEORGE) LTD	2,473	105.96	262,039.08
SAPUTO INC	14,092	36.27	511,116.84
CATAMARAN CORPORATION	11,319	75.01	849,038.19
VALEANT PHARMACEUTICALS INTERN	16,831	261.09	4,394,405.79
BANK OF MONTREAL	33,952	78.33	2,659,460.16
BANK OF NOVA SCOTIA	63,889	64.41	4,115,090.49
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	21,827	94.38	2,060,032.26
NATIONAL BANK OF CANADA	17,956	47.72	856,860.32
ROYAL BANK OF CANADA	75,975	79.60	6,047,610.00
TORONTO-DOMINION BANK	96,903	55.29	5,357,766.87
CI FINANCIAL CORP	10,961	35.72	391,526.92
IGM FINANCIAL INC	5,296	45.42	240,544.32
ONEX CORPORATION	4,665	74.12	345,769.80
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	1,174	694.51	815,354.74
GREAT-WEST LIFE CO INC	16,674	36.95	616,104.30
INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANCE AND FINANC	5,692	43.88	249,764.96
INTACT FINANCIAL CORPORATION	6,831	92.88	634,463.28
MANULIFE FINANCIAL CORP	102,971	22.24	2,290,075.04
POWER CORP OF CANADA	19,050	34.26	652,653.00

	POWER FINANCIAL CORP	14,030	37.86	531,175.80	
	SUN LIFE FINANCIAL INC	33,345	39.42	1,314,459.90	
	BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT INC	29,600	72.33	2,140,968.00	
	FIRST CAPITAL REALTY INC	4,000	19.86	79,440.00	
	CGI GROUP INC - CL A	11,051	56.05	619,408.55	
	CONSTELLATION SOFTWARE	1,027	497.74	511,178.98	
	OPEN TEXT CORPORATION	6,339	70.54	447,153.06	
	BLACKBERRY LIMITED	27,051	12.01	324,882.51	
	BCE INC	7,586	54.94	416,774.84	
	ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	19,778	43.42	858,760.76	
	TELUS CORPORATION	10,142	43.47	440,872.74	
	ATCO LTD-CLASS I	3,354	46.28	155,223.12	
	CANADIAN UTILITIES LIMITED	6,384	40.36	257,658.24	
	FORTIS INC	14,821	39.50	585,429.50	
	TRANSALTA CORP	16,343	11.97	195,625.71	
	カナダドル 小計	2,099,537		84,971,628.36 (8,119,888,806)	
ユーロ	ENI SPA	133,314	17.02	2,269,004.28	
	GALP ENERGIA SGPS S.A	18,839	11.90	224,184.10	
	NESTE OIL OYJ	7,560	24.69	186,656.40	
	OMV AG	8,399	27.53	231,224.47	
	REPSOL SA	56,393	18.15	1,023,532.95	
	SAIPEM	13,459	10.99	147,914.41	
	TECHNIP S.A.	5,450	61.18	333,431.00	
	TENARIS S.A.	26,519	14.27	378,426.13	
	TOTAL SA	113,218	48.52	5,493,337.36	
	VOPAK	3,334	54.12	180,436.08	
	AIR LIQUIDE	18,518	122.60	2,270,306.80	
	AKZO NOBEL	13,536	74.73	1,011,545.28	
	ARCELOR MITTAL	56,442	9.02	509,501.93	
	ARKEMA	2,963	75.35	223,262.05	
	BASF SE	48,454	96.72	4,686,470.88	
	CRH PLC	44,424	24.83	1,103,270.04	
	FUCHS PETROLUB SE-PREF	3,702	39.76	147,210.03	
	HEIDELBERGCEMENT AG	7,279	75.84	552,039.36	

IMERYSA SA	1,380	72.09	99,484.20
K+S AG	9,644	32.57	314,105.08
KONINKLIJKE DSM NV	8,898	53.09	472,394.82
LAFARGE SA	9,735	63.01	613,402.35
LANXESS	5,489	51.96	285,208.44
LINDE AG	9,958	193.75	1,929,362.50
SOLVAY SA	3,141	140.95	442,723.95
STORA ENSO OYJ-R SHS	28,852	10.33	298,041.16
SYMRISE AG	6,446	60.26	388,435.96
THYSSENKRUPP AG	22,878	25.29	578,584.62
UMICORE	5,012	42.16	211,305.92
UPM-KYMMENE OYJ	28,690	18.63	534,494.70
VOESTALPINE AG	5,202	37.08	192,890.16
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	10,168	32.99	335,442.32
AIRBUS GROUP NV	31,410	61.91	1,944,593.10
ALSTOM RGPT	11,766	29.76	350,156.16
ANDRITZ AG	4,044	57.20	231,316.80
BOSKALIS WESTMINSTER NV	4,309	48.18	207,607.62
BOUYGUES SA	8,920	37.76	336,863.80
BRENTAG AG	8,299	58.45	485,076.55
CNH INDUSTRIAL NV	53,303	7.77	414,430.82
COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	24,015	42.02	1,009,110.30
FERROVIAL SA	23,236	20.82	483,773.52
FINMECCANICA SPA	24,044	11.81	283,959.64
GEA GROUP AG	10,225	46.81	478,683.37
KONE OYJ-B	15,946	43.39	691,896.94
KONINKLIJKE PHILIPS NV	49,664	27.37	1,359,552.00
LEGRAND SA	14,823	52.67	780,727.41
MAN SE	1,807	98.75	178,441.25
METSO OYJ	6,269	27.42	171,895.98
OCI NV	4,649	29.89	138,958.61
OSRAM LICHT AG	4,638	47.27	219,261.45
PRYSMIAN SPA	9,328	19.65	183,295.20
REXEL SA	16,046	17.87	286,742.02
SAFRAN SA	13,920	68.15	948,648.00

SCHNEIDER ELECTRIC SE	27,557	73.62	2,028,746.34
SIEMENS AG-REG	41,863	103.45	4,330,727.35
THALES SA	4,465	54.66	244,056.90
VALLOUREC	5,478	24.48	134,128.83
VINCI S.A.	24,774	55.04	1,363,560.96
WARTSILA OYJ-B SHARES	7,635	44.07	336,474.45
ZARDOYA OTIS SA	6,340	12.32	78,108.80
ZODIAC AEROSPACE	10,335	30.97	320,126.62
BIC	1,337	144.25	192,862.25
BUREAU VERITAS SA	11,223	20.58	231,025.45
EDENRED	11,277	24.39	275,046.03
RANDSTAD HOLDING NV	6,716	57.24	384,423.84
ABERTIS INFRAESTRUCTURAS SA	20,706	17.47	361,733.82
AENA SA	3,179	99.42	316,056.18
AEROPORTS DE PARIS (ADP)	1,647	114.55	188,663.85
ATLANTIA SPA	22,079	25.13	554,845.27
BOLLORE	31,800	5.06	160,908.00
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	12,281	12.95	159,100.35
DEUTSCHE POST AG-REG	51,791	31.08	1,609,664.28
FRAPORT AG	1,856	56.26	104,418.56
GROUPE EUROTUNNEL SE	24,524	13.83	339,289.54
INTERNATIONAL CONSOLIDATED AIRLINES GROUP	45,875	8.51	390,533.87
RYANAIR HOLDINGS PLC	1,656	11.39	18,861.84
TNT EXPRESS NV	24,478	7.63	186,767.14
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	17,979	117.35	2,109,835.65
BAYERISCHE MOTOREN WERKE(BMW)AG-PFD	2,879	87.59	252,171.61
CONTINENTAL AG	5,768	229.15	1,321,737.20
DAIMLER AG	50,804	88.65	4,503,774.60
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	48,903	15.52	758,974.56
MICHELIN (CGDE)-B	9,816	96.12	943,513.92
NOKIAN RENKAAT OYJ	5,578	28.53	159,140.34
PIRELLI & C.	11,369	15.42	175,309.98
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE PREF	8,356	94.00	785,464.00
PSA PEUGEOT CITROEN	21,050	15.96	335,958.00
RENAULT SA	10,163	89.44	908,978.72

VALEO	4,009	144.55	579,500.95
VOLKSWAGEN AG	1,615	244.80	395,352.00
VOLKSWAGEN AG PFD	8,521	253.20	2,157,517.20
ADIDAS AG	11,267	77.21	869,925.07
CHRISTIAN DIOR SE	2,799	185.10	518,094.90
HERMES INTERNATIONAL	1,474	345.35	509,045.90
HUGO BOSS AG	2,856	120.00	342,720.00
KERING	3,921	176.50	692,056.50
LUXOTTICA GROUP SPA	8,430	60.95	513,808.50
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	14,648	172.40	2,525,315.20
ACCOR SA	9,735	50.19	488,599.65
SODEXO	4,808	94.50	454,356.00
ALTICE SA	4,569	108.65	496,421.85
AXEL SPRINGER SE	2,125	59.04	125,460.00
EUTELSAT COMMUNICATIONS	9,141	32.30	295,254.30
JC DECAUX S.A.	2,962	32.48	96,205.76
KABEL DEUTSCHLAND HOLDINGS AG	1,067	124.25	132,574.75
LAGARDERE S.C.A.	7,266	29.39	213,547.74
NUMERICABLE-SFR	4,599	53.96	248,162.04
PROSIEBEN SAT.1 MEDIA AG-REG	11,137	48.97	545,434.57
PUBLICIS GROUPE	10,413	75.48	785,973.24
REED ELSEVIER NV	35,787	24.05	860,856.28
RTL GROUP	2,200	96.62	212,564.00
SES	15,312	34.70	531,326.40
TELENET GROUP HOLDINGS NV	2,885	54.10	156,078.50
WOLTERS KLUWER-CVA	16,273	31.69	515,691.37
INDITEX	58,361	30.88	1,802,187.68
CARREFOUR SA	32,216	32.79	1,056,523.72
CASINO GUICHARD PERRACHON	2,725	87.27	237,810.75
COLRUYT NV	3,273	44.16	144,552.04
DELHAIZE GROUP	5,494	89.32	490,724.08
DISTRIBUIDORA INTERNACIONAL	31,663	7.62	241,462.03
JERONIMO MARTINS SGPS S.A.	16,101	12.62	203,275.12
KONINKLIJKE AHOLD NV	48,806	19.45	949,520.73
METRO AG	8,936	34.55	308,783.48

ANHEUSER-BUSCH INBEV NV	42,713	118.05	5,042,269.65
DANONE	31,137	64.95	2,022,348.15
HEINEKEN HOLDING NV	5,730	67.95	389,353.50
HEINEKEN NV	12,033	74.69	898,744.77
KERRY GROUP PLC-A	8,477	66.31	562,109.87
PERNOD-RICARD SA	11,825	113.95	1,347,458.75
REMY COINTREAU	1,273	71.53	91,057.69
UNILEVER NV-CVA	85,775	40.90	3,508,197.50
BEIERSDORF AG	5,118	83.35	426,585.30
HENKEL AG & CO KGAA	6,212	99.19	616,168.28
HENKEL AG & CO KGAA	9,525	115.20	1,097,280.00
L'OREAL	13,172	178.95	2,357,129.40
CELESIO AG	1,870	27.45	51,340.85
ESSILOR INTERNATIONAL	10,916	113.05	1,234,053.80
FRESENIUS MEDICAL CARE AG AND CO.KGAA	11,532	81.95	945,047.40
FRESENIUS SE & CO KGAA	20,040	57.47	1,151,698.80
BAYER AG	43,937	146.20	6,423,589.40
GRIFOLS S.A.	8,356	41.97	350,701.32
MERCK KGAA	6,729	111.25	748,601.25
ORION OYJ	5,809	27.27	158,411.43
QIAGEN N.V.	11,901	24.07	286,457.07
SANOFI	63,148	98.75	6,235,865.00
UCB SA	7,069	71.94	508,543.86
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	328,306	9.56	3,138,605.36
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA-RTS	328,306	0.13	44,977.92
BANCO COMERCIAL PORTUGUES-R	1,717,395	0.09	159,374.25
BANCO DE SABADEL-RTS	191,393	0.23	45,168.74
BANCO DE SABADELL SA	191,393	2.33	446,328.47
BANCO ESPIRITO SANTO,S.A(BES)	187,906	0.12	22,548.72
BANCO POPOLARE SOCIETA COOPERATIVA	19,047	14.32	272,753.04
BANCO POPULAR ESPANOL	87,937	4.64	408,203.55
BANCO SANTANDER SA	743,787	7.06	5,251,136.22
BANK OF IRELAND	1,490,771	0.36	538,168.33
BANKIA SA	253,996	1.27	324,098.89
BANKINTER,S.A.	37,894	7.02	266,319.03

BNP PARIBAS	55,558	57.25	3,180,695.50
CAIXABANK	121,699	4.39	535,110.50
COMMERZBANK AG	51,552	13.20	680,744.16
CREDIT AGRICOLE SA	55,145	14.18	782,231.82
ERSTE GROUP BANK AG	15,326	24.01	367,977.26
INTESA SANPAOLO	666,739	3.18	2,122,896.97
INTESA SANPAOLO-RSP	57,797	2.85	164,952.63
KBC GROUPE SA	12,801	59.35	759,739.35
NATIXIS	50,869	7.35	374,192.36
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG	6,561	14.80	97,102.80
SOCIETE GENERALE	37,849	46.18	1,748,056.06
UNICREDIT SPA	239,126	6.47	1,547,145.22
UNIONE DI BANCHE ITALIANE SCPA	49,218	7.57	372,826.35
DEUTSCHE BANK AG -REG	72,840	33.09	2,410,275.60
DEUTSCHE BOERSE AG	10,521	80.13	843,047.73
EURAZEO	1,748	67.45	117,902.60
EXOR SPA	6,651	43.27	287,788.77
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	4,130	80.03	330,523.90
ING GROEP NV-CVA	202,517	14.14	2,863,590.38
MEDIOBANCA SPA	33,045	9.13	301,700.85
WENDEL	1,660	116.20	192,892.00
AEGON NV	101,813	7.58	771,946.16
AGEAS	12,405	34.84	432,190.20
ALLIANZ SE-REG	24,091	169.70	4,088,242.70
ASSICURAZIONI GENERALI	62,465	18.56	1,159,350.40
AXA SA	97,725	24.47	2,391,819.37
CNP ASSURANCES	10,242	17.25	176,674.50
DELTA LLOYD NV	9,527	18.57	176,964.02
HANNOVER RUECKVERSICHERUNG SE	3,294	101.05	332,858.70
MAPFRE SA	43,669	3.53	154,195.23
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	9,272	205.30	1,903,541.60
NN GROUP NV	8,347	27.30	227,873.10
SAMPO OYJ-A SHS	23,704	49.20	1,166,236.80
SCOR SE	8,802	33.19	292,182.39
UNIPOLSAI SPA	49,963	2.79	139,396.77

VIENNA INSURANCE GROUP AG WIENER VERSICH	1,864	42.62	79,443.68
DEUTSCHE ANNINGTON IMMOBILIEN	17,600	32.25	567,600.00
DEUTSCHE WOHNEN AG-BR	16,186	24.72	400,117.92
IMMOFINANZ AG	45,326	2.79	126,867.47
AMADEUS IT HOLDING SA-A SHS	23,141	41.56	961,855.66
ATOS	4,509	67.26	303,275.34
CAP GEMINI SA	7,733	79.50	614,773.50
DASSAULT SYSTEMES SA	6,436	63.73	410,166.28
GEMALTO	4,369	78.27	341,961.63
SAP SE	49,339	69.05	3,406,857.95
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	7,020	44.05	309,231.00
ALCATEL-LUCENT	154,115	3.82	589,643.99
NOKIA OYJ	200,209	7.58	1,517,584.22
BELGACOM SA	7,483	33.65	251,802.95
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	167,071	17.49	2,922,071.79
ELISA OYJ	6,859	24.33	166,879.47
ILIAD SA	1,518	216.25	328,267.50
KONINKLIJKE KPN NV	176,807	3.35	593,010.67
ORANGE S.A.	96,686	15.45	1,493,798.70
TELECOM ITALIA SPA	544,021	1.10	601,143.20
TELECOM ITALIA-RNC	318,198	0.87	277,786.85
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	31,936	5.39	172,358.59
TELEFONICA S.A.	221,651	13.18	2,922,468.43
VIVENDI SA	64,912	24.13	1,566,651.12
E.ON SE	104,501	14.32	1,496,976.82
EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	120,953	3.69	446,800.38
ELECTRICITE DE FRANCE(EDF)	12,338	23.04	284,329.21
ENAGAS	10,716	27.96	299,672.94
ENDESA S.A.	18,551	18.56	344,306.56
ENEL GREEN POWER SPA	101,336	1.76	179,263.38
ENEL SPA	350,648	4.40	1,542,851.20
FORTUM OYJ	24,063	18.53	445,887.39
GAS NATURAL SDG SA	19,893	22.14	440,431.02
GDF SUEZ	77,656	19.26	1,496,042.84
IBERDROLA SA	269,299	6.14	1,653,765.15

	RED ELECTRICA CORPORATION S.A.	5,403	77.38	418,084.14	
	RWE AG	25,772	25.01	644,557.72	
	SNAM SPA	109,056	4.75	518,452.22	
	SUEZ ENVIRONNEMENT SA	15,717	17.00	267,189.00	
	TERNA SPA	74,967	4.19	314,261.66	
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	20,789	18.82	391,352.92	
	ASML HOLDING NV	18,245	94.70	1,727,801.50	
	INFINEON TECHNOLOGIES AG	56,996	11.80	672,837.78	
	STMICROELECTRONICS NV	30,069	8.90	267,734.37	
	ユーロ 小計	13,941,944		201,758,068.09 (25,758,452,553)	
英bond	AMEC FOSTER WHEELER PLC	20,038	9.18	183,948.84	
	BG GROUP PLC	181,223	11.68	2,116,684.64	
	BP PLC	961,758	4.72	4,541,902.15	
	PETROFAC LIMITED	14,971	10.40	155,698.40	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	208,512	20.26	4,225,495.68	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	128,464	20.48	2,630,942.72	
	TULLOW OIL PLC	54,088	3.31	179,085.36	
	ANGLO AMERICAN PLC	74,490	10.22	761,287.80	
	ANTOFAGASTA PLC	19,439	7.40	143,945.79	
	BHP BILLITON PLC	112,218	14.63	1,642,310.43	
	CRODA INTERNATIONAL PLC	6,446	29.04	187,191.84	
	FRESNILLO PLC	11,248	7.03	79,129.68	
	GLENCORE PLC	564,264	2.89	1,634,390.67	
	JOHNSON MATTHEY PLC	10,240	35.29	361,369.60	
	RANDGOLD RESOURCES LTD	5,058	48.80	246,830.40	
	REXAM PLC	38,106	5.88	224,253.81	
	RIO TINTO PLC	67,133	28.37	1,904,563.21	
	ASHTAD GROUP PLC	26,529	10.76	285,452.04	
	BAE SYSTEMS PLC	167,762	5.39	905,075.99	
	BUNZL PLC	17,795	19.12	340,240.40	
	COBHAM PLC	62,443	3.09	193,136.19	
	IMI PLC	14,214	13.00	184,782.00	
	MEGGITT PLC	44,518	5.73	255,310.73	
	MELROSE INDUSTRIES PLC	47,845	2.87	137,602.22	

ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	100,538	9.75	980,245.50
SMITHS GROUP PLC	20,685	11.34	234,567.90
TRAVIS PERKINS PLC	12,027	20.09	241,622.43
WEIR GROUP PLC/THE	12,257	17.79	218,052.03
WOLSELEY PLC	13,301	41.06	546,139.06
AGGREKO PLC	13,848	15.71	217,552.08
BABCOCK INTERNATIONAL GROUP PLC	11,442	10.02	114,648.84
CAPITA PLC	34,892	11.41	398,117.72
EXPERIAN PLC	54,324	11.93	648,085.32
G4S PLC	82,439	3.08	254,571.63
INTERTEK GROUP PLC	8,190	26.15	214,168.50
MERLIN ENTERTAINMENTS PLC	22,801	4.55	103,767.35
EASYJET PLC	7,630	19.15	146,114.50
ROYAL MAIL PLC	37,660	4.50	169,470.00
GKN PLC	91,695	3.61	331,202.34
BURBERRY GROUP PLC	24,684	18.06	445,793.04
PERSIMMON PLC	17,395	17.57	305,630.15
CARNIVAL PLC	9,886	33.70	333,158.20
COMPASS GROUP PLC	89,675	12.19	1,093,138.25
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	13,210	27.68	365,652.80
TUI AG-DI	24,395	12.48	304,449.60
WHITBREAD PLC	9,658	54.20	523,463.60
WILLIAM HILL PLC	45,985	3.90	179,617.41
ITV PLC	194,112	2.70	525,267.07
PEARSON PLC	44,031	14.71	647,696.01
REED ELSEVIER PLC	60,390	11.79	711,998.10
SKY PLC	52,626	10.54	554,678.04
WPP PLC	68,525	16.11	1,103,937.75
DIXONS CARPHONE PLC	50,564	4.32	218,790.42
KINGFISHER PLC	119,812	3.64	436,115.68
MARKS & SPENCER GROUP PLC	88,539	5.75	509,541.94
NEXT PLC	8,254	70.70	583,557.80
SPORTS DIRECT INTERNATIONAL	11,278	6.47	73,025.05
SAINSBURY (J) PLC	64,189	2.77	178,060.28
TESCO PLC	443,093	2.51	1,112,163.43

WILLIAM MORRISON SUPERMARKETS PLC	118,375	2.02	239,354.25
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	18,222	30.17	549,757.74
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	98,458	37.16	3,658,699.28
COCA-COLA HBC AG-CDI	8,704	13.60	118,374.40
DIAGEO PLC	134,844	19.38	2,613,950.94
IMPERIAL TOBACCO GROUP PLC	51,064	32.82	1,675,920.48
SABMILLER PLC	50,779	36.70	1,863,589.30
TATE & LYLE PLC	24,694	6.51	160,757.94
UNILEVER PLC	67,434	29.35	1,979,187.90
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	34,145	61.16	2,088,308.20
SMITH & NEPHEW PLC	47,568	11.95	568,437.60
ASTRAZENECA PLC	66,737	47.53	3,172,009.61
GLAXOSMITHKLINE PLC	256,271	16.42	4,207,969.82
SHIRE PLC	31,704	56.80	1,800,787.20
BARCLAYS PLC	864,147	2.57	2,221,289.86
HSBC HOLDINGS PLC	1,013,951	6.12	6,206,394.07
LLOYDS BANKING GROUP PLC	3,005,396	0.79	2,383,279.02
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	132,617	3.48	462,700.71
STANDARD CHARTERED PLC	132,573	11.09	1,470,234.57
3I GROUP PLC	52,538	5.09	267,681.11
ABERDEEN ASSET MGMT PLC	49,855	5.07	253,014.12
HARGREAVES LANSDOWN PLC	13,262	12.29	162,989.98
ICAP PLC	27,845	5.58	155,514.32
INVESTEC PLC	32,289	6.08	196,317.12
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP PLC	11,063	25.85	285,978.55
SCHRODERS PLC	5,835	34.05	198,681.75
ADMIRAL GROUP PLC	8,557	16.03	137,168.71
AVIVA PLC	156,621	5.55	869,246.55
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	84,323	3.30	278,434.54
FRIENDS LIFE GROUP LTD	77,938	4.29	334,665.77
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	307,652	2.87	883,576.54
OLD MUTUAL PLC	263,271	2.36	623,425.72
PRUDENTIAL PLC	134,884	17.16	2,314,609.44
RSA INSURANCE GROUP PLC	57,101	4.35	248,731.95
STANDARD LIFE PLC	109,175	4.77	521,528.97

	SAGE GROUP PLC/THE	59,127	4.84	286,174.68	
	BT GROUP PLC	434,054	4.54	1,973,426.51	
	INMARSAT PLC	25,159	9.73	244,922.86	
	VODAFONE GROUP PLC	1,398,703	2.29	3,207,225.97	
	CENTRICA PLC	272,401	2.62	715,597.42	
	NATIONAL GRID PLC	200,366	9.07	1,818,321.45	
	SEVERN TRENT PLC	13,551	21.74	294,598.74	
	SSE PLC	50,717	15.61	791,692.37	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	35,691	9.81	350,307.16	
	ARM HOLDINGS PLC	73,441	11.70	859,259.70	
	英ポンド 小計	14,935,934		94,258,785.30 (16,586,718,449)	
スイスフラン	TRANSOCEAN LTD	17,883	16.40	293,281.20	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	421	410.00	172,610.00	
	GIVAUDAN-REG	492	1,782.00	876,744.00	
	HOLCIM LTD-REG	11,723	74.80	876,880.40	
	SIKA AG	116	3,631.00	421,196.00	
	SYNGENTA AG	4,968	346.00	1,718,928.00	
	ABB LTD	115,265	21.08	2,429,786.20	
	GEBERIT AG-REG	1,919	370.60	711,181.40	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	1,048	162.20	169,985.60	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	2,395	165.90	397,330.50	
	SULZER AG	1,443	112.70	162,626.10	
	ADECCO SA-REG	9,174	82.35	755,478.90	
	SGS SA	306	1,909.00	584,154.00	
	KUEHNE&NAGEL INTL AG-REG	2,822	145.00	409,190.00	
	CIE FINANCIERE RICHEMONT SA-REGD A	28,127	84.45	2,375,325.15	
	THE SWATCH GROUP AG-B	1,566	445.70	697,966.20	
	THE SWATCH GROUP AG-REG	2,816	87.90	247,526.40	
	ARYZTA AG	4,891	62.45	305,442.95	
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	127	1,087.00	138,049.00	
	LINDT & SPRUENGLI AG	45	5,265.00	236,925.00	
	LINDT & SPRUENGLI AG-REG	5	62,615.00	313,075.00	
	NESTLE SA-REGISTERED	170,918	75.90	12,972,676.20	
	SONOVA HOLDING AG	2,928	137.10	401,428.80	

	ACTELION LTD	5,226	118.20	617,713.20	
	LONZA GROUP AG-REG	3,103	128.10	397,494.30	
	NOVARTIS AG-REG SHS	121,892	101.40	12,359,848.80	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	37,205	278.30	10,354,151.50	
	CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	83,176	27.12	2,255,733.12	
	JULIUS BAER GROUP LTD	11,217	52.50	588,892.50	
	PARGESA HOLDING SA-BR	1,916	70.40	134,886.40	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	813	299.50	243,493.50	
	UBS GROUP AG	194,033	19.04	3,694,388.32	
	BALOISE HOLDING AG	2,805	131.60	369,138.00	
	SWISS LIFE HOLDING AG	1,689	247.00	417,183.00	
	SWISS RE AG	18,383	96.65	1,776,716.95	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	7,849	314.60	2,469,295.40	
	SWISS PRIME SITE-REG	2,983	87.70	261,609.10	
	SWISSCOM AG-REG	1,246	549.50	684,677.00	
	スイスフラン 小計	874,934		64,293,008.09 (7,899,038,973)	
スウェーデンクローナ	LUNDIN PETROLEUM AB	13,237	134.30	1,777,729.10	
	BOLIDEN AB	15,063	183.80	2,768,579.40	
	ALFA LAVAL AB	17,594	170.10	2,992,739.40	
	ASSA ABLOY AB-B	17,169	549.50	9,434,365.50	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	35,487	292.70	10,387,044.90	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	21,365	265.30	5,668,134.50	
	SANDVIK AB	56,437	96.10	5,423,595.70	
	SKANSKA AB-B SHS	21,504	192.50	4,139,520.00	
	SKF AB-B SHARES	20,152	227.80	4,590,625.60	
	VOLVO AB-B SHS	81,290	99.50	8,088,355.00	
	SECURITAS AB-B SHS	15,832	130.10	2,059,743.20	
	ELECTROLUX AB-SER B	13,210	234.10	3,092,461.00	
	HUSQVARNA AB-B SHS	23,190	63.35	1,469,086.50	
	HENNES & MAURITZ AB-B SHS	49,666	358.00	17,780,428.00	
	ICA GRUPPEN AB	3,550	301.50	1,070,325.00	
	SWEDISH MATCH AB	11,029	265.60	2,929,302.40	
	SVENSKA CELLULOSA AB-B SHS	31,935	206.60	6,597,771.00	
	ELEKTA AB-B SHS	16,938	79.70	1,349,958.60	

	GETINGE AB-B SHS	11,418	223.80	2,555,348.40	
	NORDEA BANK AB	159,513	108.70	17,339,063.10	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN AB-A	80,153	101.60	8,143,544.80	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	27,200	392.50	10,676,000.00	
	SWEDBANK AB - A SHARES	46,778	204.90	9,584,812.20	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	8,794	167.40	1,472,115.60	
	INVESTOR AB-B SHS	24,320	353.50	8,597,120.00	
	KINNEVIK INVESTMENT AB-B	12,846	287.80	3,697,078.80	
	ERICSSON LM-B SHS	163,259	113.40	18,513,570.60	
	HEXAGON AB-B SHS	12,634	316.60	3,999,924.40	
	MILLICOM INTL CELLULAR-SDR	3,357	635.00	2,131,695.00	
	TELE2 AB-B SHS	16,838	106.50	1,793,247.00	
	TELIASONERA AB	134,088	51.25	6,872,010.00	
	スウェーデンクローナ 小計	1,165,846		186,995,294.70 (2,552,485,772)	
ノルウェークローネ	SEADRILL LID	21,887	88.25	1,931,527.75	
	STATOIL ASA	58,766	154.10	9,055,840.60	
	SUBSEA 7 SA	11,653	75.30	877,470.90	
	NORSK HYDRO ASA	65,967	44.16	2,913,102.72	
	YARA INTERNATIONAL ASA	10,350	435.30	4,505,355.00	
	ORKLA ASA	42,614	64.75	2,759,256.50	
	DNB ASA	51,728	136.90	7,081,563.20	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	10,814	145.80	1,576,681.20	
	TELENOR ASA	40,751	169.80	6,919,519.80	
	ノルウェークローネ 小計	314,530		37,620,317.67 (558,661,717)	
デンマーククローネ	NOVOZYMES A/S-B SHARES	12,350	339.80	4,196,530.00	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	12,229	317.30	3,880,261.70	
	ISS A/S	7,424	235.00	1,744,640.00	
	A P MOLLER-MAERSK A/S-A	191	14,310.00	2,733,210.00	
	A P MOLLER-MAERSK A/S-B	381	14,780.00	5,631,180.00	
	DSV A/S	9,120	232.10	2,116,752.00	
	PANDORA A/S	6,314	670.00	4,230,380.00	
	CARLSBERG AS-B	5,545	605.00	3,354,725.00	
	COLOPLAST-B	5,891	557.50	3,284,232.50	

	WILLIAM DEMANT HOLDING	864	577.00	498,528.00	
	NOVO NORDISK A/S-B	106,499	393.30	41,886,056.70	
	DANSKE BANK A/S	35,162	190.60	6,701,877.20	
	TRYG A/S	1,001	838.50	839,338.50	
	TDC A/S	45,454	51.95	2,361,335.30	
	デンマーククローネ 小計	248,425		83,459,046.90 (1,425,480,521)	
オーストラリアドル	CALTEX AUSTRALIA LIMITED	7,464	34.88	260,344.32	
	ORIGIN ENERGY LIMITED	56,777	11.98	680,188.46	
	SANTOS LTD	53,628	7.52	403,282.56	
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	39,848	34.90	1,390,695.20	
	WORLEY PARSONS LIMITED	7,527	9.70	73,011.90	
	ALUMINA LTD	146,977	1.64	241,042.28	
	AMCOR LIMITED	63,935	14.32	915,549.20	
	BHP BILLITON LTD	169,745	30.14	5,116,114.30	
	BORAL LIMITED	44,844	6.59	295,521.96	
	FORTESCUE METALS GROUP LIMITED	83,530	1.81	151,606.95	
	ILUKA RESOURCES LIMITED	22,902	8.80	201,537.60	
	INCITEC PIVOT LTD	85,406	4.24	362,121.44	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	22,958	15.78	362,277.24	
	NEWCREST MINING LIMITED	38,741	14.06	544,698.46	
	ORICA LIMITED	21,033	20.05	421,711.65	
	RIO TINTO LIMITED	22,862	56.89	1,300,619.18	
	LEIGHTON HOLDINGS LIMITED	4,188	21.43	89,748.84	
	ALS LTD	24,500	4.93	120,785.00	
	BRAMBLES LIMITED	83,288	11.79	981,965.52	
	SEEK LIMITED	17,538	17.01	298,321.38	
	ASCIANO LTD	53,896	6.50	350,324.00	
	AURIZON HOLDINGS LTD	107,889	4.89	527,577.21	
	QANTAS AIRWAYS LIMITED	26,232	3.34	87,614.88	
	TOLL HOLDINGS LIMITED	34,567	8.96	309,720.32	
	CROWN RESORTS LTD	19,825	14.13	280,127.25	
	FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD	2,650	41.13	108,994.50	
	TABCORP HOLDINGS LIMITED	36,322	4.83	175,435.26	
	TATTS GROUP LTD	81,135	4.06	329,408.10	

	REA GROUP LTD	3,058	49.56	151,554.48	
	HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	23,253	4.36	101,383.08	
	WESFARMERS LIMITED	60,409	44.40	2,682,159.60	
	WOOLWORTHS LIMITED	66,553	29.56	1,967,306.68	
	COCA-COLA AMATIL LIMITED	26,498	11.00	291,478.00	
	TREASURY WINE ESTATES LTD	35,541	5.64	200,451.24	
	COCHLEAR LIMITED	3,067	89.97	275,937.99	
	HEALTHSCOPE LTD	53,691	2.99	160,536.09	
	RAMSAY HEALTH CARE LTD	6,579	67.51	444,148.29	
	SONIC HEALTHCARE LTD	21,041	20.90	439,756.90	
	CSL LIMITED	25,282	95.11	2,404,571.02	
	AUST AND NZ BANKING GROUP LT	145,299	36.80	5,347,003.20	
	BANK OF QUEENSLAND LIMITED	21,298	14.17	301,792.66	
	BENDIGO AND ADELAIDE BANK	26,713	12.59	336,316.67	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	85,698	94.13	8,066,752.74	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	124,584	39.52	4,923,559.68	
	WESTPAC BANKING CORPORATION	164,071	39.88	6,543,151.48	
	ASX LTD	9,980	42.67	425,846.60	
	MACQUARIE GROUP LTD	16,038	80.38	1,289,134.44	
	PLATINUM ASSET MANAGEMENT	7,772	8.12	63,108.64	
	AMP LIMITED	154,322	6.67	1,029,327.74	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP LT	124,629	6.01	749,020.29	
	MEDIBANK PRIVATE LTD	150,000	2.39	358,500.00	
	QBE INSURANCE GROUP LIMITED	71,487	13.70	979,371.90	
	SUNCORP GROUP LTD	68,538	13.42	919,779.96	
	COMPUTERSHARE LIMITED	27,158	12.84	348,708.72	
	TELSTRA CORPORATION LIMITED	230,366	6.28	1,446,698.48	
	TPG TELECOM LTD	13,145	9.42	123,825.90	
	AGL ENERGY LIMITED	35,263	15.11	532,823.93	
	オーストラリアドル 小計	3,181,540		59,284,351.36	(5,460,681,603)
ニュージーランドドル	FLETCHER BUILDING LTD	34,160	8.25	281,820.00	
	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	55,056	4.56	251,330.64	
	RYMAN HEALTHCARE LIMITED	22,000	8.24	181,280.00	
	SPARK NEW ZEALAND LIMITED	101,822	2.97	302,920.45	

	CONTACT ENERGY LIMITED	17,965	5.94	106,712.10	
	MERIDIAN ENERGY LTD	71,571	1.85	132,406.35	
	MIGHTY RIVER POWER	23,758	2.98	70,798.84	
	ニュージーランドドル 小計	326,332		1,327,268.38 (120,250,515)	
香港ドル	HUTCHISON WHAMPOA LTD	114,000	113.70	12,961,800.00	
	NWS HOLDINGS LTD	67,500	13.62	919,350.00	
	CATHAY PACIFIC AIRWAYS	74,000	19.34	1,431,160.00	
	MTR CORPORATION	80,000	38.95	3,116,000.00	
	LI & FUNG LTD	317,200	7.83	2,483,676.00	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	64,500	25.85	1,667,325.00	
	YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	37,000	27.85	1,030,450.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LIMITED	122,000	41.05	5,008,100.00	
	MGM CHINA HOLDINGS LTD	62,400	16.88	1,053,312.00	
	SANDS CHINA LTD	126,400	37.25	4,708,400.00	
	SHANGRI-LA ASIA LTD.	64,000	11.44	732,160.00	
	SJM HOLDINGS LIMITED	120,000	11.44	1,372,800.00	
	WYNN MACAU LTD	78,000	19.30	1,505,400.00	
	WH GROUP LIMITED	158,500	5.26	833,710.00	
	BANK OF EAST ASIA	63,220	32.20	2,035,684.00	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	197,000	28.95	5,703,150.00	
	HANG SENG BANK LTD	38,800	143.30	5,560,040.00	
	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	74,000	167.60	12,402,400.00	
	FIRST PACIFIC COMPANY	146,000	7.88	1,150,480.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEARING LIMITED	61,300	249.00	15,263,700.00	
	AIA GROUP LTD	634,800	53.75	34,120,500.00	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	131,000	24.15	3,163,650.00	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	51,120	60.00	3,067,200.00	
	HYSAN DEVELOPMENT CO	38,000	35.50	1,349,000.00	
	KERRY PROPERTIES LTD	27,500	28.80	792,000.00	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	269,333	9.60	2,585,596.80	
	SINO LAND CO	162,200	13.46	2,183,212.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	90,000	128.10	11,529,000.00	
	SWIRE PACIFIC LTD 'A'	32,000	108.70	3,478,400.00	
	SWIRE PROPERTIES LIMITED	68,600	24.70	1,694,420.00	

	WHARF HOLDINGS LTD	76,000	58.85	4,472,600.00	
	WHEELOK&COMPANY LTD	46,000	42.70	1,964,200.00	
	PCCW LIMITED	172,000	5.07	872,040.00	
	CHEUNG KONG INFRASTRUCTURE	34,000	68.00	2,312,000.00	
	CLP HOLDINGS LTD	99,600	68.20	6,792,720.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	332,431	18.80	6,249,702.80	
	POWER ASSETS HOLDINGS LIMITED	76,000	79.85	6,068,600.00	
	ASM PACIFIC TECHNOLOGY	12,200	80.45	981,490.00	
	香港ドル 小計	4,418,604		174,615,428.60 (2,708,285,297)	
シンガポールドル	KEPPEL CORP LTD	78,400	9.21	722,064.00	
	NOBLE GROUP LTD	245,400	0.89	218,406.00	
	SEMBCORP INDUSTRIES LTD	54,820	4.54	248,882.80	
	SEMBCORP MARINE LTD	37,100	2.98	110,558.00	
	SINGAPORE TECHNOLOGIES ENG	80,000	3.51	280,800.00	
	YANGZIJIANG SHIPBUILDING HOLDINGS LTD	90,000	1.36	122,400.00	
	COMFORTDELGRO CORP LTD	107,000	2.88	308,160.00	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	28,866	11.74	338,886.84	
	GENTING SINGAPORE PLC	320,000	1.01	324,800.00	
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	92,650	4.17	386,350.50	
	CYCLE & CARRIAGE LTD	6,000	42.80	256,800.00	
	GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	378,600	0.44	166,584.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	105,000	3.26	342,300.00	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	91,000	20.50	1,865,500.00	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	154,000	10.64	1,638,560.00	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	66,800	23.16	1,547,088.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	45,000	8.21	369,450.00	
	CAPITALAND LTD	137,000	3.61	494,570.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	21,000	10.82	227,220.00	
	GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES LIMITED	180,000	2.68	482,400.00	
	UOL GROUP LIMITED	32,000	7.77	248,640.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	416,015	4.41	1,834,626.15	
	STARHUB LIMITED	37,000	4.40	162,800.00	
	シンガポールドル 小計	2,803,651		12,697,846.29 (1,117,410,473)	

イスラエルシェケル	DELEK GROUP LTD	213	1,099.00	234,087.00	
	ISRAEL CHEMICALS LIMITED	22,983	28.60	657,313.80	
	ISRAEL CORPORATION LTD/THE	115	1,475.00	169,625.00	
	TEVA PHARMACEUTICAL IND LTD	45,670	263.60	12,038,612.00	
	BANK HAPOALIM BM	61,837	19.20	1,187,270.40	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	72,754	14.83	1,078,941.82	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	4,453	42.11	187,515.83	
	NICE SYSTEMS LTD	3,300	234.80	774,840.00	
	BEZEQ ISRAELI TELECOMMUNICATION CORP LTD	96,068	7.26	698,222.22	
イスラエルシェケル 小計		307,393		17,026,428.07	(512,665,749)
合 計		61,172,072		194,942,978,250	(194,942,978,250)

(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 597銘柄	59.8%	62.6%
カナダドル	株式 93銘柄	4.0%	4.2%
ユーロ	株式 237銘柄	12.6%	13.2%
英ポンド	株式 104銘柄	8.1%	8.5%
スイスフラン	株式 38銘柄	3.9%	4.1%
スウェーデンクローナ	株式 31銘柄	1.2%	1.3%
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 14銘柄	0.7%	0.7%
オーストラリアドル	株式 57銘柄	2.7%	2.8%
ニュージーランドドル	株式 7銘柄	0.1%	0.1%
香港ドル	株式 38銘柄	1.3%	1.4%
シンガポールドル	株式 23銘柄	0.5%	0.6%
イスラエルシェケル	株式 9銘柄	0.3%	0.3%

(b) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	米ドル	AMERICAN CAPITAL AGENCY CORP	18,793	407,808.10	

	AMERICAN REALTY CAPITAL PROPERTIES	50,757	493,865.61
	AMERICAN TOWER CORP	21,285	2,023,564.95
	ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	52,984	551,033.60
	AVALONBAY COMMUNITIES INC	6,988	1,176,150.28
	BOSTON PROPERTIES INC	8,271	1,137,924.18
	CAMDEN PROPERTY TRUST	4,755	364,375.65
	DIGITAL REALTY TRUST INC	7,330	478,062.60
	DUKE REALTY CORP	18,773	385,597.42
	EQUITY RESIDENTIAL	18,570	1,404,263.40
	ESSEX PROPERTY TRUST INC	3,397	754,779.43
	FEDERAL REALTY INVESTMENT TRUST	3,695	526,241.90
	GENERAL GROWTH PROPERTIES	27,051	779,339.31
	HCP, INC.	24,808	1,057,813.12
	HEALTH CARE REIT INC	17,671	1,346,353.49
	HOST HOTELS AND RESORTS INC	40,926	815,655.18
	HUTCHISON PORT HOLDINGS TRUST	283,000	193,855.00
	IRON MOUNTAIN INC	8,269	307,358.73
	KIMCO REALTY CORPORATION	22,451	581,705.41
	LIBERTY PROPERTY TRUST	7,065	250,171.65
	MACERICH COMPANY/THE	7,263	590,845.05
	PLUM CREEK TIMBER COMPANY	8,860	377,701.80
	PROLOGIS INC	26,635	1,131,721.15
	PUBLIC STORAGE	7,644	1,480,566.36
	RAYONIER INC	7,400	194,990.00
	REALTY INCOME CORPORATION	11,892	588,772.92
	REGENCY CENTERS CORP	5,415	359,285.25
	SIMON PROPERTY GROUP INC	16,345	3,126,308.15
	SL GREEN REALTY CORP	5,242	670,189.70
	UDR INC	12,366	407,954.34
	VENTAS INC	16,727	1,238,634.35
	VORNADO REALTY TRUST	9,109	978,488.78
	米ドル 小計	781,737	26,181,376.86 (3,147,525,126)
カナダドル	H&R REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	8,500	199,750.00
	RIOCAN REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	8,647	251,195.35

カナダドル 小計		17,147	450,945.35 (43,092,337)
ユーロ	FONCIERE DES REGIONS	1,550	149,559.50
	GECINA SA	1,793	235,331.25
	ICADE	1,873	156,152.01
	KLEPIERRE	8,483	401,033.82
	UNIBAIL-RODAMCO SE	5,219	1,340,239.20
ユーロ 小計		18,918	2,282,315.78 (291,383,255)
英ポンド	BRITISH LAND CO PLC	53,382	464,423.40
	HAMMERSON PLC	45,216	313,572.96
	INTU PROPERTIES PLC	54,855	201,537.27
	LAND SECURITIES GROUP PLC	40,324	523,808.76
	SEGRO PLC	36,381	160,512.97
英ポンド 小計		230,158	1,663,855.36 (292,788,627)
オーストラリアドル	APA GROUP	61,823	579,281.51
	AUSNET SERVICES	95,413	142,642.43
	DEXUS PROPERTY GROUP	42,722	331,522.72
	FEDERATION CENTRES	90,000	276,300.00
	GOODMAN GROUP	98,927	643,025.50
	GPT GROUP	96,787	451,027.42
	LEND LEASE GROUP	27,382	461,660.52
	MIRVAC GROUP	210,942	430,321.68
	NOVION PROPERTY GROUP	124,971	322,425.18
	SCENTRE GROUP	272,692	1,055,318.04
	STOCKLAND	130,583	600,681.80
	SYDNEY AIRPORT	57,042	306,885.96
	TRANSURBAN GROUP	97,725	955,750.50
	WESTFIELD CORP	103,094	1,024,754.36
オーストラリアドル 小計		1,510,103	7,581,597.62 (698,340,956)
香港ドル	HKT TRUST AND HKT LTD	139,000	1,431,700.00
	LINK REIT	126,500	6,287,050.00
香港ドル 小計		265,500	7,718,750.00 (119,717,812)

シンガポールドル	ASCENDAS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	107,000	284,620.00	
	CAPITACOMMERCIAL TRUST	79,000	138,645.00	
	CAPITAMALL TRUST	125,000	277,500.00	
	SUNTEC REIT	135,000	250,425.00	
シンガポールドル 小計		446,000	951,190.00	(83,704,720)
合計			4,676,552,833	(4,676,552,833)

（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 32銘柄	1.5%	67.3%
カナダドル	投資証券 2銘柄	0.0%	0.9%
ユーロ	投資証券 5銘柄	0.1%	6.2%
英ポンド	投資証券 5銘柄	0.1%	6.3%
オーストラリアドル	投資証券 14銘柄	0.3%	14.9%
香港ドル	投資証券 2銘柄	0.1%	2.6%
シンガポールドル	投資証券 4銘柄	0.0%	1.8%

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26年 4月14日現在）	（平成27年 4月13日現在）
資産の部		
流動資産		
預金	3,151,782,615	1,615,611,196
コール・ローン	1,531,182,116	605,884,226
国債証券	237,153,916,070	219,609,148,881
未収利息	2,636,801,931	2,148,927,713
前払費用	69,746,542	41,657,715
流動資産合計	244,543,429,274	224,021,229,731

資産合計	244,543,429,274	224,021,229,731
負債の部		
流動負債		
未払解約金	513,300,505	8,965,916
流動負債合計	513,300,505	8,965,916
負債合計	513,300,505	8,965,916
純資産の部		
元本等		
元本	153,299,085,380	125,043,526,611
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	90,731,043,389	98,968,737,204
元本等合計	244,030,128,769	224,012,263,815
純資産合計	244,030,128,769	224,012,263,815
負債純資産合計	244,543,429,274	224,021,229,731

注記表

(重要な会計方針の注記)

項目	自 平成26年 4月15日 至 平成27年 4月13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26年 4月14日現在)	(平成27年 4月13日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	153,299,085,380口	125,043,526,611口
2. 1単位当たり純資産の1口当たり純資産額	1.5919円	1.7915円

額	(10,000口当たりの純資産額	15,919円)	(10,000口当たりの純資産額	17,915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26年 4月15日 至 平成27年 4月13日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、国債証券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。当計算期間については、為替予約取引を行っております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>

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

・金融商品の時価等に関する事項

項目	(平成27年 4月13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）

該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

（平成26年 4月14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	186,647,334,846円
同期中における追加設定元本額	2,588,049,349円
同期中における一部解約元本額	35,936,298,815円
平成26年 4月14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	4,479,928,917円
三井住友・DC年金バランス30（債券重点型）	241,134,916円
三井住友・DC年金バランス50（標準型）	693,915,964円
三井住友・DC年金バランス70（株式重点型）	356,264,352円
スミセイ・DCバランスファンド（機動的資産配分型）	35,334,880円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2020	4,896,226円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2025	10,021,485円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2030	7,354,158円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2035	8,153,183円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2040	2,271,647円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2045	5,451,207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＞	1,625,300,336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＞	9,304,932,624円
SMAM・バランスファンドVA25＜適格機関投資家専用＞	30,567,382,871円
SMAM・バランスファンドVA37.5＜適格機関投資家専用＞	9,244,157,413円
SMAM・バランスファンドVA50＜適格機関投資家専用＞	20,708,993,278円
SMAM・バランスファンドVL30＜適格機関投資家限定＞	65,391,271円
SMAM・バランスファンドVL50＜適格機関投資家限定＞	154,712,250円
世界6資産バランスファンドVA＜適格機関投資家限定＞	27,861,153円
SMAM・バランスファンドVA75＜適格機関投資家専用＞	1,271,737,063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＞	171,663,710円
SMAM・インデックス・バランスVA25＜適格機関投資家専用＞	1,837,257,529円
SMAM・インデックス・バランスVA50＜適格機関投資家専用＞	2,390,961,771円
SMAM・バランスファンドVA40＜適格機関投資家専用＞	6,325,473,027円
SMAM・バランスファンドVA35＜適格機関投資家専用＞	11,360,183,553円
SMAM・バランスVA株40T＜適格機関投資家限定＞	824,973,396円
SMAM・外国債券パッシブファンドVA＜適格機関投資家限定＞	18,008,588,219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）	1,576,016,748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）	6,604,570,757円

S M A M ・ グローバルバランス40VA < 適格機関投資家限定 >	312,394,616円
S M A M ・ バランスファンドVA20 < 適格機関投資家専用 >	4,209,883,507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）	16,378,874,434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 >	222,283,446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 >	67,610,333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 >	18,995,241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 >	268,994,950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 >	946,057,076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 >	290,272,879円
S M A M ・ アセットバランスファンドVA20A2 < 適格機関投資家専用 >	247,461,039円
S M A M ・ アセットバランスファンドVA35A2 < 適格機関投資家専用 >	74,553,951円
S M A M ・ アセットバランスファンドVA50A2 < 適格機関投資家専用 >	9,046,638円
S M A M ・ アセットバランスファンドVA25L2 < 適格機関投資家専用 >	2,230,091,827円
S M A M ・ アセットバランスファンドVA20T2 < 適格機関投資家専用 >	59,856,871円
S M A M ・ F G 新興国重視型バランス20VA < 適格機関投資家限定 >	7,741,714円
S M A M ・ F G グローバルバランス25VA < 適格機関投資家限定 >	38,255,892円
S M A M ・ グローバル・マルチアセット・グロス・ファンド（安定成長型）< 適格機関投資家限定 >	1,827,062円
合計	153,299,085,380円

（平成27年 4月13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	153,299,085,380円
同期中における追加設定元本額	3,379,671,073円
同期中における一部解約元本額	31,635,229,842円
平成27年 4月13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	6,001,087,651円
三井住友・DC年金バランス30（債券重点型）	258,315,519円
三井住友・DC年金バランス50（標準型）	778,449,825円
三井住友・DC年金バランス70（株式重点型）	405,157,900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）	57,426,161円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2020	7,227,235円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2025	15,420,156円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2030	12,974,277円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2035	16,742,877円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2040	8,885,139円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2045	18,743,595円
三井住友・DC年金バランスゼロ（債券型）	10,802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 >	1,742,474,104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 >	8,281,231,141円
S M A M ・ バランスファンドVA25 < 適格機関投資家専用 >	26,863,434,404円
S M A M ・ バランスファンドVA37.5 < 適格機関投資家専用 >	8,402,157,458円
S M A M ・ バランスファンドVA50 < 適格機関投資家専用 >	19,030,513,258円
S M A M ・ バランスファンドVL30 < 適格機関投資家限定 >	54,635,842円
S M A M ・ バランスファンドVL50 < 適格機関投資家限定 >	146,797,016円

世界6資産バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	21,671,502円
SMAM・バランスファンドVA75<適格機関投資家専用>	1,237,314,867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>	159,073,863円
SMAM・インデックス・バランスVA25<適格機関投資家専用>	1,612,883,781円
SMAM・インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用>	2,198,003,467円
SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用>	5,789,035,437円
SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>	9,961,740,547円
SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定>	263,669,995円
SMAM・外国債券パッシブファンドVA<適格機関投資家限定>	15,486,398,825円
三井住友・外国債券インデックスファンド・VAS(適格機関投資家専用)	1,411,829,039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)	5,379,673,135円
SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	260,229,467円
SMAM・バランスファンドVA20<適格機関投資家専用>	994,065,637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)	4,357,348,453円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>	190,485,869円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>	58,078,380円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用>	17,987,803円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>	229,155,570円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	777,765,012円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T<適格機関投資家専用>	240,753,259円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A2<適格機関投資家専用>	218,323,031円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A2<適格機関投資家専用>	66,979,503円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A2<適格機関投資家専用>	6,846,199円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L2<適格機関投資家専用>	1,933,111,705円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T2<適格機関投資家専用>	36,528,257円
SMAM・FG新興国重視型バランス20VA<適格機関投資家限定>	2,955,013円
SMAM・FGグローバルバランス25VA<適格機関投資家限定>	29,783,109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>	74,550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>	76,976円
合計	125,043,526,611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 0.25	8,000,000.00	7,997,500.00		
		US TREASURY N/B 0.375	7,000,000.00	7,007,109.41		
		US TREASURY N/B 0.5	6,000,000.00	6,010,312.50		
		US TREASURY N/B 0.5	2,000,000.00	2,002,656.26		
		US TREASURY N/B 0.5	4,000,000.00	3,983,750.00		
		US TREASURY N/B 0.625	4,000,000.00	4,012,187.52		
		US TREASURY N/B 0.625	7,000,000.00	7,020,781.25		
		US TREASURY N/B 0.625	5,000,000.00	5,012,109.40		
		US TREASURY N/B 0.625	4,000,000.00	4,008,750.00		
		US TREASURY N/B 0.625	3,000,000.00	3,005,625.00		
		US TREASURY N/B 0.625	5,000,000.00	4,998,437.50		
		US TREASURY N/B 0.625	6,000,000.00	5,986,875.00		
		US TREASURY N/B 0.625	5,000,000.00	4,976,953.15		
		US TREASURY N/B 0.75	6,000,000.00	6,022,968.78		
		US TREASURY N/B 0.75	4,000,000.00	4,014,375.00		
		US TREASURY N/B 0.75	5,000,000.00	5,010,156.25		
		US TREASURY N/B 0.75	5,000,000.00	4,981,250.00		
		US TREASURY N/B 0.75	3,000,000.00	2,986,171.89		
		US TREASURY N/B 0.875	5,000,000.00	5,030,859.40		
		US TREASURY N/B 0.875	6,000,000.00	6,037,500.00		
		US TREASURY N/B 0.875	6,000,000.00	6,037,968.78		
		US TREASURY N/B 0.875	5,000,000.00	5,030,859.40		
		US TREASURY N/B 0.875	3,000,000.00	3,017,812.50		
		US TREASURY N/B 0.875	6,000,000.00	6,032,812.50		
		US TREASURY N/B 0.875	3,000,000.00	3,013,125.00		
		US TREASURY N/B 0.875	4,000,000.00	4,010,625.00		
		US TREASURY N/B 0.875	4,000,000.00	4,002,500.00		
		US TREASURY N/B 1	2,000,000.00	2,016,406.26		
		US TREASURY N/B 1	5,000,000.00	5,042,187.50		
		US TREASURY N/B 1	4,000,000.00	4,033,437.52		
		US TREASURY N/B 1	5,000,000.00	5,040,820.30		
		US TREASURY N/B 1	4,000,000.00	4,024,375.00		
		US TREASURY N/B 1	4,000,000.00	4,014,062.52		
US TREASURY N/B 1	3,000,000.00	2,966,250.00				
US TREASURY N/B 1	6,000,000.00	5,916,562.50				

US TREASURY N/B 1	2,000,000.00	1,970,625.00
US TREASURY N/B 1	6,000,000.00	5,899,218.78
US TREASURY N/B 1.125	3,000,000.00	2,984,062.50
US TREASURY N/B 1.125	4,000,000.00	3,951,875.00
US TREASURY N/B 1.125	2,800,000.00	2,760,406.26
US TREASURY N/B 1.125	3,000,000.00	2,954,765.64
US TREASURY N/B 1.25	4,000,000.00	4,020,625.00
US TREASURY N/B 1.25	4,000,000.00	4,011,875.00
US TREASURY N/B 1.25	4,000,000.00	4,001,875.00
US TREASURY N/B 1.25	2,000,000.00	1,991,875.00
US TREASURY N/B 1.25	3,000,000.00	2,977,500.00
US TREASURY N/B 1.375	4,000,000.00	4,045,937.52
US TREASURY N/B 1.375	6,500,000.00	6,565,507.84
US TREASURY N/B 1.375	5,000,000.00	5,043,750.00
US TREASURY N/B 1.375	3,000,000.00	3,023,671.89
US TREASURY N/B 1.375	5,000,000.00	5,034,375.00
US TREASURY N/B 1.375	4,000,000.00	3,998,125.00
US TREASURY N/B 1.375	4,000,000.00	3,993,437.52
US TREASURY N/B 1.375	5,000,000.00	4,980,468.75
US TREASURY N/B 1.5	5,500,000.00	5,576,054.71
US TREASURY N/B 1.5	6,000,000.00	6,086,718.78
US TREASURY N/B 1.5	5,000,000.00	5,075,390.65
US TREASURY N/B 1.5	4,700,000.00	4,759,851.58
US TREASURY N/B 1.5	3,000,000.00	3,029,531.25
US TREASURY N/B 1.5	3,000,000.00	3,019,453.14
US TREASURY N/B 1.5	3,000,000.00	2,956,640.64
US TREASURY N/B 1.625	5,000,000.00	5,079,687.50
US TREASURY N/B 1.625	5,000,000.00	5,076,171.90
US TREASURY N/B 1.625	5,000,000.00	5,071,093.75
US TREASURY N/B 1.625	2,000,000.00	2,027,343.76
US TREASURY N/B 1.625	2,000,000.00	2,022,187.50
US TREASURY N/B 1.625	3,000,000.00	2,970,703.14
US TREASURY N/B 1.625	4,500,000.00	4,451,132.83
US TREASURY N/B 1.75	3,000,000.00	3,048,281.25
US TREASURY N/B 1.75	3,000,000.00	3,067,968.75

US TREASURY N/B 1.75	4,300,000.00	4,348,375.00	
US TREASURY N/B 1.75	3,000,000.00	3,003,750.00	
US TREASURY N/B 1.75	3,000,000.00	3,003,750.00	
US TREASURY N/B 1.75	3,000,000.00	2,980,546.89	
US TREASURY N/B 1.875	3,000,000.00	3,081,796.89	
US TREASURY N/B 1.875	6,000,000.00	6,166,875.00	
US TREASURY N/B 1.875	6,000,000.00	6,165,468.78	
US TREASURY N/B 1.875	4,000,000.00	4,043,125.00	
US TREASURY N/B 2	3,000,000.00	3,078,281.25	
US TREASURY N/B 2	3,300,000.00	3,383,015.62	
US TREASURY N/B 2	5,000,000.00	5,120,312.50	
US TREASURY N/B 2	3,000,000.00	3,067,968.75	
US TREASURY N/B 2	2,000,000.00	2,042,343.76	
US TREASURY N/B 2	3,000,000.00	3,058,828.14	
US TREASURY N/B 2	4,000,000.00	4,074,687.52	
US TREASURY N/B 2	3,000,000.00	3,057,656.25	
US TREASURY N/B 2	4,100,000.00	4,177,835.95	
US TREASURY N/B 2	7,500,000.00	7,613,085.97	
US TREASURY N/B 2	6,000,000.00	6,024,843.78	
US TREASURY N/B 2.125	3,500,000.00	3,612,382.83	
US TREASURY N/B 2.125	5,000,000.00	5,150,000.00	
US TREASURY N/B 2.125	2,000,000.00	2,056,406.26	
US TREASURY N/B 2.125	7,000,000.00	7,193,046.91	
US TREASURY N/B 2.125	3,000,000.00	3,080,625.00	
US TREASURY N/B 2.125	4,000,000.00	4,105,937.52	
US TREASURY N/B 2.25	4,000,000.00	4,149,687.52	
US TREASURY N/B 2.25	2,000,000.00	2,079,062.50	
US TREASURY N/B 2.25	5,000,000.00	5,182,812.50	
US TREASURY N/B 2.25	2,000,000.00	2,071,562.50	
US TREASURY N/B 2.25	2,000,000.00	2,070,468.76	
US TREASURY N/B 2.25	7,000,000.00	7,184,843.75	
US TREASURY N/B 2.375	5,500,000.00	5,611,289.09	
US TREASURY N/B 2.375	4,000,000.00	4,155,625.00	
US TREASURY N/B 2.375	2,000,000.00	2,087,656.26	
US TREASURY N/B 2.375	7,000,000.00	7,265,781.25	

US TREASURY N/B 2.5	3,000,000.00	3,121,875.00	
US TREASURY N/B 2.5	5,000,000.00	5,253,906.25	
US TREASURY N/B 2.5	9,000,000.00	9,438,750.00	
US TREASURY N/B 2.5	2,000,000.00	1,965,625.00	
US TREASURY N/B 2.625	5,000,000.00	5,121,484.40	
US TREASURY N/B 2.625	4,000,000.00	4,195,312.52	
US TREASURY N/B 2.625	4,000,000.00	4,203,750.00	
US TREASURY N/B 2.625	4,000,000.00	4,231,875.00	
US TREASURY N/B 2.625	7,500,000.00	7,934,179.72	
US TREASURY N/B 2.75	4,000,000.00	4,147,812.52	
US TREASURY N/B 2.75	5,000,000.00	5,225,390.65	
US TREASURY N/B 2.75	4,000,000.00	4,206,250.00	
US TREASURY N/B 2.75	5,000,000.00	5,292,578.15	
US TREASURY N/B 2.75	8,200,000.00	8,780,406.25	
US TREASURY N/B 2.75	7,000,000.00	7,490,000.00	
US TREASURY N/B 2.75	2,000,000.00	2,067,187.50	
US TREASURY N/B 2.75	13,000,000.00	13,431,640.69	
US TREASURY N/B 2.875	3,000,000.00	3,172,968.75	
US TREASURY N/B 3	4,000,000.00	4,143,750.00	
US TREASURY N/B 3	3,000,000.00	3,112,500.00	
US TREASURY N/B 3	4,000,000.00	4,182,812.52	
US TREASURY N/B 3	7,000,000.00	7,587,343.75	
US TREASURY N/B 3	4,000,000.00	4,349,687.52	
US TREASURY N/B 3.125	5,000,000.00	5,205,468.75	
US TREASURY N/B 3.125	3,200,000.00	3,349,000.00	
US TREASURY N/B 3.125	4,000,000.00	4,204,062.52	
US TREASURY N/B 3.125	2,000,000.00	2,148,750.00	
US TREASURY N/B 3.125	5,000,000.00	5,434,765.65	
US TREASURY N/B 3.125	2,000,000.00	2,222,343.76	
US TREASURY N/B 3.125	3,000,000.00	3,330,468.75	
US TREASURY N/B 3.125	3,000,000.00	3,337,500.00	
US TREASURY N/B 3.25	4,000,000.00	4,132,500.00	
US TREASURY N/B 3.25	4,000,000.00	4,140,937.52	
US TREASURY N/B 3.25	4,000,000.00	4,148,750.00	
US TREASURY N/B 3.25	4,000,000.00	4,186,562.52	

US TREASURY N/B 3.25	4,000,000.00	4,208,125.00	
US TREASURY N/B 3.375	5,000,000.00	5,448,046.90	
US TREASURY N/B 3.375	4,000,000.00	4,654,062.52	
US TREASURY N/B 3.5	4,500,000.00	4,833,984.37	
US TREASURY N/B 3.5	4,500,000.00	4,953,164.08	
US TREASURY N/B 3.5	2,000,000.00	2,357,500.00	
US TREASURY N/B 3.625	7,000,000.00	7,684,687.50	
US TREASURY N/B 3.625	6,000,000.00	6,628,125.00	
US TREASURY N/B 3.625	7,000,000.00	7,795,156.25	
US TREASURY N/B 3.625	6,000,000.00	7,281,562.50	
US TREASURY N/B 3.625	3,000,000.00	3,643,828.14	
US TREASURY N/B 3.75	4,000,000.00	4,373,437.52	
US TREASURY N/B 3.75	3,000,000.00	3,707,109.39	
US TREASURY N/B 3.75	3,000,000.00	3,722,109.39	
US TREASURY N/B 3.875	6,000,000.00	6,537,187.50	
US TREASURY N/B 3.875	2,000,000.00	2,504,687.50	
US TREASURY N/B 4	2,500,000.00	2,748,046.87	
US TREASURY N/B 4.25	3,000,000.00	3,267,656.25	
US TREASURY N/B 4.25	2,000,000.00	2,649,843.76	
US TREASURY N/B 4.375	1,200,000.00	1,601,906.25	
US TREASURY N/B 4.375	1,500,000.00	2,012,226.57	
US TREASURY N/B 4.375	3,000,000.00	4,035,703.14	
US TREASURY N/B 4.375	2,000,000.00	2,712,187.50	
US TREASURY N/B 4.5	3,000,000.00	3,242,109.39	
US TREASURY N/B 4.5	2,500,000.00	3,396,289.07	
US TREASURY N/B 4.5	1,000,000.00	1,356,718.75	
US TREASURY N/B 4.5	2,000,000.00	2,726,562.50	
US TREASURY N/B 4.625	4,200,000.00	4,478,250.00	
US TREASURY N/B 4.625	3,000,000.00	3,224,765.64	
US TREASURY N/B 4.625	3,500,000.00	4,865,546.87	
US TREASURY N/B 4.75	3,000,000.00	3,283,593.75	
US TREASURY N/B 4.75	3,000,000.00	4,279,453.14	
US TREASURY N/B 4.875	3,400,000.00	3,602,937.50	
US TREASURY N/B 5.125	3,700,000.00	3,892,804.70	
US TREASURY N/B 5.25	1,000,000.00	1,361,015.63	

	US TREASURY N/B 5.25	1,000,000.00	1,364,140.63	
	US TREASURY N/B 5.375	1,320,000.00	1,868,109.38	
	US TREASURY N/B 5.5	1,000,000.00	1,387,656.25	
	US TREASURY N/B 6	1,000,000.00	1,389,765.63	
	US TREASURY N/B 6.125	1,000,000.00	1,443,906.25	
	US TREASURY N/B 6.25	1,500,000.00	2,016,562.50	
	US TREASURY N/B 6.25	1,000,000.00	1,515,390.63	
	US TREASURY N/B 6.5	500,000.00	729,609.37	
	US TREASURY N/B 7.25	4,000,000.00	4,301,875.00	
	US TREASURY N/B 8	1,800,000.00	2,509,312.50	
	US TREASURY N/B 8.75	1,000,000.00	1,169,375.00	
	US TREASURY N/B 8.75	1,000,000.00	1,375,000.00	
	US TREASURY N/B 8.875	2,100,000.00	2,716,710.94	
	米ドル 小計	739,820,000.00	777,740,056.20 (93,499,909,556)	
カナダドル	CANADA-GOV'T 1	3,000,000.00	3,018,480.00	
	CANADA-GOV'T 1.25	2,000,000.00	2,043,880.00	
	CANADA-GOV'T 1.25	1,000,000.00	1,024,610.00	
	CANADA-GOV'T 1.5	1,000,000.00	1,017,450.00	
	CANADA-GOV'T 1.5	2,000,000.00	2,036,960.00	
	CANADA-GOV'T 1.5	1,000,000.00	1,023,460.00	
	CANADA-GOV'T 1.5	2,000,000.00	2,051,860.00	
	CANADA-GOV'T 1.75	2,000,000.00	2,089,300.00	
	CANADA-GOV'T 1.75	1,000,000.00	1,045,670.00	
	CANADA-GOV'T 2	2,000,000.00	2,032,300.00	
	CANADA-GOV'T 2.5	2,000,000.00	2,212,180.00	
	CANADA-GOV'T 2.75	2,000,000.00	2,061,240.00	
	CANADA-GOV'T 2.75	1,000,000.00	1,118,200.00	
	CANADA-GOV'T 3.25	1,000,000.00	1,140,200.00	
	CANADA-GOV'T 3.5	2,000,000.00	2,270,180.00	
	CANADA-GOV'T 3.5	1,000,000.00	1,330,000.00	
	CANADA-GOV'T 3.75	2,500,000.00	2,820,750.00	
	CANADA-GOV'T 4	2,000,000.00	2,077,440.00	
	CANADA-GOV'T 4	2,000,000.00	2,147,740.00	
	CANADA-GOV'T 4	4,000,000.00	5,572,960.00	

	CANADA-GOV'T 4.25	1,500,000.00	1,673,850.00
	CANADA-GOV'T 5	2,000,000.00	3,072,880.00
	CANADA-GOV'T 5.75	1,500,000.00	2,260,710.00
	CANADA-GOV'T 5.75	1,500,000.00	2,387,100.00
	CANADA-GOV'T 8	1,000,000.00	1,716,710.00
カナダドル 小計		44,000,000.00	51,246,110.00 (4,897,078,271)
メキシコペソ	MEXICAN BONOS 6.5	30,000,000.00	31,648,500.00
	MEXICAN BONOS 7.25	50,000,000.00	52,877,500.00
	MEXICAN BONOS 7.75	20,000,000.00	21,698,000.00
	MEXICAN BONOS 8	50,000,000.00	56,310,000.00
	MEXICAN BONOS 8	20,000,000.00	23,166,000.00
	MEXICAN BONOS 8.5	50,000,000.00	61,515,000.00
	MEXICAN BONOS 8.5	40,000,000.00	50,104,000.00
メキシコペソ 小計		260,000,000.00	297,319,000.00 (2,348,820,100)
ユーロ	BELGIAN 0326 4	1,000,000.00	1,510,650.00
	BELGIAN 0291 5.5	2,500,000.00	4,035,200.00
	BELGIAN 0300 5.5	740,000.00	843,807.20
	BELGIAN 0304 5	2,500,000.00	4,388,575.00
	BELGIAN 0307 3.25	2,000,000.00	2,100,500.00
	BELGIAN 0308 4	1,500,000.00	1,905,195.00
	BELGIAN 0309 4	1,500,000.00	1,623,375.00
	BELGIAN 0312 4	1,000,000.00	1,123,400.00
	BELGIAN 0315 4	1,500,000.00	1,744,095.00
	BELGIAN 0318 3.75	2,000,000.00	2,414,700.00
	BELGIAN 0320 4.25	1,500,000.00	2,626,500.00
	BELGIAN 0321 4.25	1,700,000.00	2,161,465.00
	BELGIAN 0323 3.5	2,000,000.00	2,163,260.00
	BELGIAN 0324 4.5	1,000,000.00	1,433,530.00
	BELGIAN 0325 4.25	2,000,000.00	2,607,300.00
	BELGIAN 0327 3	2,000,000.00	2,274,400.00
	BELGIAN 0328 2.25	2,000,000.00	2,326,440.00
	BELGIAN 0329 1.25	1,000,000.00	1,044,770.00
	BELGIAN 0332 2.6	2,000,000.00	2,411,800.00
	BELGIAN 0333 3	500,000.00	689,415.00

BELGIAN 3.75	1,000,000.00	1,690,100.00	
BTAN 1	2,500,000.00	2,567,625.00	
BTAN 1.75	2,500,000.00	2,590,700.00	
BTAN 2.5	3,600,000.00	3,723,948.00	
BTPS 0.75	1,000,000.00	1,014,080.00	
BTPS 1.15	2,000,000.00	2,041,600.00	
BTPS 1.5	2,000,000.00	2,047,460.00	
BTPS 2.15	2,000,000.00	2,166,600.00	
BTPS 2.25	1,500,000.00	1,536,000.00	
BTPS 2.5	1,000,000.00	1,116,500.00	
BTPS 3.25	1,000,000.00	1,251,330.00	
BTPS 3.5	1,000,000.00	1,083,480.00	
BTPS 3.5	3,400,000.00	3,740,102.00	
BTPS 3.5	2,000,000.00	2,227,860.00	
BTPS 3.5	1,000,000.00	1,244,230.00	
BTPS 3.75	2,000,000.00	2,074,600.00	
BTPS 3.75	3,700,000.00	3,877,785.00	
BTPS 3.75	3,000,000.00	3,523,740.00	
BTPS 3.75	2,000,000.00	2,350,660.00	
BTPS 3.75	3,300,000.00	3,893,769.00	
BTPS 3.75	2,000,000.00	2,448,660.00	
BTPS 4	2,500,000.00	2,675,575.00	
BTPS 4	3,500,000.00	4,125,380.00	
BTPS 4	3,500,000.00	4,716,075.00	
BTPS 4.25	4,400,000.00	5,045,260.00	
BTPS 4.25	4,500,000.00	5,243,310.00	
BTPS 4.25	3,300,000.00	3,889,710.00	
BTPS 4.5	4,000,000.00	4,474,400.00	
BTPS 4.5	3,000,000.00	3,412,140.00	
BTPS 4.5	3,700,000.00	4,289,410.00	
BTPS 4.5	2,700,000.00	3,208,761.00	
BTPS 4.5	2,800,000.00	3,540,264.00	
BTPS 4.5	3,000,000.00	3,845,040.00	
BTPS 4.5	3,000,000.00	3,963,540.00	
BTPS 4.75	2,500,000.00	2,665,825.00	

BTPS 4.75	2,000,000.00	2,187,960.00	
BTPS 4.75	2,000,000.00	2,194,460.00	
BTPS 4.75	3,600,000.00	4,477,428.00	
BTPS 4.75	3,500,000.00	4,516,855.00	
BTPS 4.75	2,000,000.00	2,766,100.00	
BTPS 4.75	1,000,000.00	1,576,000.00	
BTPS 5	2,000,000.00	2,548,860.00	
BTPS 5	3,000,000.00	4,052,550.00	
BTPS 5	2,970,000.00	4,454,109.00	
BTPS 5	2,500,000.00	3,895,200.00	
BTPS 5	3,500,000.00	5,495,350.00	
BTPS 5.25	4,000,000.00	4,464,320.00	
BTPS 5.25	3,700,000.00	5,438,741.00	
BTPS 5.5	2,500,000.00	3,300,075.00	
BTPS 5.5	3,000,000.00	3,972,240.00	
BTPS 5.75	2,200,000.00	3,519,736.00	
BTPS 6	4,100,000.00	6,588,413.00	
BTPS 6.5	2,960,000.00	4,659,128.80	
BTPS 7.25	1,000,000.00	1,626,650.00	
BTPS 9	2,000,000.00	3,285,340.00	
BUNDESUBL-160 2.75	3,000,000.00	3,089,310.00	
BUNDESUBL-161 1.25	2,000,000.00	2,045,800.00	
BUNDESUBL-162 0.75	2,500,000.00	2,548,125.00	
BUNDESUBL-163 0.5	2,000,000.00	2,030,840.00	
BUNDESUBL-164 0.5	2,000,000.00	2,038,760.00	
BUNDESUBL-165 0.5	2,000,000.00	2,043,400.00	
BUNDESUBL-166 0.25	2,000,000.00	2,030,240.00	
BUNDESUBL-167 1	2,000,000.00	2,086,540.00	
BUNDESUBL-168 1	1,000,000.00	1,046,650.00	
BUNDESUBL-169 0.5	1,000,000.00	1,027,900.00	
BUNDESSCHATZANW 0	2,000,000.00	2,009,200.00	
DEUTSCHLAND REP 0.5	1,000,000.00	1,033,750.00	
DEUTSCHLAND REP 1	2,000,000.00	2,161,700.00	
DEUTSCHLAND REP 1.5	2,500,000.00	2,778,750.00	
DEUTSCHLAND REP 1.5	2,500,000.00	2,792,125.00	

DEUTSCHLAND REP 1.5	2,000,000.00	2,239,300.00	
DEUTSCHLAND REP 1.5	2,000,000.00	2,253,200.00	
DEUTSCHLAND REP 1.75	2,500,000.00	2,821,625.00	
DEUTSCHLAND REP 1.75	2,000,000.00	2,295,500.00	
DEUTSCHLAND REP 2	2,000,000.00	2,276,360.00	
DEUTSCHLAND REP 2	2,500,000.00	2,909,250.00	
DEUTSCHLAND REP 2.25	1,500,000.00	1,693,095.00	
DEUTSCHLAND REP 2.25	2,000,000.00	2,298,660.00	
DEUTSCHLAND REP 2.5	2,000,000.00	2,299,900.00	
DEUTSCHLAND REP 2.5	2,700,000.00	4,063,581.00	
DEUTSCHLAND REP 3	3,000,000.00	3,494,310.00	
DEUTSCHLAND REP 3.25	3,000,000.00	3,487,740.00	
DEUTSCHLAND REP 3.25	3,000,000.00	3,624,750.00	
DEUTSCHLAND REP 3.25	2,000,000.00	3,326,560.00	
DEUTSCHLAND REP 3.5	4,000,000.00	4,626,400.00	
DEUTSCHLAND REP 3.75	3,000,000.00	3,209,190.00	
DEUTSCHLAND REP 3.75	4,500,000.00	5,168,250.00	
DEUTSCHLAND REP 4	3,900,000.00	4,104,048.00	
DEUTSCHLAND REP 4	3,000,000.00	3,350,700.00	
DEUTSCHLAND REP 4	2,700,000.00	4,600,530.00	
DEUTSCHLAND REP 4.25	2,000,000.00	2,201,600.00	
DEUTSCHLAND REP 4.25	3,200,000.00	3,666,720.00	
DEUTSCHLAND REP 4.25	2,000,000.00	3,648,560.00	
DEUTSCHLAND REP 4.75	1,300,000.00	2,048,514.00	
DEUTSCHLAND REP 4.75	2,600,000.00	4,625,530.00	
DEUTSCHLAND REP 4.75	1,900,000.00	3,743,190.00	
DEUTSCHLAND REP 5.5	2,300,000.00	4,081,120.00	
DEUTSCHLAND REP 5.625	2,080,000.00	3,469,544.00	
DEUTSCHLAND REP 6	890,000.00	956,198.20	
DEUTSCHLAND REP 6.25	2,200,000.00	3,396,140.00	
DEUTSCHLAND REP 6.25	1,000,000.00	1,848,100.00	
DEUTSCHLAND REP 6.5	1,500,000.00	2,628,600.00	
FINNISH GOV'T 1.625	2,000,000.00	2,224,460.00	
FINNISH GOV'T 1.75	1,200,000.00	1,223,880.00	
FINNISH GOV'T 2.75	1,100,000.00	1,423,917.00	

FINNISH GOV'T 3.375	1,200,000.00	1,407,000.00	
FINNISH GOV'T 3.5	1,000,000.00	1,210,980.00	
FINNISH GOV'T 3.875	1,000,000.00	1,099,630.00	
FINNISH GOV'T 4	1,000,000.00	1,375,880.00	
FINNISH GOV'T 4.375	1,000,000.00	1,189,950.00	
FRANCE O.A.T. 0.25	2,000,000.00	2,014,160.00	
FRANCE O.A.T. 0.5	2,000,000.00	2,050,060.00	
FRANCE O.A.T. 0.5	2,000,000.00	2,013,400.00	
FRANCE O.A.T. 1	3,000,000.00	3,107,400.00	
FRANCE O.A.T. 1	1,000,000.00	1,040,650.00	
FRANCE O.A.T. 1	1,000,000.00	1,044,400.00	
FRANCE O.A.T. 1.75	3,000,000.00	3,365,040.00	
FRANCE O.A.T. 1.75	3,000,000.00	3,387,690.00	
FRANCE O.A.T. 2.25	2,300,000.00	2,654,614.00	
FRANCE O.A.T. 2.25	3,000,000.00	3,518,340.00	
FRANCE O.A.T. 2.5	4,500,000.00	5,119,110.00	
FRANCE O.A.T. 2.5	1,000,000.00	1,252,180.00	
FRANCE O.A.T. 2.75	3,000,000.00	3,778,410.00	
FRANCE O.A.T. 3	5,000,000.00	5,999,000.00	
FRANCE O.A.T. 3.25	3,700,000.00	3,831,276.00	
FRANCE O.A.T. 3.25	4,800,000.00	5,785,920.00	
FRANCE O.A.T. 3.25	1,000,000.00	1,549,130.00	
FRANCE O.A.T. 3.5	5,000,000.00	5,887,750.00	
FRANCE O.A.T. 3.5	4,000,000.00	5,296,600.00	
FRANCE O.A.T. 3.75	5,000,000.00	5,400,600.00	
FRANCE O.A.T. 3.75	5,000,000.00	5,866,350.00	
FRANCE O.A.T. 3.75	4,700,000.00	5,747,865.00	
FRANCE O.A.T. 4	4,000,000.00	4,505,600.00	
FRANCE O.A.T. 4	3,200,000.00	5,237,856.00	
FRANCE O.A.T. 4	2,370,000.00	4,463,065.50	
FRANCE O.A.T. 4	1,500,000.00	2,908,050.00	
FRANCE O.A.T. 4.25	4,500,000.00	5,005,800.00	
FRANCE O.A.T. 4.25	4,000,000.00	4,620,800.00	
FRANCE O.A.T. 4.25	6,400,000.00	7,523,072.00	
FRANCE O.A.T. 4.25	5,000,000.00	6,687,500.00	

FRANCE O.A.T. 4.5	3,200,000.00	5,759,776.00	
FRANCE O.A.T. 4.75	2,600,000.00	4,451,408.00	
FRANCE O.A.T. 5	3,600,000.00	3,886,488.00	
FRANCE O.A.T. 5.5	4,500,000.00	7,415,550.00	
FRANCE O.A.T. 5.75	3,200,000.00	5,800,960.00	
FRANCE O.A.T. 6	2,500,000.00	3,940,000.00	
FRANCE O.A.T. 8.5	850,000.00	1,180,905.00	
FRANCE O.A.T. 8.5	2,200,000.00	3,659,810.00	
IRISH GOVT 2	1,000,000.00	1,142,650.00	
IRISH GOVT 3.4	1,000,000.00	1,242,830.00	
IRISH GOVT 3.9	1,000,000.00	1,264,350.00	
IRISH GOVT 4.4	1,500,000.00	1,774,770.00	
IRISH GOVT 4.5	1,000,000.00	1,159,580.00	
IRISH GOVT 4.5	1,490,000.00	1,810,767.20	
IRISH GOVT 4.6	800,000.00	837,800.00	
IRISH GOVT 5	1,000,000.00	1,259,500.00	
IRISH GOVT 5.4	1,500,000.00	2,172,900.00	
IRISH GOVT 5.5	500,000.00	569,875.00	
IRISH GOVT 5.9	1,300,000.00	1,641,744.00	
ITALY GOV'T INT 5.75	1,000,000.00	1,071,280.00	
NETHERLANDS GOVT 0	2,000,000.00	2,004,860.00	
NETHERLANDS GOVT 0.25	1,000,000.00	1,015,980.00	
NETHERLANDS GOVT 0.5	1,000,000.00	1,014,380.00	
NETHERLANDS GOVT 1.25	1,500,000.00	1,560,045.00	
NETHERLANDS GOVT 1.25	2,000,000.00	2,104,660.00	
NETHERLANDS GOVT 1.75	2,200,000.00	2,484,856.00	
NETHERLANDS GOVT 2	2,000,000.00	2,324,100.00	
NETHERLANDS GOVT 2.25	2,000,000.00	2,312,700.00	
NETHERLANDS GOVT 2.5	2,000,000.00	2,095,700.00	
NETHERLANDS GOVT 2.5	1,600,000.00	2,133,520.00	
NETHERLANDS GOVT 2.75	500,000.00	782,050.00	
NETHERLANDS GOVT 3.25	1,500,000.00	1,804,770.00	
NETHERLANDS GOVT 3.5	2,000,000.00	2,375,260.00	
NETHERLANDS GOVT 3.75	1,000,000.00	1,279,550.00	
NETHERLANDS GOVT 3.75	2,000,000.00	3,530,160.00	

NETHERLANDS GOVT 4	2,300,000.00	2,422,084.00	
NETHERLANDS GOVT 4	2,500,000.00	2,840,000.00	
NETHERLANDS GOVT 4	1,500,000.00	1,763,295.00	
NETHERLANDS GOVT 4	1,700,000.00	2,885,291.00	
NETHERLANDS GOVT 4.5	2,000,000.00	2,212,740.00	
NETHERLANDS GOVT 5.5	1,500,000.00	2,449,875.00	
REP OF AUSTRIA 1.65	1,000,000.00	1,128,430.00	
REP OF AUSTRIA 1.95	1,000,000.00	1,085,330.00	
REP OF AUSTRIA 3.15	1,000,000.00	1,618,680.00	
REP OF AUSTRIA 3.2	1,700,000.00	1,807,474.00	
REP OF AUSTRIA 3.4	1,000,000.00	1,247,550.00	
REP OF AUSTRIA 3.5	2,000,000.00	2,445,100.00	
REP OF AUSTRIA 3.65	2,000,000.00	2,500,400.00	
REP OF AUSTRIA 3.8	500,000.00	1,047,325.00	
REP OF AUSTRIA 3.9	2,000,000.00	2,413,800.00	
REP OF AUSTRIA 4	1,000,000.00	1,059,950.00	
REP OF AUSTRIA 4.15	1,300,000.00	2,212,795.00	
REP OF AUSTRIA 4.3	1,500,000.00	1,663,545.00	
REP OF AUSTRIA 4.35	2,200,000.00	2,584,956.00	
REP OF AUSTRIA 4.65	1,000,000.00	1,133,500.00	
REP OF AUSTRIA 4.85	1,000,000.00	1,480,100.00	
REP OF AUSTRIA 6.25	1,000,000.00	1,695,930.00	
SPANISH GOV'T 1.95	1,500,000.00	1,550,025.00	
SPANISH GOV'T 2.1	2,000,000.00	2,081,900.00	
SPANISH GOV'T 2.75	1,000,000.00	1,094,200.00	
SPANISH GOV'T 2.75	3,000,000.00	3,418,440.00	
SPANISH GOV'T 3.25	2,000,000.00	2,067,760.00	
SPANISH GOV'T 3.3	2,000,000.00	2,084,900.00	
SPANISH GOV'T 3.75	3,200,000.00	3,587,040.00	
SPANISH GOV'T 3.8	3,500,000.00	3,735,200.00	
SPANISH GOV'T 3.8	2,000,000.00	2,453,200.00	
SPANISH GOV'T 4	3,000,000.00	3,511,740.00	
SPANISH GOV'T 4.1	2,000,000.00	2,251,060.00	
SPANISH GOV'T 4.2	2,050,000.00	2,865,080.00	
SPANISH GOV'T 4.25	3,000,000.00	3,196,140.00	

	SPANISH GOV'T 4.3	3,000,000.00	3,516,960.00	
	SPANISH GOV'T 4.5	2,500,000.00	2,799,425.00	
	SPANISH GOV'T 4.6	3,500,000.00	4,122,300.00	
	SPANISH GOV'T 4.65	2,500,000.00	3,317,575.00	
	SPANISH GOV'T 4.7	1,500,000.00	2,311,095.00	
	SPANISH GOV'T 4.8	4,300,000.00	5,626,550.00	
	SPANISH GOV'T 4.85	3,000,000.00	3,687,390.00	
	SPANISH GOV'T 4.9	1,500,000.00	2,355,045.00	
	SPANISH GOV'T 5.15	1,500,000.00	2,147,925.00	
	SPANISH GOV'T 5.15	1,000,000.00	1,673,350.00	
	SPANISH GOV'T 5.4	2,000,000.00	2,659,400.00	
	SPANISH GOV'T 5.5	3,380,000.00	3,795,334.40	
	SPANISH GOV'T 5.5	3,000,000.00	3,843,990.00	
	SPANISH GOV'T 5.75	2,200,000.00	3,515,380.00	
	SPANISH GOV'T 5.85	2,500,000.00	3,326,000.00	
	SPANISH GOV'T 5.9	2,000,000.00	2,941,600.00	
	SPANISH GOV'T 6	2,400,000.00	3,705,672.00	
	ユーロ 小計	555,380,000.00	694,596,013.30 (88,679,073,018)	
英bond	TREASURY 1	3,300,000.00	3,333,297.00	
	TREASURY 1.25	1,500,000.00	1,521,915.00	
	TREASURY 1.75	2,500,000.00	2,556,750.00	
	TREASURY 1.75	1,000,000.00	1,030,370.00	
	TREASURY 1.75	3,500,000.00	3,579,485.00	
	TREASURY 2.25	3,700,000.00	3,908,014.00	
	TREASURY 2.75	2,000,000.00	2,195,860.00	
	TREASURY 3.25	1,500,000.00	1,787,535.00	
	TREASURY 3.5	500,000.00	624,595.00	
	TREASURY 3.5	1,000,000.00	1,370,790.00	
	TREASURY 3.75	3,000,000.00	3,356,100.00	
	TREASURY 3.75	3,300,000.00	3,752,595.00	
	TREASURY 3.75	2,900,000.00	3,342,482.00	
	TREASURY 3.75	2,300,000.00	3,131,772.00	
	TREASURY 4	2,800,000.00	2,939,972.00	
	TREASURY 4	2,000,000.00	2,353,980.00	

	TREASURY 4	2,000,000.00	2,960,780.00	
	TREASURY 4.25	1,800,000.00	2,295,126.00	
	TREASURY 4.25	2,500,000.00	3,278,850.00	
	TREASURY 4.25	2,500,000.00	3,347,900.00	
	TREASURY 4.25	1,500,000.00	2,054,985.00	
	TREASURY 4.25	2,000,000.00	2,758,040.00	
	TREASURY 4.25	2,900,000.00	4,159,789.00	
	TREASURY 4.25	1,900,000.00	2,784,773.00	
	TREASURY 4.25	2,600,000.00	3,958,292.00	
	TREASURY 4.5	4,200,000.00	4,781,322.00	
	TREASURY 4.5	2,500,000.00	3,422,900.00	
	TREASURY 4.5	2,500,000.00	3,623,450.00	
	TREASURY 4.75	2,700,000.00	3,172,689.00	
	TREASURY 4.75	2,300,000.00	3,161,465.00	
	TREASURY 4.75	2,500,000.00	3,645,500.00	
	TREASURY 5	3,500,000.00	3,936,835.00	
	TREASURY 5	2,500,000.00	3,275,700.00	
	TREASURY 6	1,200,000.00	1,808,040.00	
	TREASURY 8	1,620,000.00	2,267,028.00	
	TREASURY 8.75	800,000.00	957,984.00	
	英bond 小計	82,820,000.00	102,436,960.00 (18,025,831,851)	
スイスフラン	SWISS (GOVT) 2.25	900,000.00	1,028,970.00	
	SWISS (GOVT) 3	500,000.00	553,250.00	
	SWISS (GOVT) 3	1,000,000.00	1,149,700.00	
	SWISS (GOVT) 4	1,000,000.00	1,335,600.00	
	SWISS (GOVT) 4	700,000.00	1,061,620.00	
	SWISS (GOVT) 4.25	500,000.00	555,750.00	
	スイスフラン 小計	4,600,000.00	5,684,890.00 (698,445,585)	
スウェーデンクローナ	SWEDISH GOVRNMNT 1.5	8,000,000.00	8,840,640.00	
	SWEDISH GOVRNMNT 3	6,000,000.00	6,246,000.00	
	SWEDISH GOVRNMNT 3.5	11,000,000.00	13,614,260.00	
	SWEDISH GOVRNMNT 3.5	9,000,000.00	14,074,020.00	
	SWEDISH GOVRNMNT 3.75	13,200,000.00	14,457,960.00	
	SWEDISH GOVRNMNT 4.25	12,000,000.00	14,092,080.00	

	SWEDISH GOVRMNT 5	5,000,000.00	6,407,500.00	
スウェーデンクローナ 小計		64,200,000.00	77,732,460.00	(1,061,048,079)
ノルウェークローネ	NORWEGIAN GOV'T 2	10,000,000.00	10,547,000.00	
	NORWEGIAN GOV'T 3.75	11,000,000.00	12,691,800.00	
	NORWEGIAN GOV'T 4.25	10,000,000.00	10,723,000.00	
	NORWEGIAN GOV'T 4.5	6,000,000.00	6,854,400.00	
ノルウェークローネ 小計		37,000,000.00	40,816,200.00	(606,120,570)
デンマーククローネ	DENMARK - BULLET 3	10,000,000.00	12,010,000.00	
	DENMARK - BULLET 4	4,000,000.00	4,111,000.00	
	DENMARK - BULLET 4	10,000,000.00	11,090,000.00	
	DENMARK - BULLET 4	21,000,000.00	25,115,790.00	
	DENMARK - BULLET 4.5	18,000,000.00	33,706,800.00	
	DENMARK - BULLET 7	3,080,000.00	5,086,928.00	
デンマーククローネ 小計		66,080,000.00	91,120,518.00	(1,556,338,447)
ポーランドズロチ	POLAND GOVT BOND 2.5	5,000,000.00	5,115,000.00	
	POLAND GOVT BOND 4	2,000,000.00	2,281,600.00	
	POLAND GOVT BOND 5	8,000,000.00	8,280,000.00	
	POLAND GOVT BOND 5.25	5,000,000.00	5,448,500.00	
	POLAND GOVT BOND 5.25	2,000,000.00	2,336,000.00	
	POLAND GOVT BOND 5.5	4,000,000.00	4,616,000.00	
	POLAND GOVT BOND 5.75	4,000,000.00	4,880,000.00	
	POLAND GOVT BOND 5.75	4,200,000.00	5,216,400.00	
	POLAND GOVT BOND 5.75	2,000,000.00	2,776,160.00	
ポーランドズロチ 小計		36,200,000.00	40,949,660.00	(1,299,742,208)
オーストラリアドル	AUSTRALIAN GOVT. 2.75	3,000,000.00	3,107,019.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 2.75	1,000,000.00	984,500.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 3.25	2,000,000.00	2,156,800.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 3.25	1,500,000.00	1,608,450.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 3.75	1,000,000.00	1,147,100.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 4.25	2,000,000.00	2,107,800.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 4.25	1,000,000.00	1,172,500.00	

	AUSTRALIAN GOVT. 4.5	4,000,000.00	4,490,000.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 4.5	1,500,000.00	1,873,650.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 4.75	3,000,000.00	3,099,900.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 4.75	1,200,000.00	1,480,800.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 5.25	3,000,000.00	3,388,800.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 5.5	2,000,000.00	2,199,200.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 5.5	2,500,000.00	3,092,500.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 5.75	3,000,000.00	3,634,650.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 5.75	2,000,000.00	2,478,600.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 6	3,300,000.00	3,547,698.00	
オーストラリアドル 小計		37,000,000.00	41,569,967.00	(3,829,009,660)
シンガポールドル	SINGAPORE GOV'T 2.25	500,000.00	512,600.00	
	SINGAPORE GOV'T 2.75	400,000.00	402,800.00	
	SINGAPORE GOV'T 2.875	400,000.00	420,400.00	
	SINGAPORE GOV'T 3.125	1,000,000.00	1,082,800.00	
	SINGAPORE GOV'T 3.25	1,000,000.00	1,079,300.00	
	SINGAPORE GOV'T 3.375	500,000.00	558,400.00	
	SINGAPORE GOV'T 3.5	1,500,000.00	1,695,375.00	
	SINGAPORE GOV'T 3.75	1,500,000.00	1,559,475.00	
	SINGAPORE GOV'T 4	2,100,000.00	2,290,785.00	
シンガポールドル 小計		8,900,000.00	9,601,935.00	(844,970,280)
マレーシアリングgit	MALAYSIA GOVT 3.418	8,000,000.00	7,786,400.00	
	MALAYSIA GOVT 3.502	9,000,000.00	8,533,800.00	
	MALAYSIA GOVT 3.814	2,000,000.00	2,020,900.00	
	MALAYSIA GOVT 4.24	5,000,000.00	5,116,500.00	
	MALAYSIA GOVT 4.262	3,000,000.00	3,043,200.00	
	MALAYSIA GOVT 4.378	5,000,000.00	5,162,500.00	
マレーシアリングgit 小計		32,000,000.00	31,663,300.00	(1,036,339,809)
南アフリカランド	REP SOUTH AFRICA 6.5	40,000,000.00	32,468,000.00	
	REP SOUTH AFRICA 6.75	30,000,000.00	29,124,000.00	
	REP SOUTH AFRICA 7	30,000,000.00	26,874,000.00	
	REP SOUTH AFRICA 8	25,000,000.00	25,693,750.00	
	REP SOUTH AFRICA 8.25	8,000,000.00	8,237,600.00	

	南アフリカランド 小計	133,000,000.00	122,397,350.00 (1,226,421,447)	
	合計		219,609,148,881 (219,609,148,881)	

(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 188銘柄	41.7%	42.6%
カナダドル	国債証券 25銘柄	2.2%	2.2%
メキシコペソ	国債証券 7銘柄	1.0%	1.1%
ユーロ	国債証券 247銘柄	39.6%	40.4%
英ポンド	国債証券 36銘柄	8.0%	8.2%
スイスフラン	国債証券 6銘柄	0.3%	0.3%
スウェーデンクローナ	国債証券 7銘柄	0.5%	0.5%
ノルウェークローネ	国債証券 4銘柄	0.3%	0.3%
デンマーククローネ	国債証券 6銘柄	0.7%	0.7%
ポーランドズロチ	国債証券 9銘柄	0.6%	0.6%
オーストラリアドル	国債証券 17銘柄	1.7%	1.7%
シンガポールドル	国債証券 9銘柄	0.4%	0.4%
マレーシアリングット	国債証券 6銘柄	0.5%	0.5%
南アフリカランド	国債証券 5銘柄	0.5%	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

該当事項はありません。

マネーインカム・マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

	(平成26年 4月14日現在)	(平成27年 4月13日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	21,739,266	62,085,901
国債証券	1,361,568,330	1,452,000,920
未収利息	3,470,137	3,179,725
前払費用	1,463,661	1,181,231

流動資産合計	1,388,241,394	1,518,447,777
資産合計	1,388,241,394	1,518,447,777
負債の部		
流動負債		
未払解約金	5,000,000	19,837,424
流動負債合計	5,000,000	19,837,424
負債合計	5,000,000	19,837,424
純資産の部		
元本等		
元本	1,367,531,596	1,480,579,600
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	15,709,798	18,030,753
元本等合計	1,383,241,394	1,498,610,353
純資産合計	1,383,241,394	1,498,610,353
負債純資産合計	1,388,241,394	1,518,447,777

注記表

（重要な会計方針の注記）

項 目	自 平成26年 4月15日
	至 平成27年 4月13日
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>

（貸借対照表に関する注記）

項 目	（平成26年 4月14日現在）	（平成27年 4月13日現在）
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	1,367,531,596口	1,480,579,600口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.0115円 (10,000口当たりの純資産額 10,115円)	1口当たり純資産額 1.0122円 (10,000口当たりの純資産額 10,122円)

（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26年 4月15日 至 平成27年 4月13日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>(1)金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、国債証券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2)金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する委員会をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用グループに是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用グループは、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。その後、当該関連運用グループの対処の実施や対処方針の決定等に関し、必要に応じてリスク管理を行う部署が当該部署の担当役員、当該関連運用グループの担当役員およびリスク管理委員会へ報告を行う体制となっております。</p> <p>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する部会にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。</p>

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

・金融商品の時価等に関する事項

項目	(平成27年 4月13日現在)
1.貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1) 有価証券（国債証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

(平成26年 4月14日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	1,616,825,023円
同期中における追加設定元本額	616,696,919円
同期中における一部解約元本額	865,990,346円
平成26年 4月14日現在における元本の内訳	
スミセイ・DCバランスファンド（機動的資産配分型）	25,324,367円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2020	7,374,248円

スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2025	1,563,603円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2030	1,156,779円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2035	1,287,329円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2040	351,710円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2045	880,720円
三井住友・ロシア株式オープン	999,001円
S M A M円高期待ファンド(豪ドル安型)	53,545,082円
S M A M円高期待ファンド(米ドル安型)	7,647,122円
S M A M円高期待ファンド(ユーロ安型)	25,454,345円
アジア高成長国C Bファンド	5,047,155円
日興ニューバーガー米国小型ハイクオリティファンド(毎月決算型)	99,128円
日興ニューバーガー米国小型ハイクオリティファンド(資産成長型)	297,384円
S M A M・マネーインカムファンド<適格機関投資家限定>	296,772,721円
S M A M・バランス先物ファンドV A 2 0<適格機関投資家限定>	670,438,337円
S M A M・F GマネーファンドV A<適格機関投資家限定>	269,292,565円
合計	1,367,531,596円

(平成27年 4月13日現在)

開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	1,367,531,596円
同期中における追加設定元本額	535,652,905円
同期中における一部解約元本額	422,604,901円
平成27年 4月13日現在における元本の内訳	
S M A M・グローバルバランスファンド(機動的資産配分型)	9,965,058円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2020	17,049,843円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2025	2,660,534円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2030	2,144,976円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2035	2,759,823円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2040	1,428,890円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2045	3,074,544円
日興ニューバーガー米国小型ハイクオリティファンド(毎月決算型)	99,128円
日興ニューバーガー米国小型ハイクオリティファンド(資産成長型)	297,384円
S M A M・マネーインカムファンド<適格機関投資家限定>	386,063,297円
S M A M・バランス先物ファンドV A 2 0<適格機関投資家限定>	678,347,677円
S M A M・F GマネーファンドV A<適格機関投資家限定>	376,688,446円
合計	1,480,579,600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338回利付国債（2年）	215,000,000	215,195,650	
	第98回利付国債（5年）	50,000,000	50,177,000	
	第270回利付国債（10年）	728,000,000	729,710,800	
	第273回利付国債（10年）	228,000,000	229,479,720	
	第274回利付国債（10年）	25,000,000	25,255,750	
	第276回利付国債（10年）	200,000,000	202,182,000	
	合計	1,446,000,000	1,452,000,920	

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

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）

平成27年 5月29日現在

資産総額	749,668,920円
負債総額	1,223,633円
純資産総額（ - ）	748,445,287円
発行済口数	545,133,434口
1口当たり純資産額（ / ）	1.3730円
（1万口当たり純資産額）	（13,730円）

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

ファンドの受益権は、社振法の規定の適用を受け、ファンドの受益権を取り扱う振替機関が社振法の規定により主務大臣の指定を取り消された場合または当該指定が効力を失った場合であって、当該振替機関の振替業を承継する者が存在しない場合その他やむを得ない事情等がある場合を除き、当該振替受益権を表示する受益証券は発行されません。

イ 名義書換

該当事項はありません。

ロ 受益者名簿

作成しません。

ハ 受益者に対する特典

ありません。

ニ 受益権の譲渡および譲渡制限等

(イ) 受益権の譲渡

- a. 受益者は、その保有する受益権を譲渡する場合には、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿にかかる振替機関等に振替の申請をするものとします。
- b. 上記 a の申請のある場合には、上記 a の振替機関等は、当該譲渡にかかる譲渡人の保有する受益権の口数の減少および譲受人の保有する受益権の口数の増加につき、その備える振替口座簿に記載または記録するものとします。ただし、上記 a の振替機関等が振替先口座を開設したものでない場合には、譲受人の振替先口座を開設した他の振替機関等（当該他の振替機関等の上位機関を含みます。）に社振法の規定に従い、譲受人の振替先口座に受益権の口数の増加の記載または記録が行われるよう通知するものとします。
- c. 上記 a の振替について、委託会社は、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿にかかる振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合等において、委託会社が必要と認めるときまたはやむを得ない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

(ロ) 受益権の譲渡制限および譲渡の対抗要件

譲渡制限はありません。ただし、受益権の譲渡は、振替口座簿への記載または記録によらなければ、委託会社および受託会社に対抗することができません。

ホ 受益権の再分割

委託会社は、受託会社と協議の上、社振法に定めるところに従い、一定日現在の受益権を均等に再分割できるものとします。

へ 償還金

償還金は、原則として、償還日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者に支払います。

ト 質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

振替機関等の振替口座簿の質権口に記載または記録されている受益権にかかる収益分配金の支払い、一部解約の実行の請求の受付け、一部解約金および償還金の支払い等については、約款の規定によるほか、民法その他の法令等に従って取り扱われます。

第三部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

イ 資本金の額および株式数

	平成27年 5月29日現在
資本金の額	2,000百万円
会社が発行する株式の総数	60,000株
発行済株式総数	17,640株

ロ 最近5年間における資本金の額の増減 該当ありません。

八 会社の機構

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

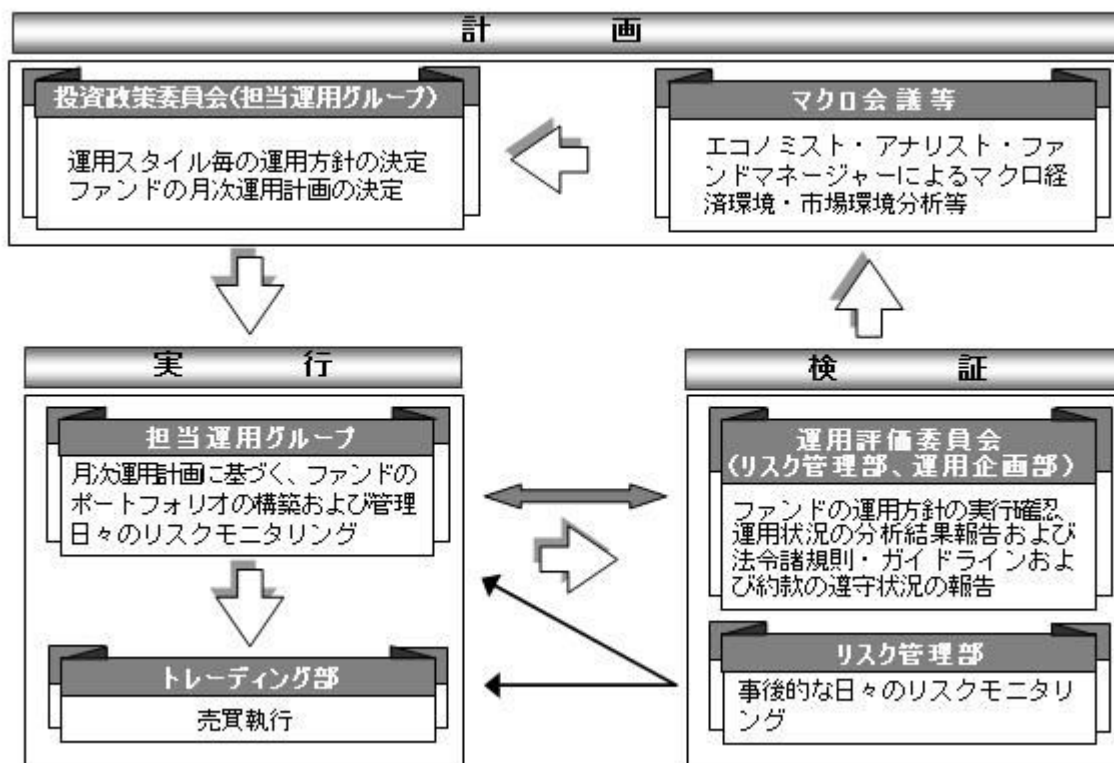
取締役の任期は、選任後1年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会の終結の時までとし、補欠または増員によって選任された取締役の任期は、他の現任取締役の任期の満了する時までとします。

委託会社の業務上重要な事項は、取締役会の決議により決定します。

取締役会は、取締役会の決議によって、代表取締役を若干名を選定します。

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

二 投資信託の運用の流れ



2【事業の内容及び営業の概況】

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

平成27年5月29日現在、委託会社が運用を行っている投資信託（親投資信託は除きます）は、以下の通りです。

（平成27年5月29日現在、単位：百万円）

		本数	純資産総額
株式投資信託	単位型	45 (13)	170,197 (54,856)
	追加型	439 (181)	5,402,076 (2,995,682)
	計	484 (194)	5,572,272 (3,050,537)
公社債投資信託	単位型	34 (34)	155,091 (155,091)
	追加型	4 (1)	272,875 (193,807)
	計	38 (35)	427,966 (348,898)
合計		522 (229)	6,000,238 (3,399,436)

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

(1)【貸借対照表】

		(単位：千円)	
		前事業年度 (平成26年3月31日)	当事業年度 (平成27年3月31日)
資産の部			
流動資産			
現金及び預金	2	20,615,467	25,021,336
有価証券		4,999,802	-
前払費用		257,741	291,119
未収入金		4,026	41,860
未収委託者報酬		4,128,531	4,897,032
未収運用受託報酬		934,710	1,000,744
未収投資助言報酬	2	453,941	455,390

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

(単位：千円)

	前事業年度 (平成26年3月31日)	当事業年度 (平成27年3月31日)
負債の部		
流動負債		
預り金	61,327	82,723
未払金		
未払収益分配金	671	711
未払償還金	143,230	143,201
未払手数料	2,138,441	2,338,432
その他未払金	203,170	1,075,587
未払費用	1,615,419	2,095,111
未払消費税等	215,390	478,421
未払法人税等	1,623,022	454,520
賞与引当金	926,263	906,623
その他の流動負債	8	808
流動負債合計	6,926,944	7,576,142
固定負債		
退職給付引当金	1,802,340	2,633,080
固定負債合計	1,802,340	2,633,080
負債合計	8,729,285	10,209,222
純資産の部		
株主資本		
資本金	2,000,000	2,000,000

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

(2) 【損益計算書】

(単位：千円)

	前事業年度		当事業年度	
	(自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)		(自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)	
営業収益				
委託者報酬	30,300,842		30,094,858	
運用受託報酬	3,773,696		3,862,895	
投資助言報酬	2,117,669		2,106,161	
その他営業収益				
情報提供コンサルタント 業務報酬	5,000		5,000	
投資法人運用受託報酬	26,625		27,345	
サービス支援手数料	24,883		18,274	
その他	56,406		52,255	
営業収益計	36,305,122		36,166,790	
営業費用				
支払手数料	15,695,322		15,123,724	
広告宣伝費	276,591		407,991	
公告費	5,637		4,737	
調査費				
調査費	1,028,700		1,319,743	
委託調査費	3,053,376		3,550,675	
営業雑経費				
通信費	38,776		38,911	
印刷費	262,934		294,002	
協会費	14,337		26,955	
諸会費	32,186		18,577	
情報機器関連費	2,277,699		2,403,857	
販売促進費	40,388		28,281	

その他		117,451	144,250
営業費用合計		22,843,403	23,361,707
一般管理費			
給料			
役員報酬		140,440	190,241
給料・手当		4,900,885	5,186,853
賞与		786,372	569,685
賞与引当金繰入額		926,263	906,623
交際費		24,915	22,609
寄付金		82	-
事務委託費		303,945	366,661
旅費交通費		196,933	226,254
租税公課		100,575	108,953
不動産賃借料		546,821	552,589
退職給付費用		330,002	387,799
固定資産減価償却費		227,090	287,833
諸経費		258,736	283,156
一般管理費合計		8,743,067	9,089,262
営業利益		4,718,652	3,715,820
営業外収益			
受取配当金		50,559	26,821
有価証券利息		2,660	1,187
受取利息	1	5,190	6,113
時効成立分配金・償還金		5,958	12
原稿・講演料		2,456	1,899
還付加算金		182	-
雑収入		3,692	7,324
営業外収益合計		70,701	43,357
営業外費用			
為替差損		29,406	14,361
雑損失		38	-
営業外費用合計		29,444	14,361
経常利益		4,759,909	3,744,816
特別利益			
投資有価証券償還益		8,250	4,181
投資有価証券売却益		310,894	893,251
負ののれん発生益		186,047	-
企業結合に係る 特定勘定取崩益		2,870	-
特別利益合計		508,062	897,432
特別損失			
固定資産除却損	2	6,717	1,076
投資有価証券償還損		2,337	-
投資有価証券評価損		1,280	-
投資有価証券売却損		454	1,091
合併関連費用		17,767	-
事務所移転費用		1,313	-
その他の特別損失	3	-	973,862
特別損失合計		29,870	976,030
税引前当期純利益		5,238,102	3,666,218
法人税、住民税及び事業税		2,147,762	1,574,213
法人税等調整額		282,886	166,505
法人税等合計		1,864,875	1,740,718
当期純利益		3,373,226	1,925,499

（ 3 ） 【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自 平成25年 4月 1日 至 平成26年 3月31日）

（単位：千円）

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

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

当事業年度（自 平成26年 4月 1日 至 平成27年 3月31日）

（単位：千円）

	株主資本								株主資本 合計
	資本金	資本剰余金		利益準備金	利益剰余金			利益剰余金 合計	
		資本準備金	資本剰余金 合計		その他利益剰余金				
				配当準備 積立金	別途積立金	繰越利益 剰余金			
当期首残高	2,000,000	8,628,984	8,628,984	284,245	60,000	1,476,959	19,227,103	21,048,308	31,677,292
会計方針の変更 による累積的影 響額							439,043	439,043	439,043
会計方針の変更を反映 した当期首残高	2,000,000	8,628,984	8,628,984	284,245	60,000	1,476,959	18,788,060	20,609,264	31,238,248
当期変動額									
剰余金の配当							1,852,200	1,852,200	1,852,200
当期純利益							1,925,499	1,925,499	1,925,499
株主資本以外の項 目の当期変動額 （純額）									
当期変動額合計	-	-	-	-	-	-	73,299	73,299	73,299

当期末残高	2,000,000	8,628,984	8,628,984	284,245	60,000	1,476,959	18,861,359	20,682,564	31,311,548
-------	-----------	-----------	-----------	---------	--------	-----------	------------	------------	------------

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

[注記事項]

(重要な会計方針)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法

(1) 満期保有目的の債券

償却原価法

(2) 子会社株式及び関連会社株式

移動平均法による原価法

(3) その他有価証券

時価のあるもの

決算日の市場価格等に基づく時価法

(評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定)

時価のないもの

移動平均法による原価法

2. 固定資産の減価償却の方法

(1) 有形固定資産

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

なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。

建物 3～50年

器具備品 3～20年

(2) 無形固定資産

定額法によっております。

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

3. 引当金の計上基準

(1) 賞与引当金

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

(2)退職給付引当金

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

退職給付見込額の期間帰属方法

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

数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法

過去勤務費用については、その発生時において一時に費用処理しております。

数理計算上の差異については、その発生時において一時に費用処理しております。

4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

消費税等の会計処理

消費税等の会計処理は税抜方式によっております。

(会計方針の変更)

(退職給付に関する会計基準等の適用)

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

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

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

なお、1株当たり情報に与える影響は当該箇所に記載しております。

(貸借対照表関係)

1 有形固定資産の減価償却累計額

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

2 関係会社に対する資産及び負債

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

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

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

4 保証債務

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

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

(損益計算書関係)

1 関係会社との取引に係るものが次のとおり含まれております。

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

2 固定資産除却損

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

3 その他の特別損失

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

(株主資本等変動計算書関係)

前事業年度(自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)

1. 発行済株式数に関する事項

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

2. 剰余金の配当に関する事項

(1) 配当金支払額等

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

(2) 基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生が翌事業年度になるもの
平成26年6月26日開催の第29回定時株主総会において次の通り付議いたします。

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

当事業年度(自 平成26年 4月 1日 至 平成27年 3月31日)

1. 発行済株式数に関する事項

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

2. 剰余金の配当に関する事項

(1) 配当金支払額等

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

(2) 基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生が翌事業年度になるもの
平成27年 6月30日開催の第30回定時株主総会において次の通り付議いたします。

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

(リース取引関係)

オペレーティング・リース取引

(借主側)

オペレーティング・リース取引のうち解約不能のものに係る未経過リース料

(単位：千円)

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

(金融商品関係)

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

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

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

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

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

営業債務である未払手数料は、すべて1年以内の支払期日であります。

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

信用リスクの管理

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

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

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

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

市場リスクの管理

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

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

(4)金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

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

2.金融商品の時価等に関する事項

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

前事業年度(平成26年3月31日)

(単位:千円)

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

当事業年度(平成27年3月31日)

(単位:千円)

	貸借対照表計上額	時価	差額
(1)現金及び預金	25,021,336	25,021,336	-
(2)未収委託者報酬	4,897,032	4,897,032	-
(3)未収運用受託報酬	1,000,744	1,000,744	-
(4)未収投資助言報酬	455,390	455,390	-
(5)有価証券及び投資有価証券			
満期保有目的の債券	-	-	-
其他有価証券	7,131,075	7,131,075	-

(6)長期差入保証金	600,480	600,480	-
資産計	39,106,059	39,106,059	-
(1)未払金			
未払手数料	2,338,432	2,338,432	-
負債計	2,338,432	2,338,432	-

(注1)金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項
資 産

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

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

(5)有価証券及び投資有価証券

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

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

(6)長期差入保証金

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

負 債

(1)未払金

未払手数料

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

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

(単位：千円)

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

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

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

(注3)金銭債権及び満期がある有価証券の決算日後の償還予定額

前事業年度（平成26年3月31日）

(単位：千円)

区分	1年以内	1年超5年以内	5年超10年以内	10年超
現金及び預金	20,615,467	-	-	-
未収委託者報酬	4,128,531	-	-	-
未収運用受託報酬	934,710	-	-	-
未収投資助言報酬	453,941	-	-	-
有価証券及び投資有価証券				

満期保有目的の債券	5,000,000	-	-	-
その他有価証券のうち				
満期があるもの	-	-	-	-
長期差入保証金	23,475	518,429	-	-
合計	31,156,125	518,429	-	-

当事業年度（平成27年3月31日）

（単位：千円）

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

（有価証券関係）

1. 満期保有目的の債券

前事業年度（平成26年3月31日）

（単位：千円）

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

当事業年度（平成27年3月31日）

該当事項はありません。

2. 子会社株式及び関連会社株式

前事業年度（平成26年3月31日）

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

当事業年度（平成27年3月31日）

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

3. その他有価証券

前事業年度（平成26年3月31日）

（単位：千円）

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

合計	6,811,166	5,811,655	999,510
----	-----------	-----------	---------

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

当事業年度(平成27年3月31日)

(単位:千円)

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

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

4. 当事業年度中に売却したその他有価証券

前事業年度(自平成25年4月1日 至平成26年3月31日)

(単位:千円)

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

当事業年度(自平成26年4月1日 至平成27年3月31日)

(単位:千円)

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

(退職給付関係)

1. 採用している退職給付制度の概要

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

2. 確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

(単位:千円)

	前事業年度 (自平成25年4月1日 至平成26年3月31日)	当事業年度 (自平成26年4月1日 至平成27年3月31日)
退職給付債務の期首残高	1,605,470	1,802,340
会計方針の変更による 累積的影響額	-	682,168
会計方針の変更を反映した期首残高	1,605,470	2,484,508
勤務費用	184,549	217,881
利息費用	25,192	18,161
数理計算上の差異の発生額	21,670	276
退職給付の支払額	93,535	87,196
過去勤務費用の発生額	27,157	-
その他	75,176	-
退職給付債務の期末残高	1,802,340	2,633,080

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

(2)退職給付債務の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金の調整表

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

(3)退職給付費用及びその内訳項目の金額

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

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

(4)数理計算上の計算基礎に関する事項

主要な数理計算上の計算基礎（加重平均で表わしております。）

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

3. 確定拠出制度

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

(税効果会計関係)

1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

	(単位：千円)	
	前事業年度 (平成26年3月31日)	当事業年度 (平成27年3月31日)
流動の部		
繰延税金資産		
未払金	-	321,602
賞与引当金	330,120	299,729
調査費	62,002	77,863
未払事業税	123,029	49,504
その他	33,507	48,762
繰延税金資産小計	548,658	797,462
評価性引当額	-	321,602
繰延税金資産合計	548,658	475,859

固定の部		
繰延税金資産		
退職給付引当金	642,354	849,431
特定外国子会社留保金額	226,680	211,024
ソフトウェア償却	105,651	62,560
投資有価証券評価損	50,143	43,051
その他	6,970	6,291
繰延税金資産小計	1,031,799	1,172,360
評価性引当額	233,276	217,192
繰延税金資産合計	798,523	955,168
繰延税金負債		
その他有価証券評価差額金	334,588	289,742
その他	457	-
繰延税金負債合計	335,046	289,742
繰延税金資産の純額	1,012,135	1,141,285

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

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

3. 法人税等の税率の変更による繰延税金資産及び繰延税金負債の金額の修正

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

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

(セグメント情報等)

前事業年度(自平成25年4月1日至平成26年3月31日)

1. セグメント情報

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

従って、当社の事業区分は、「投資・金融サービス業」という単一の事業セグメントに属しており、

事業の種類別セグメント情報の記載を省略しております。

2. 関連情報

(1) 製品及びサービスごとの情報

(単位：千円)

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

(2) 地域ごとの情報

売上高

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

有形固定資産

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

(3) 主要な顧客ごとの情報

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

3. 報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

該当事項はありません。

4. 報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

該当事項はありません。

5. 報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

当社は単一セグメントのため、記載を省略しております。

当事業年度(自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)

1. セグメント情報

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

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

2. 関連情報

(1) 製品及びサービスごとの情報

(単位：千円)

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

(2) 地域ごとの情報

売上高

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

有形固定資産

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

(3) 主要な顧客ごとの情報

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

3. 報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

該当事項はありません。

4. 報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

該当事項はありません。

5. 報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

該当事項はありません。

(関連当事者情報)

前事業年度(自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)

1. 親会社及び主要株主（会社等の場合に限る。）等

(単位：千円)

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

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

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

2. 子会社及び関連会社等

(単位：千円)

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

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

3. その他の関係会社の子会社等

(単位：千円)

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

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

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

当事業年度(自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)

1. 親会社及び主要株主（会社等の場合に限る。）等

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

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

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

2. 子会社及び関連会社等

(単位:千円)

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

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

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

3. その他の関係会社の子会社等

(単位:千円)

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

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

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

(1株当たり情報)

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

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

2. 「会計方針の変更に関する注記」に記載のとおり、退職給付会計基準等を適用し、退職給付会計基準第37項に定める経過的な取扱いに従っております。この結果、当事業年度の期首の1株当たり純資産額が、24,889円09銭減少し、1株当たり当期純利益金額は、1,591円10銭減少しております。

3. 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	前事業年度 (自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)	当事業年度 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)
1株当たり当期純利益金額		

当期純利益(千円)	3,373,226	1,925,499
普通株主に帰属しない金額 (千円)	-	-
普通株式に係る当期純利益金額 (千円)	3,373,226	1,925,499
期中平均株式数(株)	17,640	17,640

(重要な後発事象)

1. 日興グローバルラップ株式会社の株式の取得(子会社化)について

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

(1) 株式取得の目的

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

(2) 取得する会社の概要(平成26年3月末現在)

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

(3) 株式取得日

平成27年4月1日

(4) 取得する株式の数、取得価額及び取得後の持株比率

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

(5) 支払資金の調達方法

自己資金によります。

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。)

- 八 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。
- 二 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 上記八、二に掲げるもののほか、委託会社の親法人等または子法人等が関与する行為であって、投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのあるものとして内閣府令で定める行為。

5【その他】

- イ 定款の変更、その他の重要事項
該当ありません。
- ロ 訴訟事件その他会社に重要な影響を与えることが予想される事実
該当ありません。

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

イ 受託会社

- (イ) 名称 三井住友信託銀行株式会社
- (ロ) 資本金の額 342,037百万円（平成27年3月末現在）
- (ハ) 事業の内容 銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

〔参考情報：再信託受託会社の概要〕

- ・ 名称 日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社
- ・ 資本金の額 51,000百万円（平成27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
カブドットコム証券株式会社	7,196百万円	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。
楽天証券株式会社	7,495百万円	
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。

資本金の額は、平成27年3月末現在。

住友生命保険相互会社の資本金の額は、平成27年3月末現在の基金および基金償却積立金の合計額を記載しております。

2【関係業務の概要】

イ 受託会社

信託契約の受託会社であり、信託財産の保管・管理・計算等を行います。

□ 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4,851株（持株比率27.5%）保有しています。

第3【その他】

- 1．目論見書の表紙にロゴ・マーク、図案およびキャッチコピーを採用すること、ファンドの形態、申込みにかかる事項、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」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。

独立監査人の監査報告書

平成27年 6月15日

三井住友アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員

業務執行社員

公認会計士 鈴木 敏 夫 印

指定有限責任社員

業務執行社員

公認会計士 池ヶ谷 正 印

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

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

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

強調事項

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

当該事項は、当監査法人の意見に影響を及ぼすものではない。

利害関係

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

以上

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

独立監査人の監査報告書

平成27年5月19日

三井住友アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士

小澤 陽 一 印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているSMAM・グローバルバランスファンド（機動的資産配分型）（旧名称：スミセイ・DCバランスファンド（機動的資産配分型））の平成26年4月15日から平成27年4月13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、SMAM・グローバルバランスファンド（機動的資産配分型）（旧名称：スミセイ・DCバランスファンド（機動的資産配分型））の平成27年4月13日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以 上

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