

## 【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	平成28年7月7日提出
【発行者名】	三井住友アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 松下 隆史
【本店の所在の場所】	東京都港区愛宕二丁目5番1号
【事務連絡者氏名】	土田 雅央
【電話番号】	03-5405-0740
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券に係るファンドの名称】	スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2020
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券の金額】	継続募集額(平成28年7月8日から平成29年7月13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】

スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2020  
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、「DC2020」として掲載されます。

委託会社に対する照会は下記においてできます。

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

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

### （５）【申込手数料】

無手数料です。

### （６）【申込単位】

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

(7)【申込期間】

平成28年 7月 8日から平成29年 7月13日まで

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

(8)【申込取扱場所】

販売会社において申込みを取り扱います。

販売会社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、西暦2020年（以下「ターゲットイヤー」といいます。）に向けて、信託財産の着実な成長を目指した運用を行います。ターゲットイヤー到達後は、安定した収益の獲得を目指します。

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

(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。

## （３）【ファンドの仕組み】

イ 当ファンドの関係法人とその役割

（イ）委託会社 「三井住友アセットマネジメント株式会社」

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

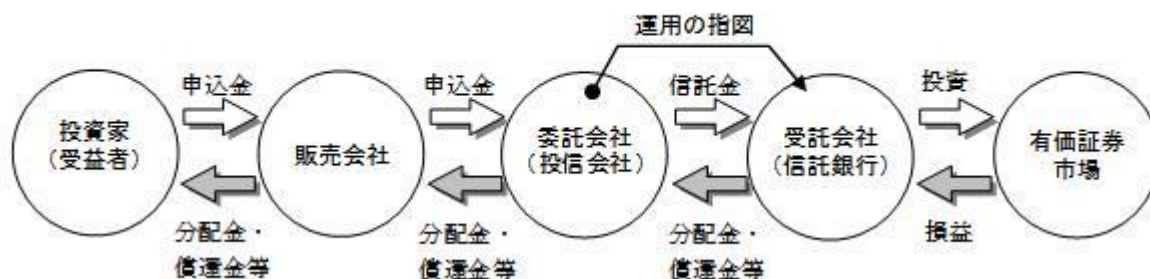
（ロ）受託会社 「三井住友信託銀行株式会社」

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

（ハ）販売会社

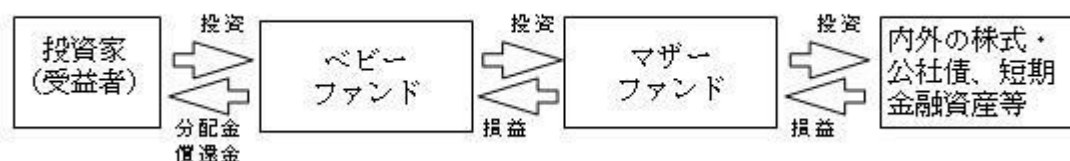
委託会社との間で締結される販売契約（名称の如何を問いません。）に基づき、当ファンドの募集・販売の取扱い、投資信託説明書（目論見書）の提供、受益者からの一部解約実行請求の受付、受益者への収益分配金、一部解約金および償還金の支払事務等を行います。

### 運営の仕組み



当ファンドの運用は、「ファミリーファンド方式」で行われます。

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



ロ 委託会社の概況

（イ）資本金の額

2,000百万円（平成28年4月28日現在）

（ロ）会社の沿革

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

## (八) 大株主の状況

(平成28年4月28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、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、ターゲットイヤーに向けて、信託財産の着実な成長を目指した運用を行います。ターゲットイヤー到達後は、安定した収益の獲得を目指します。

## 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) 長期的な視点に基づき時間的経過に従い資産配分を変更し、値上がり益の獲得と配当等収益の獲得により、信託財産の着実な成長を目指した運用を目指します。

(ハ) 基本資産配分は、西暦2020年をターゲットイヤーとし、ターゲットイヤーまでの残存期間が長いほど値上がり益の獲得を重視し、ターゲットイヤーに近づくに従い配当等収益を重視した比率とし、原則として年1回決算時に変更します。

なお、ターゲットイヤー到達後は、主として国内債券パッシブ・マザーファンドおよびマネーインカム・マザーファンドに投資することにより安定した収益の獲得を目指します。

(ニ) 組入資産の時価変動により生ずる実際の資産構成比率と基本資産配分との乖離は、資産毎に必要な応じて調整を行うものとします。



(ホ) 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。

(ヘ) 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）。

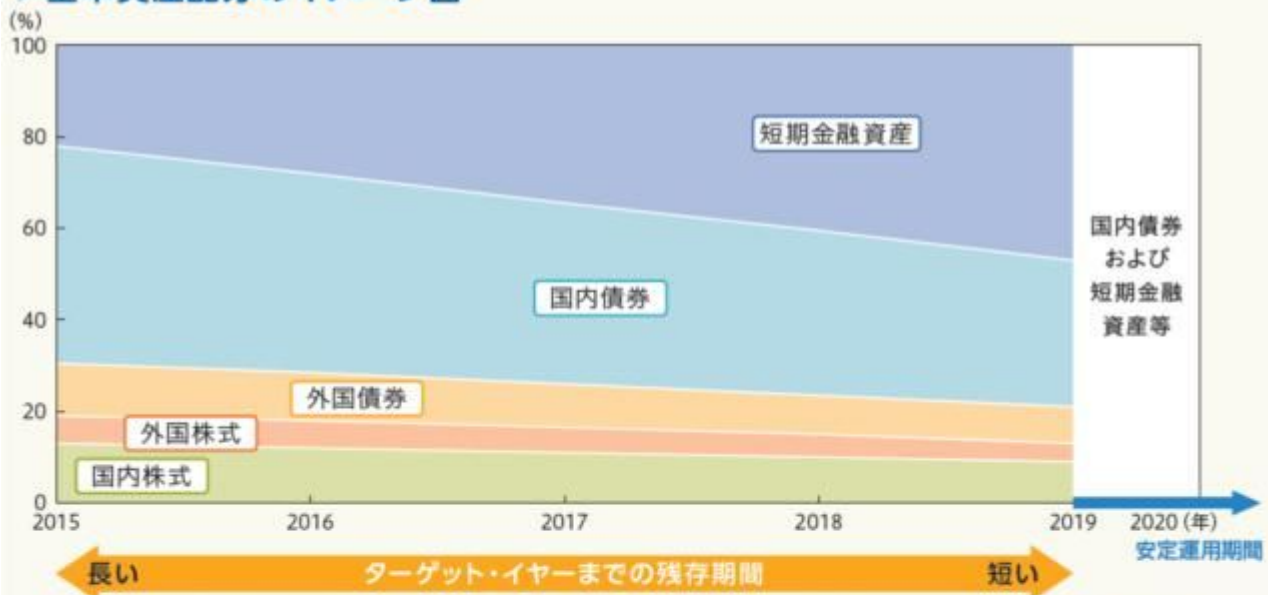
■ターゲットイヤー到達後は、主として国内債券パッシブ・マザーファンドおよびマネーインカム・マザーファンドで運用を行います。

2

基本資産配分は、ターゲットイヤーまでの残存期間が長いほど値上がり益の獲得を重視し、ターゲットイヤーに近づくに従い配当等収益を重視した比率とします。

基本資産配分は、原則として年1回決算時に変更します。

### ▶ 基本資産配分のイメージ図



※上図は、各決算時点での基本資産配分を表しています。2019年の決算日以降2020年の決算日までには、安定運用期間に向けて、順次、国内株式、外国株式および外国債券への配分を低減していきます。

また、現時点で予定している基本資産配分をもとに作成したイメージ図であり、将来、実際に上記の通りの運用を行うことを保証するものではありません。

### [ 2016年4月現在の基本資産配分 ]

国内株式	外国株式	外国債券	国内債券	短期金融資産
12.0%	6.0%	10.5%	43.5%	28.0%

## 3

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。

### ファンドのしくみ

■ファミリーファンド方式を採用し、マザーファンドの組入れを通じて、実際の運用を行います。



## 各マザーファンドの運用プロセス

### ▶国内株式インデックス・マザーファンド(B号)

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

### ▶国内債券パッシブ・マザーファンド

- わが国の公社債および短期金融資産を主要投資対象とし、NOMURA-BPI(総合)と連動する投資成果を目指して運用を行います。
- ポートフォリオの作成にあたっては、マルチファクターモデルおよび委託会社独自のリスクモデルを併用して、層化抽出法により、ファンド規模に応じデュレーション、満期構成、セクター(債券種別)配分、事業債の格付け構成および業種を可能な限りNOMURA-BPI(総合)に近づけたポートフォリオを構築します。なお事業債の銘柄選択については、委託会社クレジットアナリストの調査結果に基づき、将来的に格下げによりNOMURA-BPI(総合)から外れる可能性が高い銘柄については、組入対象から除外することがあります。
- NOMURA-BPI(総合)との連動性を随時チェックし、必要に応じてマルチファクターモデルおよび委託会社独自のリスクモデルを使用してポートフォリオのリバランスを行います。

### ▶外国株式インデックス・マザーファンド

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

### ▶外国債券パッシブ・マザーファンド

- 主として日本を除く世界各国の債券に投資し、シティ世界国債インデックス(除く日本、円ベース)と連動する投資成果を目指した運用を行います。
- ポートフォリオの作成にあたっては、マルチファクターモデルおよび委託会社独自のリスクモデルを併用して、層化抽出法により、通貨配分、国別配分、デュレーション、満期構成等を可能な限りシティ世界国債インデックス(除く日本、円ベース)に近づけたポートフォリオを構築します。
- シティ世界国債インデックス(除く日本、円ベース)との連動性を随時チェックし、必要に応じてマルチファクターモデルおよび委託会社独自のリスクモデルを使用してポートフォリオのリバランスを行います。

### ▶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。

- ・ TOPIX(東証株価指数、配当込み)、NOMURA-BPI(総合)、MSCIコクサイインデックス、シティ世界国債インデックスは、それぞれ東京証券取引所、野村證券株式会社、MSCI Inc.、Citigroup Index LLCが公表している指数で各社の知的財産です。
- ・ 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。

## (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せん。）
17. 預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
18. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
19. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限りません。）
20. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
21. 外国の者に対する権利で前号の有価証券の性質を有するもの

なお、第1号の証券または証書、第12号ならびに第17号の証券または証書のうち第1号の証券ま

たは証券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号の証券または証券のうち第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。

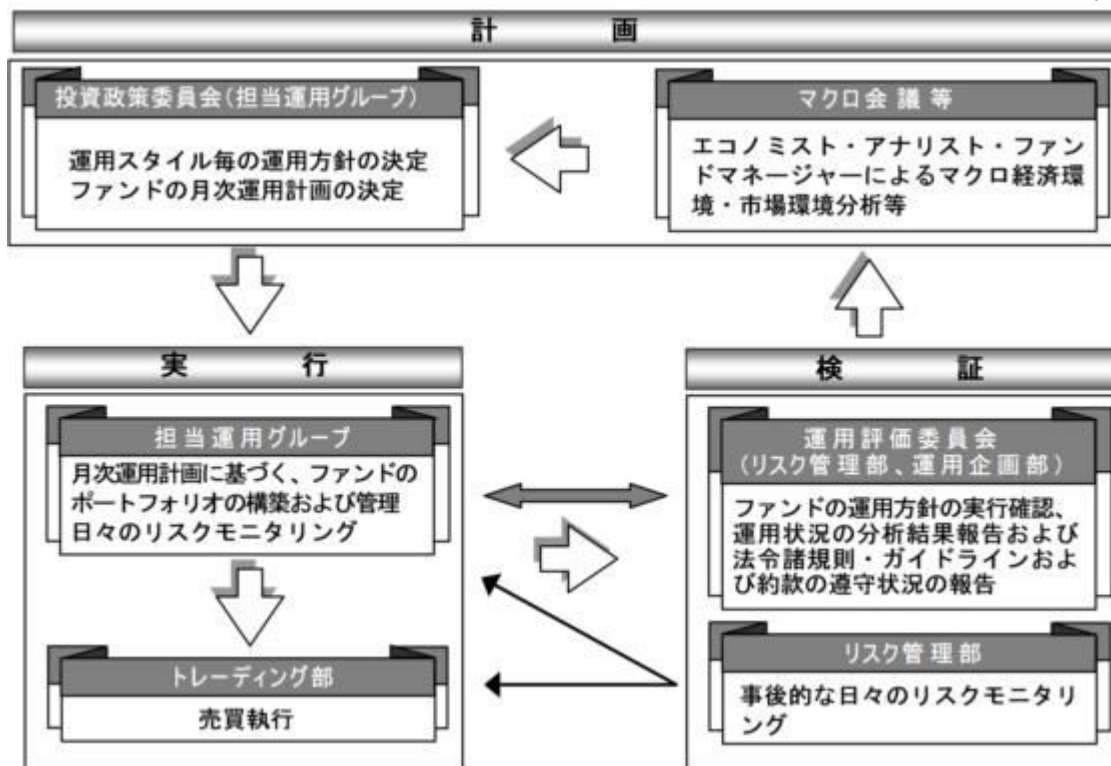
売買執行については、組織的に分離されたトレーディング部が、最良と思われる手法をもって売買を執行します。

##### (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11名程度で構成されています。

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

ロ 委託会社によるファンドの関係法人（販売会社を除く）に対する管理体制

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

（４）【配分方針】

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分配金額を決定します。

- 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。

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

（５）【投資制限】

ファンドの信託約款に基づく主要な投資制限

- イ 株式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、株券の引渡しまたは買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。
- (ロ) 信用取引の指図は、当該売付けにかかる建玉の時価総額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。

#### ハ 先物取引等の指図

- (イ) 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクを回避するため、わが国の取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。）、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。

## ニ スワップ取引の指図

- (イ) 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、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。
- (ハ) 信託財産の一部解約等の事由により、上記(ロ)の借入れにかかる有価証券の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する借り入れた有価証券の一部を返還するための指図をするものとします。
- (ニ) 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。
- (ニ) 借入金の利息は、信託財産中から支弁します。

#### ヲ デリバティブ取引等にかかる投資制限

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

#### 法令に基づく投資制限

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

（参考情報：マザーファンドの投資方針等）

（国内株式インデックス・マザーファンド（B号））

（1）投資方針等

イ 基本方針

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

## □ 投資態度

- (イ) 主として東京証券取引所第1部に上場している株式に投資を行い、TOPIX（東証株価指数、配当込み）と連動する投資成果を目指して運用を行います。
- (ロ) 株価指数先物取引等を含む株式の実質組入比率は、原則として高位を保ちます。ただし、資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。
- (ハ) 株式以外の資産への投資割合は、原則として信託財産総額の50%以下とします。

## (2) 投資対象

### イ 投資対象とする資産の種類

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

### ロ 投資対象とする有価証券

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

#### ロ 投資態度

- (イ) NOMURA - BPI（総合）をベンチマークとし、ベンチマーク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コクサイインデックス（円ベース）と連動する投資成果を目指して運用を行います。

##### ロ 投資態度

- （イ）主として世界各国の株式に投資し、MSCIコクサイインデックス（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 ハ 投資対象とする金融商品」において記載したベビーファンドが投資対象とする金融商品に同じです。

#### （３）投資制限

##### イ ファンドの信託約款に基づく主要な投資制限

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

### （外国債券パッシブ・マザーファンド）

#### （１）投資方針等

##### イ 基本方針

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

##### ロ 投資態度

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

## (2) 投資対象

### イ 投資対象とする資産の種類

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

### ロ 投資対象とする有価証券

前記「2 投資方針 (2) 投資対象 ロ 投資対象とする有価証券」において記載したベビーファンドが投資対象とする有価証券の各号(第1号から第21号)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) 信用リスク

ファンドが投資している有価証券や金融商品に債務不履行が発生あるいは懸念される場合に、当該有価証券や金融商品の価格が下がったり、投資資金を回収できなくなったりすることがあります。これらはファンドの基準価額が下落する要因となります。有価証券等の格付けが低い場合は、格付けの高い場合に比べてこうしたリスクがより高いものになると想定されます。

#### (ニ) 為替変動リスク

外貨建資産への投資は、円建資産に投資する場合の通常のリスクのほかに、為替変動による影響を受けます。ファンドが保有する外貨建資産の価格が現地通貨ベースで上昇する場合であっても、当該現地通貨が対円で下落(円高)する場合、円ベースでの評価額は下落することがあります。為替の変動(円高)は、ファンドの基準価額が下落する要因となります。

(ホ) カントリーリスク

海外に投資を行う場合には、投資する有価証券の発行者に起因するリスクのほか、投資先の国の政治・経済・社会状況の不安定化や混乱などによって投資した資金の回収が困難になることや、その影響により投資する有価証券の価格が大きく変動することがあり、基準価額が下落する要因となります。

(ヘ) 市場流動性リスク

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

(ト) ファミリーファンド方式にかかる留意点

当ファンドは「ファミリーファンド方式」により運用するため、当ファンドと同じマザーファンドを投資対象とする他のベビーファンドに追加設定・一部解約により資金の流入が生じた場合、その結果として、当該マザーファンドにおいても組入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。

(チ) 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。

(リ) 収益分配金に関する留意事項

分配金は、預貯金の利息とは異なり、ファンドの純資産から支払われますので、分配金が支払われると、その金額相当分、基準価額は下がります。



分配金は、計算期間中に発生した収益(経費控除後の配当等収益および評価益を含む売買益)を超えて支払われる場合があります。その場合、当期決算日の基準価額は前期決算日と比べて下落することになります。また、分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示すものではありません。

投資者のファンドの購入価額によっては、分配金の一部または全部が、実質的には元本の一部払戻しに相当する場合があります。ファンド購入後の運用状況により、分配金額より基準価額の値上がりが小さかった場合も同様です。

ロ 投資リスクの管理体制

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

(参考情報) 投資リスクの定量的比較

### 【ファンドの年間騰落率および 分配金再投資基準価額の推移】



### 【ファンドと他の代表的な 資産クラスとの騰落率の比較】



※左グラフは2011年5月～2016年4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のとは異なります。

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

#### <各資産クラスの指数>

日本株…TOPIX(配当込み)

先進国株…MSCIコクサイインデックス(グロス配当込み、円ベース)

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

日本国債…NOMURA-BPI(国債)

先進国債…シティ世界国債インデックス(除く日本、円ベース)

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

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

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

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

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

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

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

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

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

## 4【手数料等及び税金】

### (1)【申込手数料】

無手数料です。



## (2) 【換金（解約）手数料】

解約手数料はありません。

## (3) 【信託報酬等】

純資産総額に以下の率を乗じて得た金額が信託報酬として計算され、信託財産の費用として計上されます。

信託報酬は、毎計算期間の最初の6ヵ月終了日と各計算期末または信託終了のときに、信託財産中から支弁するものとします。

信託報酬 = 運用期間中の基準価額 × 信託報酬率

信託報酬率およびその実質的配分は以下の通りです。

決算期	信託報酬率	配分（税抜き）		
		委託会社	販売会社	受託会社
第1期～第12期 （ターゲットイヤーの 決算日まで）	年0.4536% （税抜き0.42%）	年0.19%	年0.2%	年0.03%
第13期以降 （ターゲットイヤーの 決算翌日以降）	年0.2268% （税抜き0.21%）	年0.08%	年0.1%	年0.03%

上記の配分には別途消費税等相当額がかかります。

支払先	役務の内容
委託会社	ファンド運用の指図等の対価
販売会社	交付運用報告書等各种書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
受託会社	ファンド財産の保管および管理、委託会社からの指図の実行等の対価

## (4) 【その他の手数料等】

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

上記ロ、ハにかかる費用に関しましては、その時々取引内容等により金額が決定し、実務上、その発生もしくは請求のつど、信託財産の費用として認識され、その時点の信託財産で負担することとなります。したがって、あらかじめ、その金額、上限額、計算方法等を具体的に記載することはできません。

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

## (5) 【課税上の取扱い】

## イ 個別元本について

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

## ロ 一部解約時および償還時の課税について

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

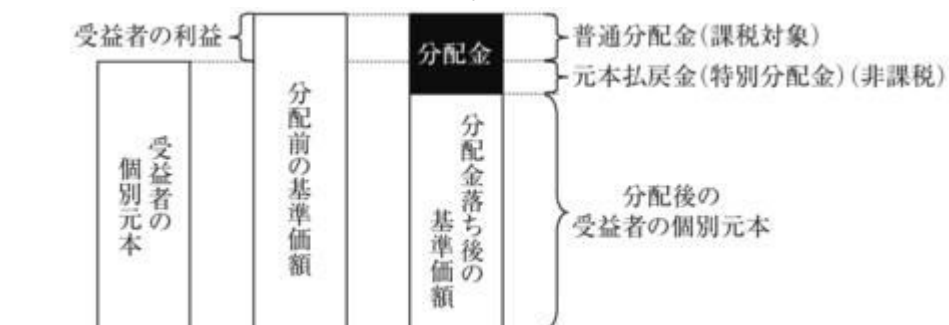
## ハ 収益分配金の課税について

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

収益分配金落ち後の基準価額が当該受益者の個別元本と同額の場合または当該受益者の個別元本を上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となります。



収益分配金落ち後の基準価額が当該受益者の個別元本を下回っている場合には、その下回る部分の額が元本払戻金（特別分配金）となり、当該収益分配金から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が普通分配金となります。なお、受益者が元本払戻金（特別分配金）を受け取った場合、収益分配金発生時にその個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の当該受益者の個別元本となります。



上記、の図はあくまでもイメージ図であり、個別元本や基準価額、分配金の各水準等を示唆するものではありません。

## 二 個人、法人別の課税の取扱いについて

### （イ）個人の受益者に対する課税

#### ・ 収益分配時

収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金については、20.315%（所得税15.315%および地方税5%）の税率による源泉徴収が行われ、申告不要制度が適用されます。確定申告による総合課税または申告分離課税の選択も可能です。

#### ・ 一部解約時および償還時

一部解約時および償還時の譲渡益については、20.315%（所得税15.315%および地方税5%）の税率による申告分離課税が適用されます。ただし、特定口座（源泉徴収選択口座）の利用も可能です。

また、一部解約時および償還時の損失については、確定申告により、収益分配金、特定公社債等（公募公社債投資信託を含みます。）の譲渡益および利子等、他の上場株式等にかかる譲渡益および配当等との通算が可能です。

### （ロ）法人の受益者に対する課税

収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金ならびに一部解約時および償還時の個別元本超過額については、15.315%（所得税のみ）の税率で源泉徴収されます。

当ファンドは、課税上は株式投資信託として取り扱われます。

公募株式投資信託は税法上、少額投資非課税制度「NISA（ニーサ）」、未成年者少額投資非課税制度「ジュニアNISA（ニーサ）」の適用対象です。ただし、販売会社によっては当ファンドをNISA、ジュニアNISAでの取扱い対象としない場合があります。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

なお、当ファンドは、配当控除の適用はありません。

少額投資非課税制度「NISA（ニーサ）」をご利用の場合、毎年、年間120万円の範囲で、未成年者少額投資非課税制度「ジュニアNISA（ニーサ）」をご利用の場合、毎年、年間80万円の範囲で、新たに購入した公募株式投資信託等から生じる配当所得および譲渡所得が5年間非課税となります。NISA、ジュニアNISAのご利用には、販売会社での専用口座の開設等、一定の要件があります。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

当ファンドの外貨建資産割合および非株式割合

外貨建資産への実質投資割合は、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28年4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】

スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2020

平成28年 4月28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	131,828,624	99.00
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1,328,343	1.00
合計(純資産総額)		133,156,967	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】

スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2020

#### イ 主要投資銘柄

平成28年 4月28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	45,232,941	1.2735	57,607,919	1.2756	57,699,139	43.33
日本	親投資信託受益証券	マネーインカム・マザーファンド	36,313,306	1.0123	36,763,560	1.0122	36,756,328	27.60
日本	親投資信託受益証券	国内株式インデックス・マザーファンド(B号)	7,950,556	1.9616	15,595,811	1.9730	15,686,446	11.78
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	8,071,455	1.6858	13,606,859	1.6896	13,637,530	10.24
日本	親投資信託受益証券	外国株式インデックス・マザーファンド	3,083,623	2.5231	7,780,289	2.6103	8,049,181	6.04

以上が、当ファンドが保有する有価証券のすべてです。

#### ロ 種類別の投資比率

平成28年 4月28日現在

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	99.00
合計	99.00

### 【投資不動産物件】

スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2020

該当事項はありません。

### 【その他投資資産の主要なもの】

スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2020

該当事項はありません。

## （３）【運用実績】

## 【純資産の推移】

スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2020

年月日	純資産総額 (円)		1万口当たりの 純資産額(円)	
	(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第1期 (平成21年 4月13日)	887,920	887,920	8,879	8,879
第2期 (平成22年 4月13日)	16,081,259	16,081,259	9,585	9,585
第3期 (平成23年 4月13日)	26,255,343	26,255,343	9,351	9,351
第4期 (平成24年 4月13日)	31,721,491	31,721,491	9,457	9,457
第5期 (平成25年 4月15日)	42,888,261	42,888,261	10,830	10,830
第6期 (平成26年 4月14日)	55,009,117	55,009,117	11,187	11,187
第7期 (平成27年 4月13日)	104,467,637	104,467,637	12,311	12,311
第8期 (平成28年 4月13日)	129,732,609	129,732,609	12,190	12,190
平成27年 4月末日	105,356,503		12,334	
5月末日	111,729,164		12,445	
6月末日	112,805,080		12,346	
7月末日	117,888,619		12,424	
8月末日	118,276,714		12,237	
9月末日	119,079,727		12,071	
10月末日	122,873,023		12,325	
11月末日	124,617,685		12,351	
12月末日	126,526,252		12,310	
平成28年 1月末日	126,590,267		12,218	
2月末日	125,788,603		12,063	
3月末日	131,851,194		12,244	
4月末日	133,156,967		12,237	

## 【分配の推移】

スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2020

	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
第8期	平成27年 4月14日～平成28年 4月13日	0

## 【収益率の推移】

## スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2020

	収益率（％）
第1期	11.2
第2期	8.0
第3期	2.4
第4期	1.1
第5期	14.5
第6期	3.3
第7期	10.0
第8期	1.0

（注）収益率とは、計算期間末の分配基準価額から前期末分配基準価額を控除した額を前期末分配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】

## スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2020

	設定口数（口）	解約口数（口）
第1期	1,000,000	0
第2期	16,162,988	385,114
第3期	12,124,210	824,679
第4期	7,500,149	2,033,603
第5期	10,218,010	4,161,181
第6期	11,527,812	1,957,719
第7期	41,478,096	5,788,485
第8期	28,443,083	6,879,463

（注）本邦外における設定および解約の実績はありません。

## （参考）

## （１）投資状況

## 国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

平成28年 4月28日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
株式	日本	193,380,426,740	98.57
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		2,796,368,253	1.43
合計(純資産総額)		196,176,794,993	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	2,175,460,000	1.10
合計	買建	-	2,175,460,000	1.10

## 国内債券パッシブ・マザーファンド

平成28年 4月28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	186,895,149,520	74.24
地方債証券	日本	19,725,670,791	7.84
特殊債券	日本	27,455,293,969	10.91
社債券	日本	11,635,517,000	4.62
	オランダ	905,539,000	0.36
	オーストラリア	901,691,000	0.36
	アメリカ	603,353,000	0.24
	小計	14,046,100,000	5.58
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		3,610,088,163	1.43
合計(純資産総額)		251,732,302,443	100.00

## 外国株式インデックス・マザーファンド

平成28年 4月28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	90,843,464,485	57.32
	イギリス	11,635,063,956	7.34
	スイス	6,110,966,386	3.86
	カナダ	5,890,261,206	3.72
	フランス	5,717,130,062	3.61
	ドイツ	5,687,252,773	3.59
	オーストラリア	3,742,244,362	2.36
	オランダ	2,597,207,351	1.64
	アイルランド	2,535,820,581	1.60
	スペイン	2,064,921,063	1.30
	スウェーデン	1,797,886,933	1.13
	香港	1,453,648,942	0.92
	デンマーク	1,220,508,962	0.77
	イタリア	1,219,391,328	0.77
	シンガポール	1,050,265,996	0.66
	ベルギー	904,126,190	0.57
	ジャージー	810,410,927	0.51
	フィンランド	596,586,446	0.38
	キュラソー	579,323,562	0.37
	パミューダ	538,102,122	0.34
	イスラエル	422,091,220	0.27
	ノルウェー	371,558,466	0.23
	ケイマン諸島	366,079,011	0.23
	ルクセンブルグ	158,029,403	0.10
	オーストリア	115,635,929	0.07
	ニュージーランド	107,137,676	0.07
	ポルトガル	104,773,348	0.07
	リベリア	67,413,768	0.04
	英ヴァージン諸島	52,642,053	0.03
	パプアニューギニア	36,584,296	0.02
マン島	17,882,416	0.01	
モーリシャス	11,668,588	0.01	
小計	148,826,079,807	93.91	
投資証券	アメリカ	2,642,622,275	1.67
	オーストラリア	604,667,524	0.38
	フランス	245,561,134	0.15



	イギリス	193,808,538	0.12
	香港	88,962,465	0.06
	シンガポール	85,479,355	0.05
	カナダ	31,217,144	0.02
	小計	3,892,318,435	2.46
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		5,766,027,431	3.63
合計(純資産総額)		158,484,425,673	100.00

その他以下の取引を行っております。

種類	買建/ 売建	国/地域	時価合計(円)	投資 比率 (%)
株価指数先物取引	買建	アメリカ	3,545,069,321	2.23
	買建	ドイツ	977,699,446	0.61
	買建	イギリス	409,844,462	0.25
	買建	オーストラリア	268,652,250	0.16
合計	買建	-	5,201,265,479	3.25

種類	買建/ 売建	国/地域	時価合計(円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	売建		346,059,600	0.21

#### 外国債券パッシブ・マザーファンド

平成28年 4月28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	74,662,217,103	41.92
	フランス	17,331,977,424	9.73
	イタリア	17,317,319,560	9.72
	イギリス	13,845,785,864	7.77
	ドイツ	13,020,627,432	7.31
	スペイン	9,659,733,333	5.42
	ベルギー	4,664,150,579	2.62
	オランダ	4,408,635,656	2.48

	カナダ	3,655,977,840	2.05
	オーストラリア	3,171,387,415	1.78
	オーストリア	2,690,992,350	1.51
	メキシコ	1,656,274,183	0.93
	アイルランド	1,524,780,403	0.86
	デンマーク	1,099,560,078	0.62
	フィンランド	1,064,613,856	0.60
	ポーランド	949,401,379	0.53
	マレーシア	890,103,483	0.50
	スウェーデン	865,481,238	0.49
	南アフリカ	791,684,128	0.44
	シンガポール	651,859,799	0.37
	スイス	553,800,467	0.31
	ノルウェー	546,667,132	0.31
	小計	175,023,030,702	98.26
	現金・預金・その他の資産(負債控除後)	3,093,743,446	1.74
	合計(純資産総額)	178,116,774,148	100.00

## マネーインカム・マザーファンド

平成28年 4月28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	431,968,200	32.55
特殊債券	日本	705,310,000	53.15
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		189,727,719	14.30
合計(純資産総額)		1,327,005,919	100.00

## (2) 投資資産

## 投資有価証券の主要銘柄

## 国内株式インデックス・マザーファンド(B号)

## イ 主要投資銘柄(上位30銘柄)

平成28年 4月28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	1,211,800	7,536.79	9,133,082,122	5,654.00	6,851,517,200	3.49
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	7,713,700	768.00	5,924,121,600	520.10	4,011,895,370	2.05
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	743,100	4,585.64	3,407,589,084	4,864.00	3,614,438,400	1.84

日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	544,700	6,431.74	3,503,368,778	5,988.00	3,261,663,600	1.66
日本	株式	KDDI	情報・通信業	976,600	3,046.67	2,975,377,922	3,169.00	3,094,845,400	1.58
日本	株式	日本たばこ産業	食料品	645,200	4,418.31	2,850,693,612	4,530.00	2,922,756,000	1.49
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	770,100	4,592.25	3,536,491,725	3,413.00	2,628,351,300	1.34
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	876,900	3,920.22	3,437,640,918	2,992.50	2,624,123,250	1.34
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	13,631,700	242.38	3,304,051,446	167.80	2,287,399,260	1.17
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	406,400	5,939.65	2,413,873,760	5,262.00	2,138,476,800	1.09
日本	株式	ソニー	電気機器	687,400	3,117.87	2,143,223,838	2,778.00	1,909,597,200	0.97
日本	株式	NTTドコモ	情報・通信業	718,500	2,346.20	1,685,744,700	2,597.00	1,865,944,500	0.95
日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	402,400	5,450.32	2,193,208,768	4,543.00	1,828,103,200	0.93
日本	株式	東日本旅客鉄道	陸運業	178,100	11,485.08	2,045,492,748	9,824.00	1,749,654,400	0.89
日本	株式	アステラス製薬	医薬品	1,141,600	1,720.68	1,964,328,288	1,497.00	1,708,975,200	0.87
日本	株式	東海旅客鉄道	陸運業	87,200	21,878.49	1,907,804,328	19,435.00	1,694,732,000	0.86
日本	株式	花王	化学	274,300	6,279.33	1,722,420,219	6,116.00	1,677,618,800	0.86
日本	株式	ファナック	電気機器	99,700	21,539.39	2,147,477,183	16,505.00	1,645,548,500	0.84
日本	株式	キヤノン	電気機器	524,800	3,680.93	1,931,752,064	3,112.00	1,633,177,600	0.83
日本	株式	三菱地所	不動産業	715,000	2,548.58	1,822,234,700	2,121.00	1,516,515,000	0.77
日本	株式	村田製作所	電気機器	102,100	18,606.76	1,899,750,196	14,795.00	1,510,569,500	0.77
日本	株式	キーエンス	電気機器	22,100	66,030.88	1,459,282,448	67,160.00	1,484,236,000	0.76
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	389,500	4,487.12	1,747,733,240	3,689.00	1,436,865,500	0.73
日本	株式	ブリヂストン	ゴム製品	344,000	4,350.13	1,496,444,720	4,116.00	1,415,904,000	0.72
日本	株式	三井不動産	不動産業	510,000	3,062.08	1,561,660,800	2,725.00	1,389,750,000	0.71
日本	株式	日産自動車	輸送用機器	1,359,500	1,289.99	1,753,741,405	1,000.00	1,359,500,000	0.69
日本	株式	三菱商事	卸売業	721,400	2,054.80	1,482,332,720	1,863.00	1,343,968,200	0.69
日本	株式	日立製作所	電気機器	2,484,000	708.03	1,758,746,520	515.60	1,280,750,400	0.65
日本	株式	ダイキン工業	機械	141,800	8,574.81	1,215,908,058	8,884.00	1,259,751,200	0.64
日本	株式	三菱電機	電気機器	1,038,000	1,343.11	1,394,148,180	1,198.00	1,243,524,000	0.63

## □ 種別・業種別の投資比率

平成28年 4月28日現在

種類	国内 / 外国	業種	投資比率 (%)
株式	国内	水産・農林業	0.11
		鉱業	0.30
		建設業	3.10
		食料品	4.94
		繊維製品	0.73
		パルプ・紙	0.27
		化学	6.11
		医薬品	5.74
		石油・石炭製品	0.54

ゴム製品	0.97
ガラス・土石製品	0.92
鉄鋼	1.25
非鉄金属	0.85
金属製品	0.65
機械	4.67
電気機器	11.54
輸送用機器	9.22
精密機器	1.60
その他製品	1.54
電気・ガス業	2.01
陸運業	4.54
海運業	0.23
空運業	0.66
倉庫・運輸関連業	0.21
情報・通信業	8.27
卸売業	4.18
小売業	4.79
銀行業	7.38
証券、商品先物取引業	1.04
保険業	2.23
その他金融業	1.36
不動産業	2.81
サービス業	3.85
合計	98.57

## 国内債券パッシブ・マザーファンド

## イ 主要投資銘柄（上位30銘柄）

平成28年 4月28日現在

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
日本	国債証券	第296回利付国債(10年)	3,543,000,000	104.88	3,715,898,400	104.16	3,690,707,670	1.500	2018/9/20	1.47
日本	国債証券	第303回利付国債(10年)	3,495,000,000	105.67	3,693,166,500	105.52	3,688,133,700	1.400	2019/9/20	1.47
日本	国債証券	第310回利付国債(10年)	3,080,000,000	104.64	3,222,912,000	105.32	3,243,856,000	1.000	2020/9/20	1.29
日本	国債証券	第305回利付国債(10年)	2,970,000,000	105.53	3,134,241,000	105.55	3,134,924,100	1.300	2019/12/20	1.25
日本	国債証券	第329回利付国債(10年)	2,540,000,000	104.45	2,653,119,100	107.11	2,720,594,000	0.800	2023/6/20	1.08
日本	国債証券	第341回利付国債(10年)	2,485,000,000	102.69	2,551,867,900	103.83	2,580,324,600	0.300	2025/12/20	1.03
日本	国債証券	第298回利付国債(10年)	2,470,000,000	104.52	2,581,644,000	104.05	2,570,109,100	1.300	2018/12/20	1.02

日本	国債証券	第339回利付国債(10年)	2,385,000,000	100.12	2,387,988,500	104.74	2,498,239,800	0.400	2025/6/20	0.99
日本	国債証券	第125回利付国債(5年)	2,450,000,000	100.25	2,456,270,900	101.34	2,482,977,000	0.100	2020/9/20	0.99
日本	国債証券	第124回利付国債(5年)	2,410,000,000	100.15	2,413,791,000	101.28	2,441,064,900	0.100	2020/6/20	0.97
日本	国債証券	第123回利付国債(5年)	2,410,000,000	100.00	2,410,000,000	101.22	2,439,618,900	0.100	2020/3/20	0.97
日本	国債証券	第301回利付国債(10年)	2,285,000,000	105.86	2,418,901,000	105.44	2,409,349,700	1.500	2019/6/20	0.96
日本	国債証券	第299回利付国債(10年)	2,245,000,000	104.77	2,352,086,500	104.43	2,344,610,650	1.300	2019/3/20	0.93
日本	国債証券	第312回利付国債(10年)	2,145,000,000	105.91	2,271,769,500	106.53	2,285,154,300	1.200	2020/12/20	0.91
日本	国債証券	第340回利付国債(10年)	2,165,000,000	100.88	2,184,144,050	104.78	2,268,508,650	0.400	2025/9/20	0.90
日本	国債証券	第313回利付国債(10年)	2,105,000,000	106.72	2,246,456,000	107.37	2,260,306,900	1.300	2021/3/20	0.90
日本	国債証券	第315回利付国債(10年)	2,090,000,000	106.35	2,222,829,400	107.27	2,242,026,600	1.200	2021/6/20	0.89
日本	国債証券	第333回利付国債(10年)	1,945,000,000	102.23	1,988,409,900	106.05	2,062,828,100	0.600	2024/3/20	0.82
日本	国債証券	第297回利付国債(10年)	1,943,000,000	104.88	2,037,818,400	104.31	2,026,879,310	1.400	2018/12/20	0.81
日本	国債証券	第293回利付国債(10年)	1,940,000,000	105.46	2,045,924,000	104.37	2,024,875,000	1.800	2018/6/20	0.80
日本	国債証券	第332回利付国債(10年)	1,840,000,000	102.93	1,893,979,750	105.94	1,949,443,200	0.600	2023/12/20	0.77
日本	国債証券	第335回利付国債(10年)	1,815,000,000	101.03	1,833,694,500	105.46	1,914,244,200	0.500	2024/9/20	0.76
日本	国債証券	第338回利付国債(10年)	1,820,000,000	99.99	1,819,818,000	104.75	1,906,559,200	0.400	2025/3/20	0.76
日本	国債証券	第330回利付国債(10年)	1,700,000,000	104.10	1,769,802,500	107.32	1,824,525,000	0.800	2023/9/20	0.72
日本	国債証券	第306回利付国債(10年)	1,670,000,000	106.22	1,773,874,000	106.30	1,775,276,800	1.400	2020/3/20	0.71
日本	国債証券	第325回利付国債(10年)	1,635,000,000	104.10	1,702,035,000	106.42	1,740,016,050	0.800	2022/9/20	0.69
日本	国債証券	第334回利付国債(10年)	1,610,000,000	102.09	1,643,795,800	106.21	1,709,997,100	0.600	2024/6/20	0.68
日本	国債証券	第321回利付国債(10年)	1,545,000,000	105.73	1,633,539,300	107.16	1,655,637,450	1.000	2022/3/20	0.66
日本	国債証券	第59回利付国債(20年)	1,455,000,000	110.76	1,611,674,400	112.68	1,639,494,000	1.700	2022/12/20	0.65
日本	国債証券	第122回利付国債(5年)	1,550,000,000	100.04	1,550,697,500	101.18	1,568,398,500	0.100	2019/12/20	0.62

## □ 種類別の投資比率

平成28年 4月28日現在

種類	投資比率(%)
国債証券	74.24
地方債証券	7.84
特殊債券	10.91
社債券	5.58
合計	98.57

## 外国株式インデックス・マザーファンド

## イ 主要投資銘柄（上位30銘柄）

平成28年 4月28日現在

国/ 地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	投資 比率 (%)
アメリカ	株式	APPLE INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	259,887	12,853.91	3,340,566,707	10,735.74	2,790,080,561	1.76
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	353,569	5,911.13	2,089,994,090	5,590.66	1,976,685,833	1.25
アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORPORATION	エネルギー	194,136	8,901.82	1,728,164,213	9,708.48	1,884,766,444	1.19
アメリカ	株式	JOHNSON & JOHNSON	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	129,035	11,228.52	1,448,872,401	12,376.50	1,597,002,645	1.01
アメリカ	株式	GENERAL ELECTRIC CO	資本財	440,130	3,325.42	1,463,619,305	3,394.56	1,494,050,994	0.94
アメリカ	株式	WELLS FARGO & COMPANY	銀行	226,382	6,050.51	1,369,728,253	5,589.56	1,265,377,470	0.80
アメリカ	株式	FACEBOOK INC-A	ソフトウェア・サービス	105,794	11,563.25	1,223,323,528	11,950.67	1,264,309,975	0.80
アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	小売	18,581	73,407.38	1,363,982,620	66,571.05	1,236,956,819	0.78
スイス	株式	NESTLE SA-REGISTERED	食品・飲料・タバコ	148,594	8,601.85	1,278,183,448	8,190.89	1,217,117,852	0.77
アメリカ	株式	AT&T INC	電気通信サービス	286,226	3,694.18	1,057,371,796	4,249.52	1,216,323,112	0.77
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	171,581	7,334.59	1,258,476,716	7,036.07	1,207,256,356	0.76
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	ソフトウェア・サービス	14,503	82,133.60	1,191,183,710	77,465.94	1,123,488,528	0.71
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	126,872	8,324.53	1,056,150,722	8,767.92	1,112,404,498	0.70
アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS INC	電気通信サービス	189,750	4,979.35	944,833,086	5,672.97	1,076,447,481	0.68
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	ソフトウェア・サービス	13,579	84,496.52	1,147,378,313	79,180.23	1,075,188,411	0.68
アメリカ	株式	PFIZER INC	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	287,423	3,584.43	1,030,249,061	3,621.74	1,040,974,250	0.66
アメリカ	株式	CHEVRON CORPORATION	エネルギー	87,768	9,888.47	867,891,673	11,397.53	1,000,339,071	0.63
アメリカ	株式	COCA-COLA CO/THE	食品・飲料・タバコ	192,672	4,732.41	911,804,826	4,903.62	944,792,199	0.60
スイス	株式	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	32,764	31,041.85	1,017,055,338	28,055.65	919,215,317	0.58
スイス	株式	NOVARTIS AG-REG SHS	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	106,192	9,964.55	1,058,155,918	8,427.98	894,984,583	0.56
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	各種金融	55,208	14,747.10	814,158,311	16,199.10	894,319,913	0.56
アメリカ	株式	HOME DEPOT INC	小売	59,127	14,737.22	871,368,198	14,898.56	880,907,305	0.56
アメリカ	株式	THE WALT DISNEY CO.	メディア	73,240	12,557.59	919,718,258	11,554.47	846,250,115	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	129,767	5,907.84	766,642,998	6,180.02	801,962,980	0.51
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	484,931	1,899.77	921,258,578	1,648.44	799,382,082	0.50
アメリカ	株式	VISA INC	ソフトウェア・サービス	90,433	8,730.61	789,535,480	8,643.90	781,694,713	0.49
アメリカ	株式	COMCAST CORP-CL A	メディア	115,793	6,735.35	779,907,251	6,727.67	779,017,671	0.49
アメリカ	株式	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL INC.	食品・飲料・タバコ	71,976	9,599.83	690,957,544	10,675.38	768,371,331	0.48
アメリカ	株式	INTEL CORP	半導体・半導体製造装置	219,427	3,765.52	826,257,306	3,484.56	764,607,096	0.48
アメリカ	株式	PEPSICO INC	食品・飲料・タバコ	67,729	11,046.33	748,157,393	11,263.64	762,875,243	0.48

□ 種類別・業種別の投資比率

平成28年 4月28日現在

種類	国内 / 外国	業種	投資比率 (%)
株式	外国	エネルギー	7.06
		素材	4.56
		資本財	6.92
		商業・専門サービス	0.95
		運輸	1.80
		自動車・自動車部品	1.60
		耐久消費財・アパレル	1.75
		消費者サービス	1.73
		メディア	2.85
		小売	3.79
		食品・生活必需品小売り	2.10
		食品・飲料・タバコ	6.61
		家庭用品・パーソナル用品	1.78
		ヘルスケア機器・サービス	3.81
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	9.18
		銀行	8.18
		各種金融	4.13
		保険	4.11
		不動産	0.74
		ソフトウェア・サービス	8.21
テクノロジー・ハードウェアおよび機器	3.78		
電気通信サービス	3.25		
公益事業	3.35		
半導体・半導体製造装置	1.64		
投資証券			2.46
合計			96.36

## 外国債券パッシブ・マザーファンド

## イ 主要投資銘柄（上位30銘柄）

平成28年 4月28日現在

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.75	11,000,000	10,489.69	1,153,866,914	11,160.20	1,227,622,344	2.750	2042/11/15	0.69
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.5	7,000,000	11,197.92	783,855,078	11,607.77	812,544,414	2.500	2024/5/15	0.46
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.375	7,000,000	11,079.60	775,572,383	11,492.88	804,501,797	2.375	2024/8/15	0.45
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 3.625	6,000,000	12,409.46	744,568,011	13,134.84	788,090,745	3.625	2043/8/15	0.44
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.125	7,000,000	10,814.66	757,026,351	11,250.23	787,516,273	2.125	2025/5/15	0.44
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2	7,000,000	10,710.05	749,703,968	11,148.19	780,373,945	2.000	2025/2/15	0.44
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2	7,000,000	10,762.27	753,359,498	11,127.62	778,933,477	2.000	2025/8/15	0.44
イタリア	国債証券	BTPS 6	4,100,000	18,628.17	763,755,292	18,761.35	769,215,703	6.000	2031/5/1	0.43
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.25	6,500,000	11,038.97	717,533,394	11,356.55	738,175,931	2.250	2025/11/15	0.41
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.75	6,200,000	11,448.29	709,794,406	11,813.55	732,440,633	2.750	2023/11/15	0.41
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 3.625	6,000,000	11,860.71	711,643,011	11,990.18	719,411,250	3.625	2020/2/15	0.40
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 3.5	5,000,000	14,287.82	714,391,278	14,280.37	714,018,918	3.500	2020/4/25	0.40
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 3.75	5,000,000	14,232.84	711,642,020	14,181.95	709,097,560	3.750	2019/10/25	0.40
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 3.875	6,000,000	11,687.51	701,251,058	11,660.93	699,656,250	3.875	2018/5/15	0.39
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.25	6,000,000	10,950.85	657,051,300	11,379.70	682,782,187	2.250	2024/11/15	0.38
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 5.5	3,500,000	18,718.28	655,140,114	19,371.40	677,999,294	5.500	2029/4/25	0.38
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 5.75	3,200,000	20,098.13	643,140,192	20,956.79	670,617,381	5.750	2032/10/25	0.38
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 1.875	6,000,000	11,144.76	668,686,172	11,158.48	669,509,297	1.875	2017/10/31	0.38
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 1.875	6,000,000	11,139.62	668,377,500	11,151.62	669,097,734	1.875	2017/9/30	0.38
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 1	6,000,000	10,723.77	643,426,527	10,929.55	655,773,402	1.000	2019/11/30	0.37
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 4.25	4,000,000	15,876.18	635,047,569	16,169.36	646,774,426	4.250	2023/10/25	0.36
イタリア	国債証券	BTPS 5.25	3,700,000	17,362.50	642,412,849	17,333.35	641,334,246	5.250	2029/11/1	0.36
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.625	5,500,000	11,407.14	627,392,734	11,612.92	638,710,703	2.625	2020/11/15	0.36
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 3.5	4,000,000	15,411.60	616,464,322	15,922.11	636,884,544	3.500	2026/4/25	0.36
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 2.5	4,500,000	13,841.86	622,883,808	13,919.80	626,391,439	2.500	2020/10/25	0.35
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 4.25	4,400,000	14,239.04	626,518,041	14,131.68	621,794,034	4.250	2019/4/25	0.35
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2	5,500,000	10,894.40	599,192,128	11,245.08	618,479,837	2.000	2023/2/15	0.35
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 3.625	5,000,000	11,942.17	597,108,594	12,142.80	607,140,430	3.625	2021/2/15	0.34
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 4.75	3,100,000	19,171.45	594,315,108	19,546.78	605,950,489	4.750	2035/4/25	0.34
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 4.25	4,500,000	13,458.33	605,624,922	13,287.04	597,917,070	4.250	2017/10/25	0.34

## ロ 種類別の投資比率



平成28年 4月28日現在

種類	投資比率（％）
国債証券	98.26
合計	98.26

## マネーインカム・マザーファンド

## イ 主要投資銘柄

平成28年 4月28日現在

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	利率 (％)	償還期限	投資 比率 (％)
日本	特殊債券	第2回政府保証地方公共団体金融機構債券（4年）	300,000,000	100.06	300,186,000	100.04	300,120,000	0.130	2016/8/30	22.62
日本	特殊債券	第16回政府保証日本政策投資銀行債券	200,000,000	101.58	203,160,000	101.49	202,990,000	1.800	2017/2/28	15.30
日本	国債証券	第283回利付国債（10年）	200,000,000	100.83	201,670,000	100.73	201,472,000	1.800	2016/9/20	15.18
日本	国債証券	第280回利付国債（10年）	190,000,000	100.36	190,684,000	100.25	190,475,000	1.900	2016/6/20	14.35
日本	特殊債券	第23回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101.20	101,203,000	101.12	101,125,000	1.700	2016/12/28	7.62
日本	特殊債券	第19回政府保証国民生活債券	100,000,000	101.16	101,161,000	101.07	101,075,000	1.700	2016/12/19	7.62
日本	国債証券	第98回利付国債（5年）	40,000,000	100.07	40,028,400	100.05	40,021,200	0.300	2016/6/20	3.02

以上が、当ファンドが保有する有価証券のすべてです。

## ロ 種類別の投資比率

平成28年 4月28日現在

種類	投資比率（％）
国債証券	32.55
特殊債券	53.15
合計	85.70

## 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28年 4月28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	164	日本円	2,203,643,720	2,175,460,000	1.10

(注) 主たる取引所の発表する清算値段または最終相場で評価しております。

## 国内債券パッシブ・マザーファンド

該当事項はありません。

## 外国株式インデックス・マザーファンド

平成28年 4月28日現在

種類	地域	取引所等	名称	買建/ 売建	数量	通貨	帳簿価額	簿価 (円)	評価額	時価 (円)	投資 比率 (%)
株価指数先物取引	アメリカ	シカゴ商業取引所	SPMINI 1606	買建	309	米ドル	31,863,239	3,496,990,480	32,301,315	3,545,069,321	2.23
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	DJ EUR 1606	買建	257	ユーロ	7,494,714	930,243,902	7,877,050	977,699,446	0.61
	オーストラリア	シドニー先物取引所	SPI200 1606	買建	25	オーストラリアドル	3,158,837.5	263,447,047	3,221,250	268,652,250	0.16
	イギリス	ロンドン国際金融先物オプション取引所	FTSE 1606	買建	41	英ポンド	2,543,517	405,640,091	2,569,880	409,844,462	0.25

(注) 主たる取引所の発表する清算値段または最終相場で評価しております。

平成28年 4月28日現在

種類	資産の名称	買建 / 売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	米ドル	売建	2,010,000.00	224,557,200	220,557,300	0.13
	カナダドル	売建	150,000.00	13,306,500	13,075,500	0.00
	ユーロ	売建	400,000.00	50,548,000	49,648,000	0.03
	英ポンド	売建	170,000.00	27,591,000	27,106,500	0.01
	スイスフラン	売建	120,000.00	13,789,200	13,549,200	0.00
	スウェーデンクローナ	売建	280,000.00	3,864,000	3,796,800	0.00
	ノルウェークローネ	売建	50,000.00	684,500	672,500	0.00
	デンマーククローネ	売建	190,000.00	3,223,540	3,169,200	0.00
	オーストラリアドル	売建	60,000.00	5,088,600	5,001,000	0.00
	香港ドル	売建	300,000.00	4,320,000	4,242,000	0.00
	シンガポールドル	売建	50,000.00	4,144,000	4,072,000	0.00
	イスラエルシェケル	売建	40,000.00	1,189,200	1,169,600	0.00

(注) わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しております。

#### 外国債券パッシブ・マザーファンド

該当事項はありません。

#### 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



## 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。

※2016年のファンドの収益率は、年初から2016年4月28日までの騰落率を表示しています。

※ファンドにはベンチマークはありません。

## 第2【管理及び運営】

### 1【申込（販売）手続等】

#### イ 申込方法

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

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

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

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

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

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

ファンドのお買付けに関しましては、クーリング・オフ制度の適用はありません。

#### ロ 申込価額

取得申込受付日の翌営業日の基準価額となります。

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

#### ハ 申込手数料

無手数料です。

#### ニ 申込単位

お申込単位の詳細は、取扱いの販売会社または委託会社にお問い合わせください。

#### ホ 照会先

手続き等のご不明な点についての委託会社に対する照会は下記においてできます。

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

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

#### ヘ 申込取扱場所・払込取扱場所

販売会社において申込み・払込みを取り扱います。

#### ト 払込期日

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

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

## 2【換金（解約）手続等】

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

お買付けの販売会社にお申し出ください。

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

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

一部解約金は、解約請求受付日から起算して5営業日目からお支払いします。

一部解約価額は、解約請求受付日の翌営業日の基準価額となります。

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

委託会社は、取引所等における取引の停止、決済機能の停止、その他やむを得ない事情があるときは、一部解約の実行の請求の受け付けを中止すること、および既に受け付けた一部解約の実行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、「DC2020」として掲載されます。

委託会社に対する照会は下記においてできます。

照会先の名称	電話番号	インターネット・ ホームページ・アドレス
--------	------	-------------------------

三井住友アセットマネジメント株式会社	0120-88-2976	<a href="http://www.smam-jp.com">http://www.smam-jp.com</a>
--------------------	--------------	---

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

## (2) 【保管】

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

## (3) 【信託期間】

平成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。
- 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、知っている受益者が議決権を行行使しないときは、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。
- 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。

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

(ロ) 償還金

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

八 信託約款の変更等

(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。

- (二) 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(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(二)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。
- (へ) 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っても、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、何らの意思表示もない場合は、自動的に1年間更新されます。販売契約の内容は、必要に応じて、委託会社と販売会社との合意により変更されることがあります。

## へ 委託会社の事業の譲渡および承継に伴う取扱い

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

## ト 公告

委託会社が受益者に対してする公告は、日本経済新聞に掲載します。

## チ 運用にかかる報告書の開示方法

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

## 4【受益者の権利等】

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

### イ 分配金請求権

受益者は、委託会社の決定した収益分配金を持分に応じて請求する権利を有します。収益分配金は、原則として、税金を差し引いた後、毎計算期間終了日後1ヵ月以内の委託会社の指定する日(原則として決算日から起算して5営業日目まで)から、販売会社において、決算日の振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者(当該収益分配金にかかる決算日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該収益分配金にかかる決算日以前に設定された受益権で取得申込代金支払い前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者とします。)に支払われます。ただし、分配金自動再投資コースをお申込みの場合の収益分配金は、原則として、税金を差し引いた後、累積投資契約に基づき、毎計算期間終了日の翌営業日に再投資され、再投資により増加



した受益権は、振替口座簿に記載または記録されます。

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

ロ 償還金請求権

受益者は、持分に応じて償還金を請求する権利を有します。

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

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

ハ 一部解約実行請求権

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

ニ 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おうとする場合において、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8期（平成27年 4月14日から平成28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】

## 【スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2020】

## (1) 【貸借対照表】

(単位:円)

	第7期 (平成27年 4月13日現在)	第8期 (平成28年 4月13日現在)
<b>資産の部</b>		
<b>流動資産</b>		
金銭信託	-	302,835
コール・ローン	432,272	-
親投資信託受益証券	104,255,775	129,717,398
流動資産合計	104,688,047	130,020,233
<b>資産合計</b>	<b>104,688,047</b>	<b>130,020,233</b>
<b>負債の部</b>		
<b>流動負債</b>		
未払解約金	-	605
未払受託者報酬	15,567	20,262
未払委託者報酬	202,308	263,422
その他未払費用	2,535	3,335
流動負債合計	220,410	287,624
<b>負債合計</b>	<b>220,410</b>	<b>287,624</b>
<b>純資産の部</b>		
<b>元本等</b>		
元本	84,860,484	106,424,104
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	19,607,153	23,308,505
元本等合計	104,467,637	129,732,609
純資産合計	104,467,637	129,732,609
<b>負債純資産合計</b>	<b>104,688,047</b>	<b>130,020,233</b>

## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第7期		第8期	
	自	平成26年 4月15日 至 平成27年 4月13日	自	平成27年 4月14日 至 平成28年 4月13日
営業収益				
受取利息		4		4
有価証券売買等損益		8,224,791		678,377
営業収益合計		8,224,795		678,373
営業費用				
受託者報酬		26,426		38,550
委託者報酬		343,416		501,071
その他費用		4,279		6,326
営業費用合計		374,121		545,947
営業利益又は営業損失（ ）		7,850,674		1,224,320
経常利益又は経常損失（ ）		7,850,674		1,224,320
当期純利益又は当期純損失（ ）		7,850,674		1,224,320
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（ ）		305,873		36,587
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		5,838,244		19,607,153
剰余金増加額又は欠損金減少額		6,991,498		6,478,750
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		6,991,498		6,478,750
剰余金減少額又は欠損金増加額		767,390		1,589,665
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		767,390		1,589,665
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（ ）		19,607,153		23,308,505

## （ 3 ）【注記表】

## （ 重要な会計方針の注記 ）

項 目	第8期
	自 平成27年 4月14日 至 平成28年 4月13日
有価証券の評価基準及び評価方法	<p>親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>

## （ 貸借対照表に関する注記 ）

項 目	第7期	第8期
	(平成27年 4月13日現在)	(平成28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	84,860,484口	106,424,104口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.2311円 (10,000口当たりの純資産額 12,311円)	1口当たり純資産額 1.2190円 (10,000口当たりの純資産額 12,190円)

## （ 損益及び剰余金計算書に関する注記 ）

項 目	第7期	第8期
	自 平成26年 4月15日 至 平成27年 4月13日	自 平成27年 4月14日 至 平成28年 4月13日
分配金の計算過程	<p>計算期間末における費用控除後の配当等収益（1,367,817円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（6,176,984円）、収益調整金（14,077,799円）、および分配準備積立金（6,702,409円）より、分配対象収益は28,325,009円（1万口当たり3,337.80円）ですが、分配を行っておりません。</p>	<p>計算期間末における費用控除後の配当等収益（1,359,509円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（0円）、収益調整金（22,279,100円）、および分配準備積立金（13,275,261円）より、分配対象収益は36,913,870円（1万口当たり3,468.54円）ですが、分配を行っておりません。</p>

## （金融商品に関する注記）

## ．金融商品の状況に関する事項

項 目	第8期 自 平成27年 4月14日 至 平成28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>

項目	第8期
	自 平成27年 4月14日 至 平成28年 4月13日
4.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって認める評価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。

・金融商品の時価等に関する事項

項目	第8期
	(平成28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（親投資信託受益証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

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	7,756,408円
合計	7,756,408円

第8期（自 平成27年 4月14日 至 平成28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	751,690円
合計	751,690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7期 （平成27年 4月13日現在）	第8期 （平成28年 4月13日現在）
期首元本額	49,170,873円	84,860,484円
期中追加設定元本額	41,478,096円	28,443,083円
期中一部解約元本額	5,788,485円	6,879,463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）	8,599,842	16,869,450	
	外国株式インデックス・マザーファンド	3,083,623	7,780,289	
	外国債券パッシブ・マザーファンド	8,544,101	14,403,645	
	国内債券パッシブ・マザーファンド	48,681,261	62,000,454	
	マネーインカム・マザーファンド	28,312,486	28,663,560	
合計		97,221,313	129,717,398	

## 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）

スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2020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27年 4月13日現在)	(平成28年 4月13日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	-	1,851,945,023
コール・ローン	2,749,242,256	-
株式	270,575,807,620	194,753,607,746
派生商品評価勘定	73,126,120	10,560,160
未収入金	10,561,520	-
未収配当金	2,169,589,215	1,957,063,159
未収利息	753	-
前払金	-	41,709,000
差入委託証拠金	-	110,540,000
流動資産合計	275,578,327,484	198,725,425,088
資産合計	275,578,327,484	198,725,425,088
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	-	52,439,800
前受金	73,300,000	-
未払金	18,225,000	-
未払解約金	1,005,258,972	75,879,277
流動負債合計	1,096,783,972	128,319,077
負債合計	1,096,783,972	128,319,077
純資産の部		
元本等		
元本	119,948,691,565	101,243,854,770
剰余金		
剰余金又は欠損金( )	154,532,851,947	97,353,251,241
元本等合計	274,481,543,512	198,597,106,011
純資産合計	274,481,543,512	198,597,106,011
負債純資産合計	275,578,327,484	198,725,425,088

### 注記表

(重要な会計方針の注記)

項 目	自 平成27年 4月14日 至 平成28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27年 4月13日現在)	(平成28年 4月13日現在)
1. 担保資産	<p>代用として、担保に供している資産は次の通りであります。</p> <p>株式 4,124,000,000円</p>	<p>代用として、担保に供している資産は次の通りであります。</p> <p>株式 2,811,500,000円</p>
2. 当計算期間の末日における受益権の総数	119,948,691,565口	101,243,854,770口
3. 1単位当たり純資産の額	<p>1口当たり純資産額 2.2883円</p> <p>(10,000口当たりの純資産額 22,883円)</p>	<p>1口当たり純資産額 1.9616円</p> <p>(10,000口当たりの純資産額 19,616円)</p>

## (金融商品に関する注記)

## . 金融商品の状況に関する事項

項目	自 平成27年 4月14日 至 平成28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	(1) 金融商品の内容

<p>リスク</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 (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>
<p>3.金融商品に係るリスク管理体制</p>	<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>
<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>	<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

<p>項 目</p>	<p>（平成28年 4月13日現在）</p>
------------	------------------------

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

(デリバティブ取引に関する注記)

(平成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

(平成28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	3,893,879,640	-	3,852,000,000	41,879,640
	東証株価指数先物	3,893,879,640	-	3,852,000,000	41,879,640
合計		3,893,879,640	-	3,852,000,000	41,879,640

(注) 1.時価の算定方法

(1)株価指数先物取引の時価の算定方法について

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

2)株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

## 2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

## ( 関連当事者との取引に関する注記 )

該当事項はありません。

## ( その他の注記 )

( 平成27年 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
SMAM・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（TOPIX）	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
SMAM・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
SMAM・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
SMAM・バランスファンドVA25＜適格機関投資家専用＞	9,178,823,798円
SMAM・バランスファンドVA37.5＜適格機関投資家専用＞	4,124,609,025円
SMAM・バランスファンドVA50＜適格機関投資家専用＞	15,704,187,582円
SMAM・バランスファンドVL30＜適格機関投資家限定＞	86,404,685円
SMAM・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
SMAM・バランスファンドVA75＜適格機関投資家専用＞	1,730,112,656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＞	86,914,341円
SMAM・インデックス・バランスVA25＜適格機関投資家専用＞	569,450,705円
SMAM・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
SMAM・バランスファンドVA40＜適格機関投資家専用＞	3,079,414,930円
SMAM・バランスファンドVA35＜適格機関投資家専用＞	5,486,370,606円
SMAM・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
SMAM・グローバルバランス40VA＜適格機関投資家限定＞	109,807,951円

SMAM・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
SMAM・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
SMAM・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
SMAM・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

(平成28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	119,948,691,565円
同期中における追加設定元本額	21,900,549,475円
同期中における一部解約元本額	40,605,386,270円
平成28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	9,877,016,976円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	526,409,568円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	2,603,617,762円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	1,871,011,843円
SMAM・グローバルバランスファンド(機動的資産配分型)	82,073,887円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2020	8,599,842円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2025	19,254,141円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2030	62,363,262円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2035	47,388,076円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2040	28,126,160円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2045	62,046,755円
国内株式指数ファンド(TOPIX)	2,706,316,638円
三井住友・DC日本株式インデックスファンドS	897,341,453円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	277,828,450円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	556,342,681円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	760,763,475円
SMAM・国内株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	16,978,928,129円
バランスファンドVA(安定運用型)<適格機関投資家限定>	121,263,347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 >	14,348,302,910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 >	7,117,159,918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 >	4,034,957,665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 >	14,756,674,460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 >	85,242,090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 >	349,430,490円
世界6資産バランスファンドV A < 適格機関投資家限定 >	23,976,922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 >	1,535,018,129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 >	85,688,096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 >	573,208,020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 >	1,715,554,716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 >	2,896,392,095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 >	5,284,633,258円
S M A M ・ バランスV A 株 4 0 T < 適格機関投資家限定 >	130,398,140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）	3,489,737,244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 >	102,988,021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 >	187,530,886円
三井住友・7資産バランスファンド・V A S（適格機関投資家専用）	3,136,160,809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 >	170,710,285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 >	76,427,722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 >	36,368,520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 >	373,012,538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 >	629,102,601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 >	267,908,539円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 2 0 A 2 < 適格機関投資家専用 >	182,110,004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 >	82,740,483円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 5 0 A 2 < 適格機関投資家専用 >	13,703,184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 >	134,242,920円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 2 5 L 2 < 適格機関投資家専用 >	1,562,934,340円
S M A M ・ 国内株式インデックスファンド・V A（適格機関投資家専用）	272,134,221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 >	33,498,132円
S M A M ・ F G 新興国重視型バランス2 0 V A < 適格機関投資家限定 >	305,920円
S M A M ・ F G グローバルバランス2 5 V A < 適格機関投資家限定 >	1,635,871円
S M A M ・ 年金Wリスクコントロールファンド < 適格機関投資家限定 >	150,170円
S M A M ・ マルチアセットストラテジーファンド2 0 1 6 - 0 1 < 適格機関投資家限定 >	67,123,006円
合計	101,243,854,770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	52,000	259.00	13,468,000
日本水産	127,800	581.00	74,251,800
マルハニチロ	22,800	2,339.00	53,329,200
サカタのタネ	16,200	2,620.00	42,444,000
ホクト	11,200	2,089.00	23,396,800
住石ホールディングス	36,300	93.00	3,375,900
日鉄鉱業	30,000	412.00	12,360,000
三井松島産業	76,000	114.00	8,664,000
国際石油開発帝石	583,400	853.80	498,106,920
日本海洋掘削	3,500	2,356.00	8,246,000
石油資源開発	17,400	2,500.00	43,500,000
K&Oエナジーグループ	7,200	1,304.00	9,388,800
ショーボンドホールディングス	11,300	4,605.00	52,036,500
ミライト・ホールディングス	33,600	921.00	30,945,600
タマホーム	11,900	430.00	5,117,000
安藤・間	73,500	552.00	40,572,000
東急建設	35,900	895.00	32,130,500
コムシスホールディングス	47,700	1,673.00	79,802,100
ミサワホーム	14,200	726.00	10,309,200
高松コンストラクショングループ	7,900	2,283.00	18,035,700
東建コーポレーション	4,500	8,780.00	39,510,000
大成建設	573,000	724.00	414,852,000
大林組	331,600	1,053.00	349,174,800
清水建設	338,000	960.00	324,480,000
飛鳥建設	91,100	179.00	16,306,900
長谷工コーポレーション	129,500	1,045.00	135,327,500
松井建設	13,900	734.00	10,202,600
銭高組	18,000	458.00	8,244,000
鹿島建設	518,000	684.00	354,312,000
不動テトラ	86,100	124.00	10,676,400
大末建設	6,100	735.00	4,483,500
鉄建建設	68,000	274.00	18,632,000
西松建設	129,000	474.00	61,146,000
三井住友建設	434,600	99.00	43,025,400
大豊建設	43,000	481.00	20,683,000
前田建設工業	69,000	819.00	56,511,000
ナカノフドー建設	10,300	502.00	5,170,600
奥村組	106,000	560.00	59,360,000
東鉄工業	13,100	3,330.00	43,623,000
イチケン	16,000	289.00	4,624,000
戸田建設	130,000	518.00	67,340,000
熊谷組	162,000	289.00	46,818,000



青木あすなる建設	9,100	692.00	6,297,200
北野建設	29,000	263.00	7,627,000
三井ホーム	17,000	499.00	8,483,000
矢作建設工業	16,500	795.00	13,117,500
ピーエス三菱	16,000	397.00	6,352,000
日本ハウスホールディングス	25,500	395.00	10,072,500
大東建託	41,400	15,955.00	660,537,000
新日本建設	15,200	516.00	7,843,200
N I P P O	25,000	1,817.00	45,425,000
東亜道路工業	24,000	352.00	8,448,000
前田道路	35,000	1,939.00	67,865,000
日本道路	32,000	485.00	15,520,000
東亜建設工業	97,000	253.00	24,541,000
若築建設	75,000	125.00	9,375,000
東洋建設	35,300	474.00	16,732,200
五洋建設	124,300	481.00	59,788,300
大林道路	14,000	721.00	10,094,000
世紀東急工業	20,000	467.00	9,340,000
福田組	18,000	1,137.00	20,466,000
住友林業	76,100	1,269.00	96,570,900
日本基礎技術	15,500	379.00	5,874,500
日成ビルド工業	33,000	372.00	12,276,000
ヤマダ・エスバイエルホーム	80,000	81.00	6,480,000
巴コーポレーション	18,900	345.00	6,520,500
パナホーム	40,000	814.00	32,560,000
大和ハウス工業	326,800	2,923.50	955,399,800
ライト工業	21,300	1,126.00	23,983,800
積水ハウス	370,000	1,888.00	698,560,000
日特建設	15,100	388.00	5,858,800
ユアテック	18,000	890.00	16,020,000
中電工	15,600	2,131.00	33,243,600
関電工	44,000	794.00	34,936,000
きんでん	66,800	1,313.00	87,708,400
東京エネシス	14,000	830.00	11,620,000
トーエネック	17,000	672.00	11,424,000
住友電設	9,100	1,368.00	12,448,800
日本電設工業	17,800	2,180.00	38,804,000
協和エクシオ	43,900	1,183.00	51,933,700
新日本空調	10,800	947.00	10,227,600
N D S	24,000	288.00	6,912,000
九電工	20,300	2,756.00	55,946,800
三機工業	24,600	852.00	20,959,200

日揮	111,000	1,775.00	197,025,000
中外炉工業	42,000	186.00	7,812,000
ヤマト	13,400	438.00	5,869,200
太平電業	17,000	867.00	14,739,000
高砂熱学工業	32,700	1,369.00	44,766,300
朝日工業社	17,000	439.00	7,463,000
明星工業	22,000	445.00	9,790,000
大気社	13,800	2,622.00	36,183,600
ダイダン	17,000	716.00	12,172,000
日比谷総合設備	13,400	1,491.00	19,979,400
東芝プラントシステム	17,900	1,338.00	23,950,200
OSJBホールディングス	26,900	255.00	6,859,500
東洋エンジニアリング	60,000	301.00	18,060,000
千代田化工建設	80,000	838.00	67,040,000
新興プランテック	22,900	814.00	18,640,600
日本製粉	72,000	853.00	61,416,000
日清製粉グループ本社	120,900	1,750.00	211,575,000
日東富士製粉	15,000	347.00	5,205,000
昭和産業	44,000	456.00	20,064,000
鳥越製粉	11,900	632.00	7,520,800
中部飼料	11,600	817.00	9,477,200
フィード・ワン	76,100	122.00	9,284,200
日本甜菜製糖	64,000	184.00	11,776,000
三井製糖	43,000	476.00	20,468,000
日新製糖	5,600	1,314.00	7,358,400
森永製菓	99,000	526.00	52,074,000
中村屋	30,000	448.00	13,440,000
江崎グリコ	25,600	5,290.00	135,424,000
名糖産業	6,800	1,270.00	8,636,000
不二家	73,000	189.00	13,797,000
山崎製パン	81,000	2,319.00	187,839,000
モロゾフ	23,000	421.00	9,683,000
亀田製菓	6,100	4,345.00	26,504,500
寿スピリッツ	7,900	2,223.00	17,561,700
カルビー	41,000	4,140.00	169,740,000
森永乳業	101,000	577.00	58,277,000
六甲バター	5,400	1,763.00	9,520,200
ヤクルト本社	59,400	5,160.00	306,504,000
明治ホールディングス	65,500	8,610.00	563,955,000
雪印メグミルク	26,300	2,602.00	68,432,600
プリマハム	68,000	281.00	19,108,000
日本ハム	81,000	2,340.00	189,540,000

林兼産業	46,000	99.00	4,554,000
丸大食品	56,000	433.00	24,248,000
S Foods	6,900	2,411.00	16,635,900
伊藤ハム米久ホールディングス	65,579	830.00	54,430,570
サッポロホールディングス	170,000	569.00	96,730,000
アサヒグループホールディングス	208,000	3,425.00	712,400,000
キリンホールディングス	449,400	1,622.00	728,926,800
宝ホールディングス	80,600	881.00	71,008,600
オエノンホールディングス	40,000	208.00	8,320,000
養命酒製造	4,400	1,905.00	8,382,000
コカ・コーラウエスト	37,500	2,735.00	102,562,500
コカ・コーライーストジャパン	39,300	1,743.00	68,499,900
サントリー食品インターナショナル	75,700	4,765.00	360,710,500
ダイトードリンコ	5,500	5,230.00	28,765,000
伊藤園	32,900	3,395.00	111,695,500
キーコーヒー	9,200	1,805.00	16,606,000
日清オイリオグループ	57,000	441.00	25,137,000
不二製油グループ本社	29,800	2,009.00	59,868,200
J・オイルミルズ	46,000	330.00	15,180,000
キッコーマン	84,000	3,590.00	301,560,000
味の素	232,500	2,503.00	581,947,500
キューピー	56,300	2,879.00	162,087,700
ハウス食品グループ本社	37,900	2,048.00	77,619,200
カゴメ	39,800	2,234.00	88,913,200
焼津水産化学工業	7,900	991.00	7,828,900
アリアケジャパン	9,000	6,270.00	56,430,000
ニチレイ	118,000	939.00	110,802,000
東洋水産	54,300	3,870.00	210,141,000
日清食品ホールディングス	46,800	5,130.00	240,084,000
永谷園ホールディングス	12,000	1,100.00	13,200,000
一正蒲鉾	5,500	974.00	5,357,000
フジッコ	10,700	2,323.00	24,856,100
ロック・フィールド	5,600	3,245.00	18,172,000
日本たばこ産業	655,100	4,729.00	3,097,967,900
ケンコーマヨネーズ	4,000	2,465.00	9,860,000
わらべや日洋	6,000	2,354.00	14,124,000
なとり	6,700	1,705.00	11,423,500
ユーグレナ	37,500	1,558.00	58,425,000
ミヨシ油脂	49,000	123.00	6,027,000
理研ビタミン	3,300	3,875.00	12,787,500
片倉工業	13,700	1,172.00	16,056,400
ゲンゼ	85,000	316.00	26,860,000

東洋紡	413,000	197.00	81,361,000	
ユニチカ	309,000	53.00	16,377,000	
富士紡ホールディングス	56,000	216.00	12,096,000	
倉敷紡績	106,000	199.00	21,094,000	
シキボウ	81,000	110.00	8,910,000	
日本毛織	31,600	791.00	24,995,600	
ダイドーリミテッド	17,400	475.00	8,265,000	
帝国繊維	11,100	1,468.00	16,294,800	
帝人	425,000	390.00	165,750,000	
東レ	752,000	932.80	701,465,600	
サカイオーベックス	35,000	170.00	5,950,000	
住江織物	30,000	293.00	8,790,000	
芦森工業	31,000	156.00	4,836,000	
アツギ	93,000	111.00	10,323,000	
ダイニック	35,000	146.00	5,110,000	
セーレン	25,700	1,183.00	30,403,100	
小松精練	18,000	617.00	11,106,000	
ワコールホールディングス	62,000	1,339.00	83,018,000	
ホギメディカル	6,500	6,030.00	39,195,000	
レナウン	38,400	107.00	4,108,800	
T S Iホールディングス	47,300	689.00	32,589,700	
三陽商会	60,000	255.00	15,300,000	
オンワードホールディングス	70,000	784.00	54,880,000	
ゴールドウイン	4,500	4,260.00	19,170,000	
デサント	23,900	1,533.00	36,638,700	
特種東海製紙	60,000	360.00	21,600,000	
王子ホールディングス	421,000	441.00	185,661,000	
日本製紙	53,000	2,058.00	109,074,000	
三菱製紙	168,000	82.00	13,776,000	
北越紀州製紙	64,400	651.00	41,924,400	
中越パルプ工業	44,000	211.00	9,284,000	
巴川製紙所	23,000	180.00	4,140,000	
大王製紙	45,100	969.00	43,701,900	
レンゴー	92,000	571.00	52,532,000	
トーモク	36,000	271.00	9,756,000	
ザ・バック	7,200	2,546.00	18,331,200	
クラレ	162,600	1,313.00	213,493,800	
旭化成	647,000	740.20	478,909,400	
共和レザー	8,200	832.00	6,822,400	
昭和電工	690,000	113.00	77,970,000	
住友化学	761,000	482.00	366,802,000	
住友精化	23,000	545.00	12,535,000	

日産化学工業	62,200	2,833.00	176,212,600
ラサ工業	52,000	109.00	5,668,000
クレハ	78,000	360.00	28,080,000
テイカ	19,000	491.00	9,329,000
石原産業	192,000	74.00	14,208,000
日東エフシー	7,600	883.00	6,710,800
日本曹達	67,000	543.00	36,381,000
東ソー	279,000	476.00	132,804,000
トクヤマ	172,000	167.00	28,724,000
セントラル硝子	113,000	606.00	68,478,000
東亜合成	65,200	910.00	59,332,000
大阪ソーダ	45,000	414.00	18,630,000
関東電化工業	25,000	810.00	20,250,000
デンカ	215,000	468.00	100,620,000
信越化学工業	185,700	6,038.00	1,121,256,600
日本カーバイド工業	44,000	171.00	7,524,000
堺化学工業	45,000	295.00	13,275,000
エア・ウォーター	85,000	1,616.00	137,360,000
大陽日酸	79,900	1,019.00	81,418,100
日本化学工業	43,000	202.00	8,686,000
日本パーカライズン	52,100	980.00	51,058,000
高压ガス工業	17,000	618.00	10,506,000
四国化成工業	15,000	925.00	13,875,000
戸田工業	24,000	320.00	7,680,000
ステラ ケミファ	5,700	2,297.00	13,092,900
保土谷化学工業	38,000	196.00	7,448,000
日本触媒	15,100	5,670.00	85,617,000
大日精化工業	39,000	448.00	17,472,000
カネカ	139,000	969.00	134,691,000
三菱瓦斯化学	178,000	593.00	105,554,000
三井化学	439,000	360.00	158,040,000
J S R	97,000	1,497.00	145,209,000
東京応化工業	21,000	2,963.00	62,223,000
大阪有機化学工業	9,400	596.00	5,602,400
三菱ケミカルホールディングス	694,400	556.60	386,503,040
日本合成化学工業	24,000	682.00	16,368,000
ダイセル	145,200	1,402.00	203,570,400
住友ベークライト	98,000	441.00	43,218,000
積水化学工業	234,300	1,368.00	320,522,400
日本ゼオン	90,000	705.00	63,450,000
アイカ工業	31,200	2,322.00	72,446,400
宇部興産	555,000	195.00	108,225,000

積水樹脂	15,700	1,430.00	22,451,000
タキロン	25,000	526.00	13,150,000
旭有機材	41,000	201.00	8,241,000
日立化成	51,100	1,862.00	95,148,200
ニチバン	12,000	611.00	7,332,000
リケンテクノス	19,100	395.00	7,544,500
大倉工業	31,000	282.00	8,742,000
積水化成成品工業	29,000	321.00	9,309,000
群栄化学工業	31,000	301.00	9,331,000
ミライアル	6,100	781.00	4,764,100
ダイキョーニシカワ	13,500	1,515.00	20,452,500
日本化薬	67,000	1,145.00	76,715,000
カーリットホールディングス	11,600	481.00	5,579,600
日本精化	10,500	757.00	7,948,500
扶桑化学工業	6,900	1,695.00	11,695,500
A D E K A	50,900	1,568.00	79,811,200
日油	79,000	802.00	63,358,000
花王	278,600	5,771.00	1,607,800,600
第一工業製薬	27,000	328.00	8,856,000
三洋化成工業	32,000	804.00	25,728,000
大日本塗料	65,000	193.00	12,545,000
日本ペイントホールディングス	79,900	2,545.00	203,345,500
関西ペイント	116,900	1,899.00	221,993,100
中国塗料	30,000	752.00	22,560,000
日本特殊塗料	8,500	871.00	7,403,500
藤倉化成	16,900	492.00	8,314,800
太陽ホールディングス	7,500	3,660.00	27,450,000
D I C	408,000	258.00	105,264,000
サカタインクス	20,900	1,242.00	25,957,800
東洋インキS Cホールディングス	99,000	429.00	42,471,000
T & K T O K A	8,200	906.00	7,429,200
富士フイルムホールディングス	237,000	4,149.00	983,313,000
資生堂	196,800	2,462.00	484,521,600
ライオン	119,000	1,416.00	168,504,000
高砂香料工業	6,900	2,441.00	16,842,900
マンダム	9,500	4,900.00	46,550,000
ミルボン	6,100	4,620.00	28,182,000
ファンケル	23,900	1,503.00	35,921,700
コーセー	16,700	10,890.00	181,863,000
シーズ・ホールディングス	13,100	2,286.00	29,946,600
ポーラ・オルビスホールディングス	10,500	9,330.00	97,965,000
ノエビアホールディングス	6,300	3,085.00	19,435,500

エステー	8,500	1,047.00	8,899,500
コニシ	16,200	1,362.00	22,064,400
長谷川香料	12,600	1,770.00	22,302,000
星光PMC	6,200	1,247.00	7,731,400
小林製薬	15,600	9,220.00	143,832,000
荒川化学工業	10,000	926.00	9,260,000
メック	9,000	835.00	7,515,000
日本高純度化学	4,000	2,011.00	8,044,000
JCU	3,300	3,550.00	11,715,000
新田ゼラチン	8,300	738.00	6,125,400
デクセリアルズ	23,400	998.00	23,353,200
アース製薬	7,200	4,420.00	31,824,000
イハラケミカル工業	15,900	1,332.00	21,178,800
北興化学工業	17,000	286.00	4,862,000
大成ラミック	3,700	2,808.00	10,389,600
クミアイ化学工業	21,400	953.00	20,394,200
日本農薬	24,900	560.00	13,944,000
アキレス	93,000	141.00	13,113,000
有沢製作所	16,900	566.00	9,565,400
日東電工	80,100	6,147.00	492,374,700
きもと	25,100	161.00	4,041,100
藤森工業	8,800	2,488.00	21,894,400
前澤化成工業	8,300	993.00	8,241,900
JSP	6,800	1,941.00	13,198,800
エフピコ	9,000	4,720.00	42,480,000
天馬	7,900	1,756.00	13,872,400
信越ポリマー	21,000	575.00	12,075,000
東リ	32,000	283.00	9,056,000
ニフコ	19,800	5,150.00	101,970,000
日本バルカー工業	46,000	279.00	12,834,000
ユニ・チャーム	210,000	2,524.00	530,040,000
協和発酵キリン	123,500	1,809.00	223,411,500
武田薬品工業	412,300	5,233.00	2,157,565,900
アステラス製薬	1,159,600	1,481.00	1,717,367,600
大日本住友製薬	73,100	1,369.00	100,073,900
塩野義製薬	151,000	5,414.00	817,514,000
田辺三菱製薬	119,800	1,916.00	229,536,800
あすか製薬	13,400	1,438.00	19,269,200
日本新薬	23,800	4,720.00	112,336,000
バイオフェルミン製薬	1,900	3,825.00	7,267,500
中外製薬	102,700	3,450.00	354,315,000
科研製薬	17,900	6,900.00	123,510,000

エーザイ	127,200	6,917.00	879,842,400
ロート製薬	50,600	1,964.00	99,378,400
小野薬品工業	235,200	5,722.00	1,345,814,400
久光製薬	32,100	5,470.00	175,587,000
持田製薬	7,200	8,100.00	58,320,000
参天製薬	190,600	1,662.00	316,777,200
扶桑薬品工業	40,000	246.00	9,840,000
日本ケミファ	17,000	464.00	7,888,000
ツムラ	32,900	2,807.00	92,350,300
日医工	24,500	2,544.00	62,328,000
キッセイ薬品工業	18,500	2,636.00	48,766,000
生化学工業	19,800	1,674.00	33,145,200
栄研化学	8,800	2,204.00	19,395,200
日水製薬	5,400	1,256.00	6,782,400
鳥居薬品	6,800	2,612.00	17,761,600
JCRファーマ	8,000	2,791.00	22,328,000
東和薬品	4,800	4,650.00	22,320,000
富士製薬工業	3,600	1,850.00	6,660,000
沢井製薬	17,600	7,030.00	123,728,000
ゼリア新薬工業	21,100	1,382.00	29,160,200
第一三共	348,400	2,543.00	885,981,200
キョーリン製薬ホールディングス	27,800	2,228.00	61,938,400
大幸薬品	5,700	1,391.00	7,928,700
ダイト	4,600	3,455.00	15,893,000
大塚ホールディングス	222,600	4,263.00	948,943,800
大正製薬ホールディングス	24,800	8,840.00	219,232,000
ペプチドリーム	12,800	6,770.00	86,656,000
日本コークス工業	95,700	76.00	7,273,200
昭和シェル石油	104,900	1,013.00	106,263,700
ニチレキ	13,500	751.00	10,138,500
東燃ゼネラル石油	147,000	1,006.00	147,882,000
ユシロ化学工業	6,400	1,243.00	7,955,200
ビーピー・カストロール	4,900	1,252.00	6,134,800
富士石油	25,800	341.00	8,797,800
MORESCO	4,900	1,156.00	5,664,400
出光興産	54,900	1,998.00	109,690,200
JXホールディングス	1,227,500	452.80	555,812,000
コスモエネルギーホールディングス	31,100	1,337.00	41,580,700
横浜ゴム	62,500	1,792.00	112,000,000
東洋ゴム工業	47,100	1,580.00	74,418,000
ブリヂストン	349,400	3,993.00	1,395,154,200
住友ゴム工業	96,800	1,659.00	160,591,200



藤倉ゴム工業	11,700	423.00	4,949,100
オカモト	33,000	923.00	30,459,000
ニッタ	11,100	2,729.00	30,291,900
住友理工	22,400	921.00	20,630,400
三ツ星ベルト	26,000	842.00	21,892,000
バンドー化学	39,000	528.00	20,592,000
日東紡績	68,000	353.00	24,004,000
旭硝子	546,000	623.00	340,158,000
日本板硝子	503,000	86.00	43,258,000
石塚硝子	21,000	195.00	4,095,000
日本山村硝子	52,000	162.00	8,424,000
日本電気硝子	215,000	567.00	121,905,000
住友大阪セメント	206,000	470.00	96,820,000
太平洋セメント	646,000	282.00	182,172,000
日本ヒューム	12,000	546.00	6,552,000
日本コンクリート工業	25,700	262.00	6,733,400
三谷セキサン	5,700	1,509.00	8,601,300
アジアパイルホールディングス	15,100	410.00	6,191,000
東海カーボン	88,000	270.00	23,760,000
日本カーボン	54,000	232.00	12,528,000
東洋炭素	6,400	1,391.00	8,902,400
ノリタケカンパニーリミテド	57,000	239.00	13,623,000
TOTO	75,900	3,500.00	265,650,000
日本碍子	131,000	2,004.00	262,524,000
日本特殊陶業	89,100	2,103.00	187,377,300
MARUWA	4,100	2,869.00	11,762,900
品川リフラクトリーズ	33,000	198.00	6,534,000
黒崎播磨	26,000	240.00	6,240,000
ニッカトー	11,200	361.00	4,043,200
フジインコーポレーテッド	9,200	1,456.00	13,395,200
ニチアス	52,000	714.00	37,128,000
ニチハ	13,900	1,627.00	22,615,300
新日鐵住金	466,900	2,295.50	1,071,768,950
神戸製鋼所	1,897,000	109.00	206,773,000
中山製鋼所	128,000	68.00	8,704,000
合同製鐵	61,000	198.00	12,078,000
ジェイ エフ イー ホールディングス	283,200	1,675.00	474,360,000
日新製鋼	47,400	1,331.00	63,089,400
東京製鐵	57,300	657.00	37,646,100
共英製鋼	11,000	1,698.00	18,678,000
大和工業	23,000	2,436.00	56,028,000
東京鐵鋼	25,000	355.00	8,875,000

大阪製鐵	7,200	1,747.00	12,578,400
淀川製鋼所	15,100	2,448.00	36,964,800
東洋鋼鈹	26,700	344.00	9,184,800
丸一鋼管	34,400	3,105.00	106,812,000
モリ工業	22,000	289.00	6,358,000
大同特殊鋼	175,000	390.00	68,250,000
日本冶金工業	80,200	135.00	10,827,000
山陽特殊製鋼	62,000	488.00	30,256,000
愛知製鋼	60,000	432.00	25,920,000
日立金属	118,500	1,204.00	142,674,000
日本金属	42,000	101.00	4,242,000
大平洋金属	71,000	317.00	22,507,000
新日本電工	63,500	172.00	10,922,000
栗本鐵工所	56,000	157.00	8,792,000
三菱製鋼	74,000	186.00	13,764,000
日亜鋼業	20,500	222.00	4,551,000
シンニッタン	11,100	645.00	7,159,500
大紀アルミニウム工業所	21,000	264.00	5,544,000
日本軽金属ホールディングス	234,600	185.00	43,401,000
三井金属鉱業	266,000	191.00	50,806,000
東邦亜鉛	54,000	281.00	15,174,000
三菱マテリアル	647,000	327.00	211,569,000
住友金属鉱山	286,000	1,182.50	338,195,000
D O W Aホールディングス	134,000	672.00	90,048,000
古河機械金属	160,000	155.00	24,800,000
大阪チタニウムテクノロジーズ	10,600	1,596.00	16,917,600
東邦チタニウム	18,500	864.00	15,984,000
U A C J	143,000	225.00	32,175,000
古河電気工業	327,000	256.00	83,712,000
住友電気工業	414,500	1,287.00	533,461,500
フジクラ	145,000	553.00	80,185,000
昭和電線ホールディングス	143,000	63.00	9,009,000
タツタ電線	23,600	341.00	8,047,600
平河ヒューテック	6,100	835.00	5,093,500
リョービ	63,000	418.00	26,334,000
アーレスティ	13,300	674.00	8,964,200
アサヒホールディングス	15,400	1,435.00	22,099,000
稲葉製作所	6,400	1,316.00	8,422,400
宮地エンジニアリンググループ	45,000	141.00	6,345,000
トーカロ	7,700	1,967.00	15,145,900
S U M C O	82,100	721.00	59,194,100
川田テクノロジーズ	2,600	3,110.00	8,086,000

東洋製罐グループホールディングス	73,300	2,042.00	149,678,600
ホッカンホールディングス	34,000	314.00	10,676,000
コロナ	6,900	1,039.00	7,169,100
横河ブリッジホールディングス	19,900	1,145.00	22,785,500
駒井ハルテック	26,000	230.00	5,980,000
三和ホールディングス	104,300	852.00	88,863,600
文化シャッター	28,600	924.00	26,426,400
三協立山	13,200	1,473.00	19,443,600
アルインコ	7,600	1,020.00	7,752,000
LIXILグループ	144,000	2,225.00	320,400,000
日本フィルコン	14,100	416.00	5,865,600
ノーリツ	20,200	1,808.00	36,521,600
長府製作所	10,900	2,497.00	27,217,300
リンナイ	19,200	9,730.00	186,816,000
日東精工	21,000	274.00	5,754,000
岡部	22,200	771.00	17,116,200
ジーテクト	11,000	1,167.00	12,837,000
東ブレ	19,700	2,166.00	42,670,200
高周波熱錬	20,100	734.00	14,753,400
東京製網	79,000	148.00	11,692,000
パイオラックス	5,200	5,380.00	27,976,000
日本発條	97,600	1,012.00	98,771,200
アドバネクス	3,100	1,198.00	3,713,800
三益半導体工業	9,200	1,016.00	9,347,200
日本製鋼所	173,000	360.00	62,280,000
三浦工業	46,400	2,061.00	95,630,400
タクマ	38,000	957.00	36,366,000
ツガミ	32,000	436.00	13,952,000
オークマ	68,000	856.00	58,208,000
東芝機械	56,000	344.00	19,264,000
アマダホールディングス	150,600	1,098.00	165,358,800
アイダエンジニアリング	26,800	993.00	26,612,400
滝澤鉄工所	45,000	121.00	5,445,000
富士機械製造	33,400	1,147.00	38,309,800
牧野フライス製作所	51,000	692.00	35,292,000
オーエスジー	47,300	1,978.00	93,559,400
旭ダイヤモンド工業	27,700	1,068.00	29,583,600
D M G 森精機	57,700	1,254.00	72,355,800
ソディック	19,900	867.00	17,253,300
ディスコ	13,200	10,010.00	132,132,000
日東工器	6,500	2,070.00	13,455,000
O K K	55,000	105.00	5,775,000

島精機製作所	14,500	1,815.00	26,317,500
N Cホールディングス	4,000	1,379.00	5,516,000
フリュー	1,800	2,782.00	5,007,600
日阪製作所	14,500	823.00	11,933,500
やまびこ	19,200	777.00	14,918,400
ペガサスミシン製造	12,500	504.00	6,300,000
ナプテスコ	53,800	2,529.00	136,060,200
三井海洋開発	12,000	1,562.00	18,744,000
レオン自動機	9,900	645.00	6,385,500
S M C	31,000	26,805.00	830,955,000
ホソカワミクロン	20,000	576.00	11,520,000
ユニオンツール	4,600	2,974.00	13,680,400
オイレス工業	13,400	1,657.00	22,203,800
日精エー・エス・ビー機械	4,100	2,191.00	8,983,100
サトーホールディングス	13,900	2,232.00	31,024,800
日精樹脂工業	9,000	651.00	5,859,000
小松製作所	507,600	1,980.00	1,005,048,000
住友重機械工業	302,000	458.00	138,316,000
日立建機	46,100	1,841.00	84,870,100
日工	20,000	314.00	6,280,000
巴工業	5,200	1,469.00	7,638,800
井関農機	108,000	224.00	24,192,000
T O W A	11,600	700.00	8,120,000
丸山製作所	32,000	173.00	5,536,000
北川鉄工所	53,000	204.00	10,812,000
クボタ	497,100	1,494.00	742,667,400
三菱化工機	38,000	216.00	8,208,000
月島機械	19,300	904.00	17,447,200
帝国電機製作所	9,000	761.00	6,849,000
新東工業	23,400	954.00	22,323,600
澁谷工業	9,200	1,255.00	11,546,000
アイチ コーポレーション	15,800	797.00	12,592,600
小森コーポレーション	25,000	1,258.00	31,450,000
鶴見製作所	8,200	1,528.00	12,529,600
住友精密工業	21,000	325.00	6,825,000
荏原製作所	230,000	505.00	116,150,000
西島製作所	12,300	1,045.00	12,853,500
北越工業	12,900	625.00	8,062,500
ダイキン工業	144,000	8,476.00	1,220,544,000
オルガノ	22,000	410.00	9,020,000
トーヨーカネツ	58,000	231.00	13,398,000
栗田工業	62,200	2,546.00	158,361,200

椿本チエイン	58,000	727.00	42,166,000
大同工業	31,000	184.00	5,704,000
木村化工機	12,800	357.00	4,569,600
アネスト岩田	16,900	1,161.00	19,620,900
ダイフク	53,200	1,976.00	105,123,200
加藤製作所	26,000	422.00	10,972,000
油研工業	28,000	177.00	4,956,000
タダノ	48,300	1,016.00	49,072,800
フジテック	28,500	1,154.00	32,889,000
C K D	27,600	873.00	24,094,800
キトー	13,900	750.00	10,425,000
平和	30,000	2,341.00	70,230,000
理想科学工業	10,700	1,681.00	17,986,700
S A N K Y O	27,400	4,150.00	113,710,000
日本金銭機械	9,800	893.00	8,751,400
マースエンジニアリング	6,000	1,920.00	11,520,000
福島工業	6,100	2,644.00	16,128,400
ダイコク電機	4,700	1,285.00	6,039,500
竹内製作所	14,800	1,584.00	23,443,200
アマノ	30,200	1,790.00	54,058,000
J U K I	15,100	945.00	14,269,500
サンデンホールディングス	61,000	314.00	19,154,000
蛇の目ミシン工業	11,400	600.00	6,840,000
マックス	15,000	1,115.00	16,725,000
グローリー	33,700	3,735.00	125,869,500
新晃工業	7,200	1,617.00	11,642,400
大和冷機工業	15,500	929.00	14,399,500
セガサミーホールディングス	106,200	1,230.00	130,626,000
日本ピストンリング	5,100	1,414.00	7,211,400
リケン	47,000	353.00	16,591,000
T P R	12,000	2,796.00	33,552,000
ツバキ・ナカシマ	9,300	1,412.00	13,131,600
ホシザキ電機	21,600	9,540.00	206,064,000
大豊工業	8,700	1,065.00	9,265,500
日本精工	202,600	967.00	195,914,200
N T N	246,000	337.00	82,902,000
ジェイテクト	105,200	1,447.00	152,224,400
不二越	94,000	362.00	34,028,000
日本トムソン	35,900	383.00	13,749,700
T H K	65,900	2,187.00	144,123,300
ユーシン精機	4,300	1,902.00	8,178,600
前澤給装工業	5,200	1,385.00	7,202,000

イーグル工業	12,100	1,453.00	17,581,300
日本ピラー工業	11,000	923.00	10,153,000
キッツ	47,700	459.00	21,894,300
日立工機	25,000	741.00	18,525,000
マキタ	64,400	6,820.00	439,208,000
日立造船	79,100	539.00	42,634,900
三菱重工業	1,761,000	422.80	744,550,800
I H I	760,000	239.00	181,640,000
日清紡ホールディングス	55,000	1,147.00	63,085,000
イビデン	60,700	1,461.00	88,682,700
コニカミノルタ	246,500	953.00	234,914,500
ブラザー工業	127,500	1,297.00	165,367,500
ミネベア	159,000	891.00	141,669,000
日立製作所	2,522,000	503.90	1,270,835,800
東芝	2,080,000	229.50	477,360,000
三菱電機	1,054,000	1,197.50	1,262,165,000
富士電機	297,000	383.00	113,751,000
東洋電機製造	24,000	314.00	7,536,000
安川電機	122,800	1,336.00	164,060,800
シンフォニアテクノロジー	71,000	146.00	10,366,000
明電舎	90,000	516.00	46,440,000
オリジン電気	21,000	263.00	5,523,000
山洋電気	27,000	504.00	13,608,000
デンヨー	10,200	1,139.00	11,617,800
東芝テック	70,000	435.00	30,450,000
マブチモーター	28,500	5,050.00	143,925,000
日本電産	118,900	7,437.00	884,259,300
東光高岳	6,200	1,492.00	9,250,400
ダブル・スコープ	3,000	5,450.00	16,350,000
ダイヘン	58,000	487.00	28,246,000
田淵電機	12,400	489.00	6,063,600
J V C ケンウッド	73,200	293.00	21,447,600
ミマキエンジニアリング	8,200	595.00	4,879,000
第一精工	4,700	1,223.00	5,748,100
日新電機	23,200	1,299.00	30,136,800
大崎電気工業	18,000	756.00	13,608,000
オムロン	111,800	3,460.00	386,828,000
日東工業	15,600	1,742.00	27,175,200
I D E C	13,400	1,019.00	13,654,600
ジーエス・ユアサ コーポレーション	191,000	487.00	93,017,000
サクサホールディングス	28,000	204.00	5,712,000
メルコホールディングス	5,700	2,491.00	14,198,700

テクノメディカ	2,700	2,199.00	5,937,300
日本電気	1,358,000	278.00	377,524,000
富士通	952,000	406.50	386,988,000
沖電気工業	430,000	149.00	64,070,000
電気興業	27,000	491.00	13,257,000
サンケン電気	55,000	382.00	21,010,000
アイホン	6,100	1,796.00	10,955,600
ルネサスエレクトロニクス	50,900	675.00	34,357,500
セイコーエプソン	147,000	1,831.00	269,157,000
ワコム	77,800	465.00	36,177,000
アルバック	18,200	3,430.00	62,426,000
E I Z O	9,800	2,754.00	26,989,200
ジャパンディスプレイ	186,700	222.00	41,447,400
日本信号	27,000	911.00	24,597,000
京三製作所	29,000	332.00	9,628,000
能美防災	11,000	1,657.00	18,227,000
ホーチキ	8,000	1,284.00	10,272,000
エレコム	8,700	2,231.00	19,409,700
日本無線	31,000	287.00	8,897,000
パナソニック	1,128,900	959.00	1,082,615,100
シャープ	768,000	137.00	105,216,000
アンリツ	60,900	598.00	36,418,200
富士通ゼネラル	30,000	1,820.00	54,600,000
日立国際電気	22,300	1,294.00	28,856,200
ソニー	697,400	3,020.00	2,106,148,000
T D K	59,800	6,150.00	367,770,000
ミツミ電機	37,900	527.00	19,973,300
タムラ製作所	41,000	287.00	11,767,000
アルプス電気	84,000	1,906.00	160,104,000
池上通信機	40,000	136.00	5,440,000
パイオニア	160,100	325.00	52,032,500
日本電波工業	11,500	729.00	8,383,500
日本トリム	2,700	5,500.00	14,850,000
ローランド ディー . ジー .	5,200	2,156.00	11,211,200
フォスター電機	12,400	2,374.00	29,437,600
クラリオン	52,000	343.00	17,836,000
S M K	30,000	550.00	16,500,000
ヨコオ	9,200	509.00	4,682,800
東光	22,000	383.00	8,426,000
ホシデン	30,200	721.00	21,774,200
ヒロセ電機	16,100	13,080.00	210,588,000
日本航空電子工業	28,000	1,295.00	36,260,000

TOA	12,100	1,033.00	12,499,300
日立マクセル	16,200	1,753.00	28,398,600
古野電気	13,200	685.00	9,042,000
ユニデンホールディングス	41,000	124.00	5,084,000
アルパイン	23,400	1,264.00	29,577,600
スミダコーポレーション	9,700	667.00	6,469,900
アイコム	5,900	2,122.00	12,519,800
リオン	4,500	1,615.00	7,267,500
船井電機	10,900	1,003.00	10,932,700
横河電機	99,000	1,133.00	112,167,000
新電元工業	37,000	383.00	14,171,000
アズビル	32,200	2,904.00	93,508,800
日本光電工業	41,400	2,765.00	114,471,000
チノー	5,300	997.00	5,284,100
共和電業	17,200	390.00	6,708,000
堀場製作所	18,300	3,995.00	73,108,500
アドバンテスト	68,000	1,053.00	71,604,000
エスペック	10,400	1,442.00	14,996,800
パナソニック デバイスSUNX	10,500	565.00	5,932,500
キーエンス	22,400	61,800.00	1,384,320,000
日置電機	5,600	2,304.00	12,902,400
シスメックス	76,700	6,980.00	535,366,000
日本マイクロニクス	13,100	1,059.00	13,872,900
メガチップス	10,500	1,211.00	12,715,500
OBARA GROUP	6,400	4,105.00	26,272,000
コーセル	13,500	1,134.00	15,309,000
オブテックス	7,400	3,850.00	28,490,000
千代田インテグレ	5,400	2,499.00	13,494,600
レーザーテック	11,700	1,571.00	18,380,700
スタンレー電気	71,000	2,335.00	165,785,000
岩崎電気	40,000	185.00	7,400,000
ウシオ電機	60,200	1,546.00	93,069,200
ヘリオス テクノ ホールディング	12,200	378.00	4,611,600
日本セラミック	6,000	2,023.00	12,138,000
遠藤照明	6,000	967.00	5,802,000
日本デジタル研究所	8,300	1,535.00	12,740,500
古河電池	9,000	636.00	5,724,000
山一電機	10,000	567.00	5,670,000
図研	8,000	1,205.00	9,640,000
日本電子	40,000	495.00	19,800,000
カシオ計算機	99,100	2,149.00	212,965,900
ファナック	101,200	18,235.00	1,845,382,000



日本シイエムケイ	23,600	432.00	10,195,200	
エンプラス	5,100	3,950.00	20,145,000	
大真空	27,000	243.00	6,561,000	
ローム	49,100	4,780.00	234,698,000	
浜松ホトニクス	77,000	3,130.00	241,010,000	
三井ハイテック	15,900	691.00	10,986,900	
新光電気工業	36,700	636.00	23,341,200	
京セラ	162,300	4,983.00	808,740,900	
太陽誘電	48,500	1,114.00	54,029,000	
村田製作所	103,700	14,250.00	1,477,725,000	
ユーシン	14,400	675.00	9,720,000	
双葉電子工業	16,800	1,613.00	27,098,400	
北陸電気工業	48,000	132.00	6,336,000	
ニチコン	30,500	753.00	22,966,500	
日本ケミコン	84,000	149.00	12,516,000	
K O A	14,500	793.00	11,498,500	
市光工業	28,000	250.00	7,000,000	
小糸製作所	59,300	4,770.00	282,861,000	
ミツバ	16,800	1,553.00	26,090,400	
スター精密	18,800	1,384.00	26,019,200	
S C R E E Nホールディングス	102,000	895.00	91,290,000	
キャノン電子	8,400	1,626.00	13,658,400	
キャノン	532,100	3,227.00	1,717,086,700	
リコー	320,500	1,101.00	352,870,500	
東京エレクトロン	81,100	7,379.00	598,436,900	
トヨタ紡織	34,600	1,916.00	66,293,600	
ユニプレス	21,100	1,886.00	39,794,600	
豊田自動織機	89,500	4,750.00	425,125,000	
モリタホールディングス	17,700	1,300.00	23,010,000	
三櫻工業	16,100	583.00	9,386,300	
デンソー	244,100	4,266.00	1,041,330,600	
東海理化電機製作所	29,100	1,972.00	57,385,200	
三井造船	388,000	161.00	62,468,000	
川崎重工業	768,000	319.00	244,992,000	
名村造船所	32,100	807.00	25,904,700	
日本車輛製造	46,000	260.00	11,960,000	
ニチユ三菱フォークリフト	13,500	488.00	6,588,000	
近畿車輛	21,000	310.00	6,510,000	
日産自動車	1,388,000	1,016.50	1,410,902,000	
いすゞ自動車	286,400	1,147.00	328,500,800	
トヨタ自動車	1,229,900	5,623.00	6,915,727,700	代用有価証券 500,000株
日野自動車	140,600	1,147.00	161,268,200	

三菱自動車工業	392,200	825.00	323,565,000
エフテック	6,700	1,040.00	6,968,000
武蔵精密工業	10,800	2,054.00	22,183,200
日産車体	48,700	1,048.00	51,037,600
新明和工業	45,000	761.00	34,245,000
極東開発工業	21,000	1,088.00	22,848,000
日信工業	23,000	1,514.00	34,822,000
トピー工業	88,000	216.00	19,008,000
ティラド	50,000	168.00	8,400,000
曙ブレーキ工業	56,800	258.00	14,654,400
タチエス	16,000	1,527.00	24,432,000
N O K	48,100	1,819.00	87,493,900
フタバ産業	31,300	438.00	13,709,400
K Y B	115,000	330.00	37,950,000
大同メタル工業	15,500	807.00	12,508,500
プレス工業	55,900	372.00	20,794,800
ミクニ	13,900	332.00	4,614,800
カルソニックカンセイ	77,000	761.00	58,597,000
太平洋工業	22,600	998.00	22,554,800
ケーヒン	23,700	1,596.00	37,825,200
河西工業	12,700	1,073.00	13,627,100
アイシン精機	101,050	4,165.00	420,873,250
富士機工	13,900	418.00	5,810,200
マツダ	312,900	1,591.00	497,823,900
ダイハツ工業	117,700	1,481.00	174,313,700
今仙電機製作所	10,300	944.00	9,723,200
本田技研工業	889,700	3,008.00	2,676,217,600
スズキ	206,300	2,980.50	614,877,150
富士重工業	312,300	3,610.00	1,127,403,000
ヤマハ発動機	139,500	1,815.00	253,192,500
ショーワ	26,800	921.00	24,682,800
T B K	18,000	372.00	6,696,000
エクセディ	13,800	2,308.00	31,850,400
豊田合成	35,900	2,025.00	72,697,500
愛三工業	18,000	848.00	15,264,000
ヨロズ	9,500	2,228.00	21,166,000
エフ・シー・シー	17,100	1,765.00	30,181,500
シマノ	39,800	17,000.00	676,600,000
テイ・エス テック	23,100	2,488.00	57,472,800
ジャムコ	4,900	2,696.00	13,210,400
テルモ	151,300	4,060.00	614,278,000
日機装	35,000	816.00	28,560,000

島津製作所	127,000	1,671.00	212,217,000
JMS	24,000	283.00	6,792,000
長野計器	8,600	616.00	5,297,600
バイ・テクノロジー	2,500	4,470.00	11,175,000
東京計器	37,000	156.00	5,772,000
愛知時計電機	19,000	301.00	5,719,000
東京精密	18,700	2,272.00	42,486,400
マニー	9,000	1,744.00	15,696,000
ニコン	184,100	1,722.00	317,020,200
トプコン	33,000	1,443.00	47,619,000
オリンパス	147,200	4,150.00	610,880,000
理研計器	9,100	1,042.00	9,482,200
タムロン	7,900	1,742.00	13,761,800
HOYA	223,400	4,223.00	943,418,200
ノーリツ鋼機	10,700	640.00	6,848,000
エー・アンド・デイ	12,400	386.00	4,786,400
シチズンホールディングス	121,500	636.00	77,274,000
リズム時計工業	50,000	142.00	7,100,000
大研医器	8,400	912.00	7,660,800
メニコン	4,800	3,805.00	18,264,000
松風	5,700	1,340.00	7,638,000
セイコーホールディングス	63,000	427.00	26,901,000
ニプロ	73,300	1,058.00	77,551,400
スノーピーク	1,000	3,670.00	3,670,000
パラマウントベッドホールディングス	10,400	4,160.00	43,264,000
前田工織	11,700	1,154.00	13,501,800
永大産業	17,000	395.00	6,715,000
アートネイチャー	9,300	1,075.00	9,997,500
ダンロップスポーツ	7,600	987.00	7,501,200
バンダイナムコホールディングス	102,200	2,466.00	252,025,200
共立印刷	22,300	276.00	6,154,800
SHOEI	5,500	1,705.00	9,377,500
フランスベッドホールディングス	13,900	1,009.00	14,025,100
パイロットコーポレーション	17,400	4,110.00	71,514,000
萩原工業	2,800	2,590.00	7,252,000
トッパン・フォームズ	16,800	1,215.00	20,412,000
フジシールインターナショナル	12,000	3,615.00	43,380,000
タカラトミー	32,600	783.00	25,525,800
アーケ	49,300	87.00	4,289,100
プロネクサス	10,200	1,129.00	11,515,800
ウッドワン	26,000	244.00	6,344,000
大建工業	43,000	303.00	13,029,000

凸版印刷	277,000	944.00	261,488,000
大日本印刷	290,000	998.00	289,420,000
図書印刷	20,000	547.00	10,940,000
共同印刷	36,000	326.00	11,736,000
日本写真印刷	16,800	1,656.00	27,820,800
宝印刷	5,900	1,324.00	7,811,600
アシックス	92,300	2,047.00	188,938,100
ツツミ	5,100	2,263.00	11,541,300
小松ウオール工業	4,000	1,738.00	6,952,000
ヤマハ	72,600	3,315.00	240,669,000
河合楽器製作所	4,400	1,950.00	8,580,000
クリナップ	12,900	756.00	9,752,400
ピジョン	56,100	2,943.00	165,102,300
キングジム	10,100	838.00	8,463,800
リンテック	23,800	2,043.00	48,623,400
イトーキ	21,000	749.00	15,729,000
任天堂	60,800	16,215.00	985,872,000
三菱鉛筆	7,300	5,050.00	36,865,000
タカラスタANDARD	40,000	989.00	39,560,000
コクヨ	51,600	1,322.00	68,215,200
ナカバヤシ	25,000	283.00	7,075,000
グローブライド	5,600	1,344.00	7,526,400
岡村製作所	33,900	1,043.00	35,357,700
美津濃	52,000	534.00	27,768,000
アデランス	18,800	674.00	12,671,200
東京電力ホールディングス	838,700	601.00	504,058,700
中部電力	302,600	1,489.00	450,571,400
関西電力	404,000	989.40	399,717,600
中国電力	135,900	1,413.00	192,026,700
北陸電力	96,700	1,497.00	144,759,900
東北電力	246,600	1,359.00	335,129,400
四国電力	89,100	1,465.00	130,531,500
九州電力	218,300	1,138.00	248,425,400
北海道電力	93,000	934.00	86,862,000
沖縄電力	10,500	2,824.00	29,652,000
電源開発	84,200	3,360.00	282,912,000
イーレックス	2,400	1,608.00	3,859,200
東京瓦斯	1,105,000	483.80	534,599,000
大阪瓦斯	1,023,000	404.40	413,701,200
東邦瓦斯	249,000	754.00	187,746,000
北海道瓦斯	30,000	270.00	8,100,000
広島ガス	20,500	363.00	7,441,500

西部瓦斯	111,000	250.00	27,750,000
静岡ガス	28,200	788.00	22,221,600
メタウォーター	6,400	2,793.00	17,875,200
SBSホールディングス	10,900	687.00	7,488,300
東武鉄道	525,000	550.00	288,750,000
相鉄ホールディングス	169,000	695.00	117,455,000
東京急行電鉄	573,000	934.00	535,182,000
京浜急行電鉄	270,000	968.00	261,360,000
小田急電鉄	315,000	1,182.00	372,330,000
京王電鉄	274,000	973.00	266,602,000
京成電鉄	148,000	1,529.00	226,292,000
富士急行	27,000	1,450.00	39,150,000
新京成電鉄	19,000	430.00	8,170,000
東日本旅客鉄道	180,800	9,639.00	1,742,731,200
西日本旅客鉄道	95,300	6,481.00	617,639,300
東海旅客鉄道	88,600	18,865.00	1,671,439,000
西武ホールディングス	78,800	2,343.00	184,628,400
鴻池運輸	13,900	1,248.00	17,347,200
西日本鉄道	128,000	695.00	88,960,000
ハマキョウレックス	7,800	1,782.00	13,899,600
サカイ引越センター	4,100	2,748.00	11,266,800
近鉄グループホールディングス	992,000	441.00	437,472,000
阪急阪神ホールディングス	662,000	687.00	454,794,000
南海電気鉄道	223,000	581.00	129,563,000
京阪ホールディングス	221,000	795.00	175,695,000
神戸電鉄	31,000	359.00	11,129,000
名古屋鉄道	359,000	547.00	196,373,000
山陽電気鉄道	37,000	493.00	18,241,000
日本通運	381,000	489.00	186,309,000
ヤマトホールディングス	183,100	2,108.50	386,066,350
山九	132,000	488.00	64,416,000
丸全昭和運輸	34,000	392.00	13,328,000
センコー	44,200	683.00	30,188,600
トナミホールディングス	25,000	281.00	7,025,000
ニッコンホールディングス	32,600	1,959.00	63,863,400
福山通運	62,000	551.00	34,162,000
セイノーホールディングス	70,300	1,157.00	81,337,100
神奈川中央交通	13,000	659.00	8,567,000
日立物流	20,100	1,879.00	37,767,900
丸和運輸機関	2,600	2,544.00	6,614,400
C&Fロジホールディングス	11,400	785.00	8,949,000
日本郵船	887,000	223.00	197,801,000

商船三井	482,000	251.00	120,982,000
川崎汽船	433,000	232.00	100,456,000
N S ユナイテッド海運	53,000	149.00	7,897,000
飯野海運	52,600	429.00	22,565,400
乾汽船	10,400	806.00	8,382,400
日本航空	189,200	4,080.00	771,936,000
A N A ホールディングス	1,835,000	310.20	569,217,000
パスコ	11,000	369.00	4,059,000
トランコム	2,900	6,120.00	17,748,000
日新	44,000	298.00	13,112,000
三菱倉庫	70,000	1,414.00	98,980,000
三井倉庫ホールディングス	58,000	287.00	16,646,000
住友倉庫	74,000	538.00	39,812,000
澁澤倉庫	32,000	277.00	8,864,000
東陽倉庫	28,000	223.00	6,244,000
日本トランスシティ	27,000	360.00	9,720,000
安田倉庫	10,100	665.00	6,716,500
東洋埠頭	39,000	145.00	5,655,000
上組	117,000	1,019.00	119,223,000
キューソー流通システム	3,200	2,840.00	9,088,000
郵船ロジスティクス	9,900	1,287.00	12,741,300
近鉄エクスプレス	17,300	1,399.00	24,202,700
東海運	15,300	265.00	4,054,500
エーアイティー	6,000	906.00	5,436,000
N E C ネットズエスアイ	12,100	1,699.00	20,557,900
システナ	9,900	1,709.00	16,919,100
デジタルアーツ	5,200	2,376.00	12,355,200
新日鉄住金ソリューションズ	16,200	2,091.00	33,874,200
コア	4,900	1,241.00	6,080,900
I T ホールディングス	32,600	2,531.00	82,510,600
電算システム	4,200	1,535.00	6,447,000
グリー	59,400	640.00	38,016,000
コーエーテクモホールディングス	23,100	1,694.00	39,131,400
三菱総合研究所	3,900	3,450.00	13,455,000
ファインデックス	6,800	1,342.00	9,125,600
ヒト・コミュニケーションズ	2,600	2,045.00	5,317,000
K L a b	16,000	640.00	10,240,000
ポルトゥウィン・ピットクルーホールディングス	7,500	943.00	7,072,500
ネクソン	93,700	1,731.00	162,194,700
アイスタイル	15,600	929.00	14,492,400
エイチーム	4,000	1,637.00	6,548,000
テクノスジャパン	1,200	5,270.00	6,324,000

コロプラ	27,300	2,497.00	68,168,100
モバイルクリエイト	9,200	452.00	4,158,400
ブロードリーフ	10,600	1,192.00	12,635,200
ハーツユナイテッドグループ	3,100	2,276.00	7,055,600
ブイキューブ	5,400	1,244.00	6,717,600
VOYAGE GROUP	2,800	1,418.00	3,970,400
オブティム	700	5,260.00	3,682,000
ティーガイア	10,200	1,389.00	14,167,800
日本アジアグループ	10,000	501.00	5,010,000
豆蔵ホールディングス	9,400	656.00	6,166,400
テクマトリックス	4,700	1,927.00	9,056,900
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	170,200	297.00	50,549,400
GMOペイメントゲートウェイ	8,500	7,600.00	64,600,000
インターネットイニシアティブ	15,900	2,207.00	35,091,300
さくらインターネット	5,100	1,219.00	6,216,900
SRAホールディングス	5,900	2,377.00	14,024,300
朝日ネット	14,300	473.00	6,763,900
コムチュア	2,300	2,481.00	5,706,300
gumi	11,000	902.00	9,922,000
フェイス	4,100	1,337.00	5,481,700
野村総合研究所	68,400	3,945.00	269,838,000
サイバネットシステム	9,500	791.00	7,514,500
インテージホールディングス	6,300	1,408.00	8,870,400
クレスコ	3,200	1,641.00	5,251,200
フジ・メディア・ホールディングス	101,800	1,228.00	125,010,400
オービック	33,700	5,880.00	198,156,000
ジャストシステム	18,300	905.00	16,561,500
ヤフー	699,600	494.00	345,602,400
トレンドマイクロ	47,500	4,045.00	192,137,500
日本オラクル	15,700	6,060.00	95,142,000
アルファシステムズ	4,300	1,691.00	7,271,300
フューチャー	12,900	850.00	10,965,000
CAC Holdings	9,700	806.00	7,818,200
ソフトバンク・テクノロジー	3,600	1,428.00	5,140,800
オービックビジネスコンサルタント	5,000	4,380.00	21,900,000
伊藤忠テクノソリューションズ	22,400	2,090.00	46,816,000
アイティフォー	16,100	475.00	7,647,500
大塚商会	26,300	5,590.00	147,017,000
サイボウズ	18,800	329.00	6,185,200
電通国際情報サービス	6,100	2,284.00	13,932,400
EMシステムズ	4,600	1,191.00	5,478,600
ウェザーニューズ	3,700	3,625.00	13,412,500

C I J	14,700	452.00	6,644,400
WOWOW	4,900	2,407.00	11,794,300
フュージョンパートナー	8,200	537.00	4,403,400
イマジカ・ロボット ホールディングス	11,100	391.00	4,340,100
ネットワンシステムズ	42,700	568.00	24,253,600
アルゴグラフィックス	5,500	1,684.00	9,262,000
マーベラス	16,800	921.00	15,472,800
エイベックス・グループ・ホールディングス	18,200	1,417.00	25,789,400
日本ユニシス	26,900	1,424.00	38,305,600
兼松エレクトロニクス	6,800	1,912.00	13,001,600
東京放送ホールディングス	58,700	1,633.00	95,857,100
日本テレビホールディングス	89,200	1,811.00	161,541,200
朝日放送	11,400	664.00	7,569,600
テレビ朝日ホールディングス	27,000	1,892.00	51,084,000
スカパーJ S A Tホールディングス	73,500	626.00	46,011,000
テレビ東京ホールディングス	9,000	1,931.00	17,379,000
U - N E X T	2,900	1,018.00	2,952,200
コネクシオ	9,200	1,172.00	10,782,400
日本通信	55,500	196.00	10,878,000
日本電信電話	754,500	4,837.00	3,649,516,500
K D D I	991,600	3,081.00	3,055,119,600
光通信	11,700	8,250.00	96,525,000
N T T ドコモ	752,800	2,649.00	1,994,167,200
エムティーアイ	13,500	805.00	10,867,500
G M O インターネット	36,200	1,353.00	48,978,600
カドカワ	30,400	1,560.00	47,424,000
学研ホールディングス	39,000	245.00	9,555,000
ゼンリン	13,100	2,281.00	29,881,100
アイネット	7,400	1,083.00	8,014,200
松竹	66,000	1,022.00	67,452,000
東宝	69,600	2,847.00	198,151,200
東映	36,000	874.00	31,464,000
A O I P r o .	7,000	933.00	6,531,000
エヌ・ティ・ティ・データ	60,200	5,500.00	331,100,000
D T S	10,900	2,166.00	23,609,400
スクウェア・エニックス・ホールディングス	41,500	2,972.00	123,338,000
シーイーシー	7,300	1,395.00	10,183,500
カブコン	25,400	2,740.00	69,596,000
ジャステック	7,700	888.00	6,837,600
S C S K	23,300	4,240.00	98,792,000
アイネス	14,400	1,126.00	16,214,400
T K C	9,100	2,916.00	26,535,600



富士ソフト	14,500	2,456.00	35,612,000
N S D	20,500	1,670.00	34,235,000
コナミホールディングス	44,200	3,515.00	155,363,000
J B C Cホールディングス	11,000	668.00	7,348,000
ミロク情報サービス	8,500	1,213.00	10,310,500
ソフトバンクグループ	553,100	5,878.00	3,251,121,800
伊藤忠食品	2,500	4,150.00	10,375,000
エレマテック	5,100	1,889.00	9,633,900
J A L U X	3,700	2,055.00	7,603,500
あらた	4,700	2,359.00	11,087,300
東京エレクトロン デバイス	5,200	1,468.00	7,633,600
フィールズ	6,700	1,825.00	12,227,500
双日	615,500	226.00	139,103,000
アルフレッサ ホールディングス	122,300	2,091.00	255,729,300
横浜冷凍	24,200	1,061.00	25,676,200
アルコニックス	6,500	1,515.00	9,847,500
神戸物産	6,400	2,471.00	15,814,400
あい ホールディングス	17,300	3,215.00	55,619,500
ダイワボウホールディングス	89,000	211.00	18,779,000
マクニカ・富士エレホールディングス	17,300	1,287.00	22,265,100
バイタルケーエスケー・ホールディングス	17,200	898.00	15,445,600
U K Cホールディングス	6,400	2,185.00	13,984,000
T O K A Iホールディングス	43,200	574.00	24,796,800
三洋貿易	6,000	1,435.00	8,610,000
ウイン・パートナーズ	3,900	1,457.00	5,682,300
シップヘルスケアホールディングス	19,700	2,826.00	55,672,200
小野建	10,000	970.00	9,700,000
佐島電機	10,300	719.00	7,405,700
伯東	9,100	898.00	8,171,800
コンドーテック	9,700	873.00	8,468,100
ナガイレーベン	14,200	2,320.00	32,944,000
三菱食品	10,400	2,816.00	29,286,400
松田産業	7,900	1,152.00	9,100,800
第一興商	17,200	4,565.00	78,518,000
メディバルホールディングス	97,400	1,762.00	171,618,800
アドヴァン	11,400	1,007.00	11,479,800
S P K	3,600	1,919.00	6,908,400
萩原電気	3,300	1,887.00	6,227,100
アズワン	7,700	4,110.00	31,647,000
尾家産業	6,000	859.00	5,154,000
シモジマ	7,800	1,065.00	8,307,000
ドウシシャ	11,500	2,006.00	23,069,000

小津産業	3,000	2,231.00	6,693,000
高速	8,500	838.00	7,123,000
黒田電気	18,200	1,726.00	31,413,200
丸文	10,800	755.00	8,154,000
ハピネット	9,800	943.00	9,241,400
エクセル	5,500	1,413.00	7,771,500
マルカキカイ	4,200	1,320.00	5,544,000
ガリバーインターナショナル	26,300	1,359.00	35,741,700
日本エム・ディ・エム	9,900	596.00	5,900,400
進和	7,100	1,504.00	10,678,400
ダイトエレクトロン	7,000	673.00	4,711,000
シークス	6,200	3,250.00	20,150,000
オーハシテクニカ	7,000	1,221.00	8,547,000
伊藤忠商事	766,200	1,379.50	1,056,972,900
丸紅	958,700	569.40	545,883,780
長瀬産業	58,900	1,223.00	72,034,700
蝶理	7,000	1,422.00	9,954,000
豊田通商	108,200	2,482.00	268,552,400
三共生興	20,500	372.00	7,626,000
兼松	206,000	162.00	33,372,000
三井物産	883,000	1,318.50	1,164,235,500
日本紙パルプ商事	51,000	317.00	16,167,000
日立ハイテクノロジーズ	33,900	3,165.00	107,293,500
カメイ	13,000	1,008.00	13,104,000
スターゼン	4,000	3,095.00	12,380,000
山善	37,100	845.00	31,349,500
住友商事	614,300	1,145.50	703,680,650
内田洋行	28,000	440.00	12,320,000
三菱商事	732,500	1,920.00	1,406,400,000
第一実業	25,000	479.00	11,975,000
キャノンマーケティングジャパン	28,100	1,877.00	52,743,700
西華産業	40,000	220.00	8,800,000
佐藤商事	12,600	619.00	7,799,400
菱洋エレクトロ	11,600	1,327.00	15,393,200
東京産業	15,200	380.00	5,776,000
ユアサ商事	9,100	2,530.00	23,023,000
阪和興業	99,000	475.00	47,025,000
カナデン	11,500	831.00	9,556,500
菱電商事	17,000	624.00	10,608,000
フルサト工業	6,200	1,660.00	10,292,000
岩谷産業	117,000	632.00	73,944,000
すてきナイスグループ	54,000	135.00	7,290,000

極東貿易	20,000	226.00	4,520,000
三愛石油	25,000	786.00	19,650,000
稲畑産業	23,200	1,064.00	24,684,800
G S I クレオス	33,000	117.00	3,861,000
ワキタ	21,100	736.00	15,529,600
東邦ホールディングス	31,400	2,319.00	72,816,600
サンゲツ	34,500	1,982.00	68,379,000
ミツウロコグループホールディングス	18,200	534.00	9,718,800
シナネンホールディングス	25,000	420.00	10,500,000
伊藤忠エネクス	24,900	877.00	21,837,300
サンリオ	30,600	2,066.00	63,219,600
サンワテクノス	9,200	691.00	6,357,200
リョーサン	15,900	2,673.00	42,500,700
新光商事	12,800	1,080.00	13,824,000
トーホー	5,200	2,427.00	12,620,400
三信電気	14,400	917.00	13,204,800
東陽テクニカ	13,800	1,110.00	15,318,000
モスフードサービス	12,600	2,931.00	36,930,600
加賀電子	9,600	1,326.00	12,729,600
ソーダニッカ	15,700	450.00	7,065,000
立花エレテック	8,300	1,155.00	9,586,500
P A L T A C	15,500	1,996.00	30,938,000
三谷産業	14,100	325.00	4,582,500
太平洋興発	76,000	74.00	5,624,000
ヤマタネ	58,000	147.00	8,526,000
日鉄住金物産	62,000	371.00	23,002,000
トラスコ中山	11,000	4,445.00	48,895,000
オートバックスセブン	37,800	1,850.00	69,930,000
加藤産業	14,900	2,714.00	40,438,600
イノテック	14,200	441.00	6,262,200
イエローハット	9,300	2,179.00	20,264,700
J Kホールディングス	13,700	464.00	6,356,800
日伝	4,500	2,821.00	12,694,500
杉本商事	7,300	1,154.00	8,424,200
因幡電機産業	13,400	3,485.00	46,699,000
ミスミグループ本社	109,800	1,566.00	171,946,800
タキヒヨー	22,000	420.00	9,240,000
スズケン	44,400	3,730.00	165,612,000
ジェコス	8,000	964.00	7,712,000
ローソン	37,100	9,100.00	337,610,000
サンエー	6,600	5,290.00	34,914,000
カワチ薬品	7,700	2,041.00	15,715,700

エービーシー・マート	12,700	7,410.00	94,107,000
ハードオフコーポレーション	5,800	1,505.00	8,729,000
アスクル	11,900	4,540.00	54,026,000
ゲオホールディングス	16,500	1,921.00	31,696,500
アダストリア	18,100	3,885.00	70,318,500
ジーフット	7,100	794.00	5,637,400
くらコーポレーション	5,800	5,170.00	29,986,000
キャンドウ	6,600	1,555.00	10,263,000
パル	5,900	2,646.00	15,611,400
エディオン	40,900	871.00	35,623,900
サーラコーポレーション	11,500	552.00	6,348,000
ハローズ	3,600	2,220.00	7,992,000
あみやき亭	2,200	4,200.00	9,240,000
ひらまつ	15,800	688.00	10,870,400
ゲンキー	2,200	3,810.00	8,382,000
大黒天物産	2,600	4,940.00	12,844,000
ハニーズ	9,500	1,049.00	9,965,500
アルペン	8,700	1,808.00	15,729,600
クオール	10,200	1,583.00	16,146,600
ジェイアイエヌ	6,700	3,860.00	25,862,000
ビックカメラ	50,100	1,163.00	58,266,300
D C Mホールディングス	48,200	811.00	39,090,200
Monotaro	34,600	3,395.00	117,467,000
アークランドサービス	3,300	3,005.00	9,916,500
J.フロント リテイリング	123,400	1,448.00	178,683,200
ドトール・日レスホールディングス	17,100	1,806.00	30,882,600
マツモトキヨシホールディングス	20,200	5,720.00	115,544,000
ブロンコビリー	4,200	2,848.00	11,961,600
スタートトゥデイ	29,900	4,815.00	143,968,500
トレジャー・ファクトリー	3,600	1,100.00	3,960,000
物語コーポレーション	2,700	5,320.00	14,364,000
ココカラファイン	10,100	4,720.00	47,672,000
三越伊勢丹ホールディングス	193,900	1,176.00	228,026,400
ウエルシアホールディングス	8,300	6,220.00	51,626,000
クリエイティブSDホールディングス	14,300	2,683.00	38,366,900
チムニー	2,700	2,945.00	7,951,500
シュッピン	3,500	1,268.00	4,438,000
ジョイフル本田	15,800	2,450.00	38,710,000
ホットランド	3,400	1,084.00	3,685,600
すかいらーく	29,900	1,409.00	42,129,100
綿半ホールディングス	3,600	1,372.00	4,939,200
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホール	31,400	972.00	30,520,800

ブックオフコーポレーション	8,300	876.00	7,270,800
あさひ	8,000	1,722.00	13,776,000
日本調剤	2,900	3,585.00	10,396,500
コスモス薬品	4,900	18,390.00	90,111,000
セブン&アイ・ホールディングス	408,300	4,670.00	1,906,761,000
薬王堂	1,600	3,495.00	5,592,000
クリエイト・レストランツ・ホールディング	26,300	1,051.00	27,641,300
ツルハホールディングス	22,400	11,050.00	247,520,000
サンマルクホールディングス	7,700	2,936.00	22,607,200
トリドール	12,100	2,039.00	24,671,900
クスリのアオキ	8,600	6,310.00	54,266,000
メディカルシステムネットワーク	13,700	681.00	9,329,700
総合メディカル	4,800	3,520.00	16,896,000
カッパ・クリエイト	14,200	1,189.00	16,883,800
ライトオン	7,900	1,585.00	12,521,500
良品計画	11,200	24,690.00	276,528,000
三城ホールディングス	17,600	444.00	7,814,400
アルビス	3,600	1,900.00	6,840,000
コナカ	14,300	515.00	7,364,500
G - 7ホールディングス	4,100	1,212.00	4,969,200
コジマ	20,100	249.00	5,004,900
コーナン商事	14,100	1,778.00	25,069,800
エコス	5,300	1,419.00	7,520,700
ドンキホーテホールディングス	63,100	3,705.00	233,785,500
西松屋チェーン	19,300	1,207.00	23,295,100
ゼンショーホールディングス	50,900	1,384.00	70,445,600
幸楽苑ホールディングス	6,900	1,459.00	10,067,100
サイゼリヤ	16,000	2,288.00	36,608,000
V Tホールディングス	33,200	585.00	19,422,000
魚力	4,800	1,243.00	5,966,400
ユナイテッドアローズ	14,000	4,305.00	60,270,000
ハイデイ日高	8,900	2,649.00	23,576,100
京都きもの友禅	9,300	824.00	7,663,200
コロワイド	32,000	1,714.00	54,848,000
ピーシーデポコーポレーション	9,000	1,085.00	9,765,000
壱番屋	4,400	6,640.00	29,216,000
スギホールディングス	17,500	5,790.00	101,325,000
スクロール	18,500	461.00	8,528,500
ヨンドシーホールディングス	7,500	2,820.00	21,150,000
ファミリーマート	30,200	6,020.00	181,804,000
木曽路	12,200	2,152.00	26,254,400
サトレストランシステムズ	14,800	787.00	11,647,600

千趣会	20,500	717.00	14,698,500
ケーヨー	22,100	511.00	11,293,100
上新電機	23,000	835.00	19,205,000
日本瓦斯	11,400	2,489.00	28,374,600
ベスト電器	39,800	122.00	4,855,600
ロイヤルホールディングス	16,000	2,176.00	34,816,000
いなげや	11,000	1,389.00	15,279,000
島忠	25,500	2,385.00	60,817,500
チヨダ	11,500	2,928.00	33,672,000
ライフコーポレーション	6,200	2,721.00	16,870,200
リンガーハット	9,100	2,210.00	20,111,000
AOKIホールディングス	22,300	1,295.00	28,878,500
オークワ	16,000	1,108.00	17,728,000
コメリ	15,500	2,447.00	37,928,500
青山商事	18,800	4,085.00	76,798,000
しまむら	11,400	14,200.00	161,880,000
高島屋	142,000	815.00	115,730,000
松屋	20,300	864.00	17,539,200
エイチ・ツー・オー リテイリング	50,300	1,882.00	94,664,600
近鉄百貨店	42,000	287.00	12,054,000
パルコ	11,900	935.00	11,126,500
丸井グループ	119,900	1,570.00	188,243,000
アクシアル リテイリング	7,600	3,465.00	26,334,000
イオン	402,100	1,580.50	635,519,050
ユニーグループ・ホールディングス	96,000	829.00	79,584,000
イズミ	19,400	4,455.00	86,427,000
平和堂	19,600	2,326.00	45,589,600
フジ	11,100	2,401.00	26,651,100
ヤオコー	10,900	4,790.00	52,211,000
ゼビオホールディングス	13,200	1,805.00	23,826,000
ケーズホールディングス	20,800	3,695.00	76,856,000
Olympicグループ	9,700	551.00	5,344,700
日産東京販売ホールディングス	20,300	265.00	5,379,500
アインホールディングス	11,800	5,780.00	68,204,000
元気寿司	3,800	2,139.00	8,128,200
ヤマダ電機	297,100	568.00	168,752,800
アーランドサカモト	16,800	1,124.00	18,883,200
ニトリホールディングス	42,200	10,620.00	448,164,000
グルメ杵屋	9,000	984.00	8,856,000
愛眼	19,800	212.00	4,197,600
吉野家ホールディングス	37,500	1,394.00	52,275,000
松屋フーズ	5,100	2,789.00	14,223,900

サガミチェーン	14,100	1,230.00	17,343,000
王将フードサービス	7,200	3,435.00	24,732,000
プレナス	10,700	2,083.00	22,288,100
ミニストップ	7,400	1,921.00	14,215,400
アークス	18,000	2,712.00	48,816,000
パローホールディングス	21,300	2,722.00	57,978,600
ベルク	4,800	4,440.00	21,312,000
大庄	6,200	1,486.00	9,213,200
ファーストリテイリング	19,500	28,695.00	559,552,500
サンドラッグ	20,600	8,050.00	165,830,000
サックスパー ホールディングス	9,400	1,456.00	13,686,400
ヤマザワ	3,600	1,663.00	5,986,800
やまや	2,600	2,066.00	5,371,600
ベルーナ	25,400	551.00	13,995,400
じもとホールディングス	75,300	138.00	10,391,400
足利ホールディングス	71,900	323.00	23,223,700
東京ＴＹフィナンシャルグループ	13,500	2,555.00	34,492,500
九州フィナンシャルグループ	148,700	590.00	87,733,000
ゆうちょ銀行	186,000	1,373.00	255,378,000
コンコルディア・フィナンシャルグループ	678,109	515.20	349,361,756
新生銀行	841,000	155.00	130,355,000
あおぞら銀行	615,000	375.00	230,625,000
三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	7,830,400	528.00	4,134,451,200
りそなホールディングス	1,137,300	402.40	457,649,520
三井住友トラスト・ホールディングス	2,030,000	328.50	666,855,000
三井住友フィナンシャルグループ	781,600	3,450.00	2,696,520,000
第四銀行	123,000	378.00	46,494,000
北越銀行	110,000	179.00	19,690,000
西日本シティ銀行	319,000	201.00	64,119,000
千葉銀行	373,000	558.00	208,134,000
常陽銀行	348,000	388.00	135,024,000
群馬銀行	215,000	458.00	98,470,000
武蔵野銀行	15,600	2,829.00	44,132,400
千葉興業銀行	28,600	472.00	13,499,200
筑波銀行	44,500	290.00	12,905,000
七十七銀行	153,000	393.00	60,129,000
青森銀行	73,000	323.00	23,579,000
秋田銀行	65,000	292.00	18,980,000
山形銀行	56,000	405.00	22,680,000
岩手銀行	6,900	3,965.00	27,358,500
東邦銀行	87,000	352.00	30,624,000
東北銀行	54,000	139.00	7,506,000

みちのく銀行	47,000	175.00	8,225,000	
ふくおかフィナンシャルグループ	420,000	368.00	154,560,000	
静岡銀行	287,000	809.00	232,183,000	
十六銀行	122,000	327.00	39,894,000	
スルガ銀行	92,100	1,930.00	177,753,000	
八十二銀行	174,000	488.00	84,912,000	
山梨中央銀行	62,000	401.00	24,862,000	
大垣共立銀行	129,000	337.00	43,473,000	
福井銀行	86,000	205.00	17,630,000	
北國銀行	109,000	289.00	31,501,000	
清水銀行	3,800	2,275.00	8,645,000	
富山銀行	2,200	3,415.00	7,513,000	
滋賀銀行	91,000	466.00	42,406,000	
南都銀行	95,000	294.00	27,930,000	
百五銀行	88,000	406.00	35,728,000	
京都銀行	185,000	729.00	134,865,000	
紀陽銀行	38,500	1,272.00	48,972,000	
三重銀行	43,000	193.00	8,299,000	
ほくほくフィナンシャルグループ	656,000	146.00	95,776,000	
広島銀行	286,000	405.00	115,830,000	
山陰合同銀行	58,900	707.00	41,642,300	
中国銀行	68,300	1,134.00	77,452,200	
鳥取銀行	34,000	159.00	5,406,000	
伊予銀行	102,900	714.00	73,470,600	
百十四銀行	108,000	316.00	34,128,000	
四国銀行	80,000	209.00	16,720,000	
阿波銀行	79,000	522.00	41,238,000	
大分銀行	58,000	328.00	19,024,000	
宮崎銀行	68,000	274.00	18,632,000	
佐賀銀行	60,000	207.00	12,420,000	
十八銀行	64,000	241.00	15,424,000	
沖縄銀行	7,900	3,450.00	27,255,000	
琉球銀行	20,700	1,219.00	25,233,300	
セブン銀行	364,400	463.00	168,717,200	
みずほフィナンシャルグループ	13,780,800	166.50	2,294,503,200	
高知銀行	38,000	114.00	4,332,000	
山口フィナンシャルグループ	90,000	1,003.00	90,270,000	
長野銀行	34,000	183.00	6,222,000	
名古屋銀行	82,000	365.00	29,930,000	
北洋銀行	148,100	280.00	41,468,000	
愛知銀行	3,400	4,500.00	15,300,000	
第三銀行	55,000	149.00	8,195,000	



中京銀行	46,000	205.00	9,430,000
大光銀行	33,000	195.00	6,435,000
愛媛銀行	62,000	223.00	13,826,000
トマト銀行	39,000	140.00	5,460,000
みなと銀行	93,000	149.00	13,857,000
京葉銀行	81,000	402.00	32,562,000
関西アーバン銀行	14,000	1,029.00	14,406,000
栃木銀行	54,000	400.00	21,600,000
北日本銀行	3,400	2,745.00	9,333,000
東和銀行	150,000	83.00	12,450,000
福島銀行	133,000	83.00	11,039,000
大東銀行	61,000	176.00	10,736,000
トモニホールディングス	76,800	309.00	23,731,200
フィデアホールディングス	65,000	170.00	11,050,000
池田泉州ホールディングス	103,700	402.00	41,687,400
F P G	29,200	1,381.00	40,325,200
S B Iホールディングス	116,400	1,139.00	132,579,600
ジャフコ	16,400	3,455.00	56,662,000
大和証券グループ本社	913,000	671.10	612,714,300
野村ホールディングス	1,876,200	489.30	918,024,660
岡三証券グループ	83,000	587.00	48,721,000
丸三証券	29,600	1,010.00	29,896,000
東洋証券	37,000	271.00	10,027,000
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	111,700	577.00	64,450,900
光世証券	23,000	137.00	3,151,000
水戸証券	29,700	301.00	8,939,700
いちよし証券	22,000	969.00	21,318,000
松井証券	49,600	919.00	45,582,400
だいこう証券ビジネス	4,400	698.00	3,071,200
マネックスグループ	115,500	280.00	32,340,000
カブドットコム証券	86,800	353.00	30,640,400
極東証券	13,000	1,289.00	16,757,000
岩井コスモホールディングス	9,100	1,078.00	9,809,800
藍澤證券	15,000	581.00	8,715,000
マネースクウェアHD	3,800	991.00	3,765,800
マネーパートナーズグループ	9,400	739.00	6,946,600
かんぽ生命保険	29,900	2,551.00	76,274,900
損保ジャパン日本興亜ホールディングス	216,600	3,063.00	663,445,800
アニコムホールディングス	7,100	2,893.00	20,540,300
M S & A Dインシュアランスグループホールディングス	291,400	3,022.00	880,610,800
ソニーフィナンシャルホールディングス	93,700	1,405.00	131,648,500
第一生命保険	625,100	1,326.50	829,195,150

東京海上ホールディングス	395,300	3,641.00	1,439,287,300
T & Dホールディングス	355,300	1,059.50	376,440,350
全国保証	25,500	3,980.00	101,490,000
クレディセゾン	73,900	1,954.00	144,400,600
アクリーティブ	10,100	501.00	5,060,100
芙蓉総合リース	11,200	4,760.00	53,312,000
興銀リース	18,500	1,882.00	34,817,000
東京センチュリーリース	22,500	3,955.00	88,987,500
日本証券金融	45,400	432.00	19,612,800
アイフル	163,800	401.00	65,683,800
ポケットカード	11,900	563.00	6,699,700
リコーリース	7,800	3,200.00	24,960,000
イオンフィナンシャルサービス	63,900	2,525.00	161,347,500
アコム	195,800	578.00	113,172,400
ジャックス	55,000	446.00	24,530,000
オリエントコーポレーション	421,900	227.00	95,771,300
日立キャピタル	23,100	2,341.00	54,077,100
アプラスフィナンシャル	50,700	104.00	5,272,800
オリックス	690,000	1,635.00	1,128,150,000
三菱UFJリース	245,400	487.00	119,509,800
日本取引所グループ	286,200	1,671.00	478,240,200
イー・ギャランティ	3,700	2,513.00	9,298,100
NECキャピタルソリューション	4,600	1,545.00	7,107,000
いちごグループホールディングス	80,700	492.00	39,704,400
日本駐車場開発	113,200	125.00	14,150,000
ヒューリック	203,300	1,056.00	214,684,800
三栄建築設計	4,600	1,224.00	5,630,400
野村不動産ホールディングス	64,800	2,006.00	129,988,800
三重交通グループホールディングス	19,200	555.00	10,656,000
サムティ	5,800	1,049.00	6,084,200
エー・ディー・ワークス	86,300	45.00	3,883,500
日本商業開発	3,500	2,120.00	7,420,000
プレサンスコーポレーション	3,300	3,945.00	13,018,500
ユニゾホールディングス	6,200	4,855.00	30,101,000
日本管理センター	6,700	1,623.00	10,874,100
フージャースホールディングス	16,300	520.00	8,476,000
オープンハウス	14,200	2,217.00	31,481,400
東急不動産ホールディングス	235,300	764.00	179,769,200
飯田グループホールディングス	89,800	2,116.00	190,016,800
パーク24	49,300	3,200.00	157,760,000
パラカ	4,600	1,430.00	6,578,000
三井不動産	517,000	2,628.50	1,358,934,500

三菱地所	726,000	2,075.00	1,506,450,000
平和不動産	18,600	1,306.00	24,291,600
東京建物	106,500	1,379.00	146,863,500
ダイビル	25,200	908.00	22,881,600
京阪神ビルディング	19,100	577.00	11,020,700
住友不動産	234,000	3,155.00	738,270,000
大京	176,000	175.00	30,800,000
テオーシー	38,000	910.00	34,580,000
東京楽天地	18,000	475.00	8,550,000
レオパレス21	115,300	655.00	75,521,500
スターツコーポレーション	10,900	2,360.00	25,724,000
フジ住宅	14,600	671.00	9,796,600
空港施設	14,800	485.00	7,178,000
明和地所	7,800	616.00	4,804,800
住友不動産販売	6,800	2,073.00	14,096,400
ゴールドクレスト	8,300	1,541.00	12,790,300
日神不動産	16,600	362.00	6,009,200
タカラレーベン	42,800	643.00	27,520,400
サンヨーハウジング名古屋	7,200	967.00	6,962,400
イオンモール	63,300	1,565.00	99,064,500
ファースト住建	4,500	1,307.00	5,881,500
トーセイ	15,600	772.00	12,043,200
エヌ・ティ・ティ都市開発	61,000	1,019.00	62,159,000
サンフロンティア不動産	12,100	1,043.00	12,620,300
エフ・ジェー・ネクスト	10,500	490.00	5,145,000
日本空港ビルデング	31,200	4,190.00	130,728,000
日本工営	37,000	345.00	12,765,000
ネクスト	29,500	1,171.00	34,544,500
ジェイエイシーリクルートメント	5,500	1,439.00	7,914,500
日本M&Aセンター	15,900	6,710.00	106,689,000
アコーディア・ゴルフ	28,900	1,058.00	30,576,200
タケエイ	10,400	1,035.00	10,764,000
トラスト・テック	5,000	1,350.00	6,750,000
パソナグループ	10,700	664.00	7,104,800
GCAサヴィアン	9,900	1,102.00	10,909,800
エス・エム・エス	13,000	1,919.00	24,947,000
テンプホールディングス	72,500	1,630.00	118,175,000
リニカル	6,500	1,981.00	12,876,500
クックパッド	23,200	1,599.00	37,096,800
エスクリ	6,600	619.00	4,085,400
学情	4,500	1,201.00	5,404,500
スタジオアリス	5,200	2,699.00	14,034,800

シミックホールディングス	5,500	1,287.00	7,078,500
総合警備保障	34,400	6,070.00	208,808,000
カカクコム	74,500	2,077.00	154,736,500
ルネサンス	7,300	1,204.00	8,789,200
ディップ	11,500	2,670.00	30,705,000
オプトホールディング	8,100	632.00	5,119,200
新日本科学	12,000	432.00	5,184,000
ツクイ	12,700	1,410.00	17,907,000
エムスリー	89,600	2,867.00	256,883,200
ツカダ・グローバルホールディング	10,200	745.00	7,599,000
アウトソーシング	4,800	3,950.00	18,960,000
ウェルネット	4,000	4,240.00	16,960,000
ディー・エヌ・エー	46,600	2,002.00	93,293,200
博報堂D Yホールディングス	142,700	1,229.00	175,378,300
ぐるなび	12,100	2,827.00	34,206,700
ジャパンベストレスキューシステム	18,800	223.00	4,192,400
ファンコミュニケーションズ	24,100	815.00	19,641,500
ジェイコムホールディングス	2,600	2,728.00	7,092,800
WDBホールディングス	4,700	979.00	4,601,300
バリューコマース	12,400	373.00	4,625,200
インフォマート	15,300	1,009.00	15,437,700
J Pホールディングス	29,500	420.00	12,390,000
E P Sホールディングス	11,800	1,332.00	15,717,600
プレステージ・インターナショナル	9,500	1,300.00	12,350,000
アミューズ	6,100	2,186.00	13,334,600
ドリームインキュベータ	3,900	2,284.00	8,907,600
クイック	6,600	877.00	5,788,200
ケネディクス	139,100	477.00	66,350,700
電通	115,000	5,510.00	633,650,000
ぴあ	4,000	2,010.00	8,040,000
イオンファンタジー	4,000	2,123.00	8,492,000
ネクシィーズグループ	5,300	1,190.00	6,307,000
みらかホールディングス	26,500	4,705.00	124,682,500
アルプス技研	4,300	2,241.00	9,636,300
日本空調サービス	12,400	544.00	6,745,600
オリエンタルランド	111,800	7,675.00	858,065,000
ダスキン	29,700	2,002.00	59,459,400
明光ネットワークジャパン	12,300	1,215.00	14,944,500
ファルコホールディングス	5,900	1,365.00	8,053,500
ラウンドワン	32,800	650.00	21,320,000
リゾートトラスト	43,300	2,369.00	102,577,700
ビー・エム・エル	6,100	4,415.00	26,931,500

りらいあコミュニケーションズ	17,100	1,125.00	19,237,500
ユー・エス・エス	125,300	1,764.00	221,029,200
東京個別指導学院	6,300	781.00	4,920,300
サイバーエージェント	25,300	5,340.00	135,102,000
楽天	484,200	1,259.00	609,607,800
テー・オー・ダブリュー	8,500	694.00	5,899,000
セントラルスポーツ	4,600	2,249.00	10,345,400
フルキャストホールディングス	10,500	797.00	8,368,500
テクノプロ・ホールディングス	16,900	2,989.00	50,514,100
リブセンス	8,900	447.00	3,978,300
ジャパンマテリアル	4,500	2,923.00	13,153,500
ベクトル	3,800	2,453.00	9,321,400
I B J	8,400	480.00	4,032,000
アサンテ	4,900	1,509.00	7,394,100
N・フィールド	4,300	1,875.00	8,062,500
ライドオン・エクスプレス	2,200	1,506.00	3,313,200
リクルートホールディングス	208,000	3,310.00	688,480,000
日本郵政	227,700	1,513.00	344,510,100
ベルシステム24ホールディングス	15,600	1,020.00	15,912,000
リロ・ホールディング	3,800	14,990.00	56,962,000
東祥	3,300	4,545.00	14,998,500
エイチ・アイ・エス	16,700	3,055.00	51,018,500
共立メンテナンス	7,700	9,190.00	70,763,000
イチネンホールディングス	12,500	971.00	12,137,500
建設技術研究所	7,700	924.00	7,114,800
スペース	6,300	1,322.00	8,328,600
燦ホールディングス	3,900	1,394.00	5,436,600
東京テアトル	62,000	117.00	7,254,000
ナガワ	2,200	2,570.00	5,654,000
よみうりランド	24,000	522.00	12,528,000
東京都競馬	73,000	216.00	15,768,000
常磐興産	54,000	148.00	7,992,000
カナモト	14,500	2,603.00	37,743,500
東京ドーム	82,000	507.00	41,574,000
西尾レントオール	8,400	2,603.00	21,865,200
トランス・コスモス	11,800	2,844.00	33,559,200
乃村工藝社	22,000	1,838.00	40,436,000
藤田観光	39,000	545.00	21,255,000
KNT-CTホールディングス	58,000	178.00	10,324,000
日本管財	9,100	1,650.00	15,015,000
トーカイ	4,700	3,115.00	14,640,500
白洋舎	21,000	255.00	5,355,000

セコム	107,500	8,123.00	873,222,500	
セントラル警備保障	5,100	2,464.00	12,566,400	
丹青社	19,800	888.00	17,582,400	
メイテック	13,000	3,795.00	49,335,000	
アサツー ディ・ケイ	18,400	2,761.00	50,802,400	
応用地質	11,100	1,136.00	12,609,600	
船井総研ホールディングス	14,700	1,688.00	24,813,600	
ベネッセホールディングス	34,700	3,145.00	109,131,500	
イオンディライト	9,800	3,325.00	32,585,000	
ナック	8,300	850.00	7,055,000	
ニチイ学館	18,700	765.00	14,305,500	
ダイセキ	19,500	2,001.00	39,019,500	
合 計	163,133,738		194,753,607,746	

## (b) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

## デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

## 国内債券パッシブ・マザーファンド

## 貸借対照表

（単位：円）

	（平成27年 4月13日現在）	（平成28年 4月13日現在）
資産の部		
流動資産		
金銭信託	-	1,087,298,169
コール・ローン	924,821,897	-
国債証券	226,539,397,100	187,852,950,690
地方債証券	21,574,445,069	19,705,368,838
特殊債券	30,412,475,093	26,958,862,667
社債券	19,333,642,000	14,582,429,000
未収入金	106,399,000	853,942,550
未収利息	751,469,926	560,459,266
前払費用	12,822,583	17,708,592
流動資産合計	299,655,472,668	251,619,019,772
資産合計	299,655,472,668	251,619,019,772
負債の部		
流動負債		
未払金	100,000,000	-
未払解約金	83,539,217	678,574,051
流動負債合計	183,539,217	678,574,051
負債合計	183,539,217	678,574,051
純資産の部		
元本等		

	（平成27年 4月13日現在）	（平成28年 4月13日現在）
元本	249,296,427,435	197,030,769,648
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	50,175,506,016	53,909,676,073
元本等合計	299,471,933,451	250,940,445,721
純資産合計	299,471,933,451	250,940,445,721
負債純資産合計	299,655,472,668	251,619,019,772

## 注記表

## （重要な会計方針の注記）

項目	自 平成27年 4月14日 至 平成28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27年 4月13日現在）	（平成28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	249,296,427,435口	197,030,769,648口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 (10,000口当たりの純資産額) 1.2013円 12,013円)	1口当たり純資産額 (10,000口当たりの純資産額) 1.2736円 12,736円)

## （金融商品に関する注記）

## ・金融商品の状況に関する事項

項目	自 平成27年 4月14日 至 平成28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、地方債証券、特殊債券、社債券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2)金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する委員会をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用グループに是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用グループは、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。その後、当該関連運用グループの対処の実施や対処方針の決定等に関し、必要に応じてリスク管理を行う部署が当該部署の担当役員、当該関連運用グループの担当役員およびリスク管理委員会へ報告を行う体制となっております。</p> <p>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する部会にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。</p>
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって認める評価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。

## . 金融商品の時価等に関する事項



項目	(平成28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、地方債証券、特殊債券、社債券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

## (デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

## (関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

## (その他の注記)

(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
SMAM・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
SMAM・バランスファンドVA25＜適格機関投資家専用＞	46,204,449,037円
SMAM・バランスファンドVA37.5＜適格機関投資家専用＞	11,669,726,446円
SMAM・バランスファンドVA50＜適格機関投資家専用＞	28,586,629,341円
SMAM・バランスファンドVL30＜適格機関投資家限定＞	478,024,861円
SMAM・バランスファンドVL50＜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VA＜適格機関投資家限定＞	117,284,750円
SMAM・バランスファンドVA75＜適格機関投資家専用＞	460,536,168円
SMAM・バランスファンドVL国際分散型＜適格機関投資家限定＞	160,703,477円
SMAM・インデックス・バランスVA25＜適格機関投資家専用＞	2,773,183,505円
SMAM・インデックス・バランスVA50＜適格機関投資家専用＞	3,304,895,415円
SMAM・バランスファンドVA40＜適格機関投資家専用＞	8,671,882,295円
SMAM・バランスファンドVA35＜適格機関投資家専用＞	17,892,859,968円
SMAM・バランスVA株40T＜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・VAS（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・VAS（適格機関投資家専用）	48,137,643,593円
SMAM・グローバルバランス40VA＜適格機関投資家限定＞	798,888,943円
SMAM・バランスファンドVA20＜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・VAS（適格機関投資家専用）	29,710,107,076円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A＜適格機関投資家専用＞	1,248,536,514円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A＜適格機関投資家専用＞	298,624,568円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A＜適格機関投資家専用＞	66,149,894円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L＜適格機関投資家専用＞	3,345,254,425円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L＜適格機関投資家専用＞	3,883,429,380円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T＜適格機関投資家専用＞	3,505,127,124円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A2＜適格機関投資家専用＞	1,436,559,661円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A2＜適格機関投資家専用＞	343,161,478円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A2＜適格機関投資家専用＞	23,823,592円
SMAM・アセットバランスファンドVA30L2＜適格機関投資家専用＞	584,638,115円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L2＜適格機関投資家専用＞	9,610,855,658円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T2＜適格機関投資家専用＞	531,205,904円
SMAM・FG新興国重視型バランス20VA＜適格機関投資家限定＞	730,429円
SMAM・FGグローバルバランス25VA＜適格機関投資家限定＞	11,128,718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＞	955,982円
SMAM・年金マルチ・インカム・ダイナミック・アロケーション・ファンド＜適格機関投資家限定＞	2,225,028円
合計	249,296,427,435円

（平成28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	249,296,427,435円
同期中における追加設定元本額	12,491,448,439円
同期中における一部解約元本額	64,757,106,226円

平成28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)	2,239,138,488円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	4,078,591,494円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	898,514,497円
SMAM・グローバルバランスファンド(機動的資産配分型)	335,784,395円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2020	48,681,261円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2025	82,366,502円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2030	159,789,344円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2035	68,089,290円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2040	34,119,985円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2045	62,891,892円
三井住友・DC年金バランスゼロ(債券型)	6,216,322円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	2,950,209,186円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	1,038,718,638円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	790,427,719円
SMAM・年金グローバル債券ファンド<適格機関投資家限定>	6,086,628,952円
SMAM・バランスファンドVA25<適格機関投資家専用>	30,018,527,129円
SMAM・バランスファンドVA37.5<適格機関投資家専用>	9,351,680,801円
SMAM・バランスファンドVA50<適格機関投資家専用>	22,548,239,869円
SMAM・バランスファンドVL30<適格機関投資家限定>	385,746,395円
SMAM・バランスファンドVL50<適格機関投資家限定>	714,264,941円
世界6資産バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	66,006,960円
SMAM・バランスファンドVA75<適格機関投資家専用>	330,459,356円
SMAM・バランスファンドVL国際分散型<適格機関投資家限定>	133,253,321円
SMAM・インデックス・バランスVA25<適格機関投資家専用>	2,376,703,215円
SMAM・インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用>	2,697,590,770円
SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用>	6,873,437,309円
SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>	14,472,854,467円
SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定>	208,544,294円
三井住友・国内債券インデックスファンド・VAS(適格機関投資家専用)	7,581,275,181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)	33,554,495,091円
SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	681,827,212円
SMAM・バランスファンドVA20<適格機関投資家専用>	1,196,087,768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)	22,100,514,454円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>	1,133,636,491円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>	240,044,186円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用>	53,970,912円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>	2,814,410,510円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	3,237,414,419円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T<適格機関投資家専用>	3,003,591,941円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A2<適格機関投資家専用>	1,248,810,687円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A2<適格機関投資家専用>	261,712,641円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A2<適格機関投資家専用>	21,167,802円
SMAM・アセットバランスファンドVA30L2<適格機関投資家専用>	488,152,676円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L2<適格機関投資家専用>	8,064,181,125円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T2<適格機関投資家専用>	382,692,836円
SMAM・FG新興国重視型バランス20VA<適格機関投資家限定>	436,835円
SMAM・FGグローバルバランス25VA<適格機関投資家限定>	4,940,968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 >	7,619,291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 >	4,379,659円
S M A M ・ 年金Wリスクコントロールファンド < 適格機関投資家限定 >	3,164,472円
S M A M ・ マルチアセットストラテジーファンド2016 - 01 < 適格機関投資家限定 >	1,888,765,699円
合計	197,030,769,648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111回利付国債(5年)	30,000,000	30,374,700	
	第116回利付国債(5年)	150,000,000	151,822,500	
	第121回利付国債(5年)	100,000,000	101,159,000	
	第122回利付国債(5年)	1,550,000,000	1,569,282,000	
	第123回利付国債(5年)	2,410,000,000	2,441,522,800	
	第124回利付国債(5年)	2,410,000,000	2,443,041,100	
	第125回利付国債(5年)	2,450,000,000	2,485,647,500	
	第126回利付国債(5年)	1,015,000,000	1,030,600,550	
	第127回利付国債(5年)	465,000,000	472,412,100	
	第1回利付国債(40年)	40,000,000	63,458,400	
	第2回利付国債(40年)	352,000,000	541,872,320	
	第3回利付国債(40年)	330,000,000	512,041,200	
	第4回利付国債(40年)	485,000,000	758,355,700	
	第5回利付国債(40年)	455,000,000	686,927,150	
	第6回利付国債(40年)	495,000,000	735,084,900	
	第7回利付国債(40年)	495,000,000	704,597,850	
	第8回利付国債(40年)	605,000,000	802,030,350	
	第293回利付国債(10年)	2,650,000,000	2,768,508,000	
	第296回利付国債(10年)	3,543,000,000	3,695,207,280	
	第297回利付国債(10年)	1,943,000,000	2,029,288,630	
	第298回利付国債(10年)	2,470,000,000	2,573,023,700	
	第299回利付国債(10年)	2,245,000,000	2,347,304,650	
	第300回利付国債(10年)	1,100,000,000	1,156,617,000	

第301回利付国債(10年)	2,285,000,000	2,412,434,450	
第303回利付国債(10年)	3,495,000,000	3,692,747,100	
第305回利付国債(10年)	2,970,000,000	3,139,319,700	
第306回利付国債(10年)	1,670,000,000	1,777,915,400	
第307回利付国債(10年)	940,000,000	997,011,000	
第308回利付国債(10年)	1,160,000,000	1,234,657,600	
第309回利付国債(10年)	550,000,000	580,756,000	
第310回利付国債(10年)	3,080,000,000	3,248,907,200	
第312回利付国債(10年)	2,145,000,000	2,289,079,650	
第313回利付国債(10年)	2,105,000,000	2,263,864,350	
第315回利付国債(10年)	2,090,000,000	2,245,516,900	
第317回利付国債(10年)	950,000,000	1,018,951,000	
第318回利付国債(10年)	1,150,000,000	1,227,142,000	
第319回利付国債(10年)	1,150,000,000	1,237,342,500	
第320回利付国債(10年)	1,080,000,000	1,155,816,000	
第321回利付国債(10年)	1,545,000,000	1,658,217,600	
第322回利付国債(10年)	790,000,000	843,143,300	
第323回利付国債(10年)	510,000,000	545,786,700	
第324回利付国債(10年)	1,410,000,000	1,500,113,100	
第325回利付国債(10年)	1,635,000,000	1,743,809,250	
第326回利付国債(10年)	660,000,000	700,939,800	
第327回利付国債(10年)	675,000,000	721,446,750	
第328回利付国債(10年)	1,405,000,000	1,485,014,750	
第329回利付国債(10年)	2,585,000,000	2,773,317,250	
第330回利付国債(10年)	1,610,000,000	1,730,814,400	
第332回利付国債(10年)	1,840,000,000	1,952,552,800	
第333回利付国債(10年)	2,035,000,000	2,161,800,850	
第334回利付国債(10年)	1,610,000,000	1,712,846,800	
第335回利付国債(10年)	1,815,000,000	1,917,384,150	
第336回利付国債(10年)	1,035,000,000	1,094,170,950	
第337回利付国債(10年)	1,480,000,000	1,538,578,400	
第338回利付国債(10年)	1,820,000,000	1,908,852,400	
第339回利付国債(10年)	2,385,000,000	2,501,268,750	
第340回利付国債(10年)	2,165,000,000	2,271,323,150	
第341回利付国債(10年)	2,485,000,000	2,583,430,850	
第342回利付国債(10年)	340,000,000	346,470,200	
第2回利付国債(30年)	510,000,000	675,801,000	
第4回利付国債(30年)	300,000,000	422,700,000	
第5回利付国債(30年)	290,000,000	381,132,500	
第7回利付国債(30年)	474,000,000	636,164,880	
第9回利付国債(30年)	100,000,000	120,245,000	
第10回利付国債(30年)	585,000,000	674,522,550	

第1 1 回利付国債(30年)	570,000,000	714,979,500
第1 2 回利付国債(30年)	590,000,000	781,466,800
第1 4 回利付国債(30年)	860,000,000	1,188,494,200
第1 6 回利付国債(30年)	465,000,000	653,966,700
第1 8 回利付国債(30年)	510,000,000	700,857,300
第1 9 回利付国債(30年)	490,000,000	674,470,300
第2 1 回利付国債(30年)	345,000,000	476,331,150
第2 2 回利付国債(30年)	335,000,000	475,823,950
第2 3 回利付国債(30年)	329,000,000	468,065,010
第2 4 回利付国債(30年)	310,000,000	442,153,000
第2 5 回利付国債(30年)	190,000,000	264,257,700
第2 6 回利付国債(30年)	483,000,000	682,734,990
第2 7 回利付国債(30年)	395,000,000	569,424,100
第2 8 回利付国債(30年)	466,000,000	675,546,220
第2 9 回利付国債(30年)	392,000,000	562,657,200
第3 0 回利付国債(30年)	560,000,000	796,000,800
第3 1 回利付国債(30年)	535,000,000	753,424,450
第3 2 回利付国債(30年)	775,000,000	1,114,829,750
第3 3 回利付国債(30年)	795,000,000	1,093,935,900
第3 4 回利付国債(30年)	850,000,000	1,214,718,000
第3 5 回利付国債(30年)	750,000,000	1,041,435,000
第3 6 回利付国債(30年)	545,000,000	760,569,300
第3 7 回利付国債(30年)	850,000,000	1,170,178,000
第3 8 回利付国債(30年)	615,000,000	834,450,450
第3 9 回利付国債(30年)	565,000,000	782,355,500
第4 0 回利付国債(30年)	470,000,000	640,572,400
第4 1 回利付国債(30年)	495,000,000	661,973,400
第4 2 回利付国債(30年)	570,000,000	763,828,500
第4 3 回利付国債(30年)	435,000,000	584,135,400
第4 4 回利付国債(30年)	740,000,000	995,758,800
第4 5 回利付国債(30年)	655,000,000	848,021,950
第4 6 回利付国債(30年)	785,000,000	1,016,794,800
第4 7 回利付国債(30年)	480,000,000	635,491,200
第4 8 回利付国債(30年)	690,000,000	876,306,900
第4 9 回利付国債(30年)	840,000,000	1,068,538,800
第5 0 回利付国債(30年)	120,000,000	132,651,600
第3 9 回利付国債(20年)	308,000,000	324,949,240
第4 0 回利付国債(20年)	300,000,000	318,606,000
第4 2 回利付国債(20年)	480,000,000	520,128,000
第4 3 回利付国債(20年)	1,120,000,000	1,241,083,200
第4 6 回利付国債(20年)	775,000,000	853,701,250
第4 8 回利付国債(20年)	955,000,000	1,077,707,950
第5 0 回利付国債(20年)	918,000,000	1,014,573,600

第52回利付国債(20年)	720,000,000	811,893,600	
第54回利付国債(20年)	965,000,000	1,099,057,800	
第56回利付国債(20年)	818,000,000	931,489,320	
第59回利付国債(20年)	1,455,000,000	1,643,335,200	
第61回利付国債(20年)	1,215,000,000	1,318,360,050	
第64回利付国債(20年)	1,025,000,000	1,186,509,250	
第65回利付国債(20年)	1,020,000,000	1,185,270,600	
第69回利付国債(20年)	1,020,000,000	1,206,568,200	
第70回利付国債(20年)	800,000,000	970,160,000	
第72回利付国債(20年)	753,000,000	898,080,510	
第74回利付国債(20年)	664,000,000	795,073,600	
第75回利付国債(20年)	490,000,000	588,705,600	
第78回利付国債(20年)	590,000,000	700,630,900	
第82回利付国債(20年)	620,000,000	750,603,000	
第84回利付国債(20年)	850,000,000	1,024,012,000	
第85回利付国債(20年)	645,000,000	785,726,100	
第88回利付国債(20年)	742,000,000	922,788,300	
第89回利付国債(20年)	20,000,000	24,667,800	
第90回利付国債(20年)	580,000,000	717,987,800	
第92回利付国債(20年)	739,000,000	910,610,580	
第93回利付国債(20年)	872,000,000	1,069,019,680	
第95回利付国債(20年)	240,000,000	303,242,400	
第97回利付国債(20年)	757,000,000	951,208,350	
第99回利付国債(20年)	888,000,000	1,109,733,600	
第100回利付国債(20年)	392,000,000	496,056,400	
第101回利付国債(20年)	425,000,000	547,978,000	
第102回利付国債(20年)	492,000,000	636,603,720	
第105回利付国債(20年)	425,000,000	535,963,250	
第106回利付国債(20年)	400,000,000	509,408,000	
第107回利付国債(20年)	503,000,000	636,556,560	
第108回利付国債(20年)	480,000,000	595,281,600	
第109回利付国債(20年)	790,000,000	982,151,700	
第111回利付国債(20年)	646,000,000	830,588,040	
第113回利付国債(20年)	807,000,000	1,029,804,630	
第114回利付国債(20年)	628,000,000	804,034,680	
第116回利付国債(20年)	825,000,000	1,071,089,250	
第118回利付国債(20年)	310,000,000	394,840,800	
第119回利付国債(20年)	560,000,000	697,502,400	
第120回利付国債(20年)	645,000,000	785,216,550	
第121回利付国債(20年)	625,000,000	788,987,500	
第122回利付国債(20年)	710,000,000	886,136,800	
第123回利付国債(20年)	380,000,000	491,746,600	

	第124回利付国債(20年)	430,000,000	550,206,500
	第125回利付国債(20年)	480,000,000	629,654,400
	第126回利付国債(20年)	280,000,000	359,044,000
	第127回利付国債(20年)	195,000,000	247,174,200
	第128回利付国債(20年)	520,000,000	660,457,200
	第129回利付国債(20年)	1,010,000,000	1,267,701,500
	第130回利付国債(20年)	535,000,000	672,714,350
	第131回利付国債(20年)	460,000,000	571,421,200
	第132回利付国債(20年)	490,000,000	609,633,500
	第133回利付国債(20年)	730,000,000	919,478,800
	第134回利付国債(20年)	90,000,000	113,543,100
	第135回利付国債(20年)	85,000,000	105,908,300
	第136回利付国債(20年)	250,000,000	307,590,000
	第137回利付国債(20年)	210,000,000	262,040,100
	第138回利付国債(20年)	245,000,000	297,954,300
	第139回利付国債(20年)	415,000,000	511,271,700
	第140回利付国債(20年)	1,145,000,000	1,430,769,100
	第141回利付国債(20年)	600,000,000	750,744,000
	第142回利付国債(20年)	520,000,000	659,100,000
	第143回利付国債(20年)	405,000,000	500,709,600
	第144回利付国債(20年)	295,000,000	359,855,750
	第145回利付国債(20年)	790,000,000	991,766,000
	第146回利付国債(20年)	815,000,000	1,024,381,650
	第147回利付国債(20年)	955,000,000	1,185,355,550
	第148回利付国債(20年)	780,000,000	954,673,200
	第149回利付国債(20年)	1,190,000,000	1,457,547,700
	第150回利付国債(20年)	1,180,000,000	1,424,130,200
	第151回利付国債(20年)	1,210,000,000	1,416,426,000
	第152回利付国債(20年)	1,040,000,000	1,217,465,600
	第153回利付国債(20年)	1,130,000,000	1,343,468,300
	第154回利付国債(20年)	915,000,000	1,071,126,450
	第155回利付国債(20年)	1,290,000,000	1,460,525,100
	第156回利付国債(20年)	200,000,000	202,996,000
	国債証券合計	162,824,000,000	187,852,950,690
地方債証券	第1回東京都公募公債(20年)	100,000,000	110,633,000
	第1回東京都公募公債(30年)	100,000,000	130,258,000
	第6回東京都公募公債(20年)	100,000,000	117,346,000
	第7回東京都公募公債(20年)	100,000,000	119,599,000
	第8回東京都公募公債(20年)	100,000,000	122,535,000
	第8回東京都公募公債(30年)	400,000,000	538,476,000
	第13回東京都公募公債(30年)	500,000,000	659,545,000
	第634回東京都公募公債	6,000,000	6,019,560



第646回東京都公募公債	100,000,000	102,343,000	
第652回東京都公募公債	200,000,000	205,580,000	
第653回東京都公募公債	200,000,000	205,074,000	
第660回東京都公募公債	700,000,000	723,786,000	
第662回東京都公募公債	100,000,000	104,009,000	
第668回東京都公募公債	200,000,000	208,882,000	
第674回東京都公募公債	100,100,000	104,759,655	
平成19年度第7回北海道公募公債	100,000,000	102,470,000	
平成20年度第4回北海道公募公債	100,000,000	104,128,000	
平成20年度第12回北海道公募公債	100,000,000	104,425,000	
平成21年度第14回北海道公募公債	100,000,000	105,499,000	
平成25年度第15回北海道公募公債	100,000,000	104,410,000	
第1回神奈川県公募公債（20年）	100,000,000	120,234,000	
第3回神奈川県公募公債（20年）	100,000,000	118,564,000	
第7回神奈川県公募公債（20年）	100,000,000	123,056,000	
第57回神奈川県公募公債（5年）	200,000,000	201,348,000	
第157回神奈川県公募公債	115,600,000	120,393,932	
第167回神奈川県公募公債	100,000,000	105,064,000	
第9回大阪府公募公債（5年）	102,000,000	102,520,200	
第306回大阪府公募公債（10年）	200,000,000	204,988,000	
第313回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	103,163,000	
第326回大阪府公募公債（10年）	200,000,000	209,678,000	
第332回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	105,288,000	
第361回大阪府公募公債（10年）	200,000,000	210,114,000	
第373回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	105,829,000	
第377回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	104,870,000	
平成19年度第1回京都府公募公債	130,260,000	133,599,866	
平成20年度第3回京都府公募公債	100,000,000	104,076,000	
平成26年度第6回京都府公募公債	100,000,000	100,404,000	
平成26年度第13回京都府公募公債	100,000,000	103,583,000	
平成27年度第4回京都府公募公債	100,000,000	104,352,000	
第5回兵庫県公募公債（15年）	300,000,000	340,383,000	
平成20年度第5回兵庫県公募公債	100,000,000	104,026,000	
平成21年度第3回兵庫県公募公債	200,000,000	209,478,000	
平成21年度第11回兵庫県公募公債	200,000,000	209,966,000	
平成21年度第23回兵庫県公募公債	200,000,000	208,934,000	
第7回静岡県公募公債（30年）	100,000,000	134,447,000	
平成19年度第7回静岡県公募公債	100,000,000	102,868,000	
平成20年度第1回静岡県公募公債	200,000,000	239,572,000	
平成20年度第7回静岡県公募公債	100,000,000	104,365,000	
平成21年度第5回静岡県公募公債	300,000,000	313,686,000	
平成19年度第3回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	102,503,000	

平成20年度第3回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	103,819,000	
平成21年度第1回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	104,744,000	
平成21年度第7回愛知県公募公債(10年)	200,000,000	210,060,000	
平成21年度第8回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	104,654,000	
平成21年度第10回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	104,711,000	
平成22年度第12回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	104,736,000	
平成23年度第18回愛知県公募公債(7年)	100,000,000	101,494,000	
平成19年度第3回広島県公募公債	200,000,000	205,692,000	
平成20年度第1回広島県公募公債	100,000,000	103,731,000	
平成21年度第1回広島県公募公債	100,000,000	104,804,000	
平成20年度第7回埼玉県公募公債	100,000,000	104,118,000	
平成21年度第1回埼玉県公募公債	100,000,000	104,472,000	
平成21年度第2回埼玉県公募公債	100,000,000	104,734,000	
平成21年度第4回埼玉県公募公債	200,000,000	209,236,000	
平成20年度第10回福岡県公募公債	100,000,000	104,235,000	
平成21年度第3回福岡県公募公債	100,000,000	105,139,000	
平成25年度第11回福岡県公募公債	100,000,000	104,964,000	
平成25年度第12回福岡県公募公債	100,000,000	100,411,000	
平成26年度第10回福岡県公募公債	100,000,000	103,332,000	
平成20年度第8回千葉県公募公債	100,000,000	104,114,000	
平成21年度第2回千葉県公募公債	345,000,000	361,290,900	
平成21年度第6回千葉県公募公債	100,000,000	104,705,000	
第9回群馬県公募公債(10年)	100,000,000	104,918,000	
平成19年度第1回岐阜県公募公債(10年)	200,000,000	205,634,000	
平成21年度第1回岐阜県公募公債(10年)	200,000,000	209,306,000	
第40回共同発行市場公募地方債	50,000,000	50,287,500	
第51回共同発行市場公募地方債	100,500,000	102,756,225	
第55回共同発行市場公募地方債	200,000,000	205,532,000	
第56回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,687,000	
第57回共同発行市場公募地方債	300,000,000	308,154,000	
第62回共同発行市場公募地方債	200,000,000	207,162,000	
第64回共同発行市場公募地方債	300,000,000	311,904,000	
第65回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,745,000	
第73回共同発行市場公募地方債	300,000,000	314,034,000	
第75回共同発行市場公募地方債	900,000,000	945,855,000	
第76回共同発行市場公募地方債	300,000,000	313,320,000	
第77回共同発行市場公募地方債	200,000,000	210,000,000	
第79回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,570,000	
第81回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,711,000	
第82回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,154,000	
第115回共同発行市場公募地方債	600,000,000	629,304,000	

	第137回共同発行市場公募地方債	200,000,000	208,330,000
	平成19年度第10回大阪市公募公債	100,000,000	102,817,000
	平成21年度第4回大阪市公募公債	300,000,000	315,609,000
	平成26年度第2回大阪市公募公債(5年)	200,000,000	200,956,000
	第1回名古屋市公募公債(20年)	200,000,000	229,460,000
	第3回名古屋市公募公債(20年)	100,000,000	117,833,000
	第467回名古屋市公募公債(10年)	100,000,000	104,977,000
	第1回京都市公募公債(30年)	100,000,000	139,668,000
	第7回京都市公募公債(20年)	100,000,000	126,925,000
	平成19年度第2回京都市公募公債	100,000,000	102,854,000
	平成26年度第1回京都市公募公債	100,000,000	100,335,000
	平成19年度第10回神戸市公募公債	100,000,000	102,980,000
	平成26年度第17回神戸市公募公債	100,000,000	101,743,000
	第4回横浜市公募公債(20年)	100,000,000	117,404,000
	第9回横浜市公募公債(20年)	100,000,000	122,805,000
	第14回横浜市公募公債(20年)	100,000,000	125,719,000
	平成20年度第6回横浜市公募公債	200,000,000	208,260,000
	平成21年度第5回横浜市公募公債	100,000,000	105,393,000
	平成25年度第1回横浜市公債「八マ債5」	100,000,000	100,539,000
	平成26年度第4回札幌市公募公債(10年)	100,000,000	103,818,000
	第2回川崎市15年公募公債	100,000,000	106,588,000
	第4回川崎市15年公募公債	100,000,000	111,621,000
	平成19年度第2回北九州市公募公債	100,000,000	102,676,000
	平成20年度第5回福岡市公募公債	100,000,000	103,896,000
	平成25年度第5回福岡市公募公債(5年)	100,000,000	100,567,000
	平成19年度第1回広島市公募公債	100,000,000	102,872,000
	平成21年度第1回千葉市公募公債	200,000,000	209,364,000
	地方債証券合計	18,349,460,000	19,705,368,838
特殊債券	第1回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	104,124,000
	第2回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	200,000,000	207,420,000
	第3回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	200,000,000	231,652,000
	第5回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	104,159,000
	第15回政府保証日本政策投資銀行債券	100,000,000	111,134,000
	第20回政府保証日本政策投資銀行債券	100,000,000	113,105,000
	第20回日本政策投資銀行債券	100,000,000	107,323,000
	第23回政府保証日本政策投資銀行債券	400,000,000	414,916,000
	第27回日本政策投資銀行債券	100,000,000	100,841,000
	第30回日本政策投資銀行債券	100,000,000	105,600,000
	第36回日本政策投資銀行債券	100,000,000	122,549,000
	第51回日本政策投資銀行債券	100,000,000	103,966,000
	第2回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	216,794,000
	第7回道路債券	100,000,000	116,416,000

第8回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	122,456,000	
第9回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	109,323,000	
第9回道路債券	100,000,000	139,512,000	
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	102,781,320	
第18回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	156,419,000	
第22回日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	452,637,000	
第25回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,441,000	
第27回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	304,740,000	
第30回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	203,240,000	
第34回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,890,000	
第36回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	653,000,000	667,640,260	
第37回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	307,353,000	
第40回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	307,827,000	
第40回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,650,000	
第41回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	400,000,000	409,836,000	
第42回道路債券	200,000,000	237,150,000	
第45回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,838,000	
第47回日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	254,952,000	
第49回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,675,000	
第52回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	205,956,000	
第56回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	205,592,000	
第58回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	500,000,000	517,930,000	
第60回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,945,000	
第62回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,872,000	
第67回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	208,082,000	
第69回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,163,000	
第81回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	250,384,000	
第88回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	139,875,000	
第90回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	376,644,000	
	100,000,000	127,464,000	

第99回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券			
第340回政府保証道路債券	100,000,000	106,805,000	
第1回政府保証地方公営企業等金融機構債券	300,000,000	311,931,000	
第1回政府保証地方公共団体金融機構債券	300,000,000	314,112,000	
第2回地方公営企業等金融機構債券(20年)	100,000,000	125,916,000	
第3回公営企業債券(20年)	100,000,000	106,779,000	
第3回地方公共団体金融機構債券	300,000,000	315,609,000	
第5回公営企業債券(20年)	100,000,000	115,100,000	
第6回政府保証地方公営企業等金融機構債券	100,000,000	103,751,000	
第6回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	210,746,000	
第7回政府保証地方公営企業等金融機構債券	500,000,000	520,795,000	
第8回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,513,000	
第11回公営企業債券(20年)	100,000,000	117,618,000	
第11回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	105,749,000	
第16回公営企業債券(20年)	100,000,000	118,612,000	
第17回公営企業債券(20年)	100,000,000	121,779,000	
第18回公営企業債券(20年)	100,000,000	124,310,000	
第22回公営企業債券(20年)	100,000,000	123,515,000	
第24回公営企業債券(20年)	200,000,000	248,966,000	
第30回公営企業債券	100,000,000	104,250,000	
第42回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	104,994,000	
第45回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	210,160,000	
第61回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	104,839,000	
第63回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,950,000	
第65回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,596,000	
F74回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,884,000	
第875回政府保証公営企業債券	200,000,000	203,744,000	
第883回政府保証公営企業債券	100,000,000	102,675,000	
第884回政府保証公営企業債券	300,000,000	308,352,000	
第885回政府保証公営企業債券	200,000,000	207,098,000	
第886回政府保証公営企業債券	200,000,000	207,792,000	
第34回株式会社日本政策金融公庫社債	200,000,000	201,116,000	
第27回国際協力銀行債券	100,000,000	101,578,000	
第19回都市再生債券	100,000,000	103,906,000	
第7回本州四国連絡橋債券	100,000,000	119,279,000	
第332回東京交通債券	100,000,000	109,363,000	
第342回東京交通債券	100,000,000	114,394,000	
第13回関西国際空港株式会社社債	100,000,000	104,144,000	
第16回関西国際空港株式会社社債	100,000,000	104,902,000	
第51回政府保証関西国際空港債券	100,000,000	113,156,000	
第14回独立行政法人福祉医療機構債券	200,000,000	204,700,000	
第17回独立行政法人福祉医療機構債券	100,000,000	104,294,000	

第199回政府保証預金保険機構債	300,000,000	300,639,000
第201回政府保証預金保険機構債	200,000,000	200,480,000
第203回政府保証預金保険機構債	300,000,000	300,957,000
第1回貸付債権担保住宅金融公庫債券	26,370,000	27,105,986
第3回貸付債権担保住宅金融公庫債券	13,501,000	13,943,832
第3回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	19,784,000	20,939,781
第4回貸付債権担保住宅金融公庫債券	14,081,000	14,539,336
第4回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	28,446,000	30,754,108
第5回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	20,303,000	21,459,864
第6回貸付債権担保住宅金融公庫債券	30,434,000	31,659,577
第7回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	26,275,000	28,220,138
第8回貸付債権担保住宅金融公庫債券	15,661,000	16,208,351
第8回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	102,461,000
第9回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	43,922,000	47,331,664
第9回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	26,580,000	28,547,451
第10回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	68,322,000	73,637,451
第10回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	26,647,000	28,269,269
第11回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	28,156,000	30,132,832
第12回貸付債権担保住宅金融公庫債券	17,989,000	18,718,094
第14回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	31,878,000	33,267,243
第14回一般担保住宅金融支援機構債券	200,000,000	207,112,000
第17回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	70,510,000	73,921,273
第19回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	38,194,000	41,412,608
第21回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	104,631,000
第24回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	78,226,000	85,811,575
第25回一般担保住宅金融支援機構債券	200,000,000	208,838,000
第26回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	114,513,000	124,606,175
第27回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	40,978,000	44,482,028
第28回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	45,386,000	49,198,424
第29回貸付債権担保住宅金融公庫債券	24,492,000	25,861,347
第29回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	47,398,000	51,320,658
第30回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	48,372,000	52,354,466
第32回貸付債権担保住宅金融公庫債券	29,883,000	31,587,227
第32回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	94,948,000	101,902,941
第35回貸付債権担保住宅金融公庫債券	29,447,000	31,271,830
第35回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	55,539,000	59,664,992
第36回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	57,930,000	62,083,001
第39回貸付債権担保住宅金融公庫債券	26,834,000	28,508,978
第41回貸付債権担保住宅金融公庫債券	28,976,000	31,186,289
第43回貸付債権担保住宅金融公庫債券	55,350,000	60,219,139

第43回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	72,166,000	77,466,592
第46回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	68,275,000	73,955,480
第48回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	132,248,000	143,350,219
第49回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	65,986,000	71,068,241
第51回貸付債権担保住宅金融公庫債券	26,753,000	29,002,659
第51回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	141,096,000	151,625,994
第52回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	123,716,000
第53回貸付債権担保住宅金融公庫債券	27,525,000	29,693,970
第55回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	156,614,000	167,104,005
第57回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	77,507,000	82,788,326
第58回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	78,287,000	83,489,171
第59回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	156,088,000	166,819,050
第60回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	236,301,000	251,216,319
第61回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	78,487,000	83,059,652
第67回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	83,698,000	87,862,812
第69回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	169,264,000	179,807,454
第70回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	165,110,000	174,963,764
第73回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	85,463,000	91,055,698
第95回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	106,061,000
第99回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	97,267,000	101,456,289
第130回一般担保住宅金融支援機構債券	200,000,000	243,968,000
第1回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	54,526,000	58,466,048
第2回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	57,802,000	62,276,452
第3回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	24,185,000	26,090,052
第6回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	28,208,000	30,341,371
第5回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	49,900,000	53,327,631
第10回農林漁業金融公庫債券	100,000,000	100,401,000
い第756号商工債	100,000,000	100,602,000
い第758号商工債	100,000,000	100,869,000
い第735号農林債	400,000,000	400,632,000
い第749号農林債	300,000,000	301,263,000
い第752号農林債	500,000,000	502,495,000
第281回信金中金債(5年)	100,000,000	100,479,000
第283回信金中金債(5年)	100,000,000	100,738,000
第291回信金中金債(5年)	100,000,000	100,660,000
第293回信金中金債(5年)	100,000,000	100,650,000
第297回信金中金債(5年)	200,000,000	201,076,000
第308回信金中金債(5年)	100,000,000	100,855,000
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	300,585,000
第175号商工債(3年)	100,000,000	100,185,000
第177号商工債(3年)	300,000,000	300,618,000
第181号商工債(3年)	100,000,000	100,243,000

	第183号商工債(3年)	500,000,000	501,375,000	
	第185号商工債(3年)	200,000,000	200,550,000	
	第5回中日本高速道路株式会社社債	200,000,000	208,970,000	
	第6回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	104,580,000	
	第10回政府保証中日本高速道路債券	100,000,000	101,078,000	
	第12回政府保証中日本高速道路債券	103,000,000	104,443,030	
	第14回政府保証中日本高速道路債券	100,000,000	102,222,000	
	第19回政府保証中日本高速道路債券	124,000,000	127,276,080	
	第21回政府保証中日本高速道路債券	200,000,000	207,088,000	
	第25回政府保証中日本高速道路債券	200,000,000	209,408,000	
	第46回中日本高速道路株式会社社債	200,000,000	200,948,000	
	第8回政府保証西日本高速道路債券	233,000,000	237,333,800	
	第15回政府保証西日本高速道路債券	100,000,000	103,877,000	
	第19回政府保証西日本高速道路債券	100,000,000	104,164,000	
	第20回西日本高速道路株式会社社債	100,000,000	105,100,000	
	第3回東京地下鉄株式会社社債	200,000,000	201,584,000	
特殊債券合計		25,273,081,000	26,958,862,667	
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	200,158,000	
	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	100,049,000	
	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	201,928,000	
	第9回ザ・ゴールドマン・サックス・グループ・インク	100,000,000	101,363,000	
	第5回オーストラリア・コモンウェルス銀行円貨社債(2011)	300,000,000	300,390,000	
	第7回オーストラリア・コモンウェルス銀行円貨社債	100,000,000	100,083,000	
	第8回ウエストパック・バンキング・コーポレーション円貨社債	300,000,000	300,837,000	
	第11回ウエストパック・バンキング・コーポレーション円貨社債	200,000,000	200,738,000	
	第20回コーペラティブ・セントラル・ライフアイゼン・ボエレンリーバンク・ピー・エー	100,000,000	100,047,000	
	第21回コーペラティブ・セントラル・ライフアイゼン・ボエレンリーバンク・ピー・エー	200,000,000	202,446,000	
	第10回コーペラティブ・セントラル・ライフアイゼン・ボエレンリーバンク・ピー・エー	300,000,000	300,342,000	
	第18回コーペラティブ・セントラル・ライフアイゼン・ボエレンリーバンク・ピー・エー	300,000,000	302,994,000	
	第18回 積水ハウス株式会社無担保社債	100,000,000	100,529,000	
	第7回麒麟ホールディングス株式会社無担保社債	200,000,000	210,828,000	



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	100,968,000	
第9回株式会社セブン&アイ・ホールディングス無担保社債	100,000,000	103,507,000	
第35回三菱化学株式会社無担保社債	100,000,000	101,249,000	
第8回株式会社三菱ケミカルホールディングス無担保社債	100,000,000	103,392,000	
第4回花王株式会社無担保社債	100,000,000	102,289,000	
第14回武田薬品工業株式会社無担保社債	100,000,000	101,387,000	
第64回新日本製鐵株式会社無担保社債	100,000,000	105,436,000	
第62回株式会社神戸製鋼所無担保社債	100,000,000	99,010,000	
第18回株式会社豊田自動織機無担保社債	100,000,000	106,094,000	
第13回株式会社クボタ無担保社債	100,000,000	101,593,000	
第16回株式会社日立製作所無担保社債	100,000,000	104,630,000	
第44回三菱電機株式会社無担保社債	100,000,000	100,601,000	
日本電産株式会社第1回無担保社債	100,000,000	100,443,000	
第36回富士通株式会社無担保社債	100,000,000	101,486,000	
第12回パナソニック株式会社無担保社債	200,000,000	201,932,000	
第13回パナソニック株式会社無担保社債	200,000,000	203,030,000	
第1回日本生命2011基金特定目的会社特定社債 第1回 - B	200,000,000	202,402,000	
第1回住友生命第4回基金流動化特定目的会社特定社債	100,000,000	100,269,000	
第1回日本生命2012基金特定目的会社特定社債	100,000,000	101,589,000	
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	101,436,000	
第1回明治安田生命2014基金特定目的会社特定社債	100,000,000	101,043,000	
第63回三井物産株式会社無担保社債	100,000,000	121,636,000	
第47回住友商事株式会社無担保社債	100,000,000	103,540,000	
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	103,882,000	
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	123,548,000	
株式会社三菱東京UFJ銀行第12回無担保社債	200,000,000	205,288,000	
第25回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	300,000,000	315,411,000	
第110回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	100,000,000	105,065,000	
株式会社三井住友フィナンシャル第1回無担保社債	100,000,000	102,909,000	
第4回株式会社りそな銀行無担保社債	100,000,000	108,114,000	
第9回三菱UFJ信託銀行株式会社無担保社債	100,000,000	107,329,000	
第7回住友信託銀行株式会社無担保社債	100,000,000	101,868,000	
第8回住友信託銀行株式会社無担保社債	100,000,000	121,488,000	
第6回株式会社セブン銀行無担保社債	200,000,000	200,844,000	

第1回株式会社みずほフィナンシャルグループ 無担保社債	100,000,000	103,329,000	
第20回株式会社三井住友銀行無担保社債	200,000,000	213,526,000	
第24回株式会社三井住友銀行無担保社債	100,000,000	107,192,000	
第8回株式会社みずほ銀行無担保社債	200,000,000	203,632,000	
第9回株式会社みずほ銀行無担保社債	100,000,000	121,228,000	
第17回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	108,132,000	
第21回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	100,363,000	
第53回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	100,629,000	
第54回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	101,827,000	
第113回オリックス株式会社無担保社債	100,000,000	102,058,000	
第162回オリックス株式会社無担保社債	100,000,000	100,908,000	
第165回オリックス株式会社無担保社債	100,000,000	100,961,000	
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	106,697,000	
第39回野村ホールディングス株式会社無担保社債	200,000,000	202,768,000	
第58回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	134,868,000	
第110回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	101,661,000	
第41回小田急電鉄株式会社無担保社債	200,000,000	201,372,000	
第15回東日本旅客鉄道株式会社社債	100,000,000	111,235,000	
第34回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	119,632,000	
第110回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	125,892,000	
第3回西日本旅客鉄道株式会社社債	200,000,000	204,604,000	
第28回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	101,219,000	
第41回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	123,688,000	
第42回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	200,000,000	251,562,000	
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	101,987,000	
第51回日本電信電話株式会社電信電話債券	300,000,000	301,083,000	
第53回日本電信電話株式会社電信電話債券	300,000,000	307,635,000	
第15回KDDI株式会社無担保社債	100,000,000	105,897,000	
第15回株式会社エヌ・ティ・ティ・ドコモ無担保社債	200,000,000	208,442,000	
第522回東京電力株式会社社債	300,000,000	302,001,000	
第524回東京電力株式会社社債	100,000,000	101,284,000	
第526回東京電力株式会社社債	300,000,000	304,905,000	
第528回東京電力株式会社社債	100,000,000	104,542,000	
第532回東京電力株式会社社債	100,000,000	102,017,000	
第537回東京電力株式会社社債	100,000,000	104,979,000	
第544回東京電力株式会社社債	100,000,000	103,550,000	

第547回東京電力株式会社社債	100,000,000	106,023,000	
第440回関西電力株式会社社債	100,000,000	101,175,000	
第449回関西電力株式会社社債	100,000,000	100,574,000	
第451回関西電力株式会社社債	100,000,000	100,739,000	
第453回関西電力株式会社社債	100,000,000	101,067,000	
第467回関西電力株式会社社債	100,000,000	103,680,000	
第286回北陸電力株式会社社債	100,000,000	106,011,000	
第303回北陸電力株式会社社債	100,000,000	102,074,000	
第471回東北電力株式会社社債	100,000,000	106,454,000	
第472回東北電力株式会社社債	100,000,000	104,859,000	
第253回四国電力株式会社社債	100,000,000	105,338,000	
第400回九州電力株式会社社債	100,000,000	106,155,000	
第328回北海道電力株式会社社債	100,000,000	100,762,000	
第11回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	114,696,000	
第17回東京瓦斯株式会社無担保社債	200,000,000	211,098,000	
第18回大阪瓦斯株式会社無担保社債	200,000,000	218,346,000	
第22回大阪瓦斯株式会社無担保社債	100,000,000	101,168,000	
第27回東邦瓦斯株式会社無担保社債	100,000,000	107,100,000	
第30回東邦瓦斯株式会社無担保社債	100,000,000	100,365,000	
社債券合計	14,000,000,000	14,582,429,000	
合計		249,099,611,195	

## デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## 外国株式インデックス・マザーファンド

## 貸借対照表

(単位：円)

(平成27年 4月13日現在) (平成28年 4月13日現在)

資産の部		
流動資産		
預金	2,910,943,638	3,297,537,450
金銭信託	-	233,094,782
コール・ローン	163,933,162	-
株式	194,942,978,250	143,907,141,807
投資証券	4,676,552,833	3,898,944,679
派生商品評価勘定	95,328,325	47,286,174
未収入金	5,734,068	1,592,186
未収配当金	305,560,499	271,057,094
未収利息	44	-
差入委託証拠金	1,322,688,796	1,396,244,955
流動資産合計	204,423,719,615	153,052,899,127
資産合計	204,423,719,615	153,052,899,127
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	30,653	20,128,882

	（平成27年 4月13日現在）	（平成28年 4月13日現在）
前受金	95,325,855	27,157,292
未払解約金	95,117,535	123,282,690
流動負債合計	190,474,043	170,568,864
負債合計	190,474,043	170,568,864
純資産の部		
元本等		
元本	69,552,562,996	60,593,406,071
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	134,680,682,576	92,288,924,192
元本等合計	204,233,245,572	152,882,330,263
純資産合計	204,233,245,572	152,882,330,263
負債純資産合計	204,423,719,615	153,052,899,127

## 注記表

（重要な会計方針の注記）

項目	自 平成27年 4月14日 至 平成28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27年 4月13日現在）	（平成28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	69,552,562,996口	60,593,406,071口
2. 1単位当たり純資産の額	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)	1口当たり純資産額 2.5231円 (10,000口当たりの純資産額 25,231円)

## （金融商品に関する注記）

## . 金融商品の状況に関する事項

項目	自 平成27年 4月14日 至 平成28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、投資証券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいておりません。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。当計算期間については、先物取引、為替予約取引を行っております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2)金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>

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

#### ・金融商品の時価等に関する事項

項目	(平成28年 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、投資証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

（デリバティブ取引に関する注記）

（平成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	うち1年超	時 価	評 価 損 益
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	4,891,203,827	-	4,986,529,682	95,325,855
	SPMINI 1506	3,296,174,528	-	3,337,953,382	41,778,854
	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
市場取引以外 の取引	為替予約取引				
	買建	294,526,953	-	294,496,300	30,653
	米ドル	170,710,838	-	170,698,200	12,638
	カナダドル	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
	イスラエルシユケ ル	1,509,950	-	1,505,000	4,950
	売建	43,031,570	-	43,029,100	2,470
	スウェーデンク ローナ	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

（平成28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	うち1年超	時価	評価損益
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	5,006,688,873	-	5,033,846,165	27,157,292
	SPMINI 1606	3,433,206,692	-	3,462,590,244	29,383,552
	DJ EUR 1606	946,122,065	-	940,443,421	5,678,644
	FTSE 1606	388,205,431	-	393,444,232	5,238,801
	SPI200 1606	239,154,685	-	237,368,268	1,786,417
合計		5,006,688,873	-	5,033,846,165	27,157,292

## (注) 1. 時価の算定方法

## (1) 株価指数先物取引の時価の算定方法について

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

2) 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

## (2) 為替予約取引の時価の算定方法について

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

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

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

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

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

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

## 2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

## (関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

## (その他の注記)

(平成27年 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・DC外国株式インデックスファンドS	7,536,872,456円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	162,631,572円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	738,732,534円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	513,535,259円
SMAM・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・DCターゲットイヤーファンド2020	2,487,376円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2025	5,119,215円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2030	6,440,950円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2035	11,222,861円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2040	6,545,571円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2045	14,783,806円
外国株式指数ファンド	355,983,276円
三井住友・DC全海外株式インデックスファンド	59,207,547円
SMAM・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VA(安定運用型) < 適格機関投資家限定 >	99,636,896円
SMAM・バランスファンドVA安定成長型 < 適格機関投資家限定 >	10,784,829,076円
SMAM・バランスファンドVA25 < 適格機関投資家専用 >	4,778,672,948円
SMAM・バランスファンドVA37.5 < 適格機関投資家専用 >	2,819,741,804円
SMAM・バランスファンドVA50 < 適格機関投資家専用 >	12,316,408,076円
SMAM・バランスファンドVL30 < 適格機関投資家限定 >	33,293,747円
SMAM・バランスファンドVL50 < 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VA < 適格機関投資家限定 >	20,581,778円
SMAM・バランスファンドVA75 < 適格機関投資家専用 >	1,552,629,156円
SMAM・バランスファンドVL国際分散型 < 適格機関投資家限定 >	100,458,682円
SMAM・インデックス・バランスVA25 < 適格機関投資家専用 >	301,622,546円
SMAM・インデックス・バランスVA50 < 適格機関投資家専用 >	1,388,864,087円
SMAM・バランスファンドVA40 < 適格機関投資家専用 >	2,429,381,760円
SMAM・バランスファンドVA35 < 適格機関投資家専用 >	3,199,142,106円
SMAM・バランスVA株40T < 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・VAS(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・VAS(適格機関投資家専用)	3,351,983,630円
SMAM・グローバルバランス40VA < 適格機関投資家限定 >	248,652,715円
SMAM・バランスファンドVA20 < 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・VAS(適格機関投資家専用)	2,733,922,578円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A < 適格機関投資家専用 >	41,820,504円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A < 適格機関投資家専用 >	25,845,812円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A < 適格機関投資家専用 >	11,292,400円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L < 適格機関投資家専用 >	100,030,538円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L < 適格機関投資家専用 >	219,965,788円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T < 適格機関投資家専用 >	200,839,597円
SMAM・FG新興国重視型バランス20VA < 適格機関投資家限定 >	307,726円
SMAM・FGグローバルバランス25VA < 適格機関投資家限定 >	4,620,979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 >	73,792円
SMAM・外国株式インデックスファンドSA < 適格機関投資家限定 >	995,848,547円
合計	69,552,562,996円

（平成28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	69,552,562,996円
同期中における追加設定元本額	14,738,717,221円
同期中における一部解約元本額	23,697,874,146円
平成28年 4月13日現在における元本の内訳	
三井住友・DC外国株式インデックスファンドS	8,800,201,270円
三井住友・DC年金バランス30（債券重点型）	200,831,501円
三井住友・DC年金バランス50（標準型）	873,812,975円
三井住友・DC年金バランス70（株式重点型）	583,556,304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）	30,773,907円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2020	3,083,623円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2025	7,205,082円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2030	29,623,573円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2035	26,788,007円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2040	16,067,043円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2045	36,039,216円
外国株式指数ファンド	437,913,349円
三井住友・DC全海外株式インデックスファンド	577,809,227円
アセットアロケーション・ファンド（安定型）	163,530,808円
アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）	239,430,957円
アセットアロケーション・ファンド（成長型）	297,138,696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）	7,705,954,401円
バランスファンドVA（安定運用型）＜適格機関投資家限定＞	45,693,152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＞	5,296,983,372円
S M A M・バランスファンドVA25＜適格機関投資家専用＞	3,693,008,705円
S M A M・バランスファンドVA37.5＜適格機関投資家専用＞	2,722,128,231円
S M A M・バランスファンドVA50＜適格機関投資家専用＞	11,262,781,335円
S M A M・バランスファンドVL30＜適格機関投資家限定＞	30,694,337円
S M A M・バランスファンドVL50＜適格機関投資家限定＞	179,966,870円
世界6資産バランスファンドVA＜適格機関投資家限定＞	13,782,411円
S M A M・バランスファンドVA75＜適格機関投資家専用＞	1,343,045,993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＞	100,455,805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＞	295,414,154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＞	1,324,189,446円
S M A M・バランスファンドVA40＜適格機関投資家専用＞	2,309,545,149円
S M A M・バランスファンドVA35＜適格機関投資家専用＞	3,035,654,992円
S M A M・バランスVA株40T＜適格機関投資家限定＞	100,751,800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）	1,244,794,128円
三井住友・5資産バランスファンド・VAS（適格機関投資家専用）	2,728,718,926円
S M A M・グローバルバランス40VA＜適格機関投資家限定＞	252,370,098円
S M A M・バランスファンドVA20＜適格機関投資家専用＞	148,942,135円
三井住友・7資産バランスファンド・VAS（適格機関投資家専用）	2,424,066,062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＞	43,589,645円

SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>	23,914,178円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用>	11,985,311円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>	94,837,863円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	211,165,907円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T<適格機関投資家専用>	205,483,522円
SMAM・FG新興国重視型バランス20VA<適格機関投資家限定>	224,527円
SMAM・FGグローバルバランス25VA<適格機関投資家限定>	2,389,563円
SMAM・外国株式インデックスファンドSA<適格機関投資家限定>	1,346,524,379円
SMAM・年金Wリスクコントロールファンド<適格機関投資家限定>	117,335円
SMAM・マルチアセットストラテジーファンド2016-01<適格機関投資家限定>	70,426,801円
合計	60,593,406,071円

## 附属明細表

## 有価証券明細表

## (a)株式

通貨	銘柄	株数	評価額		備考
			単価	金額	
米ドル	ANADARKO PETROLEUM CORP	24,486	50.11	1,226,993.46	
	ANTERO RESOURCES CORP	4,800	27.53	132,144.00	
	APACHE CORPORATION	17,646	53.29	940,355.34	
	BAKER HUGHES INC	20,189	41.23	832,392.47	
	CABOT OIL & GAS CORPORATION	22,720	23.79	540,508.80	
	CHENIERE ENERGY INC	9,802	37.17	364,340.34	
	CHEVRON CORPORATION	87,768	97.51	8,558,257.68	
	CIMAREX ENERGY CO	4,508	107.04	482,536.32	
	CONCHO RESOURCES INC	5,959	107.09	638,149.31	
	CONOCOPHILLIPS	57,562	43.47	2,502,220.14	
	CONTINENTAL RESOURCES, INC.	4,214	33.75	142,222.50	
	CORE LABORATORIES N.V.	2,101	111.90	235,101.90	
	DEVON ENERGY CORPORATION	21,418	30.96	663,101.28	
	EOG RESOURCES INC	25,275	77.51	1,959,065.25	
	EQT CORPORATION	7,021	69.00	484,449.00	
	EXXON MOBIL CORPORATION	194,136	84.35	16,375,371.60	
	FMC TECHNOLOGIES INC	10,651	28.08	299,080.08	
	HALLIBURTON CO	39,703	37.66	1,495,214.98	
	HELMERICH & PAYNE INC	5,427	60.10	326,162.70	
	HESS CORPORATION	13,053	57.36	748,720.08	
HOLLYFRONTIER CORP	8,311	35.32	293,544.52		
KINDER MORGAN INC	89,053	18.76	1,670,634.28		
MARATHON OIL CORP	35,686	13.12	468,200.32		

MARATHON PETROLEUM CORPORATION	25,098	38.99	978,571.02
MURPHY OIL CORPORATION	7,419	28.82	213,815.58
NATIONAL-OILWELL VARCO INC.	17,446	27.83	485,522.18
NOBLE ENERGY INC	19,748	33.64	664,322.72
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	35,616	72.45	2,580,379.20
OCEANEERING INTL INC	4,001	33.03	132,153.03
ONEOK INC	9,311	32.35	301,210.85
PHILLIPS 66	24,877	85.98	2,138,924.46
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	7,605	147.41	1,121,053.05
PLAINS GP HOLDINGS LP-CL A	11,469	9.20	105,514.80
RANGE RESOURCES CORPORATION	8,475	38.01	322,134.75
SCHLUMBERGER LTD	65,491	75.90	4,970,766.90
SOUTHWESTERN ENERGY COMPANY	17,747	10.54	187,053.38
SPECTRA ENERGY CORPORATION	31,453	31.08	977,559.24
TESORO CORPORATION	5,612	83.80	470,285.60
VALERO ENERGY CORP	22,455	60.90	1,367,509.50
WEATHERFORD INTL PLC	37,360	7.48	279,452.80
WILLIAMS COS INC	32,245	17.71	571,058.95
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	9,605	144.23	1,385,329.15
AIRGAS INC	3,207	142.00	455,394.00
ALBEMARLE CORPORATION	5,355	65.30	349,681.50
ALCOA INC	59,096	9.48	560,230.08
ASHLAND INC	2,691	110.58	297,570.78
AVERY DENNISON CORP	4,362	71.61	312,362.82
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	6,556	29.83	195,565.48
BALL CORPORATION	6,010	71.15	427,611.50
CELANESE CORPORATION	6,817	68.33	465,805.61
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	10,460	30.54	319,448.40
CROWN HOLDINGS INC	6,079	50.04	304,193.16
DOW CHEMICAL	52,105	51.62	2,689,660.10
DU PONT (E.I.) DE NEMOURS	40,784	64.31	2,622,819.04
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	7,159	73.24	524,325.16
ECOLAB INC	12,353	112.59	1,390,824.27
FMC CORPORATION	6,226	38.00	236,588.00
FREEPORT-MCMORAN INC	51,256	10.43	534,600.08
INTERNATIONAL PAPER CO	18,567	40.52	752,334.84
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	3,872	118.53	458,948.16
LYONDELLBASELL INDU-CL A	18,008	87.88	1,582,543.04
MARTIN MARIETTA MATERIALS	2,447	163.85	400,940.95
MONSANTO CO	20,375	87.42	1,781,182.50
MOSAIC CO/THE	14,768	25.53	377,027.04
NEWMONT MINING CORP	25,587	30.63	783,729.81

NUCOR CORP	15,086	48.09	725,485.74
PACKAGING CORP OF AMERICA	4,571	60.68	277,368.28
PPG INDUSTRIES INC	12,675	112.94	1,431,514.50
PRAXAIR INC	13,484	114.06	1,537,985.04
SEALED AIR CORP	9,368	49.05	459,500.40
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	3,596	297.66	1,070,385.36
VULCAN MATERIALS CO	6,171	106.54	657,458.34
WESTLAKE CHEMICAL CORP	2,235	45.92	102,631.20
WESTROCK CO	12,328	37.94	467,724.32
WR GRACE & CO	3,500	74.82	261,870.00
3M COMPANY	28,707	168.03	4,823,637.21
ACUITY BRANDS INC	1,995	249.83	498,410.85
AERCAP HOLDINGS NV	3,735	38.52	143,872.20
AGCO CORP	3,447	48.93	168,661.71
AMETEK INC	10,549	50.02	527,660.98
BE AEROSPACE INC	4,293	47.38	203,402.34
BOEING CO	29,881	129.47	3,868,693.07
CATERPILLAR INC	27,254	76.10	2,074,029.40
CHICAGO BRIDGE & IRON COMPANY NV	4,593	35.07	161,076.51
CUMMINS INC	7,713	107.80	831,461.40
DANAHER CORP	28,769	93.48	2,689,326.12
DEERE & CO	14,339	76.60	1,098,367.40
DOVER CORP	7,500	65.28	489,600.00
EATON CORP PLC	21,439	61.54	1,319,356.06
EMERSON ELECTRIC CO	30,995	54.53	1,690,157.35
FASTENAL COMPANY	12,936	45.34	586,518.24
FLOWSERVE CORPORATION	6,212	43.30	268,979.60
FLUOR CORP	6,997	52.77	369,231.69
GENERAL DYNAMICS CORP	12,666	133.55	1,691,544.30
GENERAL ELECTRIC CO	440,130	30.81	13,560,405.30
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	33,903	113.03	3,832,056.09
ILLINOIS TOOL WORKS	15,256	104.38	1,592,421.28
INGERSOLL-RAND PLC	12,263	61.45	753,561.35
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	5,610	41.80	234,498.00
JARDINE MATHESON HOLDINGS LIMITED	11,500	58.62	674,130.00
L-3 COMMUNICATIONS HLDGS INC	3,735	119.83	447,565.05
LOCKHEED MARTIN CORPORATION	12,897	225.98	2,914,464.06
MASCO CORP	15,275	31.78	485,439.50
NORTHROP GRUMMAN CORP	8,192	200.20	1,640,038.40
PACCAR INC	17,150	53.65	920,097.50
PARKER HANNIFIN CORPORATION	6,098	111.53	680,109.94
PENTAIR PLC-REGISTERED	8,019	53.11	425,889.09

QUANTA SERVICES INC	8,580	22.39	192,106.20
RAYTHEON COMPANY	13,822	126.04	1,742,124.88
ROCKWELL AUTOMATION INC	6,156	112.99	695,566.44
ROCKWELL COLLINS INC.	6,171	91.19	562,733.49
ROPER TECHNOLOGIES INC	4,691	177.49	832,605.59
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	8,113	37.72	306,022.36
SNAP-ON INC	2,746	156.21	428,952.66
STANLEY BLACK & DECKER INC	7,063	107.49	759,201.87
TEXTRON INC	13,079	37.15	485,884.85
TRANSDIGM GROUP INC	2,545	225.16	573,032.20
UNITED RENTALS INC	4,660	59.96	279,413.60
UNITED TECHNOLOGIES CORP	39,026	103.08	4,022,800.08
WABTEC CORP	4,643	79.46	368,932.78
WW GRAINGER INC	2,690	229.64	617,731.60
XYLEM INC	8,801	41.65	366,561.65
CINTAS CORP	4,370	89.83	392,557.10
DUN & BRADSTREET CORP	1,471	103.58	152,366.18
EQUIFAX INC	5,415	113.48	614,494.20
IHS INC-CLASS A	3,017	121.33	366,052.61
MANPOWERGROUP	3,518	81.18	285,591.24
NIELSEN HOLDINGS PLC	16,428	52.90	869,041.20
REPUBLIC SERVICES INC	10,780	45.93	495,125.40
ROBERT HALF INTL INC	6,506	44.27	288,020.62
STERICYCLE, INC.	3,750	125.53	470,737.50
THE ADT CORPORATION	8,262	41.42	342,212.04
TYCO INTERNATIONAL PLC	19,845	35.97	713,824.65
VERISK ANALYTICS INC	7,324	77.74	569,367.76
WASTE CONNECTIONS INC	6,000	63.90	383,400.00
WASTE MANAGEMENT INC	20,370	57.21	1,165,367.70
AMERCO	290	338.99	98,307.10
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	7,431	39.19	291,220.89
C.H.ROBINSON WORLDWIDE, INC.	6,364	72.49	461,326.36
CSX CORPORATION	45,626	24.99	1,140,193.74
DELTA AIR LINES INC	8,821	46.63	411,323.23
EXPEDITORS INTL WASH INC	8,693	47.88	416,220.84
FEDEX CORP	12,623	165.11	2,084,183.53
HERTZ GLOBAL HOLDINGS INC	18,331	8.44	154,713.64
J.B. HUNT TRANSPORT SERVICES INC	4,585	84.24	386,240.40
KANSAS CITY SOUTHERN	5,231	87.44	457,398.64
NORFOLK SOUTHERN CORP	13,773	78.72	1,084,210.56
SOUTHWEST AIRLINES	7,984	44.65	356,485.60
UNION PACIFIC CORP	39,491	79.64	3,145,063.24

UNITED CONTINENTAL HOLDINGS INC	3,971	54.07	214,711.97
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	32,610	105.23	3,431,550.30
AUTOLIV INC	3,884	112.76	437,959.84
BORGWARNER INC	10,148	34.92	354,368.16
DELPHI AUTOMOTIVE PLC	13,056	72.35	944,601.60
FORD MOTOR COMPANY	172,682	12.81	2,212,056.42
GENERAL MOTORS CO	66,829	29.71	1,985,489.59
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	12,804	31.23	399,868.92
HARLEY-DAVIDSON INC	9,124	44.92	409,850.08
JOHNSON CONTROLS INC	30,264	38.71	1,171,519.44
LEAR CORP	3,675	105.87	389,072.25
MOBILEYE NV	3,705	38.94	144,272.70
TESLA MOTORS INC	4,580	247.82	1,135,015.60
WABCO HOLDINGS INC	2,607	106.54	277,749.78
COACH INC	12,806	39.01	499,562.06
D.R.HORTON INC	15,704	30.71	482,269.84
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY	7,453	57.52	428,696.56
GARMIN LTD	5,408	40.42	218,591.36
HANESBRANDS INC	19,101	26.98	515,344.98
HARMAN INTERNATIONAL	3,248	80.13	260,262.24
HASBRO INC	5,206	80.94	421,373.64
JARDEN CORP	9,525	58.62	558,355.50
LEGGETT & PLATT INC	5,956	48.69	289,997.64
LENNAR CORP-CL A	8,789	47.63	418,620.07
LULULEMON ATHLETICA INC	5,461	61.91	338,090.51
MATTEL INC	15,850	33.06	524,001.00
MICHAEL KORS HOLDINGS LIMITED	8,702	51.62	449,197.24
MOHAWK INDUSTRIES INC	2,838	195.27	554,176.26
NEWELL RUBBERMAID INC	12,025	43.81	526,815.25
NIKE INC -CL B	63,236	58.55	3,702,467.80
POLARIS INDUSTRIES INC	3,113	93.48	291,003.24
PULTE GROUP INC	13,149	17.83	234,446.67
PVH CORP	3,849	93.62	360,343.38
RALPH LAUREN CORPORATION	2,738	91.08	249,377.04
TOLL BROTHERS INC	7,285	29.02	211,410.70
UNDER ARMOUR INC	8,351	41.40	345,731.40
UNDER ARMOUR INC-CLASS C-NEW	8,351	41.65	347,819.15
VF CORP	15,651	62.57	979,283.07
WHIRLPOOL CORP	3,779	185.17	699,757.43
ARAMARK	10,000	33.09	330,900.00
CARNIVAL CORP	19,432	51.23	995,501.36
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	1,451	444.62	645,143.62

DARDEN RESTAURANTS INC	5,517	65.88	363,459.96
H&R BLOCK INC	10,337	24.21	250,258.77
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS INC	22,274	22.46	500,274.04
LAS VEGAS SANDS CORP	18,558	49.53	919,177.74
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	9,857	67.34	663,770.38
MCDONALD'S CORPORATION	42,603	127.61	5,436,568.83
MELCO CROWN ENTERTAINME-ADR	3,843	15.91	61,142.13
MGM MIRAGE	22,459	22.65	508,696.35
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDINGS	7,708	53.93	415,692.44
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	7,877	80.70	635,673.90
STARBUCKS CORP	69,243	59.50	4,119,958.50
STARWOOD HOTELS & RESORTS	7,867	79.82	627,943.94
WYNDHAM WORLDWIDE CORP	5,415	76.86	416,196.90
WYNN RESORTS LTD	3,642	97.19	353,965.98
YUM! BRANDS INC	19,774	82.05	1,622,456.70
CABLEVISION SYSTEMS-NY GRP-A	9,712	33.00	320,496.00
CBS CORP-CL B	20,262	53.58	1,085,637.96
CHARTER COMMUNICATTION-A	3,790	200.25	758,947.50
COMCAST CORP-CL A	115,793	61.72	7,146,743.96
DISCOVERY COMMUNICATIONS INC-A	6,972	28.38	197,865.36
DISCOVERY COMMUNICATIONS INC-C	13,489	27.64	372,835.96
DISH NETWORK CORP.	10,483	43.74	458,526.42
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	18,385	22.79	418,994.15
LIBERTY GLOBAL PLC-A	12,566	38.76	487,058.16
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	28,327	37.93	1,074,443.11
LIBERTY MEDIA CORP-A	3,927	38.44	150,953.88
LIBERTY MEDIA CORP-C	9,534	37.46	357,143.64
NEWS CORP-CLASS A	15,889	12.47	198,135.83
OMNICOM GROUP	11,397	84.34	961,222.98
SCRIPPS NETWORKS INTERACTIVE	3,392	64.51	218,817.92
SIRIUS XM HOLDINGS INC	97,893	3.86	377,866.98
TEGNA INC	10,189	22.69	231,188.41
THE WALT DISNEY CO.	73,240	97.35	7,129,914.00
TIME WARNER CABLE, INC.	13,075	202.67	2,649,910.25
TIME WARNER INC	36,913	73.77	2,723,072.01
TWENTY-FIRST CE CL-A	53,635	29.29	1,570,969.15
TWENTY-FIRST CE CL-B	20,085	29.42	590,900.70
VIACOM INC-CLASS B	16,362	38.59	631,409.58
ADVANCE AUTO PARTS	3,481	156.50	544,776.50
AMAZON.COM INC	18,581	603.17	11,207,501.77
AUTONATION INC	3,089	44.83	138,479.87
AUTOZONE INC	1,411	777.04	1,096,403.44



BED BATH & BEYOND INC	8,340	47.14	393,147.60
BEST BUY COMPANY INC	13,895	30.82	428,243.90
CARMAX INC	9,696	51.59	500,216.64
DICK'S SPORTING GOODS INC	4,201	44.39	186,482.39
DOLLAR GENERAL CORP	13,966	83.35	1,164,066.10
DOLLAR TREE INC	10,642	80.16	853,062.72
EXPEDIA INC	5,769	104.57	603,264.33
FOOT LOCKER INC	6,434	59.98	385,911.32
GAMESTOP CORP-CL A	5,557	30.09	167,210.13
GAP INC/THE	11,563	23.58	272,655.54
GENUINE PARTS CO	7,329	97.59	715,237.11
HOME DEPOT INC	59,127	134.38	7,945,486.26
KOHL'S CORP	9,070	42.68	387,107.60
L BRANDS INC	11,410	79.07	902,188.70
LIBERTY INTERACTIVE CORP QVC GROUP-A	21,340	25.67	547,797.80
LKQ CORPORATION	13,314	32.29	429,909.06
LOWE'S COMPANIES INC	42,482	75.73	3,217,161.86
MACY'S INC	14,660	40.07	587,426.20
NETFLIX INC	18,976	106.98	2,030,052.48
NORDSTROM INC	6,499	51.59	335,283.41
O'REILLY AUTOMOTIVE INC NEW	4,706	268.75	1,264,737.50
PRICELINE GROUP INC/THE	2,322	1,300.28	3,019,250.16
ROSS STORES INC	19,002	56.41	1,071,902.82
SIGNET JEWELERS LTD	3,437	112.51	386,696.87
STAPLES INC	31,615	11.21	354,404.15
TARGET CORP	27,293	80.78	2,204,728.54
TIFFANY & CO	6,182	70.24	434,223.68
TJX COMPANIES INC	31,223	76.04	2,374,196.92
TRACTOR SUPPLY COMPANY	6,118	88.86	543,645.48
TRIPADVISOR INC-W/I	5,824	61.44	357,826.56
ULTA SALON COSMETICS & FRAGRANCE INC	2,921	203.94	595,708.74
COSTCO WHOLESALE CORP	20,222	150.52	3,043,815.44
CVS HEALTH CORPORATION	51,639	101.23	5,227,415.97
KROGER CO	43,255	37.16	1,607,355.80
RITE AID CORP	48,792	8.04	392,287.68
SYSCO CORP	26,587	46.95	1,248,259.65
WAL-MART STORES INC	74,360	68.80	5,115,968.00
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	41,008	81.31	3,334,360.48
WHOLE FOODS MARKET INC	15,915	29.62	471,402.30
ALTRIA GROUP INC	91,435	63.82	5,835,381.70
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	28,158	36.83	1,037,059.14
BROWN-FORMAN CORPORATION	5,392	96.01	517,685.92

BUNGE LIMITED	6,595	56.41	372,023.95
CAMPBELL SOUP CO	9,076	63.98	580,682.48
COCA-COLA CO/THE	192,672	46.65	8,988,148.80
COCA-COLA ENTERPRISES INC	10,446	52.82	551,757.72
CONAGRA FOODS INC	20,161	46.31	933,655.91
CONSTELLATION BRANDS INC-A	8,152	156.95	1,279,456.40
DR.PEPPER SNAPPLE GROUP, INC	8,846	90.60	801,447.60
GENERAL MILLS INC	27,873	63.46	1,768,820.58
HORMEL FOODS CORPORATION	13,718	40.68	558,048.24
JM SMUCKER CO/THE-NEW COM	5,536	127.97	708,441.92
KELLOGG CO	12,445	77.34	962,496.30
KRAFT HEINZ COMPANY	27,949	78.33	2,189,245.17
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	5,445	98.90	538,510.50
MEAD JOHNSON NUTRITION COMPANY	9,062	84.31	764,017.22
MOLSON COORS BREWING COMPANY	9,009	92.87	836,665.83
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	73,429	42.40	3,113,389.60
MONSTER BEVERAGE CORPORATION	6,708	130.19	873,314.52
PEPSICO INC	67,729	104.91	7,105,449.39
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL INC.	71,976	101.63	7,314,920.88
REYNOLDS AMERICAN INC	40,104	51.26	2,055,731.04
THE HERSHEY COMPANY	7,097	92.14	653,917.58
TYSON FOODS INC-CL A	13,389	68.37	915,405.93
WHITEWAVE FOODS CO	7,662	38.86	297,745.32
CHURCH & DWIGHT CO INC	5,983	93.74	560,846.42
CLOROX COMPANY	6,144	128.17	787,476.48
COLGATE-PALMOLIVE COMPANY	39,736	71.23	2,830,395.28
EDGEWELL PERSONAL CARE CO	2,963	81.26	240,773.38
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	10,328	94.73	978,371.44
KIMBERLY-CLARK CORP	16,929	138.13	2,338,402.77
PROCTER & GAMBLE CO	126,872	82.83	10,508,807.76
ABBOTT LABORATORIES	69,566	42.82	2,978,816.12
AETNA INC	16,364	109.29	1,788,421.56
AMERISOURCEBERGEN CORP	9,332	84.90	792,286.80
ANTHEM INC	12,135	142.87	1,733,727.45
BARD(C.R.) INC	3,414	204.85	699,357.90
BAXALTA INC	31,095	40.36	1,254,994.20
BAXTER INTERNATIONAL INC	25,602	42.03	1,076,052.06
BECTON DICKINSON & CO	10,045	157.67	1,583,795.15
BOSTON SCIENTIFIC CORP	62,550	19.31	1,207,840.50
CARDINAL HEALTH INC	15,363	82.56	1,268,369.28
CENTENE CORP	8,130	59.02	479,832.60
CERNER CORP	14,818	55.50	822,399.00

CIGNA CORP	12,013	135.78	1,631,125.14
COOPER COMPANIES INC (THE)	2,282	155.45	354,736.90
DAVITA HEALTHCARE PARTNERS INC	7,918	73.78	584,190.04
DENTSPLY SIRONA INC	11,510	59.71	687,262.10
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	10,124	105.74	1,070,511.76
ENVISION HEALTHCARE HOLDINGS	8,500	20.70	175,950.00
EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO	31,624	70.26	2,221,902.24
HCA HOLDINGS, INC.	15,366	79.78	1,225,899.48
HENRY SCHEIN INC	3,867	168.39	651,164.13
HOLOGIC INC	10,700	35.23	376,961.00
HUMANA INC.	7,085	170.41	1,207,354.85
IMS HEALTH HOLDINGS INC	7,700	26.19	201,663.00
INTUITIVE SURGICAL INC	1,772	625.51	1,108,403.72
LABORATORY CRP OF AMR HLDGS	4,739	117.56	557,116.84
MALLINCKRODT PLC	5,503	58.40	321,375.20
MCKESSON CORP	10,759	164.33	1,768,026.47
MEDNAX INC	4,300	66.63	286,509.00
MEDTRONIC PLC	65,923	76.62	5,051,020.26
PATTERSON COS INC	4,102	44.43	182,251.86
QUEST DIAGNOSTICS	6,376	72.85	464,491.60
QUINTILES TRANSNATIONAL HOLDINGS INC	4,422	69.40	306,886.80
RESMED INC	6,797	59.41	403,809.77
ST JUDE MEDICAL INC	12,789	57.50	735,367.50
STRYKER CORP	15,689	109.45	1,717,161.05
UNITEDHEALTH GROUP INC	44,239	126.80	5,609,505.20
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	4,394	122.49	538,221.06
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	4,743	81.21	385,179.03
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	8,551	111.57	954,035.07
ABBVIE INC	75,757	59.89	4,537,086.73
AGILENT TECHNOLOGIES INC	16,003	39.75	636,119.25
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	10,499	153.55	1,612,121.45
ALKERMES PLC	6,377	38.05	242,644.85
ALLERGAN PLC	18,287	222.57	4,070,137.59
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	3,571	67.43	240,792.53
AMGEN INC	35,178	158.60	5,579,230.80
BIOGEN INC	10,395	267.61	2,781,805.95
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	7,516	85.00	638,860.00
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	77,800	66.84	5,200,152.00
CELGENE CORP	36,368	105.26	3,828,095.68
ELI LILLY & CO	46,821	74.57	3,491,441.97
ENDO INTERNATIONAL PLC	10,390	26.25	272,737.50
GILEAD SCIENCES INC	66,918	97.24	6,507,106.32

ILLUMINA INC	6,791	171.44	1,164,249.04
INCYTE CORP	7,807	77.37	604,027.59
IONIS PHARMACEUTICALS INC	5,769	40.57	234,048.33
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	2,928	139.67	408,953.76
JOHNSON & JOHNSON	129,035	109.60	14,142,236.00
MEDIVATION INC	7,392	45.73	338,036.16
MERCK & CO. INC.	129,767	55.34	7,181,305.78
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL INC	1,322	354.08	468,093.76
MYLAN NV	19,492	46.25	901,505.00
PERRIGO CO PLC	6,780	125.76	852,652.80
PFIZER INC	287,423	31.96	9,186,039.08
REGENERON PHARMACEUTICALS	3,586	408.07	1,463,339.02
TARO PHARMACEUTICAL INDUSTRIES	312	142.61	44,494.32
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	18,418	142.43	2,623,275.74
UNITED THERAPEUTICS CORP	2,212	110.15	243,651.80
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	11,118	83.37	926,907.66
WATERS CORP	4,006	132.19	529,553.14
ZOETIS INC	22,514	47.01	1,058,383.14
BANK OF AMERICA CORP	484,931	13.27	6,435,034.37
BB & T CORPORATION	37,292	33.05	1,232,500.60
CIT GROUP INC	8,202	31.45	257,952.90
CITIGROUP INC	138,900	41.90	5,819,910.00
CITIZENS FINANCIAL GROUP	24,353	21.51	523,833.03
COMERICA INC	8,610	38.20	328,902.00
FIFTH THIRD BANCORP	36,500	16.65	607,725.00
FIRST REPUBLIC BANK/CA	6,528	65.79	429,477.12
HUNTINGTON BANCSHARES INC	35,918	9.57	343,735.26
JPMORGAN CHASE & CO	171,581	59.28	10,171,321.68
KEYCORP	38,474	11.02	423,983.48
M & T BANK CORP	6,915	111.45	770,676.75
NEW YORK COMMUNITY BANCORP	21,566	15.15	326,724.90
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL INC	15,218	15.65	238,161.70
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	24,013	82.86	1,989,717.18
REGIONS FINANCIAL CORPORATION	60,408	7.97	481,451.76
SIGNATURE BANK	2,300	136.14	313,122.00
SUNTRUST BANKS INC	23,766	36.75	873,400.50
US BANCORP	81,271	40.26	3,271,970.46
WELLS FARGO & COMPANY	226,382	47.77	10,814,268.14
AFFILIATED MANAGERS GROUP	2,457	164.15	403,316.55
ALLY FINANCIAL INC	20,464	17.21	352,185.44
AMERICAN EXPRESS COMPANY	39,265	60.68	2,382,600.20
AMERIPRISE FINANCIAL INC	8,391	94.17	790,180.47

BANK OF NEW YORK MELLON CORP(THE)	51,766	36.13	1,870,305.58
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	55,208	142.40	7,861,619.20
BLACKROCK INC	5,775	339.31	1,959,515.25
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	25,066	68.31	1,712,258.46
CME GROUP INC.	14,985	90.05	1,349,399.25
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	20,303	51.49	1,045,401.47
E*TRADE FINANCIAL CORPORATION	13,758	23.82	327,715.56
EATON VANCE CORP	5,530	34.19	189,070.70
FRANKLIN RESOURCES INC	17,532	37.97	665,690.04
GOLDMAN SACHS GROUP INC	17,856	154.31	2,755,359.36
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	5,527	233.00	1,287,791.00
INVESCO LIMITED	20,708	30.08	622,896.64
LEGG MASON INC	4,006	32.19	128,953.14
LEUCADIA NATIONAL CORPORATION	15,223	16.06	244,481.38
MCGRAW HILL FINANCIAL INC	12,330	97.78	1,205,627.40
MOODY'S CORP	8,503	95.32	810,505.96
MORGAN STANLEY	67,738	24.58	1,665,000.04
MSCI INC-A	5,000	73.76	368,800.00
NASDAQ INC	5,692	63.15	359,449.80
NAVIENT CORPORATION	15,911	12.42	197,614.62
NORTHERN TRUST CORP	10,598	65.16	690,565.68
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	5,579	46.23	257,917.17
SCHWAB (CHARLES) CORP	55,256	27.45	1,516,777.20
SEI INVESTMENTS COMPANY	7,092	44.33	314,388.36
STATE STREET CORP	19,301	57.49	1,109,614.49
SYNCHRONY FINANCIAL	38,885	28.16	1,095,001.60
T ROWE PRICE GROUP INC	11,704	74.04	866,564.16
TD AMERITRADE HOLDING CORPORATION	11,968	31.00	371,008.00
AFLAC INC	20,314	65.53	1,331,176.42
ALLEGHANY CORPORATION	770	499.36	384,507.20
ALLSTATE CORP	17,660	67.21	1,186,928.60
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	57,492	53.79	3,092,494.68
AON PLC	12,982	102.51	1,330,784.82
ARCH CAPITAL GROUP LTD.	5,391	70.10	377,909.10
ARTHUR J GALLAGHER & CO	8,087	44.09	356,555.83
ASSURANT INC	3,249	79.70	258,945.30
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	4,260	54.88	233,788.80
CHUBB LTD	21,268	119.43	2,540,037.24
CINCINNATI FINANCIAL CORP	7,722	65.66	507,026.52
EVEREST RE GROUP LTD	2,147	197.22	423,431.34
FNF GROUP	11,145	32.92	366,893.40
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	18,985	45.41	862,108.85

LINCOLN NATIONAL CORP	11,366	39.27	446,342.82
LOEWS CORPORATION	13,343	38.69	516,240.67
MARKEL CORP	630	904.78	570,011.40
MARSH & MCLENNAN COS	24,458	61.50	1,504,167.00
METLIFE INC	43,953	43.16	1,897,011.48
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	13,370	40.32	539,078.40
PROGRESSIVE CORP	27,420	34.71	951,748.20
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	21,195	73.27	1,552,957.65
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	2,159	116.99	252,581.41
TORCHMARK CORPORATION	5,751	54.76	314,924.76
TRAVELERS COS INC(THE)	14,351	115.19	1,653,091.69
UNUM GROUP	11,114	31.62	351,424.68
VOYA FINANCIAL INC	10,075	30.46	306,884.50
W.R.BERKLEY CORPORATION	4,740	56.10	265,914.00
WILLIS TOWERS WATSON PLC	6,260	115.79	724,845.40
XL GROUP PLC	13,694	36.33	497,503.02
CBRE GROUP INC-A	14,256	29.02	413,709.12
CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP	15,252	87.68	1,337,295.36
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	25,000	6.12	153,000.00
JONES LANG LASALLE INC	2,108	116.49	245,560.92
REALOGY HOLDINGS CORP	6,236	36.17	225,556.12
WEYERHAEUSER CO	36,775	31.45	1,156,573.75
ACCENTURE PLC-CL A	29,144	114.39	3,333,782.16
ACTIVISION BLIZZARD INC	24,807	33.48	830,538.36
ADOBE SYSTEMS INC	23,611	93.42	2,205,739.62
AKAMAI TECHNOLOGIES	8,580	50.54	433,633.20
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	2,793	204.40	570,889.20
ALPHABET INC-CL A	13,579	764.32	10,378,701.28
ALPHABET INC-CL C	14,503	743.09	10,777,034.27
ANSYS INC	4,110	86.57	355,802.70
AUTODESK INC	10,253	55.92	573,347.76
AUTOMATIC DATA PROCESSING	21,592	90.11	1,945,655.12
CA INC	14,472	29.99	434,015.28
CDK GLOBAL INC	6,408	46.65	298,933.20
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES	3,494	85.52	298,806.88
CITRIX SYSTEMS INC	7,141	78.15	558,069.15
COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS CORPORATION	28,634	59.46	1,702,577.64
EBAY INC	51,558	24.42	1,259,046.36
ELECTRONIC ARTS INC	14,215	62.96	894,976.40
EQUINIX INC	3,182	322.13	1,025,017.66
FACEBOOK INC-A	105,794	110.61	11,701,874.34
FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES	13,249	64.03	848,333.47

FISERV INC	10,876	100.21	1,089,883.96
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	3,469	148.98	516,811.62
FORTINET INC	6,500	28.79	187,135.00
GARTNER INC	4,207	87.45	367,902.15
GLOBAL PAYMENTS INC	5,600	71.81	402,136.00
INTL BUSINESS MACHINES CORP	42,876	149.63	6,415,535.88
INTUIT INC	11,882	102.71	1,220,400.22
LINKEDIN CORP-A	5,651	109.69	619,858.19
MASTERCARD INC-CL A	46,187	93.86	4,335,111.82
MICROSOFT CORP	353,569	54.65	19,322,545.85
NETSUITE INC	2,000	69.24	138,480.00
NUANCE COMMUNICATIONS INC	11,121	18.97	210,965.37
ORACLE CORPORATION	148,799	40.42	6,014,455.58
PAYCHEX INC	15,132	53.09	803,357.88
PAYPAL HOLDINGS INC	50,583	37.80	1,912,037.40
RED HAT INC	8,251	72.61	599,105.11
SABRE CORP	8,000	28.43	227,440.00
SALESFORCE.COM, INC.	29,649	74.27	2,202,031.23
SERVICENOW INC	6,961	61.75	429,841.75
SPLUNK INC	5,933	47.79	283,538.07
SYMANTEC CORPORATION	31,068	17.97	558,291.96
SYNOPSYS INC	7,563	47.82	361,662.66
TABLEAU SOFTWARE INC-CL A	2,186	44.01	96,205.86
TERADATA CORP	7,209	24.49	176,548.41
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	7,323	49.44	362,049.12
TWITTER INC	25,955	16.57	430,074.35
VANTIV INC-CL A	7,696	54.14	416,661.44
VERISIGN INC	4,574	88.61	405,302.14
VISA INC	90,433	78.52	7,100,799.16
VMWARE INC	3,826	50.38	192,753.88
WESTERN UNION COMPANY	24,601	19.89	489,313.89
WORKDAY INC-CLASS A	5,247	76.41	400,923.27
XEROX CORP	42,168	11.14	469,751.52
YAHOO! INC	42,241	36.66	1,548,555.06
ZILLOW GROUP INC-C	5,184	20.68	107,205.12
AMPHENOL CORPORATION -CL A	14,435	58.28	841,271.80
APPLE INC	259,887	110.44	28,701,920.28
ARROW ELECTRONICS INC	4,041	63.54	256,765.14
AVNET INC	6,544	43.90	287,281.60
CDW CORP/DE	6,500	41.63	270,595.00
CISCO SYSTEMS INC	235,855	27.64	6,519,032.20
CORNING INC	56,637	20.83	1,179,748.71

EMC CORP/MASS	89,406	25.65	2,293,263.90
F5 NETWORKS INC	3,338	95.19	317,744.22
FLEXTRONICS INTL LTD	27,993	12.03	336,755.79
FLIR SYSTEMS INC	7,048	32.48	228,919.04
HARRIS CORP	5,694	76.72	436,843.68
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE C	83,000	17.24	1,430,920.00
HP INC	86,101	12.22	1,052,154.22
JUNIPER NETWORKS INC	15,583	23.06	359,343.98
MOTOROLA SOLUTIONS INC	7,104	75.04	533,084.16
NETAPP INC	13,593	26.13	355,185.09
PALO ALTO NETWORKS INC	3,859	139.04	536,555.36
QORVO INC	6,774	47.68	322,984.32
QUALCOMM INC	69,660	50.82	3,540,121.20
SANDISK CORP	9,525	76.68	730,377.00
SEAGATE TECHNOLOGY	14,132	35.04	495,185.28
SKYWORKS SOLUTIONS INC	8,902	74.64	664,445.28
TE CONNECTIVITY LTD	18,347	62.64	1,149,256.08
TRIMBLE NAVIGATION LTD	11,191	24.71	276,529.61
WESTERN DIGITAL CORP	10,774	43.97	473,732.78
AT&T INC	286,226	38.67	11,068,359.42
CENTURYLINK INC	26,370	32.00	843,840.00
FRONTIER COMMUNICATIONS CORPORATION	55,620	5.34	297,010.80
LEVEL 3 COMMUNICATIONS INC	14,158	52.52	743,578.16
SBA COMMUNICATIONS CORP-CL A	6,014	100.41	603,865.74
SPRINT CORP	33,034	3.49	115,288.66
T-MOBILE US INC	12,915	38.89	502,264.35
VERIZON COMMUNICATIONS INC	189,750	51.95	9,857,512.50
AES CORPORATION	29,997	11.16	334,766.52
AGL RESOURCES INC	5,474	65.33	357,616.42
ALLIANT ENERGY CORP	4,948	73.65	364,420.20
AMEREN CORPORATION	11,406	48.71	555,586.26
AMERICAN ELECTRIC POWER	22,853	66.31	1,515,382.43
AMERICAN WATER WORKS CO INC	8,493	70.39	597,822.27
ATMOS ENERGY CORP	4,610	73.99	341,093.90
CALPINE CORP	16,738	14.85	248,559.30
CENTERPOINT ENERGY INC	20,686	21.26	439,784.36
CMS ENERGY CORPORATION	12,676	41.72	528,842.72
COLUMBIA PIPELINE GROUP	17,511	25.55	447,406.05
CONSOLIDATED EDISON INC	13,701	76.05	1,041,961.05
DOMINION RESOURCES INC/VA	28,256	73.22	2,068,904.32
DTE ENERGY COMPANY	8,619	89.09	767,866.71
DUKE ENERGY CORP	32,212	80.22	2,584,046.64



	EDISON INTERNATIONAL	14,818	70.99	1,051,929.82
	ENERGY CORP	8,476	76.56	648,922.56
	EVERSOURCE ENERGY	15,201	56.67	861,440.67
	EXELON CORP	42,120	35.08	1,477,569.60
	FIRSTENERGY CORP	19,917	35.75	712,032.75
	NEXTERA ENERGY INC	21,249	117.05	2,487,195.45
	NRG ENERGY INC	16,034	13.28	212,931.52
	OGE ENERGY CORP	9,238	28.08	259,403.04
	P G & E CORPORATION	22,413	59.21	1,327,073.73
	PINNACLE WEST CAPITAL CORPORATION	4,942	74.64	368,870.88
	PPL CORPORATION	30,607	37.46	1,146,538.22
	PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	24,048	46.26	1,112,460.48
	SCANA CORP	6,092	69.77	425,038.84
	SEMPRA ENERGY	11,320	104.09	1,178,298.80
	SOUTHERN CO	42,573	50.77	2,161,431.21
	TECO ENERGY INC	12,013	27.65	332,159.45
	WEC ENERGY GROUP INC	14,370	59.13	849,698.10
	XCEL ENERGY INC	23,635	40.99	968,798.65
	ANALOG DEVICES INC	14,416	58.80	847,660.80
	APPLIED MATERIALS INC	57,332	20.93	1,199,958.76
	BROADCOM LTD	18,024	155.43	2,801,470.32
	INTEL CORP	219,427	31.86	6,990,944.22
	KLA-TENCOR CORPORATION	7,639	72.15	551,153.85
	LAM RESEARCH CORP	7,797	81.40	634,675.80
	LINEAR TECHNOLOGY CORP	11,842	44.75	529,929.50
	MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	18,071	10.66	192,636.86
	MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	13,285	36.35	482,909.75
	MICROCHIP TECHNOLOGY INC	8,913	48.30	430,497.90
	MICRON TECHNOLOGY INC	50,896	10.17	517,612.32
	NVIDIA CORP	24,940	35.84	893,849.60
	NXP SEMICONDUCTORS NV	6,231	82.69	515,241.39
	TEXAS INSTRUMENTS INC	47,540	58.44	2,778,237.60
	XILINX INC	11,585	45.87	531,403.95
	米ドル 小計	14,726,830		859,391,467.73 (93,390,070,798)
カナダドル	ALTAGAS LTD	6,948	32.81	227,963.88
	ARC RESOURCES LTD	16,083	19.62	315,548.46
	CAMECO CORP	19,538	15.87	310,068.06
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	50,029	37.50	1,876,087.50
	CENOVUS ENERGY INC	39,619	18.11	717,500.09
	CRESCENT POINT ENERGY CORP	23,425	19.88	465,689.00
	ENBRIDGE INC	43,607	51.33	2,238,347.31

ENCANA CORP	34,842	8.84	308,003.28
HUSKY ENERGY INC	15,674	16.78	263,009.72
IMPERIAL OIL LTD	13,562	40.74	552,515.88
INTER PIPELINE LTD	17,300	26.74	462,602.00
KEYERA CORP	7,761	39.84	309,198.24
PEMBINA PIPELINE CORP	18,567	35.08	651,330.36
PEYTO EXPLORATION & DEV CORP	6,265	30.82	193,087.30
PRAIRIESKY ROYALTY LTD	9,911	24.06	238,458.66
SEVEN GENERATIONS ENERGY-A	6,800	21.10	143,480.00
SUNCOR ENERGY INC	72,773	36.89	2,684,595.97
TOURMALINE OIL CORP	8,005	27.44	219,657.20
TRANSCANADA CORP	32,655	50.16	1,637,974.80
VERESEN INC	13,299	8.66	115,169.34
VERMILION ENERGY INC	5,586	37.16	207,575.76
AGNICO EAGLE MINES LIMITED	9,597	52.40	502,882.80
AGRIUM INC	5,976	113.95	680,965.20
BARRICK GOLD CORP	53,489	20.87	1,116,315.43
CCL INDUSTRIES INC-CL B	1,385	224.45	310,863.25
ELDORADO GOLD CORPORATION	41,255	4.80	198,024.00
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	32,770	7.19	235,616.30
FRANCO-NEVADA CORPORATION	8,418	88.25	742,888.50
GOLDCORP INC	38,306	22.65	867,630.90
KINROSS GOLD CORP	51,579	5.69	293,484.51
METHANEX CORPORATION	3,622	42.44	153,717.68
POTASH CORP OF SASKATCHEWAN	40,782	20.64	841,740.48
SILVER WHEATON CORPORATION	17,420	22.73	395,956.60
TECK RESOURCES LIMITED-CL B	27,750	11.10	308,025.00
TURQUOISE HILL RESOURCES LTD	45,107	3.39	152,912.73
WEST FRASER TIMBER CO LTD	2,873	46.12	132,502.76
YAMANA GOLD INC	51,365	5.26	270,179.90
BOMBARDIER INC 'B'	80,493	1.35	108,665.55
CAE INC	13,932	14.55	202,710.60
FINNING INTERNATIONAL INC	9,972	20.20	201,434.40
SNC-LAVALIN GROUP INC	6,787	46.46	315,324.02
PROGRESSIVE WASTE SOLUTIONS	4,000	38.87	155,480.00
CANADIAN NATL RAILWAY CO	37,475	79.93	2,995,376.75
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	6,565	183.94	1,207,566.10
LINAMAR CORP	2,200	57.14	125,708.00
MAGNA INTERNATIONAL INC	19,720	51.70	1,019,524.00
GILDAN ACTIVEWEAR INC	10,518	38.26	402,418.68
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	9,229	50.66	467,541.14
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	18,916	24.54	464,198.64

THOMSON REUTERS CORP	16,217	52.13	845,392.21
CANADIAN TIRE CORP -CL A	3,288	134.42	441,972.96
DOLLARAMA INC	5,395	88.54	477,673.30
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC-B	19,555	56.64	1,107,595.20
EMPIRE CO LTD A	7,235	20.75	150,126.25
JEAN COUTU GROUP INC A	5,801	21.34	123,793.34
LOBLAW COMPANIES LTD	10,287	69.15	711,346.05
METRO INC	11,599	42.59	494,001.41
WESTON (GEORGE) LTD	2,473	110.83	274,082.59
SAPUTO INC	11,403	40.07	456,918.21
VALEANT PHARMACEUTICALS INTERN	15,376	40.83	627,802.08
BANK OF MONTREAL	29,626	79.28	2,348,749.28
BANK OF NOVA SCOTIA	56,105	62.54	3,508,806.70
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	19,002	97.14	1,845,854.28
NATIONAL BANK OF CANADA	15,972	43.17	689,511.24
ROYAL BANK OF CANADA	69,086	75.74	5,232,573.64
TORONTO-DOMINION BANK	86,464	54.97	4,752,926.08
CI FINANCIAL CORP	10,961	28.36	310,853.96
ELEMENT FINANCIAL CORP	19,611	14.42	282,790.62
IGM FINANCIAL INC	5,296	38.51	203,948.96
ONEX CORPORATION	4,217	76.82	323,949.94
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	1,023	705.11	721,327.53
GREAT-WEST LIFECO INC	14,253	35.13	500,707.89
INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANCE AND FINANC	3,892	39.37	153,228.04
INTACT FINANCIAL CORPORATION	5,933	91.20	541,089.60
MANULIFE FINANCIAL CORP	93,979	17.81	1,673,765.99
POWER CORP OF CANADA	17,850	29.76	531,216.00
POWER FINANCIAL CORP	10,930	31.74	346,918.20
SUN LIFE FINANCIAL INC	29,069	41.68	1,211,595.92
BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT INC	41,410	42.55	1,761,995.50
FIRST CAPITAL REALTY INC	4,000	20.00	80,000.00
CGI GROUP INC - CL A	10,638	62.41	663,917.58
CONSTELLATION SOFTWARE	897	533.50	478,549.50
OPEN TEXT CORPORATION	5,489	67.95	372,977.55
BLACKBERRY LIMITED	23,701	9.05	214,494.05
BCE INC	6,388	59.51	380,149.88
ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	17,418	49.78	867,068.04
TELUS CORPORATION	9,642	40.96	394,936.32
ATCO LTD-CLASS I	3,354	38.84	130,269.36
CANADIAN UTILITIES LIMITED	5,884	35.45	208,587.80
FORTIS INC	13,071	39.48	516,043.08
	1,857,540		65,967,022.86

	カナダドル 小計			(5,610,495,294)
ユーロ	ENI SPA	118,635	12.96	1,537,509.60
	GALP ENERGIA SGPS S.A	20,587	11.45	235,721.15
	NESTE OYJ	6,068	30.06	182,404.08
	OMV AG	7,833	24.67	193,240.11
	REPSOL SA	51,336	9.92	509,304.45
	SAIPEM	254,172	0.34	86,418.48
	TECHNIP S.A.	4,653	48.90	227,531.70
	TENARIS S.A.	22,139	11.21	248,178.19
	TOTAL SA	102,350	40.93	4,189,185.50
	VOPAK	3,334	43.84	146,179.23
	AIR LIQUIDE	16,342	97.85	1,599,064.70
	AKZO NOBEL	11,711	58.45	684,507.95
	ARCELOR MITTAL	69,497	4.49	312,111.02
	ARKEMA	2,963	67.93	201,276.59
	BASF SE	43,458	64.83	2,817,382.14
	CRH PLC	39,026	25.28	986,577.28
	EVONIK INDUSTRIES AG	5,616	26.60	149,385.60
	FUCHS PETROLUB SE-PREF	3,370	38.87	131,008.75
	HEIDELBERGCEMENT AG	6,427	74.96	481,767.92
	IMERYS SA	2,030	60.31	122,429.30
	K+S AG	9,644	19.37	186,852.50
	KONINKLIJKE DSM NV	8,792	49.87	438,501.00
	LANXESS	4,066	42.40	172,398.40
	LINDE AG	8,671	124.40	1,078,672.40
	SOLVAY SA	3,467	85.45	296,255.15
	STORA ENSO OYJ-R SHS	25,257	7.51	189,680.07
	SYMRISE AG	5,820	59.19	344,485.80
	THYSSENKRUPP AG	15,738	19.36	304,687.68
	UMICORE	4,218	44.71	188,607.87
	UPM-KYMMENE OYJ	24,716	14.56	359,864.96
	VOESTALPINE AG	4,961	28.41	140,966.81
	ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	9,330	27.17	253,496.10
	AIRBUS GROUP SE	27,244	56.07	1,527,571.08
	ALSTOM RGPT	8,041	22.62	181,927.62
	ANDRITZ AG	3,301	46.60	153,826.60
	BOSKALIS WESTMINSTER NV	3,523	35.35	124,555.66
	BOUYGUES SA	10,038	29.96	300,738.48
	BRENTAG AG	6,928	51.40	356,099.20
	CNH INDUSTRIAL NV	44,474	5.54	246,385.96
	COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	22,389	38.73	867,125.97
	FERROVIAL SA	22,950	18.23	418,493.25

FINMECCANICA SPA	18,294	10.63	194,465.22
GEA GROUP AG	8,548	41.28	352,861.44
KONE OYJ-B	15,772	41.38	652,645.36
KONINKLIJKE PHILIPS NV	45,338	24.24	1,099,219.81
LEGRAND SA	12,536	49.40	619,341.08
MAN SE	1,882	94.38	177,623.16
METSO OYJ	4,880	21.14	103,163.20
OCI NV	3,391	17.29	58,630.39
OSRAM LICHT AG	3,738	45.84	171,349.92
PRYSMIAN SPA	9,328	20.04	186,933.12
REXEL SA	13,762	11.63	160,120.87
SAFRAN SA	14,674	59.03	866,206.22
SCHNEIDER ELECTRIC SE	26,320	53.69	1,413,120.80
SIEMENS AG-REG	36,976	89.81	3,320,814.56
THALES SA	5,075	76.09	386,156.75
VINCI S.A.	22,009	64.75	1,425,082.75
WARTSILA OYJ-B SHARES	6,712	39.53	265,325.36
ZARDOYA OTIS SA	6,593	9.27	61,117.11
ZODIAC AEROSPACE	10,335	16.73	172,904.55
BIC	1,337	133.10	177,954.70
BUREAU VERITAS SA	11,223	20.32	228,107.47
ELENRED	8,942	17.18	153,623.56
PADDY POWER BETFAIR PLC	3,991	116.45	464,751.95
RANDSTAD HOLDING NV	6,118	46.94	287,209.51
ABERTIS INFRASTRUCTURAS SA	23,172	14.47	335,414.70
AENA SA	3,179	118.50	376,711.50
AEROPORTS DE PARIS (ADP)	1,346	110.35	148,531.10
ATLANTIA SPA	19,813	24.20	479,474.60
BOLLORE	39,433	3.40	134,387.66
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	12,281	13.95	171,381.35
DEUTSCHE POST AG-REG	45,255	24.43	1,105,805.92
FRAPORT AG	1,856	52.93	98,238.08
GROUPE EUROTUNNEL SE	19,368	9.83	190,426.17
INTERNATIONAL CONSOLIDATED AIRLINES GROUP	41,090	6.62	272,303.43
RYANAIR HOLDINGS PLC	1,614	13.05	21,070.77
TNT EXPRESS NV	24,873	7.87	195,750.51
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	15,473	75.35	1,165,890.55
BAYERISCHE MOTOREN WERKE(BMW)AG-PFD	2,879	65.39	188,257.81
CONTINENTAL AG	5,286	187.10	989,010.60
DAIMLER AG	44,765	61.30	2,744,094.50
FERRARI NV	6,007	36.02	216,372.14
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	40,074	6.41	257,074.71

MICHELIN (CGDE)-B	8,897	90.70	806,957.90
NOKIAN RENKAAT OYJ	5,578	30.82	171,913.96
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE PEF	7,484	43.44	325,142.38
PSA PEUGEOT CITROEN	21,050	13.59	286,069.50
RENAULT SA	8,797	83.89	737,980.33
VALEO	3,848	128.95	496,199.60
VOLKSWAGEN AG	1,615	121.50	196,222.50
VOLKSWAGEN AG PFD	7,364	107.45	791,261.80
ADIDAS AG	9,937	103.10	1,024,504.70
CHRISTIAN DIOR SE	2,471	155.70	384,734.70
HERMES INTERNATIONAL	1,283	299.40	384,130.20
HUGO BOSS AG	3,209	57.29	183,843.61
KERING	3,490	150.70	525,943.00
LUXOTTICA GROUP SPA	7,912	48.04	380,092.48
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	12,870	148.30	1,908,621.00
ACCOR SA	9,735	39.00	379,665.00
SODEXO	4,408	95.10	419,200.80
ALTICE NV -A W/I	16,172	14.03	226,974.02
ALTICE NV -B W/I	3,935	14.14	55,660.57
AXEL SPRINGER SE	2,125	50.22	106,717.50
EUTELSAT COMMUNICATIONS	8,726	27.89	243,368.14
JC DECAUX SA	2,828	38.77	109,641.56
LAGARDERE S.C.A.	6,108	23.61	144,209.88
NUMERICABLE-SFR	4,599	29.93	137,671.06
PROSIEBEN SAT.1 MEDIA SE-REG	10,650	45.35	482,977.50
PUBLICIS GROUPE	9,036	62.30	562,942.80
RELX NV	48,624	15.37	747,594.00
RTL GROUP	1,967	73.00	143,591.00
SES	15,312	25.89	396,427.68
TELENET GROUP HOLDINGS NV	2,936	44.76	131,415.36
WOLTERS KLUWER-CVA	14,127	35.32	498,965.64
INDITEX	50,060	28.73	1,438,474.10
CARREFOUR SA	25,669	24.38	625,938.56
CASINO GUICHARD PERRACHON	2,725	52.81	143,907.25
COLRUYT NV	3,273	51.71	169,246.83
DELHAIZE GROUP	4,870	93.43	455,004.10
DISTRIBUIDORA INTERNACIONAL	29,663	4.81	142,768.01
JERONIMO MARTINS SGPS S.A.	11,930	14.55	173,581.50
KONINKLIJKE AHOLD NV	39,764	20.07	798,262.30
METRO AG	8,566	28.39	243,188.74
ANHEUSER-BUSCH INBEV NV	37,500	106.20	3,982,500.00
DANONE	27,808	60.95	1,694,897.60

HEINEKEN HOLDING NV	4,695	69.28	325,269.60
HEINEKEN NV	11,060	78.86	872,191.60
KERRY GROUP PLC-A	7,513	81.80	614,563.40
PERNOD-RICARD SA	9,663	97.32	940,403.16
REMY COINTREAU	1,273	67.18	85,520.14
UNILEVER NV-CVA	75,361	39.72	2,993,715.72
BEIERSDORF AG	4,749	77.24	366,812.76
HENKEL AG & CO KGAA	4,785	85.83	410,696.55
HENKEL AG & CO KGAA	8,152	98.15	800,118.80
L'OREAL	11,816	154.50	1,825,572.00
ESSILOR INTERNATIONAL	9,594	106.60	1,022,720.40
FRESENIUS MEDICAL CARE AG AND CO.KGAA	10,198	78.34	798,911.32
FRESENIUS SE & CO KGAA	17,792	64.11	1,140,645.12
BAYER AG	38,564	102.55	3,954,738.20
GRIFOLS S.A.	14,594	19.51	284,801.91
MERCK KGAA	6,176	75.88	468,634.88
ORION OYJ	4,336	29.29	127,001.44
QIAGEN N.V.	9,901	19.86	196,683.36
SANOFI	54,791	74.25	4,068,231.75
UCB SA	6,014	70.30	422,784.20
ZALANDO SE	4,200	29.50	123,900.00
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	300,021	5.50	1,650,415.52
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA-RTS	300,021	0.11	35,702.49
BANCO COMERCIAL PORTUGUES-R	1,933,869	0.03	65,558.15
BANCO DE SABADELL SA	244,482	1.43	351,076.15
BANCO DE SABADELL SA-NEW	2,936	1.43	4,216.09
BANCO DE SABADELL SA-RTS	244,482	0.04	10,268.24
BANCO ESPIRITO SANTO,S.A(BES)	187,906	0.01	1,879.06
BANCO POPOLARE SOCIETA COOPERATIVA	19,054	5.32	101,462.55
BANCO POPULAR ESPANOL	75,616	2.17	164,691.64
BANCO SANTANDER SA	667,146	3.77	2,516,474.71
BANK OF IRELAND	1,306,054	0.24	319,983.23
BANKIA SA	203,996	0.77	158,708.88
BANKINTER,S.A.	34,025	6.15	209,559.97
BNP PARIBAS	48,847	42.56	2,078,928.32
CAIXABANK	128,637	2.50	322,492.95
COMMERZBANK AG	46,558	7.75	361,010.73
CREDIT AGRICOLE SA	48,700	9.23	449,841.90
ERSTE GROUP BANK AG	12,920	24.40	315,248.00
INTESA SANPAOLO	595,505	2.23	1,332,740.19
INTESA SANPAOLO-RSP	50,545	2.10	106,144.50
KBC GROUPE SA	11,308	46.70	528,083.60

NATIXIS	41,035	4.43	182,072.29
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG	6,210	13.16	81,754.65
SOCIETE GENERALE	33,109	31.36	1,038,298.24
UNICREDIT SPA	222,882	2.98	664,634.12
UNIONE DI BANCHE ITALIANE SCPA	43,951	3.12	137,390.82
DEUTSCHE BANK AG -REG	63,116	13.98	882,361.68
DEUTSCHE BOERSE AG	8,800	71.18	626,384.00
EURAZEO	1,835	60.38	110,797.30
EXOR SPA	4,723	30.16	142,445.68
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	4,000	73.59	294,360.00
ING GROEP NV-CVA	178,548	10.36	1,850,650.02
MEDIOBANCA SPA	26,522	6.24	165,629.89
WENDEL	1,155	95.16	109,909.80
AEGON NV	83,989	4.91	412,385.99
AGEAS	9,255	35.00	323,925.00
ALLIANZ SE-REG	21,483	142.10	3,052,734.30
ASSICURAZIONI GENERALI	53,806	12.59	677,417.54
AXA SA	92,925	20.71	1,924,941.37
CNP ASSURANCES	10,007	14.47	144,801.29
HANNOVER RUECKVERSICHERUNG SE	3,033	102.90	312,095.70
MAPFRE SA	43,669	1.88	82,490.74
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	7,756	177.90	1,379,792.40
NN GROUP NV	11,219	29.30	328,716.70
SAMPO OYJ-A SHS	20,982	41.34	867,395.88
SCOR SE	7,073	31.00	219,263.00
UNIPOLSAI SPA	49,963	1.93	96,478.55
DEUTSCHE WOHNEN AG-BR	16,186	27.15	439,530.83
VONOVIA SE	22,617	31.51	712,774.75
AMADEUS IT HOLDING SA-A SHS	20,344	38.32	779,582.08
ATOS SE	4,317	71.47	308,535.99
CAP GEMINI SA	7,755	79.81	618,926.55
DASSAULT SYSTEMES SA	5,686	69.84	397,110.24
GEMALTO	3,838	58.48	224,446.24
SAP SE	45,495	68.45	3,114,132.75
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	5,981	43.76	261,728.56
INGENICO S.A.	2,687	97.34	261,552.58
NOKIA OYJ	270,408	5.16	1,395,305.28
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	151,332	15.32	2,318,406.24
ELISA OYJ	7,124	33.14	236,089.36
ILIAD SA	1,212	195.25	236,643.00
KONINKLIJKE KPN NV	144,663	3.52	509,937.07
ORANGE S.A.	93,233	14.80	1,379,848.40



	PROXIMUS SA	6,287	30.41	191,187.67
	TELECOM ITALIA SPA	510,414	0.85	437,169.59
	TELECOM ITALIA-RNC	281,876	0.70	197,595.07
	TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	31,357	4.68	146,938.90
	TELEFONICA S.A.	212,136	9.38	1,989,835.68
	VIVENDI SA	52,932	18.41	974,478.12
	E.ON SE	94,260	8.50	801,210.00
	EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	112,522	2.94	331,489.81
	ELECTRICITE DE FRANCE(EDF)	10,011	10.58	105,966.43
	ENAGAS	9,716	27.15	263,837.98
	ENDESA S.A.	14,812	17.28	255,951.36
	ENEL SPA	370,188	3.75	1,388,205.00
	ENGIE	69,213	13.43	929,530.59
	FORTUM OYJ	19,645	11.72	230,239.40
	GAS NATURAL SDG SA	15,578	17.61	274,406.47
	IBERDROLA SA	253,407	5.86	1,487,245.68
	RED ELECTRICA CORPORATION S.A.	5,265	77.98	410,564.70
	RWE AG	22,761	11.78	268,124.58
	SNAM SPA	99,230	5.44	539,811.20
	SUEZ ENVIRONNEMENT SA	14,573	16.15	235,353.95
	TERNA SPA	66,992	5.05	338,309.60
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	20,789	21.11	438,855.79
	ASML HOLDING NV	16,167	88.40	1,429,162.80
	INFINEON TECHNOLOGIES AG	52,646	12.25	645,176.73
	STMICROELECTRONICS NV	28,920	4.80	138,989.52
	ユーロ 小計	13,243,050		145,201,427.09 (17,948,348,402)
英ボンド	BP PLC	859,512	3.56	3,068,028.08
	PETROFAC LIMITED	9,677	8.79	85,060.83
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	184,325	17.59	3,242,276.75
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	184,811	17.61	3,254,521.71
	ANGLO AMERICAN PLC	59,787	6.38	381,859.56
	ANTOFAGASTA PLC	19,439	4.46	86,795.13
	BHP BILLITON PLC	101,664	8.08	822,055.10
	CRODA INTERNATIONAL PLC	6,446	29.63	190,994.98
	FRESNILLO PLC	11,248	9.92	111,580.16
	GLENCORE PLC	558,145	1.48	829,124.39
	JOHNSON MATTHEY PLC	9,122	27.57	251,493.54
	MONDI PLC	17,394	13.04	226,817.76
	RANDGOLD RESOURCES LTD	4,386	68.60	300,879.60
	REXAM PLC	30,633	6.19	189,618.27
	RIO TINTO PLC	57,473	20.86	1,199,174.14

ASHTED GROUP PLC	23,485	8.17	191,872.45
BAE SYSTEMS PLC	144,830	5.01	726,322.45
BUNZL PLC	15,459	20.47	316,445.73
COBHAM PLC	52,943	2.01	106,733.08
IMI PLC	11,445	9.28	106,266.82
MEGGITT PLC	36,073	3.84	138,736.75
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	82,971	6.57	545,534.32
SMITHS GROUP PLC	19,422	10.99	213,447.78
TRAVIS PERKINS PLC	12,496	18.27	228,301.92
WEIR GROUP PLC/THE	10,014	10.78	107,950.92
WOLSELEY PLC	11,749	39.15	459,973.35
AGGREKO PLC	12,848	10.30	132,334.40
BABCOCK INTERNATIONAL GROUP PLC	11,442	9.68	110,758.56
CAPITA PLC	31,057	10.52	326,719.64
EXPERIAN PLC	45,981	12.32	566,485.92
G4S PLC	81,122	1.91	155,186.38
INTERTEK GROUP PLC	7,790	31.50	245,385.00
MERLIN ENTERTAINMENTS PLC	33,608	4.58	154,059.07
EASYJET PLC	7,630	14.55	111,016.50
ROYAL MAIL PLC	42,103	4.79	201,673.37
GKN PLC	75,574	2.85	215,385.90
BURBERRY GROUP PLC	22,103	13.01	287,560.03
PERSIMMON PLC	14,611	19.60	286,375.60
TAYLOR WIMPEY PLC	151,898	1.77	269,770.84
THE BERKELEY GROUP HOLDINGS	6,152	30.11	185,236.72
CARNIVAL PLC	9,170	37.26	341,674.20
COMPASS GROUP PLC	75,185	12.63	949,586.55
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	10,332	29.00	299,628.00
TUI AG-DI	25,116	10.34	259,699.44
WHITBREAD PLC	8,382	37.42	313,654.44
WILLIAM HILL PLC	41,877	3.36	140,706.72
ITV PLC	177,733	2.39	424,781.87
PEARSON PLC	38,947	8.35	325,207.45
RELX PLC	51,390	13.02	669,097.80
SKY PLC	48,018	10.10	484,981.80
WPP PLC	60,331	16.48	994,254.88
DIXONS CARPHONE PLC	49,868	4.11	205,306.55
KINGFISHER PLC	104,645	3.73	390,639.78
MARKS & SPENCER GROUP PLC	80,284	4.37	351,403.06
NEXT PLC	6,615	53.75	355,556.25
SPORTS DIRECT INTERNATIONAL	11,278	3.88	43,769.91
SAINSBURY (J) PLC	64,189	2.85	183,452.16

TESCO PLC	382,885	1.96	751,603.25
WILLIAM MORRISON SUPERMARKETS PLC	114,809	2.01	230,995.70
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	17,085	33.18	566,880.30
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	86,466	41.67	3,603,470.55
COCA-COLA HBC AG-CDI	8,704	14.23	123,857.92
DIAGEO PLC	116,296	19.04	2,214,275.84
IMPERIAL BRANDS PLC	44,210	37.89	1,675,116.90
SABMILLER PLC	44,870	42.39	1,902,263.65
TATE & LYLE PLC	24,535	5.85	143,529.75
UNILEVER PLC	60,021	32.39	1,944,380.29
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	47,273	5.30	250,546.90
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	29,912	67.94	2,032,221.28
MEDICLINIC INTERNATIONAL PLC	20,802	9.38	195,122.76
SMITH & NEPHEW PLC	42,313	11.66	493,369.58
ASTRAZENECA PLC	58,913	40.57	2,390,100.41
GLAXOSMITHKLINE PLC	225,614	14.79	3,336,831.06
SHIRE PLC	27,626	42.43	1,172,171.18
BARCLAYS PLC	798,323	1.55	1,242,589.74
HSBC HOLDINGS PLC	909,044	4.20	3,818,893.84
LLOYDS BANKING GROUP PLC	2,662,779	0.66	1,774,475.92
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	157,044	2.16	340,471.39
STANDARD CHARTERED PLC	150,529	4.70	708,540.00
3I GROUP PLC	42,520	4.59	195,464.44
ABERDEEN ASSET MGMT PLC	49,855	2.75	137,500.09
HARGREAVES LANSDOWN PLC	11,178	13.37	149,449.86
ICAP PLC	27,845	4.56	127,028.89
INVESTEC PLC	24,264	5.00	121,320.00
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP PLC	14,510	27.90	404,829.00
PROVIDENT FINANCIAL PLC	7,000	29.88	209,160.00
SCHRODERS PLC	5,835	25.40	148,209.00
ADMIRAL GROUP PLC	10,760	19.42	208,959.20
AVIVA PLC	191,080	4.38	837,312.56
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	63,880	3.63	232,395.44
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	273,638	2.37	650,711.16
OLD MUTUAL PLC	223,346	1.89	423,017.32
PRUDENTIAL PLC	118,451	13.45	1,593,165.95
RSA INSURANCE GROUP PLC	49,032	4.73	231,921.36
ST JAMES'S PLACE PLC	26,198	9.08	238,008.83
STANDARD LIFE PLC	98,946	3.46	342,946.83
AUTO TRADER GROUP PLC	44,900	3.80	170,664.90
SAGE GROUP PLC/THE	47,258	6.27	296,543.95
WORLDPAY GROUP PLC	56,000	2.75	154,168.00

	BT GROUP PLC	394,887	4.44	1,754,680.38
	INMARSAT PLC	20,829	10.14	211,206.06
	VODAFONE GROUP PLC	1,230,315	2.26	2,786,663.47
	CENTRICA PLC	244,720	2.35	575,336.72
	NATIONAL GRID PLC	172,671	9.93	1,716,177.06
	SEVERN TRENT PLC	10,991	22.43	246,528.13
	SSE PLC	47,906	15.21	728,650.26
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	31,939	9.60	306,614.40
	ARM HOLDINGS PLC	64,682	10.26	663,637.32
	英ポンド 小計	13,577,717		74,137,193.15 (11,494,230,425)
スイスフラン	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	421	485.25	204,290.25
	GIVAUDAN-REG	440	1,938.00	852,720.00
	LAFARGEHOLCIM LTD	20,616	45.52	938,440.32
	SIKA AG	96	3,866.00	371,136.00
	SYNGENTA AG	4,387	402.10	1,764,012.70
	ABB LTD	102,973	18.87	1,943,100.51
	GEBERIT AG-REG	1,786	355.20	634,387.20
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	1,025	177.60	182,040.00
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	2,055	178.80	367,434.00
	SULZER AG	478	76.30	36,471.40
	ADECCO SA-REG	7,984	63.00	502,992.00
	SGS SA	252	2,091.00	526,932.00
	KUEHNE&NAGEL INTL AG-REG	2,501	137.20	343,137.20
	CIE FINANCIERE RICHEMONT SA-REGD A	23,917	60.95	1,457,741.15
	THE SWATCH GROUP AG-B	1,413	318.60	450,181.80
	THE SWATCH GROUP AG-REG	2,516	63.25	159,137.00
	DUFREY AG-REG	2,088	118.90	248,263.20
	ARYZTA AG	4,011	38.31	153,661.41
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	75	1,108.00	83,100.00
	LINDT & SPRUENGLI AG	45	6,075.00	273,375.00
	LINDT & SPRUENGLI AG-REG	5	72,485.00	362,425.00
	NESTLE SA-REGISTERED	148,594	70.15	10,423,869.10
	SONOVA HOLDING AG	2,594	128.70	333,847.80
	ACTELION LTD	4,637	149.10	691,376.70
	GALENICA AG-REG	170	1,493.00	253,810.00
	LONZA GROUP AG-REG	2,430	164.60	399,978.00
	NOVARTIS AG-REG SHS	106,192	71.75	7,619,276.00
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	32,764	243.90	7,991,139.60
	CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	83,165	13.42	1,116,074.30
	JULIUS BAER GROUP LTD	10,048	39.17	393,580.16
	PARGESA HOLDING SA-BR	1,867	63.00	117,621.00

	PARTNERS GROUP HOLDING AG	813	388.25	315,647.25	
	UBS GROUP AG	172,904	14.68	2,538,230.72	
	BALOISE HOLDING AG	2,242	122.90	275,541.80	
	SWISS LIFE HOLDING AG	1,572	253.50	398,502.00	
	SWISS RE AG	16,128	89.85	1,449,100.80	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	6,896	203.10	1,400,577.60	
	SWISS PRIME SITE-REG	2,983	86.75	258,775.25	
	SWISSCOM AG-REG	1,198	498.90	597,682.20	
	スイスフラン 小計	776,281		48,429,608.42 (5,506,930,773)	
スウェーデンク ローナ	LUNDIN PETROLEUM AB	9,278	136.10	1,262,735.80	
	BOLIDEN AB	12,521	129.50	1,621,469.50	
	ALFA LAVAL AB	13,757	128.50	1,767,774.50	
	ASSA ABLOY AB-B	46,371	160.30	7,433,271.30	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	30,896	204.90	6,330,590.40	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	18,623	192.20	3,579,340.60	
	SANDVIK AB	52,526	85.20	4,475,215.20	
	SKANSKA AB-B SHS	18,229	170.60	3,109,867.40	
	SKF AB-B SHARES	18,017	140.50	2,531,388.50	
	VOLVO AB-B SHS	69,481	88.70	6,162,964.70	
	SECURITAS AB-B SHS	16,445	134.50	2,211,852.50	
	ELECTROLUX AB-SER B	11,157	210.60	2,349,664.20	
	HUSQVARNA AB-B SHS	18,159	61.55	1,117,686.45	
	HENNES & MAURITZ AB-B SHS	45,336	288.80	13,093,036.80	
	ICA GRUPPEN AB	3,550	279.10	990,805.00	
	SWEDISH MATCH AB	8,874	282.90	2,510,454.60	
	SVENSKA CELLULOOSA AB-B SHS	27,897	255.10	7,116,524.70	
	GETINGE AB-B SHS	9,231	188.60	1,740,966.60	
	NORDEA BANK AB	138,782	76.40	10,602,944.80	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN AB-A	69,802	78.15	5,455,026.30	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	70,549	100.50	7,090,174.50	
	SWEDBANK AB - A SHARES	41,670	165.70	6,904,719.00	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	9,247	140.40	1,298,278.80	
	INVESTOR AB-B SHS	20,877	292.60	6,108,610.20	
	KINNEVIK INVESTMENT AB-B	11,257	229.20	2,580,104.40	
	ERICSSON LM-B SHS	143,702	80.45	11,560,825.90	
HEXAGON AB-B SHS	11,565	318.20	3,679,983.00		
MILLICOM INTL CELLULAR-SDR	3,357	445.50	1,495,543.50		
TELE2 AB-B SHS	13,516	73.80	997,480.80		
TELIASONERA AB	125,223	41.75	5,228,060.25		
	スウェーデンクローナ 小計	1,089,895		132,407,360.20 (1,776,906,773)	

ノルウェークローネ	STATOIL ASA	51,550	129.00	6,649,950.00	
	NORSK HYDRO ASA	67,630	32.42	2,192,564.60	
	YARA INTERNATIONAL ASA	8,259	310.70	2,566,071.30	
	SCHIBSTED ASA	3,623	221.40	802,132.20	
	SCIBSTED ASA-B SHS	4,063	213.10	865,825.30	
	ORKLA ASA	36,819	72.15	2,656,490.85	
	DNB ASA	45,573	97.80	4,457,039.40	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	9,626	133.70	1,286,996.20	
	TELENOR ASA	35,231	135.70	4,780,846.70	
ノルウェークローネ 小計		262,374		26,257,916.55 (348,705,131)	
デンマーククローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	4,400	424.60	1,868,240.00	
	NOVOZYMES A/S-B SHARES	11,427	285.70	3,264,693.90	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	10,326	451.70	4,664,254.20	
	ISS A/S	7,233	256.70	1,856,711.10	
	A P MOLLER-MAERSK A/S-A	178	8,335.00	1,483,630.00	
	A P MOLLER-MAERSK A/S-B	334	8,460.00	2,825,640.00	
	DSV A/S	8,652	274.00	2,370,648.00	
	PANDORA A/S	4,936	840.50	4,148,708.00	
	CARLSBERG AS-B	5,061	618.50	3,130,228.50	
	COLOPLAST-B	5,574	486.50	2,711,751.00	
	WILLIAM DEMANT HOLDING	1,329	657.50	873,817.50	
	GENMAB A/S	2,452	925.00	2,268,100.00	
	NOVO NORDISK A/S-B	90,882	364.20	33,099,224.40	
	DANSKE BANK A/S	32,814	174.10	5,712,917.40	
	TRYG A/S	5,005	125.90	630,129.50	
TDC A/S	39,176	31.81	1,246,188.56		
デンマーククローネ 小計		229,779		72,154,882.06 (1,198,492,591)	
オーストラリアドル	CALTEX AUSTRALIA LIMITED	12,366	34.23	423,288.18	
	OIL SEARCH LTD	63,482	6.53	414,537.46	
	ORIGIN ENERGY LIMITED	79,413	4.66	370,064.58	
	SANTOS LTD	77,838	3.93	305,903.34	
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	34,805	25.07	872,561.35	
	ALUMINA LTD	106,977	1.28	136,930.56	
	AMCOR LIMITED	51,549	14.61	753,130.89	
	BHP BILLITON LTD	151,035	16.90	2,552,491.50	
	BORAL LIMITED	36,380	6.33	230,285.40	
	FORTESCUE METALS GROUP LIMITED	68,421	2.96	202,526.16	
	ILUKA RESOURCES LIMITED	22,902	5.60	128,251.20	
	INCITEC PIVOT LTD	85,406	2.97	253,655.82	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	19,258	18.31	352,613.98	

NEWCREST MINING LIMITED	36,185	17.77	643,007.45
ORICA LIMITED	17,233	14.68	252,980.44
RIO TINTO LIMITED	19,122	45.33	866,800.26
SOUTH32 LTD	251,285	1.48	371,901.80
CIMIC GROUP LTD	4,188	35.41	148,297.08
BRAMBLES LIMITED	73,679	11.96	881,200.84
SEEK LIMITED	16,538	15.40	254,685.20
ASCIANO LTD	30,546	8.70	265,750.20
AURIZON HOLDINGS LTD	92,162	3.84	353,902.08
QANTAS AIRWAYS LIMITED	24,631	4.01	98,770.31
ARISTOCRAT LEISURE LTD	28,401	9.69	275,205.69
CROWN RESORTS LTD	16,142	11.42	184,341.64
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD	2,650	42.01	111,326.50
TABCORP HOLDINGS LIMITED	36,322	4.51	163,812.22
TATTS GROUP LTD	66,783	3.77	251,771.91
REA GROUP LTD	2,708	52.68	142,657.44
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	23,253	4.37	101,615.61
WESFARMERS LIMITED	52,853	39.53	2,089,279.09
WOOLWORTHS LIMITED	57,686	20.74	1,196,407.64
COCA-COLA AMATIL LIMITED	26,498	8.47	224,438.06
TREASURY WINE ESTATES LTD	38,653	9.00	347,877.00
COCHLEAR LIMITED	2,717	102.53	278,574.01
HEALTHSCOPE LTD	88,691	2.67	236,804.97
RAMSAY HEALTH CARE LTD	6,579	62.19	409,148.01
SONIC HEALTHCARE LTD	18,440	18.43	339,849.20
CSL LIMITED	21,651	100.00	2,165,100.00
AUST AND NZ BANKING GROUP LT	134,375	22.84	3,069,125.00
BANK OF QUEENSLAND LIMITED	17,851	11.00	196,361.00
BENDIGO AND ADELAIDE BANK	18,619	8.55	159,192.45
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	79,155	72.22	5,716,574.10
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	122,872	25.56	3,140,608.32
WESTPAC BANKING CORPORATION	153,810	29.13	4,480,485.30
ASX LTD	9,096	41.46	377,120.16
CHALLENGER FINANCIAL SERVICE	30,000	8.48	254,400.00
MACQUARIE GROUP LTD	14,650	62.86	920,899.00
PLATINUM ASSET MANAGEMENT	7,772	6.02	46,787.44
AMP LIMITED	139,602	5.49	766,414.98
INSURANCE AUSTRALIA GROUP LT	117,694	5.34	628,485.96
MEDIBANK PRIVATE LTD	115,915	2.95	341,949.25
QBE INSURANCE GROUP LIMITED	64,545	10.83	699,022.35
SUNCORP GROUP LTD	63,980	11.74	751,125.20
COMPUTERSHARE LIMITED	21,847	9.56	208,857.32

	VOCUS COMMUNICATIONS LTD	20,917	8.71	182,187.07	
	TELSTRA CORPORATION LIMITED	194,462	5.16	1,003,423.92	
	TPG TELECOM LTD	13,145	11.13	146,303.85	
	AGL ENERGY LIMITED	31,834	18.27	581,607.18	
	AUSNET SERVICES	85,220	1.48	126,125.60	
	オーストラリアドル 小計	3,322,789		43,448,800.52 (3,622,760,987)	
ニュージーランドドル	FLETCHER BUILDING LTD	34,160	7.73	264,056.80	
	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	45,835	6.37	291,968.95	
	RYMAN HEALTHCARE LIMITED	15,480	8.53	132,044.40	
	SPARK NEW ZEALAND LIMITED	82,677	3.47	286,889.19	
	CONTACT ENERGY LIMITED	35,357	4.96	175,370.72	
	MERIDIAN ENERGY LTD	46,571	2.67	124,344.57	
	MIGHTY RIVER POWER	40,157	2.85	114,447.45	
	ニュージーランドドル 小計	300,237		1,389,122.08 (104,587,001)	
香港ドル	NWS HOLDINGS LTD	67,500	11.80	796,500.00	
	CATHAY PACIFIC AIRWAYS	48,000	12.78	613,440.00	
	MTR CORPORATION	68,000	37.75	2,567,000.00	
	LI & FUNG LTD	267,200	4.68	1,250,496.00	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	64,500	30.60	1,973,700.00	
	YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	28,500	27.60	786,600.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LIMITED	115,000	27.70	3,185,500.00	
	MGM CHINA HOLDINGS LTD	44,000	11.52	506,880.00	
	SANDS CHINA LTD	112,000	29.40	3,292,800.00	
	SHANGRI-LA ASIA LTD.	64,000	9.22	590,080.00	
	SJM HOLDINGS LIMITED	92,000	5.30	487,600.00	
	WYNN MACAU LTD	78,000	12.54	978,120.00	
	WH GROUP LIMITED	257,000	5.91	1,518,870.00	
	BANK OF EAST ASIA	53,020	27.55	1,460,701.00	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	178,000	23.05	4,102,900.00	
	HANG SENG BANK LTD	35,400	135.40	4,793,160.00	
	CHEUNG KONG PROPERTY HOLDING	131,924	49.75	6,563,219.00	
	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	126,924	97.60	12,387,782.40	
	FIRST PACIFIC COMPANY	86,000	4.92	423,120.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEARING LIMITED	54,500	188.00	10,246,000.00	
	AIA GROUP LTD	557,600	43.45	24,227,720.00	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	105,000	14.52	1,524,600.00	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	56,232	48.45	2,724,440.40	
HYSAN DEVELOPMENT CO	29,000	32.85	952,650.00		
KERRY PROPERTIES LTD	27,500	21.20	583,000.00		
NEW WORLD DEVELOPMENT	259,333	7.57	1,963,150.81		



	SINO LAND CO	124,200	12.30	1,527,660.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	82,000	94.80	7,773,600.00	
	SWIRE PACIFIC LTD 'A'	25,000	84.45	2,111,250.00	
	SWIRE PROPERTIES LIMITED	51,400	20.55	1,056,270.00	
	WHARF HOLDINGS LTD	65,000	41.75	2,713,750.00	
	WHEELOK&COMPANY LTD	46,000	34.65	1,593,900.00	
	PCCW LIMITED	236,000	5.20	1,227,200.00	
	CHEUNG KONG INFRASTRUCTURE	32,000	74.50	2,384,000.00	
	CLP HOLDINGS LTD	88,600	70.95	6,286,170.00	
	HK ELECTRIC INVESTMENTS-SS	99,000	6.95	688,050.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	319,074	14.52	4,632,954.48	
	POWER ASSETS HOLDINGS LIMITED	66,500	78.95	5,250,175.00	
	ASM PACIFIC TECHNOLOGY	12,200	62.65	764,330.00	
	香港ドル 小計	4,253,107		128,509,339.09 (1,800,415,840)	
シンガポールドル	KEPPEL CORP LTD	65,600	5.79	379,824.00	
	NOBLE GROUP LTD	245,400	0.42	104,295.00	
	SEMBCORP INDUSTRIES LTD	42,020	2.88	121,017.60	
	SEMBCORP MARINE LTD	37,100	1.55	57,690.50	
	SINGAPORE TECHNOLOGIES ENG	64,400	3.21	206,724.00	
	YANGZIJIANG SHIPBUILDING HOLDINGS LTD	90,000	0.95	85,500.00	
	COMFORTDELGRO CORP LTD	107,000	2.81	300,670.00	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	24,266	11.32	274,691.12	
	GENTING SINGAPORE PLC	258,200	0.82	213,015.00	
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	78,350	3.99	312,616.50	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	5,500	39.83	219,065.00	
	GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	353,600	0.40	143,208.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	85,700	3.41	292,237.00	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	81,000	15.08	1,221,480.00	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	144,200	8.86	1,277,612.00	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	59,700	18.70	1,116,390.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	38,700	7.73	299,151.00	
	CAPITALAND LTD	122,300	3.03	370,569.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	21,000	8.68	182,280.00	
	GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES LIMITED	128,000	1.94	248,960.00	
	UOL GROUP LIMITED	16,100	5.82	93,702.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	382,915	3.69	1,412,956.35	
	STARHUB LIMITED	24,500	3.30	80,850.00	
	シンガポールドル 小計	2,475,551		9,014,504.07 (728,462,073)	
イスラエルシュケル	DELEK GROUP LTD	213	621.00	132,273.00	
	ISRAEL CHEMICALS LIMITED	20,822	16.18	336,899.96	

TEVA PHARMACEUTICAL IND LTD	42,286	208.50	8,816,631.00
BANK HAPOLIM BM	53,151	19.38	1,030,066.38
BANK LEUMI LE-ISRAEL	64,754	13.64	883,244.56
MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	4,453	42.65	189,920.45
AZRIELI GROUP	1,863	150.10	279,636.30
NICE SYSTEMS LTD	2,554	232.70	594,315.80
BEZEQ ISRAELI TELECOMMUNICATION CORP LTD	96,068	8.28	795,443.04
イスラエルシュケル 小計	286,164		13,058,430.49 (376,735,719)
合 計	56,401,314		143,907,141,807 (143,907,141,807)

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

通貨	銘柄数	組入株式時価比率	合計金額に対する比率
米ドル	株式 602銘柄	61.1%	64.9%
カナダドル	株式 90銘柄	3.7%	3.9%
ユーロ	株式 234銘柄	11.7%	12.5%
英ポンド	株式 108銘柄	7.5%	8.0%
スイスフラン	株式 39銘柄	3.6%	3.8%
スウェーデンクローナ	株式 30銘柄	1.2%	1.2%
ノルウェークローネ	株式 9銘柄	0.2%	0.2%
デンマーククローネ	株式 16銘柄	0.8%	0.8%
オーストラリアドル	株式 60銘柄	2.4%	2.5%
ニュージーランドドル	株式 7銘柄	0.1%	0.1%
香港ドル	株式 39銘柄	1.2%	1.3%
シンガポールドル	株式 23銘柄	0.5%	0.5%
イスラエルシュケル	株式 9銘柄	0.2%	0.3%

(b) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	米ドル	AMERICAN CAPITAL AGENCY CORP	15,293	286,284.96	
		AMERICAN TOWER CORP	19,734	2,095,158.78	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	45,539	471,784.04	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	6,240	1,158,206.40	
		BOSTON PROPERTIES INC	7,225	933,470.00	
		BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	7,861	202,577.97	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	4,186	345,386.86	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	6,689	611,374.60	
		DUKE REALTY CORP	16,643	373,801.78	
		EQUITY RESIDENTIAL	16,955	1,226,863.80	

	ESSEX PROPERTY TRUST INC	3,011	688,465.15
	EXTRA SPACE STORAGE INC	5,203	479,352.39
	FEDERAL REALTY INVESTMENT TRUST	3,095	482,479.55
	GENERAL GROWTH PROPERTIES	26,153	761,575.36
	HCP, INC.	21,687	758,611.26
	HOST HOTELS AND RESORTS INC	34,373	545,155.78
	HUTCHISON PORT HOLDINGS TRUST	283,000	138,670.00
	IRON MOUNTAIN INC	9,338	309,648.08
	KIMCO REALTY CORPORATION	19,336	553,589.68
	LIBERTY PROPERTY TRUST	7,065	238,655.70
	MACERICH COMPANY/THE	6,260	494,978.20
	MID-AMERICA APARTMENT COMMUNITIES	3,800	386,840.00
	PROLOGIS INC	23,826	1,047,629.22
	PUBLIC STORAGE	6,764	1,867,946.24
	REALTY INCOME CORPORATION	11,331	722,237.94
	REGENCY CENTERS CORP	4,147	311,356.76
	SIMON PROPERTY GROUP INC	14,456	3,008,438.16
	SL GREEN REALTY CORP	4,650	460,815.00
	UDR INC	12,366	456,305.40
	VENTAS INC	15,512	981,289.12
	VEREIT INC	41,004	370,676.16
	VORNADO REALTY TRUST	7,967	771,922.63
	WELLTOWER INC	16,318	1,140,301.84
	米ドル 小計	727,027	24,681,848.81 (2,682,176,510)
カナダドル	H&R REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	4,711	100,344.30
	RIOCAN REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	6,847	182,951.84
	SMART REAL ESTATE INVESTMENT	2,057	68,271.83
	カナダドル 小計	13,615	351,567.97 (29,900,855)
ユーロ	FONCIERE DES REGIONS	1,550	129,533.50
	GECINA SA	1,519	187,520.55
	ICADE	1,873	125,228.78
	KLEPIERRE	10,809	455,383.17
	UNIBAIL-RODAMCO SE	4,575	1,094,568.75
	ユーロ 小計	20,326	1,992,234.75 (246,260,137)
英ポンド	BRITISH LAND CO PLC	42,823	305,542.10
	HAMMERSON PLC	37,833	222,647.20
	INTU PROPERTIES PLC	38,514	120,086.65
	LAND SECURITIES GROUP PLC	35,900	402,439.00

	SEGRO PLC	36,381	157,093.15
英ポンド 小計		191,451	1,207,808.10 (187,258,567)
オーストラリアドル	APA GROUP	53,427	454,663.77
	DEXUS PROPERTY GROUP	42,722	343,484.88
	DUET GROUP	95,542	214,014.08
	GOODMAN GROUP	83,175	553,945.50
	GPT GROUP	90,527	452,635.00
	LENLEASE GROUP	27,382	362,537.68
	MIRVAC GROUP	186,000	357,120.00
	SCENTRE GROUP	257,708	1,151,954.76
	STOCKLAND	107,141	459,634.89
	SYDNEY AIRPORT	54,494	367,289.56
	TRANSURBAN GROUP	94,148	1,052,574.64
	VICINITY CENTRES	149,882	479,622.40
	WESTFIELD CORP	91,040	907,668.80
オーストラリアドル 小計		1,333,188	7,157,145.96 (596,762,830)
香港ドル	HKT TRUST AND HKT LTD	121,000	1,282,600.00
	LINK REIT	103,000	4,815,250.00
香港ドル 小計		224,000	6,097,850.00 (85,430,878)
シンガポールドル	ASCENDAS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	109,000	263,780.00
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	120,300	170,826.00
	CAPITALAND MALL TRUST	130,700	277,084.00
	SUNTEC REIT	101,400	168,831.00
シンガポールドル 小計		461,400	880,521.00 (71,154,902)
合計			3,898,944,679 (3,898,944,679)

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

通貨	銘柄数	組入投資証券 時価比率	合計金額に対する比率
米ドル	投資証券 33銘柄	1.8%	68.8%
カナダドル	投資証券 3銘柄	0.0%	0.8%
ユーロ	投資証券 5銘柄	0.2%	6.3%
英ポンド	投資証券 5銘柄	0.1%	4.8%
オーストラリアドル	投資証券 13銘柄	0.4%	15.3%
香港ドル	投資証券 2銘柄	0.1%	2.2%
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27年 4月13日現在）	（平成28年 4月13日現在）
資産の部		
流動資産		
預金	1,615,611,196	364,120,525
金銭信託	-	221,166,178
コール・ローン	605,884,226	-
国債証券	219,609,148,881	174,826,593,847
未収利息	2,148,927,713	1,675,906,330
前払費用	41,657,715	37,008,522
流動資産合計	224,021,229,731	177,124,795,402
資産合計	224,021,229,731	177,124,795,402
負債の部		
流動負債		
未払解約金	8,965,916	24,126,508
流動負債合計	8,965,916	24,126,508
負債合計	8,965,916	24,126,508
純資産の部		
元本等		
元本	125,043,526,611	105,056,343,629
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	98,968,737,204	72,044,325,265
元本等合計	224,012,263,815	177,100,668,894
純資産合計	224,012,263,815	177,100,668,894
負債純資産合計	224,021,229,731	177,124,795,402

## 注記表

（重要な会計方針の注記）

項 目	自 平成27年 4月14日 至 平成28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27年 4月13日現在)	(平成28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	125,043,526,611口	105,056,343,629口
2. 1単位当たり純資産の額	<p>1口当たり純資産額 1.7915円</p> <p>(10,000口当たりの純資産額 17,915円)</p>	<p>1口当たり純資産額 1.6858円</p> <p>(10,000口当たりの純資産額 16,858円)</p>

## (金融商品に関する注記)

## . 金融商品の状況に関する事項

項目	自 平成27年 4月14日 至 平成28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	(1) 金融商品の内容

<p>リスク</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 (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>
<p>3.金融商品に係るリスク管理体制</p>	<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>
<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>	<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

<p>項 目</p>	<p>（平成28年 4月13日現在）</p>
------------	------------------------

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V A 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V A 2 5 < 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V A 3 7 . 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V A 5 0 < 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V L 3 0 < 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V L 5 0 < 適格機関投資家限定 >	146,797,016円
世界6資産バランスファンドV A < 適格機関投資家限定 >	21,671,502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 >	1,237,314,867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 >	159,073,863円
S M A M ・ インデックス・バランスV A 2 5 < 適格機関投資家専用 >	1,612,883,781円
S M A M ・ インデックス・バランスV A 5 0 < 適格機関投資家専用 >	2,198,003,467円
S M A M ・ バランスファンドV A 4 0 < 適格機関投資家専用 >	5,789,035,437円
S M A M ・ バランスファンドV A 3 5 < 適格機関投資家専用 >	9,961,740,547円
S M A M ・ バランスV A 株 4 0 T < 適格機関投資家限定 >	263,669,995円
S M A M ・ 外国債券パッシブファンドV A < 適格機関投資家限定 >	15,486,398,825円
三井住友・外国債券インデックスファンド・V A S（適格機関投資家専用）	1,411,829,039円
三井住友・5資産バランスファンド・V A S（適格機関投資家専用）	5,379,673,135円
S M A M ・ グローバルバランス4 0 V A < 適格機関投資家限定 >	260,229,467円
S M A M ・ バランスファンドV A 2 0 < 適格機関投資家専用 >	994,065,637円
三井住友・7資産バランスファンド・V A S（適格機関投資家専用）	4,357,348,453円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 2 0 A < 適格機関投資家専用 >	190,485,869円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 3 5 A < 適格機関投資家専用 >	58,078,380円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 5 0 A < 適格機関投資家専用 >	17,987,803円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 2 0 L < 適格機関投資家専用 >	229,155,570円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 2 5 L < 適格機関投資家専用 >	777,765,012円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 2 0 T < 適格機関投資家専用 >	240,753,259円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 2 0 A 2 < 適格機関投資家専用 >	218,323,031円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 3 5 A 2 < 適格機関投資家専用 >	66,979,503円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 5 0 A 2 < 適格機関投資家専用 >	6,846,199円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 2 5 L 2 < 適格機関投資家専用 >	1,933,111,705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 >	36,528,257円
S M A M ・ F G 新興国重視型バランス2 0 V A < 適格機関投資家限定 >	2,955,013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 >	29,783,109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 >	74,550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 >	76,976円
合計	125,043,526,611円

(平成28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	125,043,526,611円
同期中における追加設定元本額	6,823,302,530円
同期中における一部解約元本額	26,810,485,512円
平成28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	7,346,160,970円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	288,409,692円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	857,455,684円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	442,434,229円
SMAM・グローバルバランスファンド(機動的資産配分型)	51,016,068円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2020	8,544,101円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2025	21,533,883円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2030	58,678,871円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2035	36,813,376円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2040	20,804,114円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2045	43,801,378円
三井住友・DC年金バランスゼロ(債券型)	1,199,855円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	109,412,792円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	186,889,135円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	251,038,011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>	1,494,949,025円
SMAM・バランスファンドVA安定成長型<適格機関投資家限定>	3,821,555,609円
SMAM・バランスファンドVA25<適格機関投資家専用>	19,243,724,359円
SMAM・バランスファンドVA37.5<適格機関投資家専用>	7,379,971,636円
SMAM・バランスファンドVA50<適格機関投資家専用>	16,312,945,354円
SMAM・バランスファンドVL30<適格機関投資家限定>	45,968,708円
SMAM・バランスファンドVL50<適格機関投資家限定>	130,038,973円
世界6資産バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	13,644,843円
SMAM・バランスファンドVA75<適格機関投資家専用>	939,503,001円
SMAM・バランスファンドVL国際分散型<適格機関投資家限定>	142,165,035円
SMAM・インデックス・バランスVA25<適格機関投資家専用>	1,513,583,466円
SMAM・インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用>	1,924,991,258円
SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用>	4,909,027,048円
SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>	9,047,341,588円
SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定>	150,974,873円
SMAM・外国債券パッシブファンドVA<適格機関投資家限定>	14,447,331,155円
三井住友・外国債券インデックスファンド・VAS(適格機関投資家専用)	1,248,309,934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)	4,140,231,510円
SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	244,324,035円
SMAM・バランスファンドVA20<適格機関投資家専用>	861,343,324円
三井住友・7資産バランスファンド・VAS(適格機関投資家専用)	3,639,387,901円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>	185,069,203円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>	52,811,680円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用>	16,896,401円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>	209,180,765円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	717,216,112円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T<適格機関投資家専用>	226,773,526円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A2<適格機関投資家専用>	203,301,882円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A2<適格機関投資家専用>	57,130,687円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A2<適格機関投資家専用>	6,475,605円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L2<適格機関投資家専用>	1,767,576,019円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T2<適格機関投資家専用>	27,895,415円
SMAM・FG新興国重視型バランス20VA<適格機関投資家限定>	2,078,450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 >	14,227,327円
S M A M ・ 年金Wリスクコントロールファンド < 適格機関投資家限定 >	395,826円
S M A M ・ マルチアセットストラテジーファンド 2 0 1 6 - 0 1 < 適格機関投資家限定 >	193,809,937円
合計	105,056,343,629円

## 附属明細表

## 有価証券明細表

## (a) 株式

該当事項はありません。

## (b) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	米ドル	US TREASURY N/B 0.5	4,000,000.00	3,990,625.00	
		US TREASURY N/B 0.625	5,000,000.00	4,998,828.15	
		US TREASURY N/B 0.625	4,000,000.00	3,995,625.00	
		US TREASURY N/B 0.625	3,000,000.00	2,995,781.25	
		US TREASURY N/B 0.625	5,000,000.00	4,990,429.70	
		US TREASURY N/B 0.625	3,000,000.00	2,990,859.39	
		US TREASURY N/B 0.75	5,000,000.00	5,005,078.15	
		US TREASURY N/B 0.75	1,000,000.00	1,000,234.38	
		US TREASURY N/B 0.75	2,000,000.00	1,999,921.88	
		US TREASURY N/B 0.75	5,000,000.00	4,999,609.40	
		US TREASURY N/B 0.75	3,000,000.00	2,999,296.89	
		US TREASURY N/B 0.75	4,000,000.00	3,997,812.52	
		US TREASURY N/B 0.75	2,000,000.00	1,992,968.76	
		US TREASURY N/B 0.875	4,000,000.00	4,010,625.00	
		US TREASURY N/B 0.875	5,000,000.00	5,013,671.90	
		US TREASURY N/B 0.875	3,000,000.00	3,007,500.00	
		US TREASURY N/B 0.875	3,000,000.00	3,007,734.39	
		US TREASURY N/B 0.875	4,000,000.00	4,008,437.52	
		US TREASURY N/B 0.875	4,000,000.00	4,008,437.52	
		US TREASURY N/B 0.875	2,000,000.00	2,004,453.12	
		US TREASURY N/B 0.875	3,000,000.00	3,004,687.50	
		US TREASURY N/B 0.875	2,000,000.00	2,001,718.76	
		US TREASURY N/B 1	5,000,000.00	5,020,312.50	
		US TREASURY N/B 1	4,000,000.00	4,015,937.52	
		US TREASURY N/B 1	2,000,000.00	2,008,281.26	
		US TREASURY N/B 1	4,000,000.00	4,017,500.00	

US TREASURY N/B 1	2,000,000.00	2,008,750.00	
US TREASURY N/B 1	3,000,000.00	3,012,421.89	
US TREASURY N/B 1	3,000,000.00	3,007,031.25	
US TREASURY N/B 1	4,000,000.00	4,005,625.00	
US TREASURY N/B 1	2,000,000.00	2,002,187.50	
US TREASURY N/B 1	6,000,000.00	5,997,656.28	
US TREASURY N/B 1.125	2,000,000.00	2,014,375.00	
US TREASURY N/B 1.125	2,000,000.00	2,013,593.76	
US TREASURY N/B 1.125	4,000,000.00	4,011,562.52	
US TREASURY N/B 1.125	2,800,000.00	2,805,906.26	
US TREASURY N/B 1.125	3,000,000.00	3,003,750.00	
US TREASURY N/B 1.125	1,800,000.00	1,793,390.63	
US TREASURY N/B 1.25	3,000,000.00	3,030,468.75	
US TREASURY N/B 1.25	3,000,000.00	3,030,468.75	
US TREASURY N/B 1.25	3,000,000.00	3,031,406.25	
US TREASURY N/B 1.25	4,000,000.00	4,042,812.52	
US TREASURY N/B 1.25	2,000,000.00	2,021,406.26	
US TREASURY N/B 1.25	2,000,000.00	2,017,187.50	
US TREASURY N/B 1.25	3,000,000.00	3,020,156.25	
US TREASURY N/B 1.375	4,000,000.00	4,051,875.00	
US TREASURY N/B 1.375	4,500,000.00	4,560,468.75	
US TREASURY N/B 1.375	5,000,000.00	5,069,140.65	
US TREASURY N/B 1.375	2,000,000.00	2,027,968.76	
US TREASURY N/B 1.375	5,000,000.00	5,070,312.50	
US TREASURY N/B 1.375	4,000,000.00	4,047,500.00	
US TREASURY N/B 1.375	2,000,000.00	2,022,343.76	
US TREASURY N/B 1.375	4,000,000.00	4,044,375.00	
US TREASURY N/B 1.375	4,000,000.00	4,042,187.52	
US TREASURY N/B 1.375	3,000,000.00	3,031,406.25	
US TREASURY N/B 1.375	2,000,000.00	2,019,218.76	
US TREASURY N/B 1.375	3,000,000.00	3,026,250.00	
US TREASURY N/B 1.375	3,000,000.00	3,025,546.89	
US TREASURY N/B 1.375	3,000,000.00	3,022,968.75	
US TREASURY N/B 1.5	5,000,000.00	5,081,250.00	
US TREASURY N/B 1.5	4,700,000.00	4,781,148.46	
US TREASURY N/B 1.5	3,000,000.00	3,053,906.25	
US TREASURY N/B 1.5	3,000,000.00	3,051,093.75	
US TREASURY N/B 1.5	2,000,000.00	2,030,468.76	
US TREASURY N/B 1.5	3,000,000.00	3,019,453.14	
US TREASURY N/B 1.5	2,000,000.00	1,995,781.26	
US TREASURY N/B 1.625	5,000,000.00	5,107,421.90	
US TREASURY N/B 1.625	4,000,000.00	4,085,625.00	

US TREASURY N/B 1.625	3,000,000.00	3,065,859.39
US TREASURY N/B 1.625	2,000,000.00	2,043,593.76
US TREASURY N/B 1.625	3,000,000.00	3,065,390.64
US TREASURY N/B 1.625	2,000,000.00	2,042,343.76
US TREASURY N/B 1.625	2,000,000.00	2,040,000.00
US TREASURY N/B 1.625	3,000,000.00	3,060,000.00
US TREASURY N/B 1.625	3,000,000.00	3,060,468.75
US TREASURY N/B 1.625	3,000,000.00	3,031,171.89
US TREASURY N/B 1.625	3,500,000.00	3,530,351.58
US TREASURY N/B 1.625	4,000,000.00	3,942,500.00
US TREASURY N/B 1.75	1,000,000.00	1,023,437.50
US TREASURY N/B 1.75	2,300,000.00	2,357,320.32
US TREASURY N/B 1.75	2,000,000.00	2,049,687.50
US TREASURY N/B 1.75	3,000,000.00	3,059,531.25
US TREASURY N/B 1.75	2,500,000.00	2,547,460.95
US TREASURY N/B 1.75	3,000,000.00	3,056,953.14
US TREASURY N/B 1.75	3,000,000.00	3,053,203.14
US TREASURY N/B 1.75	3,000,000.00	3,048,046.89
US TREASURY N/B 1.75	3,000,000.00	3,043,359.39
US TREASURY N/B 1.75	5,000,000.00	5,070,703.15
US TREASURY N/B 1.875	3,000,000.00	3,048,046.89
US TREASURY N/B 1.875	6,000,000.00	6,100,781.28
US TREASURY N/B 1.875	6,000,000.00	6,105,000.00
US TREASURY N/B 1.875	3,000,000.00	3,093,046.89
US TREASURY N/B 1.875	3,000,000.00	3,084,375.00
US TREASURY N/B 1.875	3,000,000.00	3,077,812.50
US TREASURY N/B 1.875	2,000,000.00	2,048,593.76
US TREASURY N/B 1.875	3,000,000.00	3,070,078.14
US TREASURY N/B 2	3,000,000.00	3,106,875.00
US TREASURY N/B 2	2,300,000.00	2,383,554.69
US TREASURY N/B 2	4,000,000.00	4,144,687.52
US TREASURY N/B 2	3,000,000.00	3,109,687.50
US TREASURY N/B 2	2,000,000.00	2,073,281.26
US TREASURY N/B 2	3,000,000.00	3,106,875.00
US TREASURY N/B 2	3,000,000.00	3,104,296.89
US TREASURY N/B 2	3,000,000.00	3,104,062.50
US TREASURY N/B 2	3,100,000.00	3,209,953.12
US TREASURY N/B 2	3,000,000.00	3,097,265.64
US TREASURY N/B 2	5,000,000.00	5,155,468.75
US TREASURY N/B 2	5,500,000.00	5,671,015.62
US TREASURY N/B 2	7,000,000.00	7,154,218.75
US TREASURY N/B 2	7,000,000.00	7,139,453.16
US TREASURY N/B 2.125	3,500,000.00	3,643,007.83

US TREASURY N/B 2.125	4,000,000.00	4,171,562.52	
US TREASURY N/B 2.125	2,000,000.00	2,085,312.50	
US TREASURY N/B 2.125	5,000,000.00	5,210,937.50	
US TREASURY N/B 2.125	3,000,000.00	3,125,859.39	
US TREASURY N/B 2.125	4,000,000.00	4,165,000.00	
US TREASURY N/B 2.125	3,000,000.00	3,120,937.50	
US TREASURY N/B 2.125	7,000,000.00	7,223,125.00	
US TREASURY N/B 2.25	3,000,000.00	3,073,125.00	
US TREASURY N/B 2.25	2,000,000.00	2,065,156.26	
US TREASURY N/B 2.25	4,000,000.00	4,195,000.00	
US TREASURY N/B 2.25	2,000,000.00	2,097,968.76	
US TREASURY N/B 2.25	2,000,000.00	2,097,968.76	
US TREASURY N/B 2.25	6,000,000.00	6,259,687.50	
US TREASURY N/B 2.25	6,500,000.00	6,769,140.62	
US TREASURY N/B 2.375	4,000,000.00	4,086,562.52	
US TREASURY N/B 2.375	2,000,000.00	2,069,843.76	
US TREASURY N/B 2.375	2,000,000.00	2,107,187.50	
US TREASURY N/B 2.375	7,000,000.00	7,377,890.66	
US TREASURY N/B 2.5	3,000,000.00	3,066,093.75	
US TREASURY N/B 2.5	4,000,000.00	4,265,625.00	
US TREASURY N/B 2.5	7,000,000.00	7,452,812.50	
US TREASURY N/B 2.5	3,500,000.00	3,422,343.75	
US TREASURY N/B 2.5	3,300,000.00	3,226,523.45	
US TREASURY N/B 2.625	4,000,000.00	4,133,125.00	
US TREASURY N/B 2.625	2,000,000.00	2,076,406.26	
US TREASURY N/B 2.625	4,000,000.00	4,248,750.00	
US TREASURY N/B 2.625	5,500,000.00	5,851,054.71	
US TREASURY N/B 2.75	5,000,000.00	5,117,578.15	
US TREASURY N/B 2.75	4,000,000.00	4,135,625.00	
US TREASURY N/B 2.75	3,000,000.00	3,158,906.25	
US TREASURY N/B 2.75	6,200,000.00	6,721,187.50	
US TREASURY N/B 2.75	5,000,000.00	5,420,312.50	
US TREASURY N/B 2.75	2,000,000.00	2,073,750.00	
US TREASURY N/B 2.75	11,000,000.00	11,386,718.75	
US TREASURY N/B 2.875	3,000,000.00	3,123,984.39	
US TREASURY N/B 2.875	4,000,000.00	4,221,875.00	
US TREASURY N/B 3	2,800,000.00	3,047,406.26	
US TREASURY N/B 3	4,000,000.00	4,329,687.52	
US TREASURY N/B 3	4,000,000.00	4,327,187.52	
US TREASURY N/B 3	3,000,000.00	3,248,203.14	
US TREASURY N/B 3.125	4,000,000.00	4,104,375.00	
US TREASURY N/B 3.125	2,000,000.00	2,136,250.00	

US TREASURY N/B 3.125	5,000,000.00	5,461,718.75
US TREASURY N/B 3.125	2,000,000.00	2,231,093.76
US TREASURY N/B 3.125	2,500,000.00	2,786,132.82
US TREASURY N/B 3.125	4,000,000.00	4,439,062.52
US TREASURY N/B 3.25	4,000,000.00	4,102,187.52
US TREASURY N/B 3.375	5,000,000.00	5,417,578.15
US TREASURY N/B 3.375	4,000,000.00	4,651,562.52
US TREASURY N/B 3.5	2,500,000.00	2,625,976.57
US TREASURY N/B 3.5	2,500,000.00	2,738,476.57
US TREASURY N/B 3.5	2,000,000.00	2,386,562.50
US TREASURY N/B 3.625	5,000,000.00	5,434,765.65
US TREASURY N/B 3.625	6,000,000.00	6,582,656.28
US TREASURY N/B 3.625	5,000,000.00	5,564,453.15
US TREASURY N/B 3.625	6,000,000.00	7,307,812.50
US TREASURY N/B 3.625	3,000,000.00	3,651,328.14
US TREASURY N/B 3.75	3,000,000.00	3,225,234.39
US TREASURY N/B 3.75	2,000,000.00	2,471,250.00
US TREASURY N/B 3.75	3,000,000.00	3,736,875.00
US TREASURY N/B 3.875	6,000,000.00	6,394,687.50
US TREASURY N/B 3.875	2,000,000.00	2,514,375.00
US TREASURY N/B 4	2,500,000.00	2,691,406.25
US TREASURY N/B 4.25	3,000,000.00	3,165,234.39
US TREASURY N/B 4.25	2,000,000.00	2,655,937.50
US TREASURY N/B 4.375	1,200,000.00	1,626,843.75
US TREASURY N/B 4.375	1,500,000.00	2,024,062.50
US TREASURY N/B 4.375	1,500,000.00	2,024,765.62
US TREASURY N/B 4.375	2,000,000.00	2,707,968.76
US TREASURY N/B 4.5	3,000,000.00	3,124,921.89
US TREASURY N/B 4.5	1,500,000.00	2,064,609.37
US TREASURY N/B 4.5	1,000,000.00	1,377,890.63
US TREASURY N/B 4.5	1,000,000.00	1,372,578.13
US TREASURY N/B 4.625	3,000,000.00	4,189,687.50
US TREASURY N/B 4.75	3,000,000.00	3,161,484.39
US TREASURY N/B 4.75	1,500,000.00	2,137,031.25
US TREASURY N/B 5.25	1,000,000.00	1,369,218.75
US TREASURY N/B 5.25	500,000.00	687,031.25
US TREASURY N/B 5.375	1,320,000.00	1,893,890.63
US TREASURY N/B 5.5	500,000.00	696,015.62
US TREASURY N/B 6	1,000,000.00	1,382,968.75
US TREASURY N/B 6.125	1,000,000.00	1,442,265.63
US TREASURY N/B 6.25	800,000.00	1,062,125.00
US TREASURY N/B 6.25	1,000,000.00	1,526,015.63
US TREASURY N/B 6.5	500,000.00	726,484.37

	US TREASURY N/B 8	1,300,000.00	1,768,000.00	
	US TREASURY N/B 8.75	1,000,000.00	1,088,281.25	
	US TREASURY N/B 8.75	1,000,000.00	1,322,265.63	
	US TREASURY N/B 8.875	1,100,000.00	1,349,562.50	
	米ドル 小計	651,520,000.00	684,207,439.01 (74,352,822,397)	
カナダドル	CANADA-GOV'T 0.25	1,000,000.00	994,950.00	
	CANADA-GOV'T 0.75	1,000,000.00	1,002,350.00	
	CANADA-GOV'T 0.75	1,000,000.00	1,000,449.00	
	CANADA-GOV'T 1.25	2,000,000.00	2,017,140.00	
	CANADA-GOV'T 1.25	2,000,000.00	2,024,860.00	
	CANADA-GOV'T 1.25	1,000,000.00	1,015,690.00	
	CANADA-GOV'T 1.5	1,000,000.00	1,008,100.00	
	CANADA-GOV'T 1.5	1,000,000.00	1,012,490.00	
	CANADA-GOV'T 1.5	2,000,000.00	2,055,240.00	
	CANADA-GOV'T 1.75	1,000,000.00	1,032,670.00	
	CANADA-GOV'T 1.75	1,000,000.00	1,037,120.00	
	CANADA-GOV'T 2.25	1,000,000.00	1,081,600.00	
	CANADA-GOV'T 2.5	2,000,000.00	2,198,480.00	
	CANADA-GOV'T 2.75	1,000,000.00	1,108,300.00	
	CANADA-GOV'T 3.25	1,000,000.00	1,122,540.00	
	CANADA-GOV'T 3.5	2,000,000.00	2,227,220.00	
	CANADA-GOV'T 3.5	1,500,000.00	2,001,750.00	
	CANADA-GOV'T 3.75	2,500,000.00	2,742,750.00	
	CANADA-GOV'T 4	2,000,000.00	2,076,940.00	
	CANADA-GOV'T 4	3,000,000.00	4,167,090.00	
	CANADA-GOV'T 4.25	1,500,000.00	1,616,250.00	
	CANADA-GOV'T 5	1,500,000.00	2,274,495.00	
	CANADA-GOV'T 5.75	1,500,000.00	2,216,745.00	
	CANADA-GOV'T 5.75	1,500,000.00	2,347,440.00	
	CANADA-GOV'T 8	500,000.00	833,055.00	
	カナダドル 小計	36,500,000.00	42,215,714.00 (3,590,446,475)	
メキシコペソ	MEXICAN BONOS 6.5	30,000,000.00	31,603,410.00	
	MEXICAN BONOS 7.25	20,000,000.00	20,420,540.00	
	MEXICAN BONOS 7.75	20,000,000.00	21,199,300.00	
	MEXICAN BONOS 8	50,000,000.00	55,399,300.00	
	MEXICAN BONOS 8	20,000,000.00	22,898,900.00	
	MEXICAN BONOS 8.5	50,000,000.00	60,574,050.00	
	MEXICAN BONOS 8.5	40,000,000.00	49,039,160.00	
	メキシコペソ 小計	230,000,000.00	261,134,660.00 (1,621,646,238)	



ユーロ

BELGIAN 0326 4	1,000,000.00	1,432,800.00
BELGIAN 0.8	2,000,000.00	2,067,760.00
BELGIAN 0291 5.5	2,000,000.00	3,094,800.00
BELGIAN 0300 5.5	740,000.00	804,676.00
BELGIAN 0304 5	2,500,000.00	4,117,750.00
BELGIAN 0308 4	1,500,000.00	1,869,900.00
BELGIAN 0312 4	1,000,000.00	1,088,200.00
BELGIAN 0315 4	1,500,000.00	1,697,700.00
BELGIAN 0318 3.75	2,000,000.00	2,361,860.00
BELGIAN 0320 4.25	1,500,000.00	2,404,170.00
BELGIAN 0321 4.25	1,700,000.00	2,112,675.00
BELGIAN 0323 3.5	2,000,000.00	2,095,800.00
BELGIAN 0324 4.5	1,000,000.00	1,393,900.00
BELGIAN 0325 4.25	2,000,000.00	2,556,000.00
BELGIAN 0327 3	1,000,000.00	1,116,930.00
BELGIAN 0328 2.25	1,000,000.00	1,157,150.00
BELGIAN 0329 1.25	1,000,000.00	1,037,800.00
BELGIAN 0332 2.6	2,000,000.00	2,383,800.00
BELGIAN 0333 3	500,000.00	647,800.00
BELGIAN 1.9	1,000,000.00	1,097,450.00
BELGIAN 3.75	1,000,000.00	1,528,400.00
BTAN 1	2,500,000.00	2,546,825.00
BTPS 0.3	1,000,000.00	1,006,370.00
BTPS 0.75	1,000,000.00	1,013,130.00
BTPS 1.05	1,000,000.00	1,031,380.00
BTPS 1.15	2,000,000.00	2,025,600.00
BTPS 1.35	2,000,000.00	2,077,960.00
BTPS 1.5	2,000,000.00	2,035,200.00
BTPS 2	1,000,000.00	1,056,450.00
BTPS 2.15	2,000,000.00	2,173,460.00
BTPS 2.5	1,000,000.00	1,072,750.00
BTPS 2.5	2,000,000.00	2,204,400.00
BTPS 2.7	1,000,000.00	1,037,980.00
BTPS 3.25	1,500,000.00	1,743,270.00
BTPS 3.5	1,000,000.00	1,054,150.00
BTPS 3.5	3,400,000.00	3,651,872.00
BTPS 3.5	2,000,000.00	2,181,860.00
BTPS 3.5	1,000,000.00	1,213,050.00
BTPS 3.75	3,000,000.00	3,480,090.00
BTPS 3.75	2,000,000.00	2,326,260.00
BTPS 3.75	3,300,000.00	3,858,525.00
BTPS 3.75	2,000,000.00	2,402,260.00
BTPS 4	3,500,000.00	4,059,825.00

BTPS 4	3,000,000.00	3,888,690.00	
BTPS 4.25	2,400,000.00	2,680,920.00	
BTPS 4.25	3,500,000.00	3,982,230.00	
BTPS 4.25	3,300,000.00	3,813,876.00	
BTPS 4.5	4,000,000.00	4,322,720.00	
BTPS 4.5	3,000,000.00	3,308,640.00	
BTPS 4.5	2,700,000.00	3,043,629.00	
BTPS 4.5	2,700,000.00	3,138,021.00	
BTPS 4.5	1,800,000.00	2,242,350.00	
BTPS 4.5	2,000,000.00	2,510,160.00	
BTPS 4.5	2,000,000.00	2,571,800.00	
BTPS 4.75	1,000,000.00	1,050,100.00	
BTPS 4.75	2,000,000.00	2,108,000.00	
BTPS 4.75	2,600,000.00	3,181,828.00	
BTPS 4.75	2,500,000.00	3,170,450.00	
BTPS 4.75	2,000,000.00	2,686,640.00	
BTPS 4.75	1,000,000.00	1,464,600.00	
BTPS 5	2,000,000.00	2,500,200.00	
BTPS 5	3,000,000.00	3,934,140.00	
BTPS 5	2,470,000.00	3,579,771.00	
BTPS 5	2,000,000.00	2,963,600.00	
BTPS 5	2,500,000.00	3,699,500.00	
BTPS 5.25	3,000,000.00	3,205,500.00	
BTPS 5.25	3,700,000.00	5,255,850.00	
BTPS 5.5	2,500,000.00	3,235,825.00	
BTPS 5.5	2,500,000.00	3,244,825.00	
BTPS 5.75	2,200,000.00	3,389,276.00	
BTPS 6	4,100,000.00	6,311,458.00	
BTPS 6.5	2,960,000.00	4,472,412.00	
BTPS 7.25	1,000,000.00	1,561,330.00	
BTPS 9	1,000,000.00	1,576,900.00	
BUNDESUBL-163 0.5	1,000,000.00	1,009,980.00	
BUNDESUBL-164 0.5	2,000,000.00	2,030,760.00	
BUNDESUBL-165 0.5	2,000,000.00	2,038,100.00	
BUNDESUBL-166 0.25	2,000,000.00	2,031,100.00	
BUNDESUBL-167 1	2,000,000.00	2,076,540.00	
BUNDESUBL-168 1	1,000,000.00	1,043,630.00	
BUNDESUBL-169 0.5	1,000,000.00	1,030,580.00	
BUNDESUBL-170 0.25	1,000,000.00	1,026,330.00	
BUNDESUBL-171 0	1,000,000.00	1,018,570.00	
BUNDESUBL-172 0.25	2,000,000.00	2,061,200.00	
DEUTSCHLAND REP 0.5	2,000,000.00	2,082,560.00	

DEUTSCHLAND REP 0.5	1,000,000.00	1,032,780.00
DEUTSCHLAND REP 1	2,000,000.00	2,174,260.00
DEUTSCHLAND REP 1	2,000,000.00	2,167,460.00
DEUTSCHLAND REP 1.5	2,500,000.00	2,786,450.00
DEUTSCHLAND REP 1.5	1,500,000.00	1,678,575.00
DEUTSCHLAND REP 1.5	2,000,000.00	2,243,300.00
DEUTSCHLAND REP 1.5	2,000,000.00	2,256,700.00
DEUTSCHLAND REP 1.75	2,500,000.00	2,820,825.00
DEUTSCHLAND REP 1.75	2,000,000.00	2,293,160.00
DEUTSCHLAND REP 2	2,000,000.00	2,269,460.00
DEUTSCHLAND REP 2	1,500,000.00	1,740,600.00
DEUTSCHLAND REP 2.25	1,500,000.00	1,679,850.00
DEUTSCHLAND REP 2.25	2,000,000.00	2,284,960.00
DEUTSCHLAND REP 2.5	2,000,000.00	2,278,000.00
DEUTSCHLAND REP 2.5	2,200,000.00	3,114,650.00
DEUTSCHLAND REP 2.5	1,000,000.00	1,432,330.00
DEUTSCHLAND REP 3	3,000,000.00	3,441,300.00
DEUTSCHLAND REP 3.25	3,000,000.00	3,421,740.00
DEUTSCHLAND REP 3.25	2,000,000.00	2,382,260.00
DEUTSCHLAND REP 3.25	1,500,000.00	2,361,045.00
DEUTSCHLAND REP 3.5	4,000,000.00	4,520,000.00
DEUTSCHLAND REP 3.75	3,500,000.00	3,909,255.00
DEUTSCHLAND REP 4	3,000,000.00	3,235,650.00
DEUTSCHLAND REP 4	2,200,000.00	3,593,216.00
DEUTSCHLAND REP 4.25	2,000,000.00	2,117,100.00
DEUTSCHLAND REP 4.25	3,200,000.00	3,541,696.00
DEUTSCHLAND REP 4.25	1,500,000.00	2,609,175.00
DEUTSCHLAND REP 4.75	1,300,000.00	1,999,374.00
DEUTSCHLAND REP 4.75	2,100,000.00	3,599,232.00
DEUTSCHLAND REP 4.75	1,400,000.00	2,625,140.00
DEUTSCHLAND REP 5.5	1,800,000.00	3,086,010.00
DEUTSCHLAND REP 5.625	1,580,000.00	2,564,308.40
DEUTSCHLAND REP 6.25	1,200,000.00	1,795,680.00
DEUTSCHLAND REP 6.25	1,000,000.00	1,789,750.00
DEUTSCHLAND REP 6.5	1,000,000.00	1,700,130.00
FINNISH GOV'T 1.625	1,000,000.00	1,108,750.00
FINNISH GOV'T 2	1,000,000.00	1,144,730.00
FINNISH GOV'T 2.625	500,000.00	680,625.00
FINNISH GOV'T 2.75	600,000.00	751,158.00
FINNISH GOV'T 3.375	1,200,000.00	1,378,956.00
FINNISH GOV'T 3.5	1,000,000.00	1,187,380.00
FINNISH GOV'T 3.875	1,000,000.00	1,062,100.00
FINNISH GOV'T 4	1,000,000.00	1,337,150.00

FRANCE O.A.T. 0	2,000,000.00	2,022,960.00	
FRANCE O.A.T. 0.5	2,000,000.00	2,060,760.00	
FRANCE O.A.T. 0.5	3,000,000.00	3,035,340.00	
FRANCE O.A.T. 1	3,000,000.00	3,091,440.00	
FRANCE O.A.T. 1	1,000,000.00	1,037,150.00	
FRANCE O.A.T. 1	1,000,000.00	1,042,800.00	
FRANCE O.A.T. 1	3,000,000.00	3,156,540.00	
FRANCE O.A.T. 1.5	1,000,000.00	1,070,300.00	
FRANCE O.A.T. 1.75	3,000,000.00	3,359,310.00	
FRANCE O.A.T. 1.75	3,000,000.00	3,374,310.00	
FRANCE O.A.T. 2.25	2,800,000.00	3,213,420.00	
FRANCE O.A.T. 2.25	3,000,000.00	3,497,940.00	
FRANCE O.A.T. 2.5	4,500,000.00	5,062,860.00	
FRANCE O.A.T. 2.5	3,000,000.00	3,632,700.00	
FRANCE O.A.T. 2.75	3,000,000.00	3,693,000.00	
FRANCE O.A.T. 3	4,000,000.00	4,746,200.00	
FRANCE O.A.T. 3.25	3,800,000.00	4,515,540.00	
FRANCE O.A.T. 3.25	1,700,000.00	2,398,360.00	
FRANCE O.A.T. 3.5	5,000,000.00	5,770,150.00	
FRANCE O.A.T. 3.5	4,000,000.00	5,187,600.00	
FRANCE O.A.T. 3.75	3,000,000.00	3,130,290.00	
FRANCE O.A.T. 3.75	5,000,000.00	5,728,000.00	
FRANCE O.A.T. 3.75	3,700,000.00	4,439,334.00	
FRANCE O.A.T. 4	4,000,000.00	4,362,320.00	
FRANCE O.A.T. 4	2,700,000.00	4,095,360.00	
FRANCE O.A.T. 4	1,370,000.00	2,286,557.40	
FRANCE O.A.T. 4	1,500,000.00	2,540,670.00	
FRANCE O.A.T. 4.25	4,500,000.00	4,826,250.00	
FRANCE O.A.T. 4.25	4,000,000.00	4,475,720.00	
FRANCE O.A.T. 4.25	4,400,000.00	5,021,632.00	
FRANCE O.A.T. 4.25	4,000,000.00	5,248,720.00	
FRANCE O.A.T. 4.5	2,700,000.00	4,480,110.00	
FRANCE O.A.T. 4.75	3,100,000.00	4,981,793.00	
FRANCE O.A.T. 5.5	3,500,000.00	5,544,525.00	
FRANCE O.A.T. 5.75	3,200,000.00	5,503,360.00	
FRANCE O.A.T. 6	2,500,000.00	3,824,450.00	
FRANCE O.A.T. 8.5	850,000.00	1,117,665.00	
FRANCE O.A.T. 8.5	1,200,000.00	1,915,440.00	
IRISH GOVT 2	1,000,000.00	1,031,600.00	
IRISH GOVT 3.4	1,000,000.00	1,213,850.00	
IRISH GOVT 3.9	1,000,000.00	1,239,630.00	
IRISH GOVT 4.4	1,000,000.00	1,146,350.00	

IRISH GOVT 4.5	1,000,000.00	1,121,850.00
IRISH GOVT 4.5	1,490,000.00	1,765,828.80
IRISH GOVT 5	1,000,000.00	1,227,100.00
IRISH GOVT 5.4	1,500,000.00	2,090,550.00
IRISH GOVT 5.5	500,000.00	544,325.00
IRISH GOVT 5.9	800,000.00	970,224.00
NETHERLANDS GOVT 0	1,000,000.00	1,009,170.00
NETHERLANDS GOVT 0.25	1,000,000.00	1,025,000.00
NETHERLANDS GOVT 0.25	1,000,000.00	998,700.00
NETHERLANDS GOVT 0.5	1,000,000.00	1,010,120.00
NETHERLANDS GOVT 0.5	500,000.00	505,375.00
NETHERLANDS GOVT 1.25	1,500,000.00	1,545,795.00
NETHERLANDS GOVT 1.25	2,000,000.00	2,094,860.00
NETHERLANDS GOVT 1.75	2,200,000.00	2,481,336.00
NETHERLANDS GOVT 2	2,000,000.00	2,307,960.00
NETHERLANDS GOVT 2.25	2,000,000.00	2,302,460.00
NETHERLANDS GOVT 2.5	1,100,000.00	1,401,928.00
NETHERLANDS GOVT 2.75	500,000.00	727,525.00
NETHERLANDS GOVT 3.25	1,500,000.00	1,779,825.00
NETHERLANDS GOVT 3.5	2,000,000.00	2,332,700.00
NETHERLANDS GOVT 3.75	1,000,000.00	1,261,500.00
NETHERLANDS GOVT 3.75	2,000,000.00	3,298,260.00
NETHERLANDS GOVT 4	1,500,000.00	1,651,920.00
NETHERLANDS GOVT 4	1,500,000.00	1,718,370.00
NETHERLANDS GOVT 4	1,200,000.00	1,924,380.00
NETHERLANDS GOVT 4.5	2,000,000.00	2,125,500.00
NETHERLANDS GOVT 5.5	1,500,000.00	2,366,295.00
REP OF AUSTRIA 1.2	500,000.00	538,375.00
REP OF AUSTRIA 1.65	1,000,000.00	1,121,350.00
REP OF AUSTRIA 1.75	1,000,000.00	1,126,430.00
REP OF AUSTRIA 1.95	1,000,000.00	1,074,850.00
REP OF AUSTRIA 3.15	500,000.00	726,625.00
REP OF AUSTRIA 3.4	1,000,000.00	1,228,430.00
REP OF AUSTRIA 3.5	2,000,000.00	2,404,540.00
REP OF AUSTRIA 3.65	1,000,000.00	1,227,830.00
REP OF AUSTRIA 3.8	500,000.00	912,715.00
REP OF AUSTRIA 3.9	2,000,000.00	2,362,460.00
REP OF AUSTRIA 4.15	1,300,000.00	2,041,754.00
REP OF AUSTRIA 4.3	1,500,000.00	1,602,450.00
REP OF AUSTRIA 4.35	1,200,000.00	1,367,700.00
REP OF AUSTRIA 4.65	1,000,000.00	1,090,450.00
REP OF AUSTRIA 4.85	1,000,000.00	1,432,630.00
REP OF AUSTRIA 6.25	1,000,000.00	1,628,080.00

	SPANISH GOV'T 0.5	1,000,000.00	1,008,050.00	
	SPANISH GOV'T 1.4	2,000,000.00	2,083,900.00	
	SPANISH GOV'T 1.6	2,000,000.00	2,037,000.00	
	SPANISH GOV'T 1.95	500,000.00	519,836.50	
	SPANISH GOV'T 1.95	1,000,000.00	999,800.00	
	SPANISH GOV'T 2.1	2,000,000.00	2,045,160.00	
	SPANISH GOV'T 2.15	2,000,000.00	2,120,660.00	
	SPANISH GOV'T 2.75	1,000,000.00	1,078,330.00	
	SPANISH GOV'T 2.75	3,000,000.00	3,338,790.00	
	SPANISH GOV'T 3.75	2,200,000.00	2,406,756.00	
	SPANISH GOV'T 3.8	2,000,000.00	2,387,160.00	
	SPANISH GOV'T 4	3,000,000.00	3,439,950.00	
	SPANISH GOV'T 4.1	3,000,000.00	3,278,640.00	
	SPANISH GOV'T 4.2	2,050,000.00	2,643,372.50	
	SPANISH GOV'T 4.3	3,000,000.00	3,430,710.00	
	SPANISH GOV'T 4.4	1,000,000.00	1,239,130.00	
	SPANISH GOV'T 4.5	2,500,000.00	2,702,500.00	
	SPANISH GOV'T 4.6	3,500,000.00	4,005,050.00	
	SPANISH GOV'T 4.65	2,000,000.00	2,557,700.00	
	SPANISH GOV'T 4.7	1,500,000.00	2,086,770.00	
	SPANISH GOV'T 4.8	3,000,000.00	3,815,790.00	
	SPANISH GOV'T 4.85	2,000,000.00	2,397,800.00	
	SPANISH GOV'T 4.9	1,500,000.00	2,133,570.00	
	SPANISH GOV'T 5.15	1,500,000.00	2,053,020.00	
	SPANISH GOV'T 5.15	1,000,000.00	1,494,700.00	
	SPANISH GOV'T 5.4	2,000,000.00	2,595,160.00	
	SPANISH GOV'T 5.5	3,380,000.00	3,622,684.00	
	SPANISH GOV'T 5.5	2,000,000.00	2,498,300.00	
	SPANISH GOV'T 5.75	2,200,000.00	3,318,150.00	
	SPANISH GOV'T 5.85	2,500,000.00	3,243,575.00	
	SPANISH GOV'T 5.9	1,500,000.00	2,114,070.00	
	SPANISH GOV'T 6	2,400,000.00	3,534,600.00	
	ユーロ 小計	476,890,000.00	582,889,365.60 (72,050,954,481)	
英bond	TREASURY 1	3,300,000.00	3,327,093.00	
	TREASURY 1.25	1,500,000.00	1,527,525.00	
	TREASURY 1.75	1,000,000.00	1,037,350.00	
	TREASURY 1.75	3,000,000.00	3,133,350.00	
	TREASURY 2	1,000,000.00	1,053,820.00	
	TREASURY 2.25	2,700,000.00	2,900,286.00	
	TREASURY 2.75	2,000,000.00	2,222,600.00	
	TREASURY 3.25	2,000,000.00	2,380,020.00	

	TREASURY 3.5	1,500,000.00	1,866,705.00
	TREASURY 3.5	1,000,000.00	1,403,550.00
	TREASURY 3.75	3,000,000.00	3,329,610.00
	TREASURY 3.75	2,800,000.00	3,176,180.00
	TREASURY 3.75	2,400,000.00	2,767,824.00
	TREASURY 3.75	2,300,000.00	3,162,960.00
	TREASURY 4	1,500,000.00	1,769,310.00
	TREASURY 4	2,000,000.00	3,024,600.00
	TREASURY 4.25	1,300,000.00	1,661,413.00
	TREASURY 4.25	2,000,000.00	2,619,900.00
	TREASURY 4.25	2,000,000.00	2,663,760.00
	TREASURY 4.25	1,500,000.00	2,034,225.00
	TREASURY 4.25	2,000,000.00	2,737,240.00
	TREASURY 4.25	1,900,000.00	2,716,753.00
	TREASURY 4.25	1,900,000.00	2,792,677.00
	TREASURY 4.25	2,100,000.00	3,244,500.00
	TREASURY 4.5	2,700,000.00	3,019,221.00
	TREASURY 4.5	2,500,000.00	3,402,000.00
	TREASURY 4.5	2,000,000.00	2,876,860.00
	TREASURY 4.75	2,700,000.00	3,132,837.00
	TREASURY 4.75	1,800,000.00	2,457,720.00
	TREASURY 4.75	1,500,000.00	2,164,305.00
	TREASURY 5	2,500,000.00	2,723,115.00
	TREASURY 5	2,500,000.00	3,269,250.00
	TREASURY 6	1,200,000.00	1,795,848.00
	TREASURY 8	1,620,000.00	2,208,335.40
	TREASURY 8.75	800,000.00	892,000.00
	UNITED KINGDOM G 2	1,500,000.00	1,573,755.00
	英bond 小計	71,020,000.00	88,068,497.40 (13,654,139,836)
スイスフラン	SWISS (GOVT) 2.25	900,000.00	1,021,590.00
	SWISS (GOVT) 3	500,000.00	534,250.00
	SWISS (GOVT) 3	1,000,000.00	1,123,900.00
	SWISS (GOVT) 4	500,000.00	662,050.00
	SWISS (GOVT) 4	700,000.00	1,060,850.00
	SWISS (GOVT) 4.25	500,000.00	529,350.00
	スイスフラン 小計	4,100,000.00	4,931,990.00 (560,816,582)
スウェーデンクローナ	SWEDISH GOVRNMNT 1.5	8,000,000.00	8,676,960.00
	SWEDISH GOVRNMNT 2.5	5,000,000.00	5,870,250.00
	SWEDISH GOVRNMNT 3.5	11,000,000.00	13,235,750.00
	SWEDISH GOVRNMNT 3.5	6,000,000.00	8,072,940.00
	SWEDISH GOVRNMNT 3.75	8,200,000.00	8,679,700.00

	SWEDISH GOVRNMNT 4.25	12,000,000.00	13,650,720.00
	SWEDISH GOVRNMNT 5	5,000,000.00	6,191,000.00
スウェーデンクローナ 小計		55,200,000.00	64,377,320.00 (863,943,634)
ノルウェークローネ	NORWEGIAN GOV'T 2	10,000,000.00	10,722,000.00
	NORWEGIAN GOV'T 3	4,000,000.00	4,593,600.00
	NORWEGIAN GOV'T 3.75	11,000,000.00	12,659,900.00
	NORWEGIAN GOV'T 4.25	6,000,000.00	6,248,580.00
	NORWEGIAN GOV'T 4.5	6,000,000.00	6,748,800.00
ノルウェークローネ 小計		37,000,000.00	40,972,880.00 (544,119,846)
デンマーククローネ	DENMARK - BULLET 1.5	5,000,000.00	5,533,500.00
	DENMARK - BULLET 1.75	5,000,000.00	5,654,500.00
	DENMARK - BULLET 3	10,000,000.00	11,791,000.00
	DENMARK - BULLET 4	5,000,000.00	5,352,900.00
	DENMARK - BULLET 4	8,000,000.00	9,260,000.00
	DENMARK - BULLET 4.5	14,000,000.00	24,495,800.00
	DENMARK - BULLET 7	3,080,000.00	4,887,652.00
デンマーククローネ 小計		50,080,000.00	66,975,352.00 (1,112,460,596)
ポーランドズロチ	POLAND GOVT BOND 2.5	5,000,000.00	5,105,000.00
	POLAND GOVT BOND 3.25	2,000,000.00	2,080,000.00
	POLAND GOVT BOND 4	2,000,000.00	2,189,000.00
	POLAND GOVT BOND 5.25	5,000,000.00	5,286,000.00
	POLAND GOVT BOND 5.25	2,000,000.00	2,268,000.00
	POLAND GOVT BOND 5.5	4,000,000.00	4,488,000.00
	POLAND GOVT BOND 5.75	4,000,000.00	4,688,000.00
	POLAND GOVT BOND 5.75	4,200,000.00	5,019,126.00
	POLAND GOVT BOND 5.75	2,000,000.00	2,525,800.00
ポーランドズロチ 小計		30,200,000.00	33,648,926.00 (970,435,025)
オーストラリアドル	AUSTRALIAN GOVT. 2.75	1,000,000.00	1,026,600.00
	AUSTRALIAN GOVT. 2.75	3,000,000.00	3,087,282.00
	AUSTRALIAN GOVT. 2.75	1,000,000.00	1,011,400.00
	AUSTRALIAN GOVT. 2.75	1,000,000.00	954,600.00
	AUSTRALIAN GOVT. 3.25	2,000,000.00	2,063,300.00
	AUSTRALIAN GOVT. 3.25	2,000,000.00	2,130,400.00
	AUSTRALIAN GOVT. 3.25	1,500,000.00	1,585,050.00
	AUSTRALIAN GOVT. 3.75	1,000,000.00	1,100,000.00
	AUSTRALIAN GOVT. 4.25	2,000,000.00	2,056,600.00
	AUSTRALIAN GOVT. 4.25	2,000,000.00	2,306,000.00
	AUSTRALIAN GOVT. 4.5	3,000,000.00	3,297,138.00
	AUSTRALIAN GOVT. 4.5	1,500,000.00	1,816,500.00



	AUSTRALIAN GOVT. 4.75	1,200,000.00	1,455,240.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 5.25	3,000,000.00	3,287,100.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 5.5	2,000,000.00	2,122,800.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 5.5	2,500,000.00	3,014,750.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 5.75	3,000,000.00	3,527,250.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 5.75	2,000,000.00	2,407,300.00	
	オーストラリアドル 小計	34,700,000.00	38,249,310.00 (3,189,227,467)	
シンガポールドル	SINGAPORE GOV'T 2.25	500,000.00	518,580.00	
	SINGAPORE GOV'T 2.75	400,000.00	424,400.00	
	SINGAPORE GOV'T 2.875	400,000.00	430,860.00	
	SINGAPORE GOV'T 3.125	1,000,000.00	1,087,500.00	
	SINGAPORE GOV'T 3.25	1,000,000.00	1,084,500.00	
	SINGAPORE GOV'T 3.375	500,000.00	573,780.00	
	SINGAPORE GOV'T 3.5	1,500,000.00	1,716,000.00	
	SINGAPORE GOV'T 4	2,100,000.00	2,254,350.00	
	シンガポールドル 小計	7,400,000.00	8,089,970.00 (653,750,475)	
マレーシアリングgit	MALAYSIA GOVT 3.418	8,000,000.00	7,904,000.00	
	MALAYSIA GOVT 3.502	9,000,000.00	8,492,580.00	
	MALAYSIA GOVT 3.814	2,000,000.00	2,019,962.00	
	MALAYSIA GOVT 4.24	5,000,000.00	5,106,535.00	
	MALAYSIA GOVT 4.262	3,000,000.00	3,024,513.00	
	MALAYSIA GOVT 4.378	5,000,000.00	5,157,370.00	
	マレーシアリングgit 小計	32,000,000.00	31,704,960.00 (893,762,822)	
南アフリカランド	REP SOUTH AFRICA 6.5	40,000,000.00	26,736,000.00	
	REP SOUTH AFRICA 6.75	30,000,000.00	27,678,000.00	
	REP SOUTH AFRICA 7	40,000,000.00	31,592,000.00	
	REP SOUTH AFRICA 8	10,000,000.00	9,919,500.00	
	REP SOUTH AFRICA 8.25	8,000,000.00	8,007,920.00	
	南アフリカランド 小計	128,000,000.00	103,933,420.00 (768,067,973)	
	合計		174,826,593,847 (174,826,593,847)	

(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 200銘柄	42.0%	42.5%
カナダドル	国債証券 25銘柄	2.0%	2.1%
メキシコペソ	国債証券 7銘柄	0.9%	0.9%
ユーロ	国債証券 245銘柄	40.7%	41.2%

英ポンド	国債証券	36銘柄	7.7%	7.8%
スイスフラン	国債証券	6銘柄	0.3%	0.3%
スウェーデンクローナ	国債証券	7銘柄	0.5%	0.5%
ノルウェークローネ	国債証券	5銘柄	0.3%	0.3%
デンマーククローネ	国債証券	7銘柄	0.6%	0.6%
ポーランドズロチ	国債証券	9銘柄	0.5%	0.6%
オーストラリアドル	国債証券	18銘柄	1.8%	1.8%
シンガポールドル	国債証券	8銘柄	0.4%	0.4%
マレーシアリングgit	国債証券	6銘柄	0.5%	0.5%
南アフリカランド	国債証券	5銘柄	0.4%	0.4%

### デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

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27年 4月13日現在） （平成28年 4月13日現在）

資産の部		
流動資産		
金銭信託	-	473,493,536
コール・ローン	62,085,901	-
国債証券	1,452,000,920	432,382,400
特殊債券	-	405,524,000
未収利息	3,179,725	2,563,481
前払費用	1,181,231	-
流動資産合計	1,518,447,777	1,313,963,417
資産合計	1,518,447,777	1,313,963,417
負債の部		
流動負債		
未払解約金	19,837,424	7,000,713
流動負債合計	19,837,424	7,000,713
負債合計	19,837,424	7,000,713
純資産の部		
元本等		
元本	1,480,579,600	1,290,985,957
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	18,030,753	15,976,747
元本等合計	1,498,610,353	1,306,962,704
純資産合計	1,498,610,353	1,306,962,704
負債純資産合計	1,518,447,777	1,313,963,417

#### 注記表

（重要な会計方針の注記）

項目	自 平成27年 4月14日 至 平成28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、特殊債券は個別法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>

## (貸借対照表に関する注記)

項目	(平成27年 4月13日現在)	(平成28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	1,480,579,600口	1,290,985,957口
2. 1単位当たり純資産の額	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)	1口当たり純資産額 1.0124円 (10,000口当たりの純資産額 10,124円)

## (金融商品に関する注記)

## . 金融商品の状況に関する事項

項目	自 平成27年 4月14日 至 平成28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、特殊債券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p>

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

#### ・金融商品の時価等に関する事項

項目	(平成28年 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、特殊債券）</p> <p>「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）</p> <p>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</p> <p>これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

## （デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

## （関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

## （その他の注記）

（平成27年 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
日興ニューバークー米国小型ハイクオリティファンド（毎月決算型）	99,128円
日興ニューバーク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

（平成28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	1,480,579,600円
同期中における追加設定元本額	716,376,125円
同期中における一部解約元本額	905,969,768円
平成28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）	33,626,531円

スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2020	28,312,486円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2025	8,934,284円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2030	9,209,457円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2035	5,723,760円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2040	3,286,242円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2045	6,937,555円
米国小型ハイクオリティファンド(毎月決算型)	99,128円
米国小型ハイクオリティファンド(資産成長型)	297,384円
S M A M ・ マネーインカムファンド<適格機関投資家限定>	432,140,183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>	485,731,667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>	276,687,280円
合計	1,290,985,957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98回利付国債(5年)	40,000,000	40,028,400	
	第280回利付国債(10年)	190,000,000	190,684,000	
	第283回利付国債(10年)	200,000,000	201,670,000	
国債証券合計		430,000,000	432,382,400	
特殊債券	第16回政府保証日本政策投資銀行債券	200,000,000	203,160,000	
	第23回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,203,000	
	第19回政府保証国民生活債券	100,000,000	101,161,000	
特殊債券合計		400,000,000	405,524,000	
合計			837,906,400	

### 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】

スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2020

平成28年 4月28日現在

資産総額	133,181,638円
負債総額	24,671円
純資産総額（ - ）	133,156,967円
発行済口数	108,812,910口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2237円
（1万口当たり純資産額）	（12,237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28年 4月28日現在
資本金の額	2,000百万円
会社が発行する株式の総数	60,000株
発行済株式総数	17,640株

###### ロ 最近5年間における資本金の額の増減 該当ありません。

##### 八 会社の機構

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

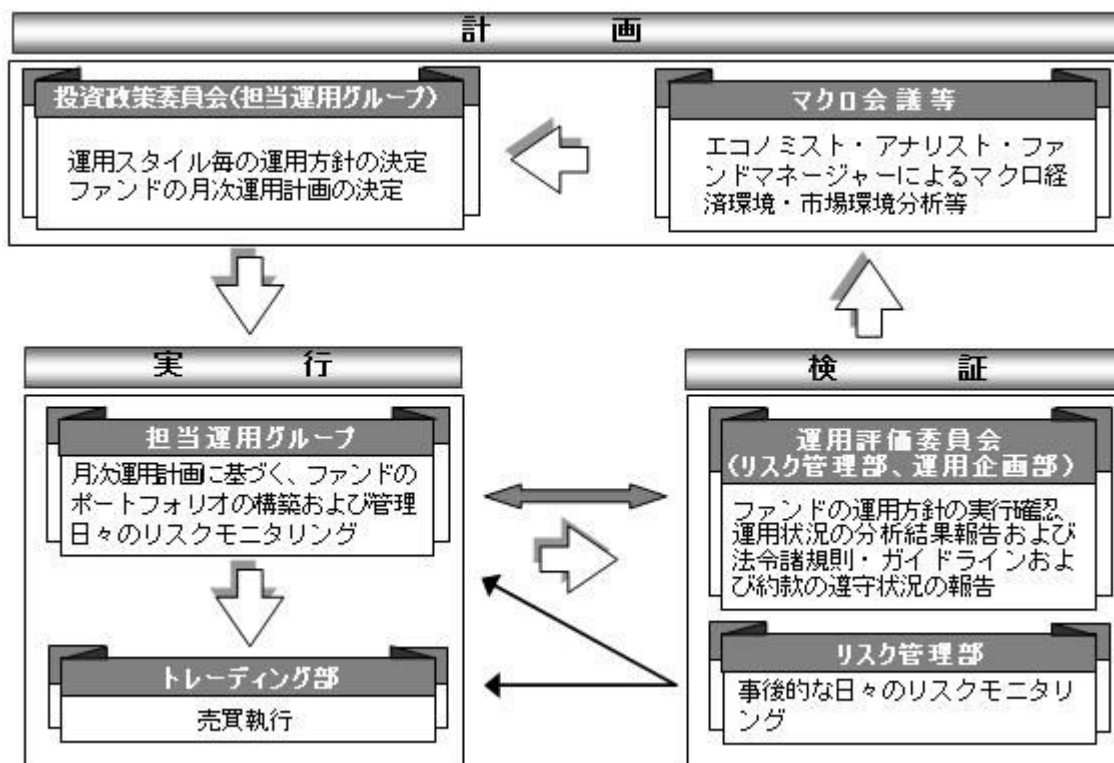
取締役の任期は、選任後1年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会の終結の時までとし、補欠または増員によって選任された取締役の任期は、他の現任取締役の任期の満了する時までとします。

委託会社の業務上重要な事項は、取締役会の決議により決定します。

取締役会は、取締役会の決議によって、代表取締役を若干名を選定します。

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

##### 二 投資信託の運用の流れ



## 2【事業の内容及び営業の概況】

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

平成28年4月28日現在、委託会社が運用を行っている投資信託（親投資信託は除きます）は、以下の通りです。

（平成28年 4月28日現在）

		本 数(本)	純資産総額(百万円)
株式投資信託	単位型	52 ( 14 )	144,300 ( 55,222 )
	追加型	471 ( 195 )	5,035,988 ( 2,788,703 )
	計	523 ( 209 )	5,180,288 ( 2,843,925 )
公社債投資信託	単位型	60 ( 60 )	295,060 ( 295,060 )
	追加型	1 ( 0 )	26,379 ( 0 )
	計	61 ( 60 )	321,438 ( 295,060 )
合 計		584 ( 269 )	5,501,726 ( 3,138,985 )

（ ）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27年4月1日から平成28年3月31日まで）の財務諸表については、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、有限責任 あずさ監査法人の監査を受けております。

## (1)【貸借対照表】

(単位：千円)

		前事業年度 (平成27年3月31日)	当事業年度 (平成28年3月31日)
資産の部			
流動資産			
現金及び預金	2	25,021,336	10,857,507
顧客分別金信託		-	20,006
前払費用		291,119	324,934
未収入金		41,860	81,347
未収委託者報酬		4,897,032	5,418,116
未収運用受託報酬		1,000,744	1,635,461
未収投資助言報酬		455,390	382,911
未収収益		13,030	28,813

繰延税金資産		475,859	494,032
その他の流動資産		52,473	6,226
流動資産合計		32,248,847	19,249,357
固定資産			
有形固定資産	1		
建物		120,234	154,246
器具備品		230,712	240,748
有形固定資産合計		350,947	394,995
無形固定資産			
ソフトウェア		497,668	449,034
ソフトウェア仮勘定		77,155	146,452
電話加入権		91	79
商標権		222	60
無形固定資産合計		575,137	595,627
投資その他の資産			
投資有価証券		7,151,933	13,115,106
関係会社株式		509,146	10,412,523
長期差入保証金		600,480	603,625
長期前払費用		36,031	32,533
会員権		17,299	17,299
繰延税金資産		665,425	750,481
投資その他の資産合計		8,980,317	24,931,569
固定資産合計		9,906,402	25,922,192
資産合計		42,155,249	45,171,549

(単位：千円)

	前事業年度 (平成27年3月31日)	当事業年度 (平成28年3月31日)
負債の部		
流動負債		
顧客からの預り金	-	0
その他の預り金	82,723	73,103
未払金		
未払収益分配金	711	154
未払償還金	143,201	141,808
未払手数料	2,338,432	2,479,778
その他未払金	1,075,587	58,453
未払費用	2,095,111	2,092,669
未払消費税等	478,421	317,444
未払法人税等	454,520	992,491
賞与引当金	906,623	982,654
その他の流動負債	808	-
流動負債合計	7,576,142	7,138,557
固定負債		
退職給付引当金	2,633,080	3,028,212
賞与引当金	-	51,310
その他の固定負債	-	693
固定負債合計	2,633,080	3,080,216
負債合計	10,209,222	10,218,774

純資産の部

株主資本

資本金	2,000,000	2,000,000
資本剰余金		
資本準備金	8,628,984	8,628,984
資本剰余金合計	8,628,984	8,628,984
利益剰余金		
利益準備金	284,245	284,245
その他利益剰余金		
配当準備積立金	60,000	60,000
別途積立金	1,476,959	1,476,959
繰越利益剰余金	18,861,359	21,984,811
利益剰余金合計	20,682,564	23,806,015
株主資本計	31,311,548	34,434,999
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	634,478	517,775
評価・換算差額等合計	634,478	517,775
純資産合計	31,946,027	34,952,774
負債・純資産合計	42,155,249	45,171,549

## (2) 【損益計算書】

(単位：千円)

	前事業年度 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)	当事業年度 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	30,094,858	32,339,255
運用受託報酬	3,862,895	7,401,835
投資助言報酬	2,106,161	1,909,892
その他営業収益		
情報提供コンサルタント 業務報酬	5,000	5,000
投資法人運用受託報酬	27,345	8,546
サービス支援手数料	18,274	74,038
その他	52,255	55,319
営業収益計	36,166,790	41,793,887
営業費用		
支払手数料	15,123,724	16,006,652
広告宣伝費	407,991	615,596
公告費	4,737	4,507
調査費		
調査費	1,319,743	1,624,477
委託調査費	3,550,675	4,106,366
営業雑経費		
通信費	38,911	43,662
印刷費	294,002	399,236
協会費	26,955	23,328
諸会費	18,577	22,650
情報機器関連費	2,403,857	2,557,200
販売促進費	28,281	31,271
その他	144,250	161,974
営業費用合計	23,361,707	25,596,925

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

## (3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

（単位：千円）

	株主資本
--	------

	資本金	資本剰余金		利益剰余金					株主資本 合計
		資本準備金	資本剰余金 合計	利益準備金	その他利益剰余金			利益剰余金 合計	
					配当準備 積立金	別途積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	2,000,000	8,628,984	8,628,984	284,245	60,000	1,476,959	19,227,103	21,048,308	31,677,292
会計方針の変更による 累積的影響額							439,043	439,043	439,043
会計方針の変更を反映した 当期首残高	2,000,000	8,628,984	8,628,984	284,245	60,000	1,476,959	18,788,060	20,609,264	31,238,248
当期変動額									
剰余金の配当							1,852,200	1,852,200	1,852,200
当期純利益							1,925,499	1,925,499	1,925,499
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）									
当期変動額合計	-	-	-	-	-	-	73,299	73,299	73,299
当期末残高	2,000,000	8,628,984	8,628,984	284,245	60,000	1,476,959	18,861,359	20,682,564	31,311,548

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

当事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

（単位：千円）

	株主資本								株主資本 合計
	資本金	資本剰余金		利益準備金	その他利益剰余金			利益剰余金 合計	
		資本準備金	資本剰余金 合計		配当準備 積立金	別途積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	2,000,000	8,628,984	8,628,984	284,245	60,000	1,476,959	18,861,359	20,682,564	31,311,548
当期変動額									
剰余金の配当							952,560	952,560	952,560
当期純利益							4,076,011	4,076,011	4,076,011
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）									
当期変動額合計	-	-	-	-	-	-	3,123,451	3,123,451	3,123,451
当期末残高	2,000,000	8,628,984	8,628,984	284,245	60,000	1,476,959	21,984,811	23,806,015	34,434,999

	評価・換算差額等

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

## [注記事項]

## (重要な会計方針)

## 1. 有価証券の評価基準及び評価方法

## (1) 満期保有目的の債券

償却原価法

## (2) 子会社株式及び関連会社株式

移動平均法による原価法

## (3) その他有価証券

時価のあるもの

決算日の市場価格等に基づく時価法

（評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定）

時価のないもの

移動平均法による原価法

## 2. 固定資産の減価償却の方法

## (1) 有形固定資産

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

なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。

建物 3～50年

器具備品 3～20年

## (2) 無形固定資産

定額法によっております。

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

## 3. 引当金の計上基準

## (1) 賞与引当金

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

## (2) 退職給付引当金

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

退職給付見込額の期間帰属方法

退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当事業年度末までの期間に帰属させる方法につい

ては、給付算定式基準によっております。

数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法

過去勤務費用については、その発生時において一時に費用処理しております。

数理計算上の差異については、その発生時において一時に費用処理しております。

#### 4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

##### 消費税等の会計処理

消費税等の会計処理は税抜方式によっております。

#### (貸借対照表関係)

##### 1 有形固定資産の減価償却累計額

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

##### 2 関係会社に対する資産及び負債

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

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

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

##### 4 保証債務

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

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

#### (損益計算書関係)

1 関係会社との取引に係るものが次のとおり含まれております。

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

##### 2 固定資産除却損

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

##### 3 その他の特別損失

その他の特別損失は、中国において同国国家税務総局が平成26年11月17日付で公布した財税[2014]79号通達に基づき、当社が委託者として運用する証券投資信託に関し、適格国外機関投資家として



課される平成21年11月17日から平成26年11月16日までに行われた中国A株投資のキャピタル・ゲインに対して遡及的に徴される源泉所得税等について納付すべきと見込まれる金額を計上したものであります。

(株主資本等変動計算書関係)

前事業年度(自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)

1. 発行済株式数に関する事項

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

2. 剰余金の配当に関する事項

(1) 配当金支払額等

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

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

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

当事業年度(自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)

1. 発行済株式数に関する事項

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

2. 剰余金の配当に関する事項

(1) 配当金支払額等

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

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

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

(リース取引関係)

オペレーティング・リース取引

(借主側)

オペレーティング・リース取引のうち解約不能のものに係る未経過リース料

(単位：千円)

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

## (金融商品関係)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

## (1) 金融商品に対する取組方針

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

## (2) 金融商品の内容及びそのリスク

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

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

営業債務である未払手数料は、すべて1年以内の支払期日であります。

## (3) 金融商品に係るリスク管理体制

## 信用リスクの管理

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

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

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

## 市場リスクの管理

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

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

## (4) 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

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

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

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

前事業年度（平成27年3月31日）

（単位：千円）

	貸借対照表計上額	時価	差額
(1) 現金及び預金	25,021,336	25,021,336	-
(2) 顧客分別金信託	-	-	-

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

当事業年度（平成28年3月31日）

（単位：千円）

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

（注1）金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

#### 資 産

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

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

(6)投資有価証券

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

(7)長期差入保証金

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

#### 負 債

(1)顧客からの預り金、(2)未払手数料

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

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

（単位：千円）

	前事業年度 （平成27年3月31日）	当事業年度 （平成28年3月31日）
その他有価証券 非上場株式	298	298
投資証券	20,560	-

合計	20,858	298
子会社株式及び関連会社株式 非上場株式	509,146	10,412,523
合計	509,146	10,412,523

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

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

(注3) 金銭債権及び満期がある有価証券の決算日後の償還予定額

前事業年度(平成27年3月31日)

(単位:千円)

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

当事業年度(平成28年3月31日)

(単位:千円)

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

(有価証券関係)

1. 子会社株式及び関連会社株式

前事業年度(平成27年3月31日)

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

当事業年度(平成28年3月31日)

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

2. その他有価証券

前事業年度(平成27年3月31日)

(単位:千円)

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

合計	7,131,075	6,206,854	924,220
----	-----------	-----------	---------

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

当事業年度(平成28年3月31日)

(単位:千円)

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

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

### 3. 当事業年度中に売却したその他有価証券

前事業年度(自平成26年4月1日至平成27年3月31日)

(単位:千円)

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

当事業年度(自平成27年4月1日至平成28年3月31日)

(単位:千円)

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

### (退職給付関係)

#### 1. 採用している退職給付制度の概要

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

#### 2. 確定給付制度

##### (1)退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

(単位:千円)

	前事業年度 (自平成26年4月1日 至平成27年3月31日)	当事業年度 (自平成27年4月1日 至平成28年3月31日)
退職給付債務の期首残高	1,802,340	2,633,080
会計方針の変更による累積的影響額	682,168	-
会計方針の変更を反映した期首残高	2,484,508	2,633,080
勤務費用	217,881	225,881
利息費用	18,161	19,247
数理計算上の差異の発生額	276	285,510
退職給付の支払額	87,196	135,507
退職給付債務の期末残高	2,633,080	3,028,212

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

(単位:千円)

	前事業年度 (平成27年3月31日)	当事業年度 (平成28年3月31日)
--	-----------------------	-----------------------

非積立型制度の退職給付債務	2,633,080	3,028,212
未認識数理計算上の差異	-	-
未認識過去勤務費用	-	-
退職給付引当金	2,633,080	3,028,212

## (3)退職給付費用及びその内訳項目の金額

(単位：千円)

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

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

## (4)数理計算上の計算基礎に関する事項

主要な数理計算上の計算基礎(加重平均で表わしております。)

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

## 3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、前事業年度105,357千円、当事業年度125,210千円であります。

## (税効果会計関係)

## 1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

(単位：千円)

	前事業年度 (平成27年3月31日)	当事業年度 (平成28年3月31日)
流動の部		
繰延税金資産		
賞与引当金	299,729	303,247
調査費	77,863	74,734
未払金	321,602	44,028
未払事業税	49,504	67,598
その他	48,762	7,369
繰延税金資産小計	797,462	496,977
評価性引当額	321,602	2,945
繰延税金資産合計	475,859	494,032
固定の部		
繰延税金資産		
退職給付引当金	849,431	927,238
特定外国子会社留保金額	211,024	205,413
ソフトウェア償却	62,560	35,707
賞与引当金	-	15,834
投資有価証券評価損	43,051	95
その他	6,291	5,971
繰延税金資産小計	1,172,360	1,190,261

評価性引当額	217,192	211,267
繰延税金資産合計	955,168	978,994
繰延税金負債		
その他有価証券評価差額金	289,742	228,513
繰延税金負債合計	289,742	228,513
繰延税金資産の純額	1,141,285	1,244,513

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

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

### 3. 法人税等の税率の変更による繰延税金資産及び繰延税金負債の金額の修正

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

この税率変更により、繰延税金資産の金額(繰延税金負債の金額を控除した金額)は62,206千円減少し、法人税等調整額が74,445千円、その他有価証券評価差額金が12,239千円、それぞれ増加しております。

#### (セグメント情報等)

前事業年度(自平成26年4月1日 至平成27年3月31日)

##### 1. セグメント情報

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

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

##### 2. 関連情報

###### (1) 製品及びサービスごとの情報

(単位：千円)

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

###### (2) 地域ごとの情報

**売上高**

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

**有形固定資産**

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

**(3)主要な顧客ごとの情報**

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

**3. 報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報**

該当事項はありません。

**4. 報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報**

該当事項はありません。

**5. 報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報**

該当事項はありません。

当事業年度(自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)

**1. セグメント情報**

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

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

**2. 関連情報****(1)製品及びサービスごとの情報**

(単位：千円)

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

**(2)地域ごとの情報****売上高**

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

**有形固定資産**

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

**(3)主要な顧客ごとの情報**

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

**3. 報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報**

該当事項はありません。

**4. 報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報**

該当事項はありません。



## 5. 報告セグメントごとの負のれん発生益に関する情報

該当事項はありません。

## (関連当事者情報)

前事業年度(自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)

## 1. 親会社及び主要株主（会社等の場合に限る。）等

(単位：千円)

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金、出資金又は基金	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額	科目	期末残高
その他の関係会社	(株)三井住友銀行	東京都千代田区	1,770,996,505	銀行業	(被所有) 直接 40 %	投信の販売委託 役員の兼任	委託販売手数料	2,527,962	未払手数料	289,954

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

## 2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

## 2. 子会社及び関連会社等

(単位：千円)

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

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

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

## 3. その他の関係会社の子会社等

(単位：千円)

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

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

## 2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

当事業年度(自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)

## 1. 親会社及び主要株主（会社等の場合に限る。）等

(単位：千円)

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金、出資金又は基金	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額	科目	期末残高
その他の関係会社	(株)三井住友銀行	東京都千代田区	1,770,996,505	銀行業	(被所有) 直接 40 %	投信の販売委託 役員の兼任	委託販売手数料	2,740,552	未払手数料	471,118

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

## 2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

## 2. 兄弟会社等

(単位：千円)

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金、出資金又は基金	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額	科目	期末残高	
その他の関係会社の子会社	S M B C 日興証券(株)	東京都千代田区	10,000,000	証券業	-	%	投信の販売委託 役員の兼任	子会社株式の取得	9,877,717	-	-
								委託販売手数料	5,483,224	未払手数料	912,899

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

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

#### (1株当たり情報)

	前事業年度 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)	当事業年度 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)
1株当たり純資産額	1,810,999.27円	1,981,449.82円
1株当たり当期純利益金額	109,155.30円	231,066.40円

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

2. 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	前事業年度 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)	当事業年度 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)
1株当たり当期純利益金額		
当期純利益(千円)	1,925,499	4,076,011
普通株主に帰属しない金額(千円)	-	-
普通株式に係る当期純利益金額(千円)	1,925,499	4,076,011
期中平均株式数(株)	17,640	17,640

#### (重要な後発事象)

該当事項はありません。

#### 4【利害関係人との取引制限】

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

イ 自己またはその取締役もしくは執行役との間における取引を行うことを内容とした運用を行うこと(投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。)

ロ 運用財産相互間において取引を行うことを内容とした運用を行うこと(投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。)

ハ 通常の取引の条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託会社の親法人等(委託会社の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。)または子法人等(委託会社が総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。)と有価証券の売買その他の取引または店頭デリバティブ取引を行うこと。

ニ 委託会社の親法人等または子法人等の利益を図るため、その行う投資運用業に関して運用の方

針、運用財産の額もしくは市場の状況に照らして不必要な取引を行うことを内容とした運用を行うこと。

- ホ 上記八、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28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28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 住友生命保険相互会社
- (ロ) 資本金の額 639,000百万円(平成28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。)
- (ハ) 事業の内容 保険業法に基づき、生命保険業を営んでいます。

### 2【関係業務の概要】

#### イ 受託会社

信託契約の受託会社であり、信託財産の保管・管理・計算等を行います。

#### ロ 販売会社

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

### 3【資本関係】

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

## 第3【その他】

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

**独立監査人の監査報告書**

平成28年 6月17日

三井住友アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

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

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

**財務諸表に対する経営者の責任**

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

**監査人の責任**

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

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

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

**監査意見**

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三井住友アセットマネジメント株式会社の平成28年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

**利害関係**

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

以 上

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

## 独立監査人の監査報告書

平成28年5月17日

三井住友アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員  
業務執行社員

公認会計士 小澤 陽一 印

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」に掲げられているスミセイ・DCターゲットイヤーファンド2020の平成27年4月14日から平成28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、スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2020の平成28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. XBRLデータは監査の対象には含まれていません。