

## 【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31年1月10日提出
【発行者名】	三井住友アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 松下 隆史
【本店の所在の場所】	東京都港区愛宕二丁目5番1号
【事務連絡者氏名】	土田 雅央
【電話番号】	03-5405-0740
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券に係るファンドの名称】	三井住友・DCターゲットイヤーファンド2040（4資産タイプ）
【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31年1月11日から平成31年7月11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】

三井住友・DCターゲットイヤーファンド2040（４資産タイプ）  
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、「DC2040」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】

2019年1月11日から2019年7月11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 日本以外の地域における募集

ありません。

ハ クーリング・オフ制度（金融商品取引法第37条の6）の適用

ありません。

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2040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

単字型・追加型	投資対象地域	投資対象資産 (収益の源泉)
単字型	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)		
債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット属性 ( )	年2回 年4回 年6回(隔月) 年12回(毎月) 日々 その他 ( )	日本 北米 欧州 アジア オセアニア 中南米 アフリカ	ファミリーファンド	あり
不動産投信		中近東(中東)	ファンド・オブ・ファンズ	なし
その他資産 (投資信託証券(資産複合(株式、債券、円短期金融資産)資産配分変更型))		エマージング		
資産複合 ( )				

資産配分固定型				
資産配分変更型				

（注）当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

属性区分の「為替ヘッジ」は、対円での為替変動リスクに対するヘッジの有無を記載しています。商品分類、属性区分は、一般社団法人投資信託協会「商品分類に関する指針」に基づき記載していません。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】

2008年3月31日 信託契約締結、設定、運用開始。  
 2017年1月13日 「スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2040」から「三井住友・DCターゲットイヤーファンド2040（4資産タイプ）」に名称を変更。

## （３）【ファンドの仕組み】

イ 当ファンドの関係法人とその役割

（イ）委託会社 「三井住友アセットマネジメント株式会社」

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

（ロ）受託会社 「三井住友信託銀行株式会社」

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

（ハ）販売会社

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

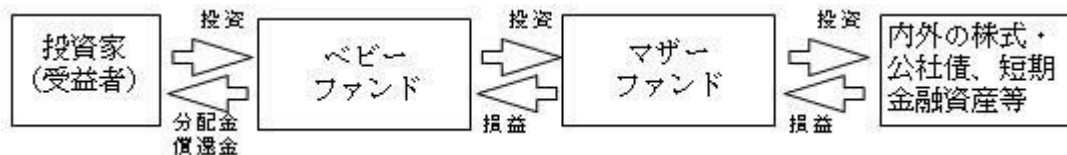
### 運営の仕組み



当ファンドの運用は、「ファミリーファンド方式」で行われます。

「ファミリーファンド方式」とは、複数のファンドを合同運用する仕組みで、受益者の資金をまとめて「ベビーファンド」とし、「ベビーファンド」の資金の全部または一部を「マザーファンド」に投

資することにより、実質的な運用は「マザーファンド」において行う仕組みです。



## □ 委託会社の概況

### (イ) 資本金の額

2,000百万円（2018年10月31日現在）

### (ロ) 会社の沿革

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

### (ハ) 大株主の状況

（2018年11月 1日現在）

名称	住所	所有株式数	比率 (%)
株式会社三井住友フィナンシャルグループ	東京都千代田区丸の内一丁目 1 番 2 号	10,584,000	60.0
住友生命保険相互会社	大阪府大阪市中央区城見一丁目 4 番 35号	3,528,000	20.0
三井住友海上火災保険株式会社	東京都千代田区神田駿河台三丁目 9 番地	3,528,000	20.0

## 2【投資方針】

### (1)【投資方針】

「(1) 投資方針」には、当ファンドと実質的な投資対象資産が同じで、ターゲットイヤーおよび基本資産配分比率の異なるファンドの情報を合わせて説明している部分があります。

#### 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2040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、資産毎に必要なに応じて調整を行うものとします。

[2018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
30.0%	22.0%	20.0%	26.0%	2.0%

- (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。

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。



※販売会社によっては一部のファンドのみの取扱いとなる場合があります。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

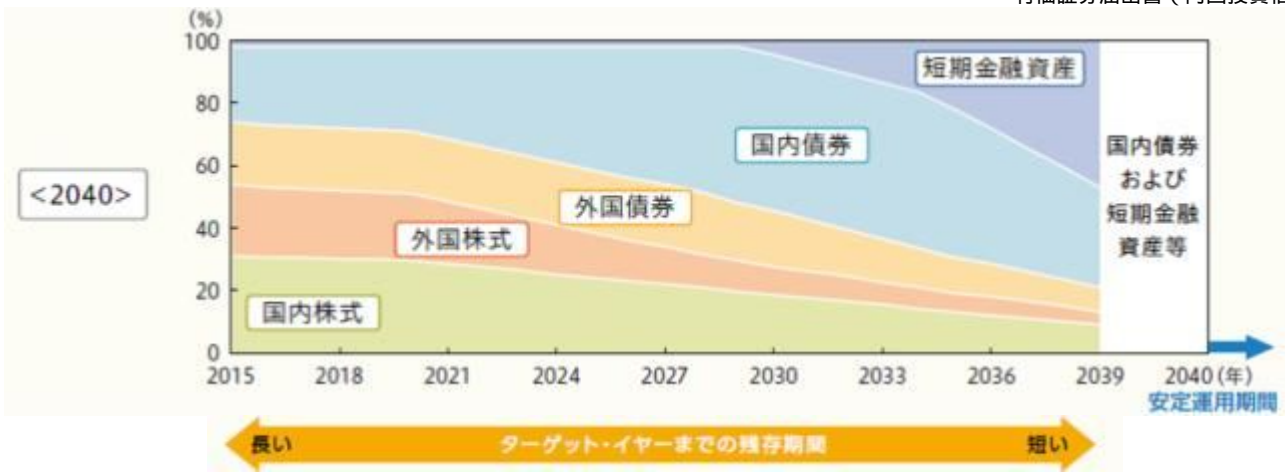
### ▶ 2018年4月現在の基本資産配分

	<2020>	<2025>	<2030>	<2035>	<2040>	<2045>
国内株式	10.0%	15.5%	21.0%	26.5%	30.0%	31.5%
外国株式	5.0%	7.0%	10.5%	17.0%	22.0%	23.5%
外国債券	8.5%	14.0%	20.0%	20.0%	20.0%	20.0%
国内債券	36.0%	50.0%	46.5%	34.5%	26.0%	23.0%
短期金融資産	40.5%	13.5%	2.0%	2.0%	2.0%	2.0%

<2040><2045>の運用にあたっては、各マザーファンドが運用の対象とする指数から基本資産配分比率に基づき作成した合成指数を参考指数とします。

各マザーファンドは、それぞれの対象指数の動きに連動する投資成果を目指して運用を行うため、<2040><2045>は結果として参考指数の動きに連動する成果を目指して運用を行います。

### ▶ 基本資産配分のイメージ



※上記は、各決算時点での基本資産配分を表しています。各ターゲットイヤーの前年の決算日から翌年の決算日までは、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。



## 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)

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

### ▶国内債券バッシブ・マザーファンド

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

### ▶外国株式インデックス・マザーファンド

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



#### 最適化法とは

計量モデル等に基づいて、インデックスとの連動性を保てるように一部の銘柄を抽出してポートフォリオを構築する方法です。信用不安が懸念される銘柄を排除することや少額でもポートフォリオを構築することができるメリットがあります。

#### トラッキングエラーとは

ポートフォリオとベンチマークのリターンの乖離のことをいいます。

#### 層化抽出法とは

指数を構成する銘柄をいくつかのグループ(層)に分け、それぞれのグループから代表銘柄を抽出してファンドを構築する方法です。指数を構成するすべての銘柄を保有する完全法に比べて、少ない銘柄数でポートフォリオを構築することができるため、銘柄入れ替えに伴う取引コストの抑制や、低流動性銘柄の組入れを避けることができるというメリットがあり、債券バッシブ運用に適しています。

## ▶外国債券パッシブ・マザーファンド

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

## ▶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、FTSE世界国債インデックスは、それぞれ東京証券取引所、野村證券株式会社、MSCI Inc.、FTSE Fixed Income LLCが公表している指数で各社の知的財産です。
- ・ 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す。）
  17. 預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
  18. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
  19. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
  20. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
  21. 外国の者に対する権利で前号の有価証券の性質を有するもの
- なお、第1号の証券または証書、第12号ならびに第17号の証券または証書のうち第1号の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、第2号から第6号までの証券および第12号ならびに第17号の証券または証書のうち第2号から第6号までの証券の性質を有するもの、および第14号の証券のうち投資法人債券を以下「公社債」といい、第13号の証券および第14号の証券（ただし、投資法人債券を除きます。）を以下「投資信託証券」といいます。

#### 八 投資対象とする金融商品

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

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

### （3）【運用体制】

#### イ 運用体制

当ファンドの運用は、次のプロセスに基づいて行われます。

#### （イ）計画（Plan）

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

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

#### （ロ）実行（Do）

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



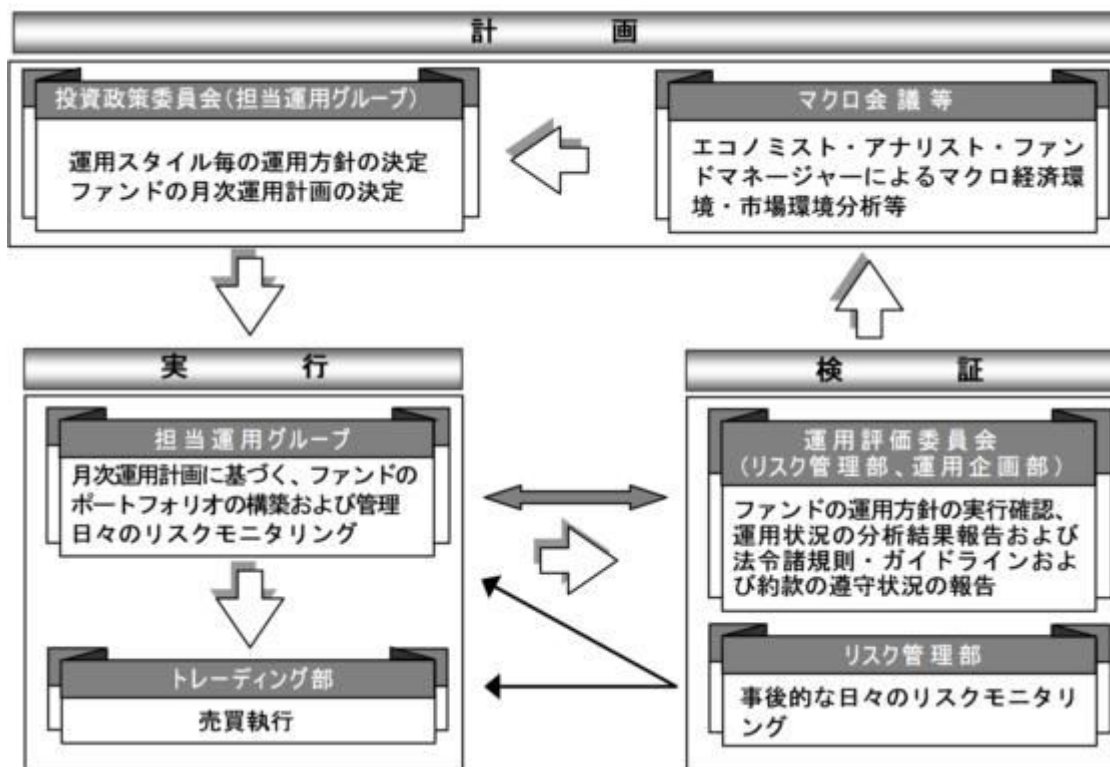
売買執行については、組織的に分離されたトレーディング部が、最良と思われる手法をもって売買を執行します。

#### （八）検証（Check）

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

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

#### 〔ファンドの運用体制〕



リスク管理部は11名程度、運用企画部は10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。

#### □ 委託会社によるファンドの関係法人（販売会社を除く）に対する管理体制

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

#### （４）【分配方針】

毎年1回（原則として4月13日。休業日の場合は翌営業日となります。）決算を行い、原則として以下の方針に基づき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。
  - 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。
- 八 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、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 同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- ヘ 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。
- ト デリバティブ取引（法人税法第61条の5に定めるものをいいます。）は、価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。
- チ 外国為替予約取引は、為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。

ファンドの信託約款に基づくその他の投資制限

- イ 投資する株式等の範囲
  - （イ）委託会社が投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、取引所に上場している株式の発行会社の発行するもの、取引所に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。
  - （ロ）上記（イ）にかかわらず、上場予定または登録予定の株式、新株引受権証券および新株予約権証券で目論見書等において上場または登録することが確認できるものについては委託会社が投資することを指図することができるものとします。
- ロ 信用取引の指図
  - （イ）委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売り付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、株券の引渡しまたは買戻しにより行うことの指図をすることができます。
  - （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。
- （二）信託財産の一部解約等の事由により、上記（ロ）の売付けにかかる建玉の時価総額の合計額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に



相当する売付けの一部を決済するための指図をするものとします。

#### 八 先物取引等の指図

- (イ) 委託会社は、日本の取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。）、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、日本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、日本の取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。

#### ニ スワップ取引の指図

- (イ) 委託会社は、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行うことの指図をすることができます。
- (ロ) スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの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、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことの指図をすることができます。
- (ロ) 金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- (ハ) 金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかる金利先渡取引および為替先渡取引の想定元本の合計額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記純資産総額が減少して、金利先渡取引および為替先渡取引の想定元本の合計額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する金利先渡取引および為替先渡取引の一部の解約を指図するものとします。
- (ニ) 金利先渡取引および為替先渡取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額により行うものとします。
- (ホ) 委託会社は、金利先渡取引および為替先渡取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。
- (ヘ) 「金利先渡取引」とは、当事者間において、あらかじめ将来の特定の日（以下「決済日」といいます。）における決済日から一定の期間を経過した日（以下「満期日」といいます。）までの期間にかかる国内または海外において代表的利率として公表される預金契約または金銭の貸借契約に基づく債権の利率（以下「指標利率」といいます。）の数値を取り決め、その取決めにかかる数値と決済日における当該指標利率の現実の数値との差にあらかじめ元本として定めた金額および当事者間で約定した日数を基準とした数値を乗じた額を決済日における当該指標

利率の現実の数値で決済日における現在価値に割り引いた額の金銭の授受を約する取引をいいます。

- (ト)「為替先渡取引」とは、当事者間において、あらかじめ決済日から満期日までの期間にかかる為替スワップ取引(同一の相手方との間で直物外国為替取引および当該直物外国為替取引と反対売買の関係に立つ先物外国為替取引を同時に約定する取引をいいます。以下同じ。)のスワップ幅(当該直物外国為替取引にかかる外国為替相場と当該先物外国為替取引にかかる外国為替相場との差を示す数値をいいます。以下同じ。)を取り決め、その取決めにかかるスワップ幅から決済日における当該為替スワップ取引の現実のスワップ幅を差し引いた値にあらかじめ元本として定めた金額を乗じた額を決済日における指標利率の数値で決済日における現在価値に割り引いた額の金銭またはその取決めにかかるスワップ幅から決済日における当該為替スワップ取引の現実のスワップ幅を差し引いた値にあらかじめ元本として定めた金額を乗じた金額とあらかじめ元本として定めた金額について決済日を受渡日として行った先物外国為替取引を決済日における直物外国為替取引で反対売買したときの差金にかかる決済日から満期日までの利息とを合算した額を決済日における指標利率の数値で決済日における現在価値に割り引いた額の金銭の授受を約する取引をいいます。

#### へ 有価証券の貸付けの指図

- (イ) 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式および公社債を次の各号の範囲内で貸し付けることの指図をすることができます。
1. 株式の貸付けは、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額を超えないものとします。
  2. 公社債の貸付けは、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額を超えないものとします。
- (ロ) 上記(イ)各号に定める限度額を超えることとなった場合には、委託会社は、速やかにその超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとします。
- (ハ) 委託会社は、有価証券の貸付けにあたって必要と認めるときは、担保の受入れの指図を行うものとします。

#### ト 有価証券の空売りの指図

- (イ) 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産において有しない有価証券または借り入れた有価証券を売り付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、売り付けた有価証券の引渡しまたは買戻しにより行うことの指図をすることができます。
- (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、日本の国際収支上の理由等により特に必要と認められる場合には、制約されることがあります。

## ヌ 外国為替予約取引の指図

- (イ) 委託会社は、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。
- (ロ) 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。
- (ニ) 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。

## 八 信用リスク集中回避のための投資制限(金融商品取引業等に関する内閣府令第130条第1項第8号の2)

委託会社は、運用財産に関し、信用リスク(保有する有価証券その他の資産について取引の相手方の債務不履行その他の理由により発生し得る危険をいいます。)を適正に管理する方法としてあらかじめ委託会社が定めた合理的な方法に反することとなる取引を行うことを受託会社に指図しないものとします。

(参考情報:マザーファンドの投資方針等)

(国内株式インデックス・マザーファンド(B号))

### (1) 投資方針等

#### イ 基本方針

主として日本の株式に投資し、TOPIX(東証株価指数、配当込み)の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。

#### ロ 投資態度

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

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

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

### (2) 投資対象

#### イ 投資対象とする資産の種類

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

#### ロ 投資対象とする有価証券

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

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

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

(国内債券パッシブ・マザーファンド)

## (1) 投資方針等

## イ 基本方針

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

## ロ 投資態度

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

(ロ) 公社債の組入比率は原則として高位を保ちます。

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

## (2) 投資対象

## イ 投資対象とする資産の種類

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

## ロ 投資対象とする有価証券

前記「2 投資方針 (2) 投資対象 ロ 投資対象とする有価証券」において記載したベビーファンドが投資対象とする有価証券の各号(第1号から第21号)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) 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

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

## (外国株式インデックス・マザーファンド)

## (1) 投資方針等

## イ 基本方針

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

## ロ 投資態度

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

(ロ) 外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行わないものとします。

(八) 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。

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

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

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

## (外国債券パッシブ・マザーファンド)

### (1) 投資方針等

#### イ 基本方針

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

#### ロ 投資態度

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

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

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

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

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

## 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コンプライアンス部)を設置し、ファンドの投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる確認等を行っています。リスク管理部では、主に投資信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングを行います。また、コンプライアンス部では、主に法令・諸規則等の遵守状況についての確認等を行います。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価委員会、リスク管理委員会およびコンプライアンス委員会への報告が義務づけられています。

## （参考情報）投資リスクの定量的比較

### 「ファンドの年間騰落率および 分配金再投資基準価額の推移」

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

#### ▶<2040>

年間騰落率：  
2013年11月～2018年10月

分配金再投資基準価額：  
2013年11月～2018年10月



※年間騰落率、分配金再投資基準価額は、分配金（税引前）を分配時に再投資したものと仮定して計算したものです。  
※分配実績がない場合は、分配金再投資基準価額は基準価額と同じです。

### 「ファンドと他の代表的な 資産クラスとの騰落率の比較」

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

ファンド：  
2013年11月～2018年10月

他の資産クラス：  
2013年11月～2018年10月



※ファンドの騰落率は、分配金（税引前）を分配時に再投資したものと仮定して計算しており、実際の基準価額をもとに計算したものと異なります。  
※すべての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。

## 各資産クラスの指数

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

※海外の指数は、為替ヘッジなしによる投資を想定して、円ベースとしています。  
※上記各指数に関する知的所有権その他の一切の権利は、その発行者および許諾者に帰属します。また、上記各指数の発行者および許諾者は、当ファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。

## 4【手数料等及び税金】

### (1)【申込手数料】

無手数料です。

## (2) 【換金（解約）手数料】

解約手数料はありません。

## (3) 【信託報酬等】

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

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

信託報酬 = 運用期間中の基準価額 × 信託報酬率

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32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33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種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
受託会社	ファンド財産の保管および管理、委託会社からの指図の実行等の対価

## (4) 【その他の手数料等】

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

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

上記(1)～(4)にかかる手数料等の合計額、その上限額、計算方法等は、手数料等に保有期間に応じて異なるものが含まれていたり、発生時・請求時に初めて具体的な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。

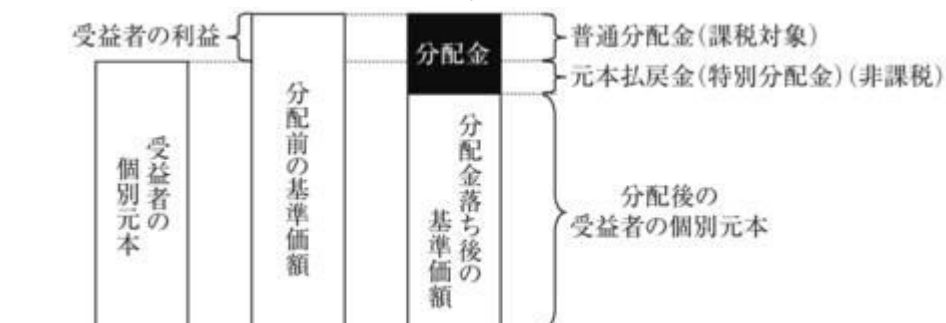
## ハ 収益分配金の課税について

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。また、当ファンドは、非課税累積投資契約に係る少額投資非課税制度「つみたてNISA（ニーサ）」の適用対象です。ただし、販売会社によっては当ファンドをNISA、ジュニアNISAおよびつみたてNISA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。

つみたてNISA（ニーサ）、NISA（ニーサ）およびジュニアNISA（ニーサ）をご利用になる場合、それぞれの制度の違いにご留意ください。また、販売会社での専用口座の開設等、一定の要件があります。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

	非課税累積投資契約に係る 少額投資非課税制度 つみたてNISA	少額投資非課税制度 NISA	未成年者少額投資 非課税制度 ジュニアNISA
対象となる 投資信託	一定の要件を満たした 公募株式投資信託 (新たに積立投資が必要)	公募株式投資信託 (新たに購入が必要)	
非課税対象	公募株式投資信託から生じる配当所得および譲渡所得		
利用対象と なる方	20歳以上の日本居住者 (専用口座が開設される年の1月1日現在)		0~19歳の日本居住者 (専用口座が開設される年の 1月1日現在)
非課税の期間	最長20年間 (投資期間は2037年まで)	最長5年間 (投資期間は2023年まで)	
利用できる 限度額	40万円/年 (最大800万円)	120万円/年 (最大600万円)	80万円/年 (最大400万円)
留意事項	つみたてNISA ↔ NISA 同一年において、つみたてNISAとNISAを併用した投資を行うことはできません。		

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、2018年10月末現在の情報をもとに作成しています。税法の改正等により、変更されることがあります。

課税上の取扱いの詳細につきましては、税務専門家に確認されることをお勧めいたします。

## 5【運用状況】

### (1)【投資状況】

三井住友・DCターゲットイヤーファンド2040(4資産タイプ)

2018年10月31日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
親投資信託受益証券	日本	428,747,009	99.41
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		2,560,720	0.59
合計(純資産総額)		431,307,729	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】

三井住友・DCターゲットイヤーファンド2040(4資産タイプ)

#### イ 主要投資銘柄

2018年10月31日現在

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	投資 比率 (%)
日本	親投資信託受益証券	国内株式インデックス・マザーファンド(B号)	50,686,737	2.6566	134,654,506	2.5593	129,722,566	30.08
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	89,734,817	1.2633	113,361,995	1.2549	112,608,221	26.11
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	27,141,643	3.3255	90,261,729	3.3893	91,991,170	21.33
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	50,102,697	1.7344	86,900,738	1.7312	86,737,789	20.11
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	7,608,139	1.0107	7,690,075	1.0104	7,687,263	1.78

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

2018年10月31日現在

種類	投資比率（％）
親投資信託受益証券	99.41
合計	99.41

## 【投資不動産物件】

三井住友・DCターゲットイヤーファンド2040（4資産タイプ）

該当事項はありません。

## 【その他投資資産の主要なもの】

三井住友・DCターゲットイヤーファンド2040（4資産タイプ）

該当事項はありません。

## （3）【運用実績】

## 【純資産の推移】

三井住友・DCターゲットイヤーファンド2040（4資産タイプ）

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 (2009年 4月13日)	789,754	789,754	7,898	7,898
第2期 (2010年 4月13日)	921,372	921,372	9,072	9,072
第3期 (2011年 4月13日)	3,130,163	3,130,163	8,674	8,674
第4期 (2012年 4月13日)	20,230,023	20,230,023	8,618	8,618
第5期 (2013年 4月15日)	10,961,140	10,961,140	11,020	11,020
第6期 (2014年 4月14日)	17,867,281	17,867,281	11,765	11,765
第7期 (2015年 4月13日)	81,578,616	81,578,616	14,379	14,379
第8期 (2016年 4月13日)	178,916,663	178,916,663	13,267	13,267
第9期 (2017年 4月13日)	236,077,626	236,077,626	14,009	14,009
第10期 (2018年 4月13日)	331,831,432	331,831,432	15,438	15,438
2017年10月末日	303,335,040		15,581	
11月末日	310,199,263		15,682	
12月末日	319,633,353		15,898	
2018年 1月末日	326,370,383		15,901	
2月末日	321,964,702		15,496	
3月末日	328,438,275		15,279	
4月末日	337,403,423		15,621	
5月末日	393,144,964		15,494	

6月末日	402,377,282		15,523
7月末日	414,510,730		15,730
8月末日	423,154,536		15,728
9月末日	443,093,206		16,121
10月末日	431,307,729		15,299

## 【分配の推移】

三井住友・DCターゲットイヤーファンド2040（4資産タイプ）

	計算期間	1万口当たり分配金（円）
第1期	2008年 3月31日～2009年 4月13日	0
第2期	2009年 4月14日～2010年 4月13日	0
第3期	2010年 4月14日～2011年 4月13日	0
第4期	2011年 4月14日～2012年 4月13日	0
第5期	2012年 4月14日～2013年 4月15日	0
第6期	2013年 4月16日～2014年 4月14日	0
第7期	2014年 4月15日～2015年 4月13日	0
第8期	2015年 4月14日～2016年 4月13日	0
第9期	2016年 4月14日～2017年 4月13日	0
第10期	2017年 4月14日～2018年 4月13日	0

## 【収益率の推移】

三井住友・DCターゲットイヤーファンド2040（4資産タイプ）

	収益率（％）
第1期	21.0
第2期	14.9
第3期	4.4
第4期	0.6
第5期	27.9
第6期	6.8
第7期	22.2
第8期	7.7
第9期	5.6
第10期	10.2
第11期（中間期）	0.2

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



## (4) 【設定及び解約の実績】

## 三井住友・DCターゲットイヤーファンド2040(4資産タイプ)

	設定口数(口)	解約口数(口)
第1期	1,000,000	0
第2期	15,583	0
第3期	2,593,247	0
第4期	19,866,478	0
第5期	5,765,406	19,294,423
第6期	9,427,064	4,186,617
第7期	44,831,283	3,281,608
第8期	84,680,093	6,563,135
第9期	49,340,920	15,674,791
第10期	53,950,215	7,519,004
第11期(中間期)	64,867,044	3,470,992

(注) 本邦外における設定および解約の実績はありません。

## (参考)

## (1) 投資状況

## 国内株式インデックス・マザーファンド(B号)

2018年10月31日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
株式	日本	166,476,022,020	97.71
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		3,906,615,156	2.29
合計(純資産総額)		170,382,637,176	100.00

その他以下の取引を行っております。

種類	買建/ 売建	国/地域	時価合計(円)	投資 比率 (%)
株価指数先物取引	買建	日本	4,020,450,000	2.35
合計	買建		4,020,450,000	2.35

## 国内債券パッシブ・マザーファンド

2018年10月31日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
国債証券	日本	140,919,776,030	73.05
地方債証券	日本	18,213,004,311	9.44
特殊債券	日本	24,693,157,831	12.80
社債券	日本	7,289,651,000	3.78
	オーストラリア	200,652,000	0.10
	フランス	199,780,000	0.10
	小計	7,690,083,000	3.99
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1,385,950,128	0.72
合計(純資産総額)		192,901,971,300	100.00

## 外国株式インデックス・マザーファンド

2018年10月31日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
株式	アメリカ	104,853,018,578	61.58
	イギリス	10,209,625,890	6.00
	フランス	6,085,179,557	3.57
	カナダ	6,063,310,045	3.56
	スイス	5,755,584,368	3.38
	ドイツ	5,532,099,818	3.25
	オーストラリア	3,689,441,415	2.17
	オランダ	2,835,465,621	1.67
	アイルランド	2,407,430,643	1.41
	スペイン	1,849,561,187	1.09
	スウェーデン	1,497,642,501	0.88
	香港	1,407,046,603	0.83
	イタリア	1,160,868,453	0.68
	デンマーク	1,015,540,052	0.60
	ジャージー	826,143,725	0.49
	フィンランド	764,042,601	0.45

	シンガポール	716,693,861	0.42
	バミューダ	713,671,871	0.42
	ベルギー	603,656,399	0.35
	ノルウェー	477,179,011	0.28
	ケイマン諸島	356,478,775	0.21
	キュラソー	341,075,078	0.20
	イスラエル	327,290,921	0.19
	ルクセンブルグ	191,760,694	0.11
	オーストリア	147,577,655	0.09
	ニュージーランド	132,615,995	0.08
	ポルトガル	97,784,472	0.06
	リベリア	78,272,432	0.05
	英ヴァージン諸島	38,555,386	0.02
	パプアニューギニア	37,656,013	0.02
	マン島	32,027,114	0.02
	モーリシャス	7,227,584	0.00
	小計	160,251,524,318	94.12
投資証券	アメリカ	2,807,978,967	1.65
	オーストラリア	469,096,121	0.28
	フランス	216,641,760	0.13
	イギリス	128,378,943	0.08
	香港	117,159,950	0.07
	シンガポール	70,107,074	0.04
	カナダ	31,420,629	0.02
	小計	3,840,783,444	2.26
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		6,177,918,284	3.62
合計(純資産総額)		170,270,226,046	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	4,683,711,001	2.75
	買建	ドイツ	1,118,125,707	0.65
	買建	イギリス	424,335,198	0.24

	買建	オーストラリア	277,887,168	0.16
合計	買建		6,504,059,074	3.80

種類	買建/ 売建	国/地域	時価合計(円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	買建		520,321,400	0.30

## 外国債券パッシブ・マザーファンド

2018年10月31日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
国債証券	アメリカ	77,445,272,123	44.80
	フランス	17,655,877,773	10.21
	イタリア	15,169,229,213	8.77
	ドイツ	11,624,551,896	6.72
	イギリス	11,207,422,109	6.48
	スペイン	9,992,803,808	5.78
	ベルギー	4,349,322,018	2.52
	オーストラリア	3,629,983,586	2.10
	カナダ	3,472,209,693	2.01
	オランダ	3,423,316,289	1.98
	オーストリア	2,828,607,177	1.64
	アイルランド	1,466,423,616	0.85
	メキシコ	1,362,510,805	0.79
	フィンランド	1,082,184,445	0.63
	ポーランド	1,061,042,595	0.61
	デンマーク	1,044,310,544	0.60
	南アフリカ	924,825,703	0.53
	マレーシア	837,998,499	0.48
	シンガポール	705,415,346	0.41
	スウェーデン	637,957,762	0.37
ノルウェー	420,497,130	0.24	
	小計	170,341,762,130	98.54
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		2,530,554,688	1.46
合計(純資産総額)		172,872,316,818	100.00

## マネーインカム・マザーファンド

2018年10月31日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
特殊債券	日本	2,047,231,940	70.68
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		849,170,064	29.32
合計(純資産総額)		2,896,402,004	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)

2018年10月31日現在

国/地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	投資 比率 (%)
日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	795,500	7,046.98	5,605,880,236	6,615.00	5,262,232,500	3.09
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	4,902,000	787.15	3,858,613,440	684.80	3,356,889,600	1.97
日本	株式	ソニー	電気機器	478,400	5,243.34	2,508,416,368	6,140.00	2,937,376,000	1.72
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	292,800	9,470.72	2,773,029,000	9,048.00	2,649,254,400	1.55
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	479,100	5,842.45	2,799,120,520	4,750.00	2,275,725,000	1.34
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	495,800	4,549.93	2,255,856,600	4,414.00	2,188,461,200	1.28
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	602,000	3,732.74	2,247,113,429	3,241.00	1,951,082,000	1.15
日本	株式	キーエンス	電気機器	35,000	64,590.99	2,260,684,658	55,300.00	1,935,500,000	1.14
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	9,556,000	203.38	1,943,582,860	194.00	1,853,864,000	1.09
日本	株式	KDDI	情報・通信業	617,200	3,193.46	1,971,006,008	2,814.50	1,737,109,400	1.02
日本	株式	三菱商事	卸売業	493,200	2,833.32	1,397,397,416	3,180.00	1,568,376,000	0.92
日本	株式	任天堂	その他製品	44,000	44,785.40	1,970,557,612	35,160.00	1,547,040,000	0.91
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	488,700	2,664.46	1,302,125,172	3,037.00	1,484,181,900	0.87
日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	294,500	4,612.07	1,358,257,207	4,893.00	1,440,988,500	0.85
日本	株式	NTTドコモ	情報・通信業	503,000	2,901.54	1,459,476,421	2,844.50	1,430,783,500	0.84
日本	株式	東海旅客鉄道	陸運業	63,900	20,823.45	1,330,618,853	21,650.00	1,383,435,000	0.81
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	255,000	4,973.05	1,268,128,476	5,346.00	1,363,230,000	0.80
日本	株式	ファナック	電気機器	67,800	27,614.68	1,872,275,645	19,735.00	1,338,033,000	0.79
日本	株式	花王	化学	173,300	7,463.99	1,293,510,560	7,531.00	1,305,122,300	0.77

日本	株式	武田薬品工業	医薬品	281,900	5,999.82	1,691,351,628	4,570.00	1,288,283,000	0.76
日本	株式	村田製作所	電気機器	74,900	15,283.75	1,144,753,090	17,165.00	1,285,658,500	0.75
日本	株式	ダイキン工業	機械	97,400	12,952.41	1,261,565,316	13,125.00	1,278,375,000	0.75
日本	株式	東日本旅客鉄道	陸運業	126,900	10,835.10	1,374,974,560	9,875.00	1,253,137,500	0.74
日本	株式	日本電産	電気機器	85,900	15,290.36	1,313,442,473	14,490.00	1,244,691,000	0.73
日本	株式	キャノン	電気機器	384,400	4,254.49	1,635,429,790	3,222.00	1,238,536,800	0.73
日本	株式	日本たばこ産業	食料品	413,600	3,681.63	1,522,724,110	2,906.50	1,202,128,400	0.71
日本	株式	信越化学工業	化学	123,200	11,676.08	1,438,494,016	9,469.00	1,166,580,800	0.68
日本	株式	アステラス製薬	医薬品	658,000	1,435.50	944,559,224	1,747.00	1,149,526,000	0.67
日本	株式	日立製作所	電気機器	321,100	4,163.77	1,336,989,720	3,462.00	1,111,648,200	0.65
日本	株式	三井物産	卸売業	579,100	1,714.62	992,941,378	1,885.50	1,091,893,050	0.64

□ 種類別・業種別の投資比率

2018年10月31日現在

種類	国内 / 外国	業種	投資比率 (%)
株式	国内	水産・農林業	0.12
		鉱業	0.33
		建設業	2.87
		食料品	4.20
		繊維製品	0.63
		パルプ・紙	0.31
		化学	6.95
		医薬品	4.96
		石油・石炭製品	0.87
		ゴム製品	0.79
		ガラス・土石製品	0.87
		鉄鋼	1.01
		非鉄金属	0.79
		金属製品	0.58
		機械	4.88
		電気機器	12.79
		輸送用機器	7.93
		精密機器	1.78
		その他製品	2.02
		電気・ガス業	1.81
		陸運業	4.33
		海運業	0.16
		空運業	0.57
倉庫・運輸関連業	0.18		
情報・通信業	7.49		
卸売業	5.00		
小売業	5.07		

	銀行業	6.87
	証券、商品先物取引業	0.97
	保険業	2.43
	その他金融業	1.20
	不動産業	2.31
	サービス業	4.63
合計		97.71

## 国内債券パッシブ・マザーファンド

## イ 主要投資銘柄（上位30銘柄）

2018年10月31日現在

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
日本	国債証券	第313回利付国債(10年)	2,105,000,000	104.03	2,189,915,700	103.40	2,176,612,100	1.300	2021/3/20	1.13
日本	国債証券	第329回利付国債(10年)	2,030,000,000	104.60	2,123,380,000	104.14	2,114,042,000	0.800	2023/6/20	1.10
日本	国債証券	第350回利付国債(10年)	1,900,000,000	100.65	1,912,442,100	100.09	1,901,767,000	0.100	2028/3/20	0.99
日本	国債証券	第315回利付国債(10年)	1,800,000,000	104.10	1,873,908,000	103.48	1,862,748,000	1.200	2021/6/20	0.97
日本	国債証券	第349回利付国債(10年)	1,770,000,000	100.71	1,782,567,000	100.22	1,774,000,200	0.100	2027/12/20	0.92
日本	国債証券	第344回利付国債(10年)	1,681,000,000	100.95	1,696,969,500	100.62	1,691,573,490	0.100	2026/9/20	0.88
日本	国債証券	第340回利付国債(10年)	1,570,000,000	103.30	1,621,822,000	102.93	1,616,016,700	0.400	2025/9/20	0.84
日本	国債証券	第342回利付国債(10年)	1,600,000,000	101.02	1,616,475,200	100.77	1,612,400,000	0.100	2026/3/20	0.84
日本	国債証券	第348回利付国債(10年)	1,595,000,000	100.43	1,601,858,500	100.30	1,599,928,550	0.100	2027/9/20	0.83
日本	国債証券	第59回利付国債(20年)	1,455,000,000	108.30	1,575,808,650	107.47	1,563,717,600	1.700	2022/12/20	0.81
日本	国債証券	第346回利付国債(10年)	1,530,000,000	100.83	1,542,699,000	100.50	1,537,665,300	0.100	2027/3/20	0.80
日本	特殊債券	第103回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1,500,000,000	102.41	1,536,255,000	101.84	1,527,645,000	1.300	2020/3/19	0.79
日本	国債証券	第341回利付国債(10年)	1,407,000,000	102.49	1,442,073,100	102.24	1,438,643,430	0.300	2025/12/20	0.75
日本	国債証券	第343回利付国債(10年)	1,410,000,000	100.99	1,424,066,600	100.72	1,420,208,400	0.100	2026/6/20	0.74
日本	国債証券	第325回利付国債(10年)	1,365,000,000	103.94	1,418,849,250	103.53	1,413,184,500	0.800	2022/9/20	0.73
日本	国債証券	第345回利付国債(10年)	1,398,000,000	100.89	1,410,442,200	100.56	1,405,940,640	0.100	2026/12/20	0.73
日本	国債証券	第339回利付国債(10年)	1,315,000,000	103.00	1,354,463,000	102.85	1,352,569,550	0.400	2025/6/20	0.70
日本	国債証券	第351回利付国債(10年)	1,350,000,000	100.05	1,350,805,700	99.95	1,349,352,000	0.100	2028/6/20	0.70
日本	国債証券	第330回利付国債(10年)	1,285,000,000	104.78	1,346,423,000	104.34	1,340,781,850	0.800	2023/9/20	0.70
日本	国債証券	第334回利付国債(10年)	1,265,000,000	104.11	1,317,004,150	103.73	1,312,184,500	0.600	2024/6/20	0.68

日本	国債証券	第335回利付国債(10年)	1,250,000,000	103.61	1,295,187,500	103.27	1,290,950,000	0.500	2024/9/20	0.67
日本	国債証券	第61回利付国債(20年)	1,215,000,000	105.34	1,279,917,450	104.81	1,273,526,550	1.000	2023/3/20	0.66
日本	特殊債券	第89回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1,251,000,000	101.79	1,273,467,960	101.22	1,266,274,710	1.300	2019/9/30	0.66
日本	国債証券	第128回利付国債(5年)	1,215,000,000	100.70	1,223,590,050	100.59	1,222,217,100	0.100	2021/6/20	0.63
日本	国債証券	第347回利付国債(10年)	1,170,000,000	100.76	1,178,892,000	100.38	1,174,516,200	0.100	2027/6/20	0.61
日本	国債証券	第154回利付国債(20年)	1,050,000,000	113.39	1,190,661,000	111.33	1,168,986,000	1.200	2035/9/20	0.61
日本	国債証券	第132回利付国債(20年)	970,000,000	119.96	1,163,679,900	118.06	1,145,211,100	1.700	2031/12/20	0.59
日本	国債証券	第69回利付国債(20年)	1,020,000,000	112.72	1,149,815,400	111.72	1,139,544,000	2.100	2024/3/20	0.59
日本	国債証券	第338回利付国債(10年)	1,105,000,000	103.14	1,139,752,250	102.81	1,136,094,700	0.400	2025/3/20	0.59
日本	国債証券	第147回利付国債(20年)	960,000,000	119.68	1,148,995,200	117.54	1,128,412,800	1.600	2033/12/20	0.58

## ロ 種類別の投資比率

2018年10月31日現在

種類	投資比率(%)
国債証券	73.05
地方債証券	9.44
特殊債券	12.80
社債券	3.99
合計	99.28

## 外国株式インデックス・マザーファンド

### イ 主要投資銘柄(上位30銘柄)

2018年10月31日現在

国/地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿単価(円)	帳簿価額(円)	評価額単価(円)	評価額(円)	投資比率(%)
アメリカ	株式	APPLE INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	204,177	19,203.23	3,920,858,504	24,158.35	4,932,581,061	2.90
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	303,031	9,457.21	2,865,827,804	11,748.45	3,560,147,522	2.09
アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	小売	17,122	132,274.08	2,264,796,948	173,335.36	2,967,848,191	1.74
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	111,237	15,815.62	1,759,282,834	15,941.34	1,773,267,394	1.04
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	141,482	11,748.45	1,662,195,590	12,084.84	1,709,787,616	1.00
アメリカ	株式	FACEBOOK INC-A	ソフトウェア・サービス	99,482	19,842.01	1,973,923,774	16,560.87	1,647,509,186	0.97



アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORPORATION	エネルギー	175,561	9,305.44	1,633,672,632	8,922.62	1,566,464,581	0.92
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	ソフトウェア・サービス	13,023	115,884.23	1,509,160,382	117,361.14	1,528,394,186	0.90
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	ソフトウェア・サービス	12,384	117,611.44	1,456,500,187	118,867.50	1,472,055,152	0.86
スイス	株式	NESTLE SA-REGISTERED	食品・飲料・タバコ	129,019	9,549.89	1,232,118,252	9,496.96	1,225,288,489	0.72
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	各種金融	52,994	21,542.05	1,141,599,503	23,031.42	1,220,527,124	0.72
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	400,264	3,201.86	1,281,589,371	3,033.10	1,214,041,859	0.71
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	242,394	4,101.14	994,092,844	4,857.72	1,177,482,521	0.69
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	39,819	25,249.05	1,005,391,994	29,252.79	1,164,816,957	0.68
アメリカ	株式	WELLS FARGO & COMPANY	銀行	192,363	6,420.70	1,235,106,923	5,967.66	1,147,958,789	0.67
アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS INC	電気通信サービス	171,136	5,646.01	966,235,738	6,589.46	1,127,694,990	0.66
アメリカ	株式	VISA INC	ソフトウェア・サービス	74,010	12,449.53	921,390,396	15,036.39	1,112,843,786	0.65
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	104,122	10,108.45	1,052,512,551	10,101.65	1,051,804,980	0.62
アメリカ	株式	INTEL CORP	半導体・半導体製造装置	192,982	4,981.17	961,277,075	5,409.29	1,043,897,069	0.61
アメリカ	株式	AT&T INC	電気通信サービス	301,751	3,944.84	1,190,361,165	3,451.03	1,041,352,417	0.61
アメリカ	株式	CHEVRON CORPORATION	エネルギー	79,150	13,260.48	1,049,567,056	12,554.87	993,718,040	0.58
アメリカ	株式	CISCO SYSTEMS INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	194,765	4,249.51	827,656,828	5,049.13	983,393,960	0.58
アメリカ	株式	HOME DEPOT INC	小売	47,771	20,075.33	959,018,828	19,960.94	953,554,179	0.56
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	111,371	6,267.80	698,052,089	8,253.25	919,173,396	0.54
アメリカ	株式	BOEING CO	資本財	22,998	30,776.13	707,789,663	39,630.80	911,429,290	0.54
アメリカ	株式	COCA-COLA CO/THE	食品・飲料・タバコ	167,322	5,147.66	861,317,937	5,394.57	902,630,877	0.53
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	90,055	9,419.24	848,250,280	9,796.55	882,228,977	0.52
アメリカ	株式	MASTERCARD INC-CL A	ソフトウェア・サービス	38,382	16,819.10	645,551,080	21,262.29	816,089,591	0.48
アメリカ	株式	COMCAST CORP-CLASS A	メディア・娯楽	189,992	4,211.00	800,057,604	4,271.03	811,462,406	0.48
アメリカ	株式	THE WALT DISNEY CO.	メディア・娯楽	61,522	11,919.48	733,310,396	12,997.71	799,645,582	0.47

□ 種類別・業種別の投資比率

2018年10月31日現在

種類	国内 / 外国	業種	投資比率 (%)
株式	外国	エネルギー	6.54
		素材	4.27
		資本財	6.69
		商業・専門サービス	1.05
		運輸	1.89
		自動車・自動車部品	1.23
		耐久消費財・アパレル	1.69
		消費者サービス	1.75
		メディア・娯楽	2.01
		小売	4.55
		食品・生活必需品小売り	1.62
		食品・飲料・タバコ	4.89
		家庭用品・パーソナル用品	1.89
		ヘルスケア機器・サービス	4.83
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	8.28
		銀行	8.30
		各種金融	4.18
		保険	3.65
		不動産	0.75
		ソフトウェア・サービス	11.16
テクノロジー・ハードウェアおよび機器	4.61		
電気通信サービス	2.39		
公益事業	3.16		
半導体・半導体製造装置	2.73		
投資証券			2.26
合計			96.37

## 外国債券パッシブ・マザーファンド

## イ 主要投資銘柄（上位30銘柄）

2018年10月31日現在

国 / 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.375	7,000,000	11,393.95	797,576,920	10,953.48	766,743,659	2.375	2024/8/15	0.44
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 3	5,000,000	14,711.27	735,563,561	14,320.84	716,042,201	3.000	2022/4/25	0.41
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.75	6,200,000	11,664.89	723,223,502	11,221.58	695,738,483	2.750	2023/11/15	0.40
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 2.75	4,500,000	15,621.83	702,982,795	15,302.43	688,609,552	2.750	2027/10/25	0.40
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 3.625	6,000,000	11,748.95	704,937,319	11,447.22	686,833,419	3.625	2020/2/15	0.40
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.75	6,100,000	11,229.61	685,006,560	11,233.09	685,218,578	2.750	2023/8/31	0.40

アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.25	6,300,000	11,303.87	712,144,374	10,849.95	683,547,105	2.250	2024/11/15	0.40
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 4.5	3,300,000	21,151.13	697,987,511	20,595.03	679,636,148	4.500	2041/4/25	0.39
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 1.75	4,800,000	14,152.27	679,309,037	14,077.46	675,718,519	1.750	2024/11/25	0.39
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.25	6,200,000	11,225.19	695,962,313	10,641.13	659,750,118	2.250	2027/2/15	0.38
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.25	6,200,000	11,107.00	688,634,003	10,569.45	655,306,436	2.250	2027/11/15	0.38
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2	6,200,000	11,008.34	682,517,151	10,465.04	648,832,919	2.000	2026/11/15	0.38
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.375	6,000,000	11,342.81	680,568,726	10,728.73	643,723,832	2.375	2027/5/15	0.37
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.75	5,800,000	11,234.43	651,597,239	11,002.14	638,124,537	2.750	2028/2/15	0.37
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.5	5,700,000	11,484.56	654,620,148	11,046.38	629,644,194	2.500	2024/5/15	0.36
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.625	5,500,000	11,541.90	634,804,603	11,274.67	620,107,348	2.625	2020/11/15	0.36
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 2.25	4,300,000	14,536.99	625,090,643	14,392.37	618,872,319	2.250	2024/5/25	0.36
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 1.625	6,000,000	10,734.92	644,095,463	10,275.69	616,541,432	1.625	2026/2/15	0.36
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 1.75	5,700,000	11,074.70	631,258,149	10,757.93	613,202,027	1.750	2023/5/15	0.35
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 5.75	2,900,000	21,530.00	624,370,150	20,851.38	604,690,051	5.750	2032/10/25	0.35
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2	5,500,000	11,228.66	617,576,694	10,898.62	599,424,128	2.000	2023/2/15	0.35
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2	5,600,000	11,105.14	621,888,008	10,668.56	597,439,424	2.000	2025/2/15	0.35
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 4.25	3,800,000	16,142.36	613,409,935	15,602.70	592,902,746	4.250	2023/10/25	0.34
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 3.625	5,000,000	13,359.37	667,968,547	11,849.82	592,491,375	3.625	2044/2/15	0.34
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.25	5,500,000	11,270.50	619,877,643	10,760.58	591,832,169	2.250	2025/11/15	0.34
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.75	5,200,000	11,284.99	586,819,994	11,279.10	586,513,373	2.750	2021/9/15	0.34
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 1.5	5,800,000	10,578.48	613,552,072	10,105.80	586,136,430	1.500	2026/8/15	0.34
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.875	5,200,000	11,237.52	584,351,379	11,101.24	577,264,984	2.875	2028/8/15	0.33
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 4.75	2,900,000	20,449.90	593,047,359	19,876.46	576,417,600	4.750	2035/4/25	0.33
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 3.625	5,000,000	11,893.18	594,659,245	11,513.58	575,679,344	3.625	2021/2/15	0.33

## ロ 種類別の投資比率

2018年10月31日現在

種類	投資比率（％）
国債証券	98.54
合計	98.54

## マネーインカム・マザーファンド

### イ 主要投資銘柄

2018年10月31日現在

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
日本	特殊債券	第9回政府保証 日本高速道路保 有・債務返済機構 債券	300,000,000	101.26	303,795,000	101.23	303,702,000	1.200	2019/10/31	10.49
日本	特殊債券	第3回政府保証地 方公共団体金融機 構債券	200,000,000	101.57	203,159,000	101.21	202,430,000	1.500	2019/8/16	6.99
日本	特殊債券	第7回政府保証 日本高速道路保 有・債務返済機構 債券	201,000,000	101.00	203,022,060	100.21	201,432,150	1.400	2018/12/25	6.95
日本	特殊債券	第4回政府保証地 方公営企業等金融 機構債券	200,000,000	101.03	202,076,000	100.30	200,606,000	1.300	2019/1/22	6.93
日本	特殊債券	第6回政府保証 日本高速道路保 有・債務返済機構 債券	200,000,000	101.02	202,050,000	100.12	200,250,000	1.600	2018/11/28	6.91
日本	特殊債券	第8回政府保証 日本高速道路保 有・債務返済機構 債券	131,000,000	101.61	133,114,340	101.00	132,321,790	1.500	2019/6/28	4.57
日本	特殊債券	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	101.60	101,601,000	101.54	101,549,000	1.400	2019/11/29	3.51
日本	特殊債券	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	101.48	101,480,000	101.22	101,221,000	1.300	2019/9/30	3.49
日本	特殊債券	第5回政府保証 日本高速道路保 有・債務返済機構 債券	100,000,000	101.44	101,443,000	101.07	101,073,000	1.400	2019/7/31	3.49
日本	特殊債券	第8回政府保証地 方公営企業等金融 機構債券	100,000,000	101.70	101,701,000	100.86	100,862,000	1.500	2019/5/24	3.48
日本	特殊債券	第5回政府保証株 式会社日本政策投 資銀行社債	100,000,000	100.91	100,919,000	100.65	100,652,000	1.400	2019/4/15	3.48
日本	特殊債券	第15回政府保証 東日本高速道路債 券	100,000,000	101.16	101,162,000	100.42	100,428,000	1.300	2019/2/25	3.47
日本	特殊債券	第5回政府保証地 方公営企業等金融 機構債券	100,000,000	101.13	101,137,000	100.40	100,402,000	1.300	2019/2/18	3.47
日本	特殊債券	第2回政府保証 中日本高速道路債 券	100,000,000	101.03	101,038,000	100.30	100,303,000	1.300	2019/1/22	3.46

以上が、当ファンドが保有する有価証券のすべてです。

#### □ 種類別の投資比率

2018年10月31日現在

種類	投資比率 (%)
特殊債券	70.68
合計	70.68

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）

2018年10月31日現在

種類	取引所等	名称	買建/ 売建	数量	通貨	簿価 (円)	時価 (円)	投資 比率 (%)
株価指数先物 取引	大阪取引所	東証株価指数先物	買建	245	日本円	3,993,214,600	4,020,450,000	2.35

(注) 主たる取引所の発表する清算値段または最終相場で評価しております。

## 国内債券パッシブ・マザーファンド

該当事項はありません。

## 外国株式インデックス・マザーファンド

2018年10月31日現在

種類	地域	取引所等	名称	買建/ 売建	数量	通貨	帳簿価額	簿価 (円)	評価額	時価 (円)	投資 比率 (%)
株価指 数先物 取引	アメリカ	シカゴ商業 取引所	SPMINI 1812	買建	308	米ドル	43,062,166.5	4,877,220,978	41,353,620	4,683,711,001	2.75
	ドイツ	ユーレック ス・ドイツ 金融先物取 引所	DJ EUR 1812	買建	277	ユーロ	8,989,194	1,154,482,185	8,706,110	1,118,125,707	0.65
	オース トラリ ア	シドニー先 物取引所	SP1200 1812	買建	24	オースト ラリアド ル	3,594,633	288,433,352	3,463,200	277,887,168	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 1812	買建	42	英ポンド	2,984,779	429,509,698	2,948,820	424,335,198	0.24

（注）主たる取引所の発表する清算値段または最終相場で評価しております。

2018年10月31日現在

種類	資産の名称	買建 / 売建	数量	簿価 （円）	時価 （円）	投資 比率 （%）
為替予約取引	米ドル	買建	3,130,000.00	353,618,800	354,453,000	0.20
	カナダドル	買建	190,000.00	16,347,700	16,419,800	0.00
	ユーロ	買建	480,000.00	61,513,200	61,646,400	0.03
	英ポンド	買建	240,000.00	34,548,000	34,533,600	0.02
	スイスフラン	買建	170,000.00	19,119,900	19,147,100	0.01
	スウェーデンクローナ	買建	430,000.00	5,301,000	5,306,200	0.00
	ノルウェークローネ	買建	120,000.00	1,613,700	1,614,000	0.00
	デンマーククローネ	買建	240,000.00	4,125,600	4,130,400	0.00
	オーストラリアドル	買建	150,000.00	11,990,400	12,034,500	0.00
	ニュージーランドドル	買建	10,000.00	734,900	741,900	0.00
	香港ドル	買建	480,000.00	6,908,400	6,926,400	0.00
	シンガポールドル	買建	30,000.00	2,447,700	2,452,500	0.00
	イスラエルシェケル	買建	30,000.00	914,006	915,600	0.00

（注）日本における対顧客先物相場の仲値で評価しております。

#### 外国債券パッシブ・マザーファンド

該当事項はありません。

#### マネーインカム・マザーファンド

該当事項はありません。

#### 参考情報

基準日:2018年10月31日

※ファンドの運用実績はあくまで過去の実績であり、将来の運用成果を約束するものではありません。  
※委託会社ホームページにおいてもファンドの運用状況は適宜開示しています。

**基準価額・純資産の推移**

**分配の推移**

## ▶&lt;2040&gt;



決算期	分配金
2018年4月	0円
2017年4月	0円
2016年4月	0円
2015年4月	0円
2014年4月	0円
設定来累計	0円

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

※基準価額は、1万口当たり、信託報酬控除後です。

## 主要な資産の状況

## ▶&lt;2040&gt;

## 資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
親投資信託受益証券	日本	99.41
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		0.59
合計(純資産総額)		100.00

## 主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	比率(%)
日本	親投資信託受益証券	国内株式インデックス・マザーファンド(B号)	30.08
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	26.11
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	21.33
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	20.11
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	1.78

※比率は、各ファンドの純資産総額に対する時価の比率です。

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



## 国内株式インデックス・マザーファンド(B号)

### 資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
株式	日本	97.71
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		2.29
合計(純資産総額)		100.00

※株価指数先物取引の買建て 2.35%

### 主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	業種	比率(%)
日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	3.09
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	1.97
日本	株式	ソニー	電気機器	1.72
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	1.55
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	1.34
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	1.28
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	1.15
日本	株式	キーエンス	電気機器	1.14
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	1.09
日本	株式	KDDI	情報・通信業	1.02

## 国内債券パッシブ・マザーファンド

### 資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
国債証券	日本	73.05
特殊債券	日本	12.80
地方債証券	日本	9.44
社債券	日本	3.78
	オーストラリア	0.10
	フランス	0.10
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		0.72
合計(純資産総額)		100.00

### 主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	利率(%)	償還期限	比率(%)
日本	国債証券	第313回利付国債(10年)	1.300	2021/03/20	1.13
日本	国債証券	第329回利付国債(10年)	0.800	2023/06/20	1.10
日本	国債証券	第350回利付国債(10年)	0.100	2028/03/20	0.99
日本	国債証券	第315回利付国債(10年)	1.200	2021/06/20	0.97
日本	国債証券	第349回利付国債(10年)	0.100	2027/12/20	0.92
日本	国債証券	第344回利付国債(10年)	0.100	2026/09/20	0.88
日本	国債証券	第340回利付国債(10年)	0.400	2025/09/20	0.84
日本	国債証券	第342回利付国債(10年)	0.100	2026/03/20	0.84
日本	国債証券	第348回利付国債(10年)	0.100	2027/09/20	0.83
日本	国債証券	第59回利付国債(20年)	1.700	2022/12/20	0.81

## 外国株式インデックス・マザーファンド

### 資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
株式	アメリカ	61.58
	イギリス	6.00
	フランス	3.57
	カナダ	3.56
	スイス	3.38
	ドイツ	3.25
	その他	12.78
	投資証券	アメリカ・その他
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		3.62
合計(純資産総額)		100.00

※株価指数先物取引の買建て 3.80%

### 主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	業種	比率(%)
アメリカ	株式	APPLE INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	2.90
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	2.09
アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	小売	1.74
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	1.04
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	1.00
アメリカ	株式	FACEBOOK INC-A	ソフトウェア・サービス	0.97
アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORPORATION	エネルギー	0.92
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	ソフトウェア・サービス	0.90
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	ソフトウェア・サービス	0.86
スイス	株式	NESTLE SA-REGISTERED	食品・飲料・タバコ	0.72

※比率は、各マザーファンドのそれぞれの純資産総額に対する時価の比率です。



## ■外国債券パッシブ・マザーファンド

### 資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
国債証券	アメリカ	44.80
	フランス	10.21
	イタリア	8.77
	ドイツ	6.72
	イギリス	6.48
	スペイン	5.78
	ベルギー	2.52
	その他	13.25
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1.46
合計(純資産総額)		100.00

### 主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	利率(%)	償還期限	比率(%)
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.375	2.375	2024/08/15	0.44
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 3	3.000	2022/04/25	0.41
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.75	2.750	2023/11/15	0.40
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 2.75	2.750	2027/10/25	0.40
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 3.625	3.625	2020/02/15	0.40
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.75	2.750	2023/08/31	0.40
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.25	2.250	2024/11/15	0.40
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 4.5	4.500	2041/04/25	0.39
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 1.75	1.750	2024/11/25	0.39
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.25	2.250	2027/02/15	0.38

## ■マネーインカム・マザーファンド

### 資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
特殊債券	日本	70.68
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		29.32
合計(純資産総額)		100.00

### 主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	利率(%)	償還期限	比率(%)
日本	特殊債券	第91回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.200	2019/10/31	10.49
日本	特殊債券	第3回政府保証地方公共団体金融機構債券	1.500	2019/08/16	6.99
日本	特殊債券	第71回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.400	2018/12/25	6.95
日本	特殊債券	第4回政府保証地方公営企業等金融機構債券	1.300	2019/01/22	6.93
日本	特殊債券	第69回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.600	2018/11/28	6.91
日本	特殊債券	第82回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.500	2019/06/28	4.57
日本	特殊債券	第93回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.400	2019/11/29	3.51
日本	特殊債券	第89回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.300	2019/09/30	3.49
日本	特殊債券	第85回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.400	2019/07/31	3.49
日本	特殊債券	第8回政府保証地方公営企業等金融機構債券	1.500	2019/05/24	3.48

※比率は、各マザーファンドのそれぞれの純資産総額に対する時価の比率です。

## 年間収益率の推移(暦年ベース)

### <2040>



※換金時に費用・税金などがかかる場合があります。したがって、ファンドの収益率は実際の投資家利回りとは異なります。

※2018年のファンドの収益率は、年初から2018年10月31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。

ご購入の販売会社にお申し出ください。

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

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

一部解約金は、解約請求受付日から起算して5営業日目からお支払いします。

一部解約価額は、解約請求受付日の翌営業日の基準価額となります。

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

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

## 3【資産管理等の概要】

### （1）【資産の評価】

#### イ 基準価額の算出方法

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

#### ロ 基準価額の算出頻度・照会方法

基準価額は、委託会社の営業日において日々算出されます。

基準価額は、販売会社または委託会社にお問い合わせいただけるほか、原則として翌日付の日本経済新聞朝刊の証券欄「オープン基準価格」の紙面に、「DC2040」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】

2008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発します。
- 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。

(ハ) 委託会社の登録取消等に伴う取扱い

委託会社が、監督官庁より登録の取消しを受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託会社は当ファンドの信託契約を解約し、信託を終了させます。ただし、監督官庁が当ファンドに関する委託会社の業務を他の委託会社に引継ぐことを命じたときは、当ファンドは、その委託会社と受託会社との間において存続します。

(ニ) 受託会社の辞任および解任に伴う取扱い

- a. 受託会社は、委託会社の承諾を受けてその任務を辞任することができます。また、受託会社

が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せん。
- 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。
- (ニ) 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(ニ)までの取扱いは、委託会社が重大な信託約款の変更等について提案をした場合において、当該提案につき、当ファンドのすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。
- (ヘ) 上記にかかわらず、当ファンドと他のファンドとの併合の場合は、当ファンドにおいて併合の書面決議が可決された場合にあつても、相手方となる他のファンドにおいて当該併合の書面決議



議が否決された場合は、併合を行うことはできません。

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

## ヘ 委託会社の事業の譲渡および承継に伴う取扱い

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

## ト 公告

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

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

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

## チ 運用にかかる報告書の開示方法

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

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

## 4【受益者の権利等】

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

受益者の有する主な権利は次の通りです。

### イ 分配金請求権

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

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

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

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

### ロ 償還金請求権

受益者は、持分に応じて償還金を請求する権利を有します。

償還金は、信託終了後1ヵ月以内の委託会社の指定する日（原則として償還日から起算して5営業日以内）に支払われます。

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10期(平成29年 4月14日から平成30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】



## 【三井住友・DCターゲットイヤーファンド2040（4資産タイプ）】

## （1）【貸借対照表】

（単位：円）

	第9期 （平成29年 4月13日現在）	第10期 （平成30年 4月13日現在）
<b>資産の部</b>		
流動資産		
金銭信託	-	1,764,937
コール・ローン	2,042,548	535,002
親投資信託受益証券	234,553,849	328,390,952
未収入金	-	2,000,000
流動資産合計	236,596,397	332,690,891
資産合計	236,596,397	332,690,891
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	5,220	138,305
未払受託者報酬	36,253	50,892
未払委託者報酬	471,291	661,582
未払利息	3	1
その他未払費用	6,004	8,679
流動負債合計	518,771	859,459
負債合計	518,771	859,459
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	168,519,500	214,950,711
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	67,558,126	116,880,721
元本等合計	236,077,626	331,831,432
純資産合計	236,077,626	331,831,432
負債純資産合計	236,596,397	332,690,891

## (2)【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第9期		第10期	
	自	平成28年 4月14日 至 平成29年 4月13日	自	平成29年 4月14日 至 平成30年 4月13日
営業収益				
有価証券売買等損益		12,329,040		26,407,103
営業収益合計		12,329,040		26,407,103
営業費用				
支払利息		1,312		1,734
受託者報酬		66,644		93,937
委託者報酬		866,218		1,221,197
その他費用		11,248		16,034
営業費用合計		945,422		1,332,902
営業利益又は営業損失( )		11,383,618		25,074,201
経常利益又は経常損失( )		11,383,618		25,074,201
当期純利益又は当期純損失( )		11,383,618		25,074,201
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( )		614,493		886,784
期首剰余金又は期首欠損金( )		44,063,292		67,558,126
剰余金増加額又は欠損金減少額		17,865,515		28,259,664
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		17,865,515		28,259,664
剰余金減少額又は欠損金増加額		5,139,806		3,124,486
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		5,139,806		3,124,486
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( )		67,558,126		116,880,721

## （ 3 ）【注記表】

## （ 重要な会計方針の注記 ）

項 目	第10期
	自 平成29年 4月14日 至 平成30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9期	第10期
	( 平成29年 4月13日現在 )	( 平成30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	168,519,500口	214,950,711口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.4009円 (10,000口当たりの純資産額 14,009円)	1口当たり純資産額 1.5438円 (10,000口当たりの純資産額 15,438円)

## （ 損益及び剰余金計算書に関する注記 ）

項目	第9期	第10期
	自 平成28年 4月14日 至 平成29年 4月13日	自 平成29年 4月14日 至 平成30年 4月13日
分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益(3,785,039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(72,316,446円)、および分配準備積立金(11,548,119円)より、分配対象収益は87,649,604円(1万口当たり5,201.14円)ですが、分配を行っておりません。	計算期間末における費用控除後の配当等収益(5,303,802円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(10,765,852円)、収益調整金(97,148,903円)、および分配準備積立金(14,745,713円)より、分配対象収益は127,964,270円(1万口当たり5,953.16円)ですが、分配を行っておりません。

## (金融商品に関する注記)

## . 金融商品の状況に関する事項

項目	第10期
	自 平成29年 4月14日 至 平成30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、価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2)金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>

項目	第10期 自 平成29年 4月14日 至 平成30年 4月13日
3.金融商品に係るリスク管理体制	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する委員会をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用グループに是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用グループは、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。その後、当該関連運用グループの対処の実施や対処方針の決定等に関し、必要に応じてリスク管理を行う部署が当該部署の担当役員、当該関連運用グループの担当役員およびリスク管理委員会へ報告を行う体制となっております。</p> <p>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する部会にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。</p>
4.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって認める評価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。</p>

#### ・金融商品の時価等に関する事項

項目	第10期 (平成30年 4月13日現在)
1.貸借対照表計上額、時価及び差額	<p>金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p>
2.時価の算定方法	<p>(1) 有価証券（親投資信託受益証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

第9期（自 平成28年 4月14日 至 平成29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	11,560,626円
合計	11,560,626円

第10期（自 平成29年 4月14日 至 平成30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	25,054,310円
合計	25,054,310円

## （デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

## （関連当事者との取引に関する注記）

第10期 自 平成29年 4月14日 至 平成30年 4月13日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。

## （その他の注記）

項 目	第9期 （平成29年 4月13日現在）	第10期 （平成30年 4月13日現在）
期首元本額	134,853,371円	168,519,500円
期中追加設定元本額	49,340,920円	53,950,215円
期中一部解約元本額	15,674,791円	7,519,004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）	37,694,743	100,196,396	
	外国株式インデックス・マザーファンド	22,367,694	73,994,568	
	外国債券パッシブ・マザーファンド	37,838,418	65,770,738	
	国内債券パッシブ・マザーファンド	65,165,843	82,389,175	
	マネーインカム・マザーファンド	5,975,540	6,040,075	
合計		169,042,238	328,390,952	

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

(参考)

三井住友・DCターゲットイヤーファンド2040（4資産タイプ）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29年 4月13日現在)	(平成30年 4月13日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	-	2,296,322,668
コール・ローン	2,834,577,861	696,080,183
株式	192,397,438,150	176,796,539,042
派生商品評価勘定	-	79,387,680
未収入金	-	1,143,520
未収配当金	1,888,213,581	1,668,690,100
前払金	215,520,000	-
差入委託証拠金	-	25,305,000
流動資産合計	197,335,749,592	181,563,468,193
資産合計	197,335,749,592	181,563,468,193
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	215,669,040	212,560
前受金	-	79,430,000

	（平成29年 4月13日現在）	（平成30年 4月13日現在）
未払金	38,812,000	-
未払解約金	633,868,121	548,844,868
未払利息	4,581	2,040
その他未払費用	44,779	347,014
流動負債合計	888,398,521	628,836,482
負債合計	888,398,521	628,836,482
純資産の部		
元本等		
元本	88,953,399,408	68,068,329,504
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	107,493,951,663	112,866,302,207
元本等合計	196,447,351,071	180,934,631,711
純資産合計	196,447,351,071	180,934,631,711
負債純資産合計	197,335,749,592	181,563,468,193

## 注記表

## （重要な会計方針の注記）

項目	自 平成29年 4月14日 至 平成30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) 金融商品取引所等の上場されている有価証券 金融商品取引所等の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) 金融商品取引所等の上場されていない有価証券 金融商品取引所等の上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>先物取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場によっております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金の計上基準</p> <p>受取配当金は原則として、配当落ち日において、確定配当金額または予想配当金額を計上しております。なお、配当金額が未確定の場合は、入金日基準で計上しております。</p>

## （貸借対照表に関する注記）

項目	（平成29年 4月13日現在）	（平成30年 4月13日現在）
----	-----------------	-----------------



1. 担保資産	代用として、担保に供している資産は次の通りであります。	代用として、担保に供している資産は次の通りであります。
	株式 2,865,500,000円	株式 2,764,000,000円
2. 当計算期間の末日における受益権の総数	88,953,399,408口	68,068,329,504口
3. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 2.2084円 (10,000口当たりの純資産額 22,084円)	1口当たり純資産額 2.6581円 (10,000口当たりの純資産額 26,581円)

## (金融商品に関する注記)

## . 金融商品の状況に関する事項

項目	自 平成29年 4月14日 至 平成30年 4月13日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、株式を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。 当計算期間については、先物取引を行っております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>

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

#### ・金融商品の時価等に関する事項

項目	(平成30年 4月13日現在)
1.貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	<p>(1) 有価証券（株式） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

（デリバティブ取引に関する注記）

（平成29年 4月13日現在）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

（単位：円）

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	4,172,519,040	-	3,956,850,000	215,669,040
	東証株価指数先物	4,172,519,040	-	3,956,850,000	215,669,040
合計		4,172,519,040	-	3,956,850,000	215,669,040

（平成30年 4月13日現在）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

（単位：円）

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	4,003,624,880	-	4,082,800,000	79,175,120
	東証株価指数先物	4,003,624,880	-	4,082,800,000	79,175,120
合計		4,003,624,880	-	4,082,800,000	79,175,120

（注）1．時価の算定方法

(1) 株価指数先物取引の時価の算定方法について

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

2) 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

2．ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

自 平成29年 4月14日 至 平成30年 4月13日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。

（その他の注記）

（平成29年 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	101,243,854,770円
同期中における追加設定元本額	20,447,663,690円
同期中における一部解約元本額	32,738,119,052円
平成29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	9,874,363,739円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	591,877,621円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	2,826,539,442円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	2,037,392,883円
SMAM・グローバルバランスファンド(機動的資産配分型)	88,471,035円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2020(4資産タイプ)	8,783,971円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2025(4資産タイプ)	23,579,194円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2030(4資産タイプ)	59,715,277円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2035(4資産タイプ)	59,967,602円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2040(4資産タイプ)	31,907,731円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2045(4資産タイプ)	80,984,467円
国内株式指数ファンド(TOPIX)	1,749,419,277円
三井住友・DC日本株式インデックスファンドS	1,812,129,756円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	1,747,890,526円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	2,050,537,030円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	2,254,237,958円
イオン・バランス戦略ファンド	4,143,496円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2050	3,714,174円
SMAM・国内株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	11,563,234,699円
バランスファンドVA(安定運用型) <適格機関投資家限定>	53,219,713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>	7,407,446,299円
SMAM・バランスファンドVA25 <適格機関投資家専用>	5,242,604,674円
SMAM・バランスファンドVA37.5 <適格機関投資家専用>	3,233,328,475円
SMAM・バランスファンドVA50 <適格機関投資家専用>	11,906,550,508円
SMAM・バランスファンドVL30 <適格機関投資家限定>	66,465,825円
SMAM・バランスファンドVL50 <適格機関投資家限定>	286,787,060円
世界6資産バランスファンドVA <適格機関投資家限定>	7,947,015円
SMAM・バランスファンドVA75 <適格機関投資家専用>	1,268,372,695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>	76,730,984円
SMAM・インデックス・バランスVA25 <適格機関投資家専用>	463,133,118円
SMAM・インデックス・バランスVA50 <適格機関投資家専用>	1,417,032,401円
SMAM・バランスファンドVA40 <適格機関投資家専用>	2,408,713,760円
SMAM・バランスファンドVA35 <適格機関投資家専用>	4,145,417,817円
SMAM・バランスVA株40T <適格機関投資家限定>	106,434,313円
三井住友・5資産バランスファンド・VAS(適格機関投資家専用)	1,962,608,632円
SMAM・グローバルバランス40VA <適格機関投資家限定>	87,447,724円
SMAM・バランスファンドVA20 <適格機関投資家専用>	142,173,296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)	2,182,237,989円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A <適格機関投資家専用>	133,378,406円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A <適格機関投資家専用>	62,338,241円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A <適格機関投資家専用>	28,597,369円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L <適格機関投資家専用>	284,050,792円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L <適格機関投資家専用>	482,778,920円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T <適格機関投資家専用>	215,218,371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 >	146,623,095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 >	71,447,740円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 5 0 A 2 < 適格機関投資家専用 >	12,212,418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 >	97,696,853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 >	1,243,055,864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 )	232,330,680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 >	24,843,673円
S M A M ・ グローバルバランスファンド ( 標準型 ) V A < 適格機関投資家限定 >	2,318,364,544円
S M A M ・ グローバルバランスファンド ( 債券重視型 ) V A < 適格機関投資家限定 >	381,908,627円
S M A M ・ 世界バランスファンドV A < 適格機関投資家限定 >	2,280,387,276円
S M A M ・ 世界バランスファンドV A 2 < 適格機関投資家限定 >	1,360,250,642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 >	21,880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 >	60,899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 >	227,744円
S M A M ・ マルチアセットストラテジーファンド2 0 1 6 - 0 4 < 適格機関投資家限定 >	115,594,073円
S M A M ・ マルチアセットストラテジーファンド2 0 1 6 - 0 5 < 適格機関投資家限定 >	55,350,457円
S M A M ・ マルチアセットストラテジー・オープン < 適格機関投資家限定 >	73,118,668円
合計	88,953,399,408円

(平成30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	88,953,399,408円
同期中における追加設定元本額	9,849,755,431円
同期中における一部解約元本額	30,734,825,335円
平成30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	10,019,201,676円
三井住友・D C 年金バランス3 0 ( 債券重点型 )	656,170,114円
三井住友・D C 年金バランス5 0 ( 標準型 )	3,174,611,330円
三井住友・D C 年金バランス7 0 ( 株式重点型 )	2,341,574,535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 )	98,423,118円
三井住友・D C ターゲットイヤーファンド2 0 2 0 ( 4 資産タイプ )	7,451,102円
三井住友・D C ターゲットイヤーファンド2 0 2 5 ( 4 資産タイプ )	23,605,504円
三井住友・D C ターゲットイヤーファンド2 0 3 0 ( 4 資産タイプ )	57,669,775円
三井住友・D C ターゲットイヤーファンド2 0 3 5 ( 4 資産タイプ )	67,460,127円
三井住友・D C ターゲットイヤーファンド2 0 4 0 ( 4 資産タイプ )	37,694,743円
三井住友・D C ターゲットイヤーファンド2 0 4 5 ( 4 資産タイプ )	103,594,831円
国内株式指数ファンド ( T O P I X )	1,674,090,137円
三井住友・D C つみたてN I S A ・ 日本株インデックスファンド	4,850,049,150円
アセットアロケーション・ファンド ( 安定型 )	530,400,363円
アセットアロケーション・ファンド ( 安定成長型 )	764,660,113円
アセットアロケーション・ファンド ( 成長型 )	756,226,519円
三井住友・D C ターゲットイヤーファンド2 0 5 0	4,128,918円
三井住友・資産最適化ファンド ( 1 安定重視型 )	312,825円

三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	1,379,644円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	11,116,632円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	12,707,145円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	48,494,238円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	2,206,030円
SMAM・国内株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	7,050,490,278円
バランスファンドVA(安定運用型)〈適格機関投資家限定〉	29,843,140円
SMAM・バランスファンドVA安定成長型〈適格機関投資家限定〉	2,100,013,284円
SMAM・バランスファンドVA25〈適格機関投資家専用〉	3,897,902,109円
SMAM・バランスファンドVA37.5〈適格機関投資家専用〉	2,575,394,920円
SMAM・バランスファンドVA50〈適格機関投資家専用〉	9,519,506,705円
SMAM・バランスファンドVL30〈適格機関投資家限定〉	58,389,025円
SMAM・バランスファンドVL50〈適格機関投資家限定〉	233,380,829円
世界6資産バランスファンドVA〈適格機関投資家限定〉	1,265,342円
SMAM・バランスファンドVA75〈適格機関投資家専用〉	1,042,616,592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〉	58,305,372円
SMAM・インデックス・バランスVA25〈適格機関投資家専用〉	403,229,598円
SMAM・インデックス・バランスVA50〈適格機関投資家専用〉	1,139,461,875円
SMAM・バランスファンドVA40〈適格機関投資家専用〉	1,176,432,255円
SMAM・バランスファンドVA35〈適格機関投資家専用〉	3,292,030,822円
SMAM・バランスVA株40T〈適格機関投資家限定〉	58,530,027円
三井住友・5資産バランスファンド・VAS(適格機関投資家専用)	1,491,761,168円
SMAM・グローバルバランス40VA〈適格機関投資家限定〉	70,337,724円
SMAM・バランスファンドVA20〈適格機関投資家専用〉	113,704,142円
三井住友・7資産バランスファンド・VAS(適格機関投資家専用)	1,676,254,768円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A〈適格機関投資家専用〉	113,401,289円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A〈適格機関投資家専用〉	49,655,788円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A〈適格機関投資家専用〉	22,291,989円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L〈適格機関投資家専用〉	230,253,415円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L〈適格機関投資家専用〉	413,451,782円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T〈適格機関投資家専用〉	171,547,764円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A2〈適格機関投資家専用〉	122,157,944円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A2〈適格機関投資家専用〉	60,182,351円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A2〈適格機関投資家専用〉	11,179,619円
SMAM・アセットバランスファンドVA30L2〈適格機関投資家専用〉	79,078,095円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L2〈適格機関投資家専用〉	1,028,353,423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)	199,684,881円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T2〈適格機関投資家専用〉	21,028,969円
SMAM・グローバルバランスファンド(標準型)VA〈適格機関投資家限定〉	1,787,366,166円
SMAM・グローバルバランスファンド(債券重視型)VA〈適格機関投資家限定〉	265,581,987円
SMAM・世界バランスファンドVA〈適格機関投資家限定〉	1,772,189,307円
SMAM・世界バランスファンドVA2〈適格機関投資家限定〉	308,023,278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〉	7,364,536円
SMAM・マルチアセットストラテジーファンド2016-04〈適格機関投資家限定〉	70,808,588円
SMAM・マルチアセットストラテジーファンド2016-05〈適格機関投資家限定〉	33,953,240円
SMAM・マルチアセットストラテジー・オープン〈適格機関投資家限定〉	68,688,360円

S M A M ・ マ ル チ ア セ ッ ト ・ ダイ ナ ミ ッ ク ア ロ ケ ー シ ョ ン ・ ス ト ラ テ ジ ー ・ フ ァ ン ド < 適 格 機 関 投 資 家 限 定 >	8,189円
合 計	68,068,329,504円

## 附属明細表

## 有価証券明細表

## (a) 株式

(単位：円)

銘 柄	株 数	評 価 額		備 考
		単 価	金 額	
極洋	3,400	3,760.00	12,784,000	
日本水産	91,400	572.00	52,280,800	
マルハニチロ	15,300	3,545.00	54,238,500	
カネコ種苗	3,800	1,616.00	6,140,800	
サカタのタネ	11,600	3,960.00	45,936,000	
ホクト	7,700	2,034.00	15,661,800	
住石ホールディングス	21,000	161.00	3,381,000	
日鉄鉱業	2,300	6,100.00	14,030,000	
三井松島産業	5,000	1,509.00	7,545,000	
国際石油開発帝石	391,200	1,394.50	545,528,400	
石油資源開発	12,500	2,586.00	32,325,000	
K & O エナジーグループ	5,100	1,666.00	8,496,600	
ショーボンドホールディングス	7,500	7,830.00	58,725,000	
ミライト・ホールディングス	23,900	1,708.00	40,821,200	
タマホーム	8,700	1,396.00	12,145,200	
T A T E R U	7,400	2,300.00	17,020,000	
ダイセキ環境ソリューション	3,600	1,094.00	3,938,400	
安藤・間	62,000	827.00	51,274,000	
東急建設	30,300	1,116.00	33,814,800	
コムシスホールディングス	28,200	2,862.00	80,708,400	
ミサワホーム	8,000	930.00	7,440,000	
ビーアールホールディングス	10,900	401.00	4,370,900	
高松コンストラクショングループ	4,900	2,988.00	14,641,200	
東建コーポレーション	2,900	10,750.00	31,175,000	
大成建設	79,500	5,360.00	426,120,000	
大林組	238,700	1,162.00	277,369,400	
清水建設	243,300	972.00	236,487,600	
飛島建設	81,500	170.00	13,855,000	
長谷工コーポレーション	93,300	1,641.00	153,105,300	
松井建設	10,800	828.00	8,942,400	



銭高組	1,400	5,160.00	7,224,000
鹿島建設	351,000	986.00	346,086,000
不動テトラ	71,700	183.00	13,121,100
鉄建建設	5,100	3,030.00	15,453,000
西松建設	19,100	2,843.00	54,301,300
三井住友建設	61,400	633.00	38,866,200
大豊建設	29,000	620.00	17,980,000
前田建設工業	58,000	1,291.00	74,878,000
ナカノフドー建設	8,300	642.00	5,328,600
奥村組	13,500	4,370.00	58,995,000
東鉄工業	9,200	3,120.00	28,704,000
イチケン	2,000	2,364.00	4,728,000
浅沼組	31,000	387.00	11,997,000
戸田建設	94,000	794.00	74,636,000
熊谷組	12,500	3,375.00	42,187,500
青木あすなろ建設	6,000	984.00	5,904,000
北野建設	21,000	392.00	8,232,000
三井ホーム	12,000	689.00	8,268,000
矢作建設工業	12,500	800.00	10,000,000
ピーエス三菱	11,500	684.00	7,866,000
日本ハウスホールディングス	18,800	586.00	11,016,800
大東建託	29,000	19,275.00	558,975,000
新日本建設	10,300	1,169.00	12,040,700
N I P P O	17,900	2,399.00	42,942,100
東亜道路工業	2,000	4,090.00	8,180,000
前田道路	25,000	2,211.00	55,275,000
日本道路	2,400	5,120.00	12,288,000
東亜建設工業	6,900	2,505.00	17,284,500
若築建設	5,800	1,676.00	9,720,800
東洋建設	26,400	497.00	13,120,800
五洋建設	96,900	779.00	75,485,100
世紀東急工業	13,900	699.00	9,716,100
福田組	2,700	6,800.00	18,360,000
住友林業	50,800	1,717.00	87,223,600
日成ビルド工業	12,500	1,314.00	16,425,000
ヤマダ・エスバイエルホーム	67,000	79.00	5,293,000
大和ハウス工業	236,500	4,004.00	946,946,000
ライト工業	15,300	1,107.00	16,937,100
積水ハウス	260,900	1,940.00	506,146,000
日特建設	9,500	615.00	5,842,500
北陸電気工事	5,400	1,231.00	6,647,400
ユアテック	13,200	875.00	11,550,000

中電工	9,400	2,983.00	28,040,200
関電工	30,200	1,253.00	37,840,600
きんでん	53,100	1,809.00	96,057,900
東京エネシス	9,800	1,243.00	12,181,400
トーエネック	2,700	3,125.00	8,437,500
住友電設	6,500	2,229.00	14,488,500
日本電設工業	11,800	2,153.00	25,405,400
協和エクシオ	29,100	2,764.00	80,432,400
新日本空調	7,100	1,620.00	11,502,000
N D S	1,800	4,560.00	8,208,000
九電工	15,800	5,320.00	84,056,000
三機工業	16,900	1,205.00	20,364,500
日揮	69,400	2,432.00	168,780,800
中外炉工業	3,400	2,916.00	9,914,400
ヤマト	9,100	792.00	7,207,200
太平電業	5,700	2,755.00	15,703,500
高砂熱学工業	21,600	1,965.00	42,444,000
朝日工業社	2,300	3,495.00	8,038,500
明星工業	15,800	726.00	11,470,800
大気社	9,800	3,435.00	33,663,000
ダイダン	5,600	2,559.00	14,330,400
日比谷総合設備	9,100	2,058.00	18,727,800
東芝プラントシステム	17,200	2,231.00	38,373,200
O S J Bホールディングス	40,000	295.00	11,800,000
千代田化工建設	53,600	1,022.00	54,779,200
新興プランテック	16,100	988.00	15,906,800
日本製粉	23,000	1,721.00	39,583,000
日清製粉グループ本社	87,000	2,188.00	190,356,000
日東富士製粉	1,200	4,760.00	5,712,000
昭和産業	5,900	2,844.00	16,779,600
鳥越製粉	9,400	946.00	8,892,400
中部飼料	8,900	2,191.00	19,499,900
フィード・ワン	50,900	232.00	11,808,800
日本甜菜製糖	5,000	2,349.00	11,745,000
三井製糖	5,400	4,310.00	23,274,000
日新製糖	3,800	2,081.00	7,907,800
森永製菓	17,200	5,070.00	87,204,000
中村屋	2,600	4,795.00	12,467,000
江崎グリコ	20,100	5,650.00	113,565,000
名糖産業	5,300	1,603.00	8,495,900
不二家	5,600	2,567.00	14,375,200
山崎製パン	58,400	2,280.00	133,152,000

モロゾフ	1,600	6,570.00	10,512,000
亀田製菓	4,500	5,200.00	23,400,000
寿スピリッツ	6,900	5,190.00	35,811,000
カルビー	32,900	3,640.00	119,756,000
森永乳業	14,600	4,630.00	67,598,000
六甲バター	4,100	2,580.00	10,578,000
ヤクルト本社	43,000	7,640.00	328,520,000
明治ホールディングス	47,200	8,090.00	381,848,000
雪印メグミルク	17,500	3,125.00	54,687,500
プリマハム	50,000	595.00	29,750,000
日本ハム	31,000	4,500.00	139,500,000
丸大食品	36,000	520.00	18,720,000
S Foods	4,900	4,380.00	21,462,000
伊藤ハム米久ホールディングス	44,000	960.00	42,240,000
サッポロホールディングス	26,500	3,020.00	80,030,000
アサヒグループホールディングス	150,500	5,541.00	833,920,500
キリンホールディングス	345,300	3,044.00	1,051,093,200
宝ホールディングス	55,000	1,225.00	67,375,000
オエノンホールディングス	28,800	452.00	13,017,600
養命酒製造	3,200	2,445.00	7,824,000
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールデ	50,300	4,540.00	228,362,000
サントリー食品インターナショナル	54,600	5,240.00	286,104,000
ダイドーグループホールディングス	3,500	6,500.00	22,750,000
伊藤園	24,000	4,240.00	101,760,000
キーコーヒー	6,900	2,126.00	14,669,400
日清オイリオグループ	8,000	3,150.00	25,200,000
不二製油グループ本社	19,700	3,350.00	65,995,000
かどや製油	1,000	6,330.00	6,330,000
J - オイルミルズ	3,800	3,700.00	14,060,000
キッコーマン	55,700	4,285.00	238,674,500
味の素	166,100	1,917.00	318,413,700
キューピー	40,000	2,451.00	98,040,000
ハウス食品グループ本社	27,500	3,685.00	101,337,500
カゴメ	29,000	3,810.00	110,490,000
焼津水産化学工業	7,800	1,224.00	9,547,200
アリアケジャパン	6,300	8,660.00	54,558,000
ニチレイ	34,300	3,115.00	106,844,500
東洋水産	39,100	4,135.00	161,678,500
日清食品ホールディングス	31,100	7,450.00	231,695,000
永谷園ホールディングス	9,000	1,449.00	13,041,000
一正蒲鉾	4,600	1,266.00	5,823,600
フジッコ	7,700	2,366.00	18,218,200

ロック・フィールド	7,800	2,149.00	16,762,200
日本たばこ産業	444,000	2,957.00	1,312,908,000
ケンコーマヨネーズ	5,000	3,595.00	17,975,000
わらべや日洋ホールディングス	4,900	2,739.00	13,421,100
なとり	5,300	1,920.00	10,176,000
北の達人コーポレーション	21,800	1,011.00	22,039,800
ユーグレナ	28,600	1,011.00	28,914,600
ミヨシ油脂	4,900	1,414.00	6,928,600
理研ビタミン	3,000	4,070.00	12,210,000
片倉工業	10,000	1,384.00	13,840,000
ゲンゼ	5,600	6,340.00	35,504,000
東洋紡	28,400	2,101.00	59,668,400
ユニチカ	22,900	704.00	16,121,600
富士紡ホールディングス	4,600	4,115.00	18,929,000
倉敷紡績	76,000	352.00	26,752,000
シキボウ	5,700	1,351.00	7,700,700
日本毛織	20,500	1,053.00	21,586,500
帝国繊維	8,300	2,120.00	17,596,000
帝人	60,800	2,015.00	122,512,000
東レ	544,600	1,005.50	547,595,300
サカイオーベックス	2,700	2,412.00	6,512,400
住江織物	2,700	2,975.00	8,032,500
アツギ	7,900	1,218.00	9,622,200
ダイニック	4,600	1,061.00	4,880,600
セーレン	17,300	1,995.00	34,513,500
小松精練	13,000	1,060.00	13,780,000
ワコールホールディングス	21,000	3,110.00	65,310,000
ホギメディカル	9,400	4,445.00	41,783,000
レナウン	26,700	190.00	5,073,000
T S Iホールディングス	26,200	799.00	20,933,800
三陽商会	4,900	2,680.00	13,132,000
オンワードホールディングス	46,800	822.00	38,469,600
ルックホールディングス	17,000	325.00	5,525,000
ゴールドウイン	4,400	6,430.00	28,292,000
デサント	16,900	1,775.00	29,997,500
特種東海製紙	4,200	4,125.00	17,325,000
王子ホールディングス	312,000	700.00	218,400,000
日本製紙	33,200	1,988.00	66,001,600
三菱製紙	12,500	662.00	8,275,000
北越紀州製紙	40,600	681.00	27,648,600
中越パルプ工業	3,700	1,963.00	7,263,100
巴川製紙所	17,000	285.00	4,845,000

大王製紙	29,000	1,495.00	43,355,000
レンゴー	73,100	943.00	68,933,300
トーモク	5,000	2,079.00	10,395,000
ザ・パック	5,200	4,070.00	21,164,000
クラレ	124,800	1,767.00	220,521,600
旭化成	467,600	1,450.00	678,020,000
共和レザー	6,300	969.00	6,104,700
昭和電工	50,000	3,720.00	186,000,000
住友化学	547,000	622.00	340,234,000
住友精化	3,100	5,070.00	15,717,000
日産化学工業	43,500	4,660.00	202,710,000
ラサ工業	3,400	2,202.00	7,486,800
クレハ	6,400	6,670.00	42,688,000
テイカ	5,900	2,843.00	16,773,700
石原産業	13,900	1,247.00	17,333,300
日東エフシー	6,500	735.00	4,777,500
日本曹達	52,000	600.00	31,200,000
東ソー	108,000	1,972.00	212,976,000
トクヤマ	22,100	3,445.00	76,134,500
セントラル硝子	16,000	2,514.00	40,224,000
東亜合成	44,600	1,274.00	56,820,400
大阪ソーダ	6,700	2,943.00	19,718,100
関東電化工業	18,400	1,058.00	19,467,200
デンカ	27,500	3,785.00	104,087,500
信越化学工業	124,700	11,130.00	1,387,911,000
日本カーバイド工業	3,200	2,030.00	6,496,000
堺化学工業	5,400	2,830.00	15,282,000
エア・ウォーター	60,800	2,061.00	125,308,800
大陽日酸	57,300	1,654.00	94,774,200
日本化学工業	3,300	3,405.00	11,236,500
日本パーカライズン	39,200	1,700.00	66,640,000
高压ガス工業	12,300	950.00	11,685,000
チタン工業	1,200	2,521.00	3,025,200
四国化成工業	10,800	1,621.00	17,506,800
戸田工業	1,800	3,715.00	6,687,000
ステラ ケミファ	4,200	3,195.00	13,419,000
保土谷化学工業	2,600	4,730.00	12,298,000
日本触媒	11,800	7,270.00	85,786,000
大日精化工業	5,700	4,530.00	25,821,000
カネカ	100,000	1,074.00	107,400,000
三菱瓦斯化学	61,600	2,599.00	160,098,400
三井化学	67,600	3,360.00	227,136,000

J S R	75,400	2,364.00	178,245,600
東京応化工業	13,300	3,915.00	52,069,500
大阪有機化学工業	6,200	1,623.00	10,062,600
三菱ケミカルホールディングス	501,100	1,039.50	520,893,450
K Hネオケム	11,700	3,500.00	40,950,000
ダイセル	101,200	1,202.00	121,642,400
住友ベークライト	62,000	980.00	60,760,000
積水化学工業	154,000	1,868.00	287,672,000
日本ゼオン	63,600	1,539.00	97,880,400
アイカ工業	21,100	3,885.00	81,973,500
宇部興産	37,800	3,240.00	122,472,000
積水樹脂	11,400	2,274.00	25,923,600
タキロンシーアイ	16,400	657.00	10,774,800
旭有機材	5,200	1,741.00	9,053,200
日立化成	36,700	2,501.00	91,786,700
ニチバン	4,100	3,300.00	13,530,000
リケンテクノス	18,300	515.00	9,424,500
大倉工業	20,000	582.00	11,640,000
積水化成成品工業	10,000	1,236.00	12,360,000
群栄化学工業	2,300	3,550.00	8,165,000
ミライアル	3,400	1,543.00	5,246,200
ダイキョーニシカワ	14,600	1,892.00	27,623,200
日本化薬	48,600	1,323.00	64,297,800
カーリットホールディングス	7,900	1,013.00	8,002,700
日本精化	8,000	1,262.00	10,096,000
扶桑化学工業	5,300	2,775.00	14,707,500
A D E K A	32,500	1,930.00	62,725,000
日油	29,100	3,130.00	91,083,000
新日本理化	16,200	253.00	4,098,600
ハリマ化成グループ	8,000	835.00	6,680,000
花王	176,000	7,779.00	1,369,104,000
第一工業製薬	15,000	864.00	12,960,000
三洋化成工業	4,500	5,140.00	23,130,000
大日本塗料	9,000	1,541.00	13,869,000
日本ペイントホールディングス	57,900	4,070.00	235,653,000
関西ペイント	78,600	2,446.00	192,255,600
中国塗料	21,600	1,099.00	23,738,400
日本特殊塗料	5,100	2,187.00	11,153,700
藤倉化成	12,300	670.00	8,241,000
太陽ホールディングス	5,600	4,690.00	26,264,000
D I C	29,300	3,680.00	107,824,000
サカティンクス	15,400	1,645.00	25,333,000

東洋インキＳＣホールディングス	69,000	665.00	45,885,000
T & K T O K A	5,700	1,318.00	7,512,600
富士フイルムホールディングス	148,500	4,281.00	635,728,500
資生堂	133,400	6,703.00	894,180,200
ライオン	99,700	2,223.00	221,633,100
高砂香料工業	4,600	3,370.00	15,502,000
マンダム	13,600	3,755.00	51,068,000
ミルボン	9,700	4,765.00	46,220,500
ファンケル	17,300	4,010.00	69,373,000
コーセー	12,100	21,030.00	254,463,000
シーズ・ホールディングス	9,800	5,320.00	52,136,000
ポーラ・オルビスホールディングス	30,500	4,665.00	142,282,500
ノエビアホールディングス	4,400	7,550.00	33,220,000
エステー	5,700	2,392.00	13,634,400
アグロ カネショウ	3,500	2,620.00	9,170,000
コニシ	11,700	1,766.00	20,662,200
長谷川香料	9,500	2,095.00	19,902,500
星光PMC	5,000	1,198.00	5,990,000
小林製薬	20,000	8,610.00	172,200,000
荒川化学工業	6,900	1,911.00	13,185,900
メック	5,400	1,794.00	9,687,600
日本高純度化学	3,100	2,520.00	7,812,000
タカラバイオ	18,900	2,158.00	40,786,200
J C U	9,000	2,508.00	22,572,000
新田ゼラチン	7,400	820.00	6,068,000
デクセリアルズ	19,000	1,188.00	22,572,000
アース製薬	5,300	5,500.00	29,150,000
北興化学工業	10,000	743.00	7,430,000
大成ラミック	3,100	3,150.00	9,765,000
クミアイ化学工業	33,400	649.00	21,676,600
日本農薬	21,200	681.00	14,437,200
アキレス	6,200	2,251.00	13,956,200
有沢製作所	12,800	1,030.00	13,184,000
日東電工	54,100	8,315.00	449,841,500
レック	4,500	3,835.00	17,257,500
きもと	18,500	310.00	5,735,000
藤森工業	5,900	3,705.00	21,859,500
前澤化成工業	7,000	1,176.00	8,232,000
J S P	4,100	3,440.00	14,104,000
エフピコ	5,800	6,660.00	38,628,000
天馬	5,900	2,048.00	12,083,200
信越ポリマー	14,600	1,120.00	16,352,000



東リ	21,200	388.00	8,225,600
ニフコ	26,200	3,660.00	95,892,000
日本バルカー工業	6,000	3,070.00	18,420,000
ユニ・チャーム	151,600	2,962.00	449,039,200
協和発酵キリン	88,900	2,374.00	211,048,600
武田薬品工業	263,300	4,911.00	1,293,066,300
アステラス製薬	734,500	1,561.50	1,146,921,750
大日本住友製薬	52,900	1,914.00	101,250,600
塩野義製薬	102,400	5,436.00	556,646,400
田辺三菱製薬	86,100	2,093.00	180,207,300
あすか製薬	8,600	1,728.00	14,860,800
日本新薬	18,800	7,200.00	135,360,000
中外製薬	74,300	5,590.00	415,337,000
科研製薬	13,100	6,270.00	82,137,000
エーザイ	85,600	6,836.00	585,161,600
ロート製薬	39,700	3,035.00	120,489,500
小野薬品工業	169,000	2,745.50	463,989,500
久光製薬	21,200	7,600.00	161,120,000
持田製薬	5,200	7,400.00	38,480,000
参天製薬	135,700	1,707.00	231,639,900
扶桑薬品工業	3,400	2,883.00	9,802,200
日本ケミファ	1,400	4,800.00	6,720,000
ツムラ	25,900	3,750.00	97,125,000
日医工	18,100	1,722.00	31,168,200
キッセイ薬品工業	13,700	2,912.00	39,894,400
生化学工業	14,000	1,868.00	26,152,000
栄研化学	11,800	2,529.00	29,842,200
鳥居薬品	4,600	2,762.00	12,705,200
JCRファーマ	5,200	5,770.00	30,004,000
東和薬品	3,500	6,900.00	24,150,000
富士製薬工業	2,800	4,840.00	13,552,000
沢井製薬	14,500	4,750.00	68,875,000
ゼリア新薬工業	15,600	2,135.00	33,306,000
第一三共	204,700	3,713.00	760,051,100
キョーリン製薬ホールディングス	19,900	2,069.00	41,173,100
大幸薬品	4,400	1,976.00	8,694,400
ダイト	4,300	4,035.00	17,350,500
大塚ホールディングス	148,700	5,277.00	784,689,900
大正製薬ホールディングス	15,800	9,940.00	157,052,000
ペプチドリーム	33,000	5,050.00	166,650,000
日本コークス工業	71,000	112.00	7,952,000
昭和シェル石油	66,000	1,426.00	94,116,000

ニチレキ	9,800	1,228.00	12,034,400
ユシロ化学工業	4,900	1,720.00	8,428,000
ビーピー・カストロール	3,500	1,722.00	6,027,000
富士石油	18,000	452.00	8,136,000
MORESCO	3,400	1,880.00	6,392,000
出光興産	60,000	3,860.00	231,600,000
JXTGホールディングス	1,140,000	680.50	775,770,000
コスモエネルギーホールディングス	20,000	3,475.00	69,500,000
横浜ゴム	41,300	2,534.00	104,654,200
東洋ゴム工業	43,200	1,874.00	80,956,800
ブリヂストン	236,600	4,658.00	1,102,082,800
住友ゴム工業	73,300	1,970.00	144,401,000
藤倉ゴム工業	7,700	750.00	5,775,000
オカモト	26,000	1,042.00	27,092,000
ニッタ	7,200	4,040.00	29,088,000
住友理工	14,200	1,137.00	16,145,400
三ツ星ベルト	18,000	1,206.00	21,708,000
バンドー化学	13,900	1,242.00	17,263,800
日東紡績	11,000	2,293.00	25,223,000
旭硝子	72,900	4,365.00	318,208,500
日本板硝子	25,600	868.00	22,220,800
日本山村硝子	47,000	185.00	8,695,000
日本電気硝子	31,300	3,070.00	96,091,000
オハラ	3,200	2,386.00	7,635,200
住友大阪セメント	142,000	473.00	67,166,000
太平洋セメント	45,200	3,825.00	172,890,000
日本ヒューム	10,500	830.00	8,715,000
日本コンクリート工業	20,500	442.00	9,061,000
三谷セキサン	4,200	2,486.00	10,441,200
アジアパイルホールディングス	12,100	622.00	7,526,200
東海カーボン	65,200	1,322.00	86,194,400
日本カーボン	3,900	4,760.00	18,564,000
東洋炭素	5,000	2,992.00	14,960,000
ノリタケカンパニーリミテド	4,500	4,535.00	20,407,500
TOTO	55,000	5,910.00	325,050,000
日本碍子	86,900	1,875.00	162,937,500
日本特殊陶業	61,400	2,569.00	157,736,600
MARUWA	2,600	8,530.00	22,178,000
品川リフラクトリーズ	2,500	2,891.00	7,227,500
黒崎播磨	1,900	4,945.00	9,395,500
フジミインコーポレーテッド	6,800	2,251.00	15,306,800
ニチアス	39,000	1,340.00	52,260,000

ニチハ	10,900	4,165.00	45,398,500
新日鐵住金	316,600	2,393.00	757,623,800
神戸製鋼所	130,900	1,095.00	143,335,500
中山製鋼所	10,400	731.00	7,602,400
合同製鐵	4,600	2,167.00	9,968,200
ジェイ エフ イー ホールディングス	191,400	2,254.00	431,415,600
日新製鋼	20,200	1,267.00	25,593,400
東京製鐵	38,700	867.00	33,552,900
共英製鋼	8,000	2,009.00	16,072,000
大和工業	15,400	3,080.00	47,432,000
東京鐵鋼	4,100	1,639.00	6,719,900
大阪製鐵	4,800	2,296.00	11,020,800
淀川製鋼所	10,300	2,925.00	30,127,500
丸一鋼管	25,400	3,290.00	83,566,000
モリ工業	2,800	3,070.00	8,596,000
大同特殊鋼	12,800	5,540.00	70,912,000
日本冶金工業	61,600	286.00	17,617,600
山陽特殊製鋼	8,300	2,698.00	22,393,400
愛知製鋼	3,900	4,620.00	18,018,000
日立金属	77,000	1,302.00	100,254,000
日本金属	2,200	2,302.00	5,064,400
大平洋金属	4,700	3,520.00	16,544,000
新日本電工	44,700	343.00	15,332,100
栗本鐵工所	4,400	2,017.00	8,874,800
三菱製鋼	5,500	2,504.00	13,772,000
日本精線	1,300	4,630.00	6,019,000
シンニッタン	15,800	464.00	7,331,200
大紀アルミニウム工業所	13,800	752.00	10,377,600
日本輕金属ホールディングス	208,500	285.00	59,422,500
三井金属鉱業	19,400	4,890.00	94,866,000
東邦亜鉛	4,100	5,080.00	20,828,000
三菱マテリアル	46,700	3,200.00	149,440,000
住友金属鉱山	90,800	4,457.00	404,695,600
D O W A ホールディングス	18,000	3,915.00	70,470,000
古河機械金属	11,600	2,064.00	23,942,400
大阪チタニウムテクノロジーズ	8,100	1,991.00	16,127,100
東邦チタニウム	13,900	1,319.00	18,334,100
U A C J	10,500	2,825.00	29,662,500
古河電気工業	23,700	5,020.00	118,974,000
住友電気工業	264,600	1,664.50	440,426,700
フジクラ	87,200	714.00	62,260,800
タツタ電線	16,000	661.00	10,576,000

平河ヒューテック	5,000	1,411.00	7,055,000
リョービ	8,900	2,851.00	25,373,900
アーレスティ	11,000	986.00	10,846,000
アサヒホールディングス	12,400	1,988.00	24,651,200
稲葉製作所	5,200	1,386.00	7,207,200
宮地エンジニアリンググループ	2,600	2,007.00	5,218,200
トーカロ	20,400	1,311.00	26,744,400
アルファC o	3,300	1,703.00	5,619,900
SUMCO	65,500	2,758.00	180,649,000
川田テクノロジーズ	1,600	5,970.00	9,552,000
RS Technologies	1,200	7,110.00	8,532,000
東洋製罐グループホールディングス	47,800	1,594.00	76,193,200
ホッカカンホールディングス	24,000	382.00	9,168,000
コロナ	5,200	1,259.00	6,546,800
横河ブリッジホールディングス	13,400	2,277.00	30,511,800
駒井ハルテック	2,700	2,473.00	6,677,100
三和ホールディングス	68,200	1,382.00	94,252,400
文化シャッター	21,300	1,052.00	22,407,600
三協立山	9,800	1,596.00	15,640,800
アルインコ	7,500	1,092.00	8,190,000
LIXILグループ	103,900	2,432.00	252,684,800
日本フィルコン	8,000	629.00	5,032,000
ノーリツ	15,700	1,924.00	30,206,800
長府製作所	7,300	2,539.00	18,534,700
リンナイ	12,600	10,340.00	130,284,000
日東精工	12,800	752.00	9,625,600
岡部	14,900	1,043.00	15,540,700
ジーテクト	7,800	2,056.00	16,036,800
東プレ	12,600	3,140.00	39,564,000
高周波熱錬	14,500	1,072.00	15,544,000
東京製綱	6,100	2,218.00	13,529,800
モリテック スチール	4,600	716.00	3,293,600
パイオラックス	10,300	2,902.00	29,890,600
エイチワン	6,000	1,458.00	8,748,000
日本発條	70,400	1,166.00	82,086,400
三益半導体工業	6,800	1,980.00	13,464,000
日本製綱所	23,300	3,290.00	76,657,000
三浦工業	30,700	3,170.00	97,319,000
タクマ	24,100	1,193.00	28,751,300
ツガミ	19,000	1,416.00	26,904,000
オークマ	8,300	5,960.00	49,468,000
東芝機械	40,000	721.00	28,840,000

アマダホールディングス	107,900	1,305.00	140,809,500
アイダエンジニアリング	17,900	1,266.00	22,661,400
滝澤鉄工所	3,200	1,941.00	6,211,200
F U J I	20,400	1,990.00	40,596,000
牧野フライス製作所	35,000	983.00	34,405,000
オーエスジー	32,600	2,360.00	76,936,000
旭ダイヤモンド工業	21,300	1,113.00	23,706,900
D M G 森精機	39,500	1,915.00	75,642,500
ソディック	15,500	1,327.00	20,568,500
ディスコ	9,600	23,470.00	225,312,000
日東工器	4,800	2,913.00	13,982,400
パンチ工業	7,000	1,156.00	8,092,000
豊和工業	4,300	1,228.00	5,280,400
O K K	4,500	1,130.00	5,085,000
東洋機械金属	6,800	831.00	5,650,800
津田駒工業	27,000	240.00	6,480,000
島精機製作所	9,000	6,940.00	62,460,000
オプトラン	5,200	3,255.00	16,926,000
フリュー	6,700	923.00	6,184,100
ヤマシンフィルタ	10,300	1,308.00	13,472,400
日阪製作所	11,700	1,124.00	13,150,800
やまびこ	13,900	1,484.00	20,627,600
平田機工	2,000	9,380.00	18,760,000
ペガサスミシン製造	9,000	767.00	6,903,000
ナプテスコ	38,900	3,995.00	155,405,500
三井海洋開発	7,700	2,721.00	20,951,700
レオン自動機	6,600	1,997.00	13,180,200
S M C	22,400	42,830.00	959,392,000
新川	7,100	1,061.00	7,533,100
ホソカワミクロン	2,800	7,090.00	19,852,000
ユニオンツール	3,400	3,610.00	12,274,000
オイレス工業	9,000	2,305.00	20,745,000
日精エー・エス・ビー機械	2,400	6,610.00	15,864,000
サトーホールディングス	9,300	3,155.00	29,341,500
技研製作所	3,900	2,674.00	10,428,600
日精樹脂工業	6,700	1,493.00	10,003,100
オカダアイヨン	2,700	1,481.00	3,998,700
ワイエイシイホールディングス	3,900	1,066.00	4,157,400
小松製作所	345,500	3,591.00	1,240,690,500
住友重機械工業	40,700	4,055.00	165,038,500
日立建機	33,400	4,030.00	134,602,000
日工	3,000	2,339.00	7,017,000

巴工業	4,100	2,118.00	8,683,800
井関農機	7,500	2,089.00	15,667,500
TOWA	6,200	1,478.00	9,163,600
北川鉄工所	4,000	2,686.00	10,744,000
ローツェ	3,800	2,127.00	8,082,600
クボタ	383,800	1,801.00	691,223,800
三菱化工機	3,000	2,215.00	6,645,000
月島機械	14,500	1,528.00	22,156,000
帝国電機製作所	6,100	1,527.00	9,314,700
新東工業	16,800	1,147.00	19,269,600
澁谷工業	6,400	3,865.00	24,736,000
アイチ コーポレーション	13,500	745.00	10,057,500
小森コーポレーション	18,300	1,374.00	25,144,200
鶴見製作所	6,400	2,054.00	13,145,600
住友精密工業	18,000	388.00	6,984,000
酒井重工業	1,800	4,935.00	8,883,000
荏原製作所	29,500	3,995.00	117,852,500
西島製作所	9,000	1,010.00	9,090,000
北越工業	8,900	1,255.00	11,169,500
ダイキン工業	97,600	12,550.00	1,224,880,000
オルガノ	3,100	3,140.00	9,734,000
トーヨーカネツ	3,400	3,230.00	10,982,000
栗田工業	38,700	3,455.00	133,708,500
椿本チエイン	40,000	898.00	35,920,000
大同工業	4,000	1,498.00	5,992,000
アネスト岩田	12,000	1,176.00	14,112,000
ダイフク	36,300	5,950.00	215,985,000
加藤製作所	3,700	2,474.00	9,153,800
タダノ	35,000	1,637.00	57,295,000
フジテック	22,300	1,454.00	32,424,200
C K D	19,700	2,350.00	46,295,000
キトー	6,000	1,891.00	11,346,000
平和	21,900	2,099.00	45,968,100
理想科学工業	6,800	2,113.00	14,368,400
S A N K Y O	18,000	3,685.00	66,330,000
日本金銭機械	7,900	1,244.00	9,827,600
マースエンジニアリング	5,200	2,379.00	12,370,800
福島工業	4,400	4,450.00	19,580,000
ダイコク電機	4,100	1,737.00	7,121,700
竹内製作所	12,000	2,497.00	29,964,000
アマノ	22,300	2,896.00	64,580,800
J U K I	10,900	1,560.00	17,004,000

サンデンホールディングス	9,000	1,569.00	14,121,000
蛇の目ミシン工業	8,900	730.00	6,497,000
マックス	10,700	1,332.00	14,252,400
グローリー	21,500	3,930.00	84,495,000
新晃工業	7,500	1,731.00	12,982,500
大和冷機工業	11,500	1,210.00	13,915,000
セガサミーホールディングス	71,000	1,623.00	115,233,000
日本ピストンリング	3,800	2,277.00	8,652,600
リケン	3,300	6,050.00	19,965,000
T P R	7,600	3,155.00	23,978,000
ツバキ・ナカシマ	7,500	2,698.00	20,235,000
ホシザキ	22,500	9,720.00	218,700,000
大豊工業	6,400	1,595.00	10,208,000
日本精工	145,500	1,376.00	200,208,000
N T N	164,800	456.00	75,148,800
ジェイテクト	75,100	1,621.00	121,737,100
不二越	67,000	558.00	37,386,000
日本トムソン	23,000	821.00	18,883,000
T H K	44,600	3,995.00	178,177,000
ユーシン精機	7,200	1,620.00	11,664,000
イーグル工業	8,600	1,905.00	16,383,000
日本ピラー工業	8,100	1,562.00	12,652,200
キッツ	32,300	904.00	29,199,200
マキタ	93,000	4,995.00	464,535,000
日立造船	54,000	553.00	29,862,000
三菱重工業	120,000	4,074.00	488,880,000
I H I	55,000	3,595.00	197,725,000
スター精密	11,800	1,975.00	23,305,000
日清紡ホールディングス	44,100	1,458.00	64,297,800
イビデン	44,000	1,665.00	73,260,000
コニカミノルタ	166,000	922.00	153,052,000
ブラザー工業	87,100	2,458.00	214,091,800
ミネベアミツミ	132,500	2,266.00	300,245,000
日立製作所	1,715,000	786.30	1,348,504,500
三菱電機	714,400	1,711.00	1,222,338,400
富士電機	216,000	731.00	157,896,000
東洋電機製造	4,000	1,813.00	7,252,000
安川電機	82,800	4,665.00	386,262,000
シンフォニアテクノロジー	49,000	352.00	17,248,000
明電舎	62,000	404.00	25,048,000
オリジン電気	3,300	1,732.00	5,715,600
山洋電気	3,500	8,370.00	29,295,000

デンヨー	7,400	1,953.00	14,452,200
東芝テック	50,000	641.00	32,050,000
芝浦メカトロニクス	13,000	456.00	5,928,000
マブチモーター	19,800	5,330.00	105,534,000
日本電産	86,100	16,620.00	1,430,982,000
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	3,000	2,750.00	8,250,000
東光高岳	4,500	1,715.00	7,717,500
ダブル・スコープ	10,800	1,636.00	17,668,800
ダイヘン	39,000	826.00	32,214,000
ヤーマン	9,500	2,505.00	23,797,500
JVCケンウッド	54,000	376.00	20,304,000
ミマキエンジニアリング	7,500	849.00	6,367,500
第一精工	3,900	2,156.00	8,408,400
日新電機	17,100	1,064.00	18,194,400
大崎電気工業	17,600	791.00	13,921,600
オムロン	75,800	6,060.00	459,348,000
日東工業	11,600	1,752.00	20,323,200
I D E C	9,000	2,705.00	24,345,000
ジーエス・ユアサ コーポレーション	130,000	579.00	75,270,000
サクサホールディングス	2,400	2,171.00	5,210,400
メルコホールディングス	3,700	3,615.00	13,375,500
日本電気	92,000	2,928.00	269,376,000
富士通	735,000	662.50	486,937,500
沖電気工業	30,000	1,435.00	43,050,000
電気興業	4,700	3,165.00	14,875,500
サンケン電気	43,000	727.00	31,261,000
アイホン	5,200	1,857.00	9,656,400
ルネサスエレクトロニクス	36,100	1,025.00	37,002,500
セイコーエプソン	105,900	1,965.00	208,093,500
ワコム	57,000	548.00	31,236,000
アルバック	16,400	6,300.00	103,320,000
E I Z O	6,600	5,190.00	34,254,000
ジャパンディスプレイ	103,900	156.00	16,208,400
日本信号	19,700	1,007.00	19,837,900
京三製作所	19,000	700.00	13,300,000
能美防災	9,500	2,270.00	21,565,000
ホーチキ	5,600	2,083.00	11,664,800
エレコム	6,400	2,431.00	15,558,400
パナソニック	816,200	1,561.00	1,274,088,200
シャープ	48,000	3,435.00	164,880,000
アンリツ	52,800	1,334.00	70,435,200
富士通ゼネラル	22,000	1,869.00	41,118,000



ソニー	478,100	5,245.00	2,507,634,500
T D K	37,200	9,710.00	361,212,000
タムラ製作所	28,000	821.00	22,988,000
アルプス電気	60,500	2,671.00	161,595,500
池上通信機	34,000	168.00	5,712,000
パイオニア	119,100	175.00	20,842,500
日本電波工業	9,500	696.00	6,612,000
日本トリム	1,900	5,370.00	10,203,000
ローランド ディー . ジー .	4,200	2,470.00	10,374,000
フォスター電機	8,500	2,637.00	22,414,500
クラリオン	39,000	336.00	13,104,000
S M K	21,000	458.00	9,618,000
ヨコオ	5,500	1,901.00	10,455,500
ホシデン	18,300	1,342.00	24,558,600
ヒロセ電機	12,390	15,140.00	187,584,600
日本航空電子工業	18,000	1,646.00	29,628,000
T O A	8,300	1,260.00	10,458,000
マクセルホールディングス	14,100	2,201.00	31,034,100
古野電気	10,500	785.00	8,242,500
ユニデンホールディングス	25,000	265.00	6,625,000
アルパイン	17,500	2,117.00	37,047,500
スミダコーポレーション	8,000	1,503.00	12,024,000
アイコム	4,700	2,685.00	12,619,500
リオン	3,700	2,648.00	9,797,600
本多通信工業	6,400	1,083.00	6,931,200
船井電機	9,200	782.00	7,194,400
横河電機	71,600	2,234.00	159,954,400
新電元工業	2,600	6,960.00	18,096,000
アズビル	21,400	4,885.00	104,539,000
日本光電工業	30,200	2,915.00	88,033,000
チノー	3,500	1,534.00	5,369,000
共和電業	14,300	423.00	6,048,900
堀場製作所	14,300	8,010.00	114,543,000
アドバンテスト	40,000	2,276.00	91,040,000
エスベック	6,400	2,478.00	15,859,200
キーエンス	35,100	62,430.00	2,191,293,000
日置電機	4,300	3,510.00	15,093,000
シスメックス	55,600	9,210.00	512,076,000
日本マイクロニクス	13,000	1,133.00	14,729,000
メガチップス	5,700	3,505.00	19,978,500
O B A R A G R O U P	4,200	6,160.00	25,872,000
コーセル	10,000	1,422.00	14,220,000

イリソ電子工業	6,000	6,530.00	39,180,000
新日本無線	5,400	748.00	4,039,200
オブテックスグループ	12,000	2,942.00	35,304,000
千代田インテグレ	3,900	2,489.00	9,707,100
アイ・オー・データ機器	4,300	1,141.00	4,906,300
レーザーテック	14,700	4,015.00	59,020,500
スタンレー電気	54,500	4,085.00	222,632,500
岩崎電気	4,000	1,702.00	6,808,000
ウシオ電機	44,000	1,498.00	65,912,000
ヘリオス テクノ ホールディング	7,200	934.00	6,724,800
日本セラミック	7,500	2,966.00	22,245,000
遠藤照明	5,300	1,047.00	5,549,100
古河電池	6,100	960.00	5,856,000
双信電機	4,300	604.00	2,597,200
山一電機	5,600	1,987.00	11,127,200
図研	5,500	1,478.00	8,129,000
日本電子	27,000	956.00	25,812,000
カシオ計算機	57,700	1,675.00	96,647,500
ファナック	68,000	26,675.00	1,813,900,000
日本シイエムケイ	13,800	836.00	11,536,800
エンプラス	3,500	3,605.00	12,617,500
大真空	3,700	1,278.00	4,728,600
ローム	32,000	9,860.00	315,520,000
浜松ホトニクス	51,900	4,070.00	211,233,000
三井ハイテック	9,900	1,598.00	15,820,200
新光電気工業	26,800	804.00	21,547,200
京セラ	117,300	6,072.00	712,245,600
太陽誘電	32,500	1,912.00	62,140,000
村田製作所	75,000	14,405.00	1,080,375,000
ユーシン	13,400	746.00	9,996,400
双葉電子工業	11,500	2,228.00	25,622,000
北陸電気工業	4,100	1,515.00	6,211,500
ニチコン	22,700	1,229.00	27,898,300
日本ケミコン	6,000	2,605.00	15,630,000
K O A	10,000	2,191.00	21,910,000
市光工業	11,300	1,119.00	12,644,700
小糸製作所	42,600	7,480.00	318,648,000
ミツバ	13,400	1,491.00	19,979,400
S C R E E Nホールディングス	13,600	9,530.00	129,608,000
キャノン電子	6,600	2,415.00	15,939,000
キャノン	384,400	3,865.00	1,485,706,000
リコー	215,100	1,107.00	238,115,700

象印マホービン	13,300	1,380.00	18,354,000	
東京エレクトロン	47,700	20,265.00	966,640,500	
トヨタ紡織	21,100	2,403.00	50,703,300	
芦森工業	1,900	2,408.00	4,575,200	
ユニプレス	14,400	2,529.00	36,417,600	
豊田自動織機	57,500	6,370.00	366,275,000	
モリタホールディングス	11,800	2,103.00	24,815,400	
三櫻工業	11,700	776.00	9,079,200	
デンソー	158,600	5,860.00	929,396,000	
東海理化電機製作所	19,300	2,182.00	42,112,600	
三井E & Sホールディングス	26,800	1,729.00	46,337,200	
川崎重工業	55,600	3,420.00	190,152,000	
名村造船所	22,900	649.00	14,862,100	
日本車輛製造	31,000	316.00	9,796,000	
三菱ロジスネクスト	9,700	911.00	8,836,700	
日産自動車	842,800	1,125.00	948,150,000	
いすゞ自動車	207,300	1,616.50	335,100,450	
トヨタ自動車	869,500	6,910.00	6,008,245,000	代用有価証券 400,000株
日野自動車	102,000	1,368.00	139,536,000	
三菱自動車工業	265,300	770.00	204,281,000	
エフテック	5,500	1,420.00	7,810,000	
武蔵精密工業	7,800	3,765.00	29,367,000	
日産車体	28,700	1,148.00	32,947,600	
新明和工業	31,500	1,052.00	33,138,000	
極東開発工業	13,800	1,623.00	22,397,400	
日信工業	14,300	1,876.00	26,826,800	
トピー工業	6,200	3,150.00	19,530,000	
ティラド	3,200	3,830.00	12,256,000	
タチエス	12,300	1,928.00	23,714,400	
NOK	38,700	2,140.00	82,818,000	
フタバ産業	22,700	905.00	20,543,500	
KYB	7,500	5,240.00	39,300,000	
大同メタル工業	10,900	1,318.00	14,366,200	
プレス工業	38,400	632.00	24,268,800	
ミクニ	11,700	625.00	7,312,500	
太平洋工業	15,300	1,450.00	22,185,000	
ケーヒン	16,200	2,255.00	36,531,000	
河西工業	9,000	1,440.00	12,960,000	
アイシン精機	58,500	5,990.00	350,415,000	
マツダ	224,500	1,458.50	327,433,250	
今仙電機製作所	8,400	1,199.00	10,071,600	
本田技研工業	643,400	3,773.00	2,427,548,200	

スズキ	141,700	5,912.00	837,730,400
S U B A R U	222,000	3,576.00	793,872,000
安永	3,700	2,202.00	8,147,400
ヤマハ発動機	100,500	3,375.00	339,187,500
ショーワ	18,900	1,753.00	33,131,700
T B K	14,300	520.00	7,436,000
エクセディ	8,100	3,550.00	28,755,000
豊田合成	26,100	2,574.00	67,181,400
愛三工業	13,100	1,179.00	15,444,900
ヨロズ	7,700	1,854.00	14,275,800
エフ・シー・シー	11,800	3,040.00	35,872,000
シマノ	28,800	14,390.00	414,432,000
テイ・エス テック	16,900	4,375.00	73,937,500
ジャムコ	3,900	2,375.00	9,262,500
テルモ	109,500	5,680.00	621,960,000
日機装	25,300	1,163.00	29,423,900
島津製作所	85,000	3,020.00	256,700,000
J M S	11,500	626.00	7,199,000
長野計器	6,900	1,216.00	8,390,400
ブイ・テクノロジー	1,700	29,050.00	49,385,000
東京計器	5,700	1,215.00	6,925,500
東京精密	12,700	4,300.00	54,610,000
マニー	8,900	4,270.00	38,003,000
ニコン	124,300	1,898.00	235,921,400
トプコン	39,100	2,094.00	81,875,400
オリンパス	106,400	3,920.00	417,088,000
理研計器	7,200	2,471.00	17,791,200
タムロン	6,400	2,290.00	14,656,000
H O Y A	144,100	5,684.00	819,064,400
ノーリツ鋼機	7,700	2,803.00	21,583,100
シチズン時計	86,000	800.00	68,800,000
リズム時計工業	4,000	2,353.00	9,412,000
大研医器	10,200	738.00	7,527,600
メニコン	10,000	2,740.00	27,400,000
松風	6,200	1,438.00	8,915,600
セイコーホールディングス	10,900	2,769.00	30,182,100
ニプロ	50,300	1,536.00	77,260,800
スノーピーク	3,000	1,410.00	4,230,000
パラマウントベッドホールディングス	7,500	5,390.00	40,425,000
トランザクション	4,000	988.00	3,952,000
ニホンフラッシュ	3,800	2,506.00	9,522,800
前田工織	7,700	1,662.00	12,797,400

永大産業	14,000	554.00	7,756,000
アートネイチャー	11,000	703.00	7,733,000
バンダイナムコホールディングス	73,900	3,525.00	260,497,500
SHOEI	3,300	4,190.00	13,827,000
フランスベッドホールディングス	10,700	962.00	10,293,400
パイロットコーポレーション	12,500	5,800.00	72,500,000
萩原工業	5,000	1,890.00	9,450,000
トッパン・フォームズ	14,700	1,180.00	17,346,000
フジシールインターナショナル	15,900	4,245.00	67,495,500
タカラトミー	30,000	1,081.00	32,430,000
アーク	39,600	121.00	4,791,600
プロネクサス	7,900	1,305.00	10,309,500
大建工業	5,500	2,672.00	14,696,000
凸版印刷	197,000	876.00	172,572,000
大日本印刷	92,500	2,244.00	207,570,000
図書印刷	5,700	974.00	5,551,800
共同印刷	2,500	3,300.00	8,250,000
NISSHA	14,600	2,901.00	42,354,600
宝印刷	5,300	1,900.00	10,070,000
アシックス	71,100	2,030.00	144,333,000
ツツミ	2,900	2,004.00	5,811,600
小松ウオール工業	3,300	2,688.00	8,870,400
ヤマハ	48,100	4,880.00	234,728,000
河合楽器製作所	3,300	3,630.00	11,979,000
クリナップ	8,600	850.00	7,310,000
ピジョン	43,200	4,745.00	204,984,000
キングジム	8,400	1,044.00	8,769,600
リンテック	17,000	3,145.00	53,465,000
イトーキ	16,900	716.00	12,100,400
任天堂	44,100	45,280.00	1,996,848,000
三菱鉛筆	11,700	2,381.00	27,857,700
タカラスタンダード	13,700	1,799.00	24,646,300
コクヨ	34,300	2,133.00	73,161,900
ナカバヤシ	9,900	626.00	6,197,400
グローブライド	4,100	2,980.00	12,218,000
オカムラ	24,700	1,466.00	36,210,200
美津濃	6,900	3,165.00	21,838,500
東京電力ホールディングス	565,100	425.00	240,167,500
中部電力	219,200	1,543.50	338,335,200
関西電力	292,500	1,421.50	415,788,750
中国電力	97,700	1,297.00	126,716,900
北陸電力	71,600	977.00	69,953,200

東北電力	164,600	1,428.00	235,048,800
四国電力	65,100	1,314.00	85,541,400
九州電力	156,000	1,258.00	196,248,000
北海道電力	72,800	705.00	51,324,000
沖縄電力	11,600	3,070.00	35,612,000
電源開発	57,300	2,793.00	160,038,900
エフオン	4,400	1,395.00	6,138,000
イーレックス	12,400	816.00	10,118,400
東京瓦斯	153,500	2,799.00	429,646,500
大阪瓦斯	140,100	2,187.00	306,398,700
東邦瓦斯	35,700	3,235.00	115,489,500
広島ガス	22,200	371.00	8,236,200
西部瓦斯	9,000	2,695.00	24,255,000
静岡ガス	20,400	946.00	19,298,400
メタウォーター	4,400	3,130.00	13,772,000
SBSホールディングス	8,300	1,334.00	11,072,200
東武鉄道	75,600	3,225.00	243,810,000
相鉄ホールディングス	23,200	2,901.00	67,303,200
東京急行電鉄	192,000	1,712.00	328,704,000
京浜急行電鉄	98,500	1,853.00	182,520,500
小田急電鉄	105,300	2,191.00	230,712,300
京王電鉄	39,700	4,605.00	182,818,500
京成電鉄	49,700	3,330.00	165,501,000
富士急行	10,100	2,796.00	28,239,600
東日本旅客鉄道	128,500	10,010.00	1,286,285,000
西日本旅客鉄道	64,800	7,487.00	485,157,600
東海旅客鉄道	64,000	20,260.00	1,296,640,000
西武ホールディングス	91,400	1,782.00	162,874,800
鴻池運輸	10,100	1,887.00	19,058,700
西日本鉄道	20,400	2,858.00	58,303,200
ハマキョウレックス	5,300	3,605.00	19,106,500
サカイ引越センター	3,900	5,670.00	22,113,000
近鉄グループホールディングス	66,800	4,200.00	280,560,000
阪急阪神ホールディングス	89,400	3,980.00	355,812,000
南海電気鉄道	32,700	2,724.00	89,074,800
京阪ホールディングス	30,300	3,385.00	102,565,500
神戸電鉄	2,600	3,870.00	10,062,000
名古屋鉄道	52,900	2,715.00	143,623,500
山陽電気鉄道	5,900	2,731.00	16,112,900
日本通運	26,400	7,610.00	200,904,000
ヤマトホールディングス	119,400	2,787.50	332,827,500
山九	17,500	5,070.00	88,725,000

丸全昭和運輸	28,000	520.00	14,560,000
センコーグループホールディングス	40,400	810.00	32,724,000
トナミホールディングス	1,800	5,890.00	10,602,000
ニッコンホールディングス	26,100	2,896.00	75,585,600
福山通運	9,800	4,620.00	45,276,000
セイノーホールディングス	50,600	1,878.00	95,026,800
神奈川中央交通	2,400	3,790.00	9,096,000
日立物流	14,200	2,939.00	41,733,800
丸和運輸機関	3,800	3,055.00	11,609,000
C & F ロジホールディングス	8,600	1,490.00	12,814,000
九州旅客鉄道	57,000	3,295.00	187,815,000
S Gホールディングス	48,000	2,391.00	114,768,000
日本郵船	56,100	2,190.00	122,859,000
商船三井	42,500	3,130.00	133,025,000
川崎汽船	31,600	2,470.00	78,052,000
N S ユナイテッド海運	3,600	2,121.00	7,635,600
飯野海運	36,300	533.00	19,347,900
乾汽船	9,000	861.00	7,749,000
日本航空	126,000	4,228.00	532,728,000
A N Aホールディングス	133,000	4,170.00	554,610,000
トランコム	1,900	7,640.00	14,516,000
日新	6,000	2,765.00	16,590,000
三菱倉庫	23,300	2,370.00	55,221,000
三井倉庫ホールディングス	44,000	337.00	14,828,000
住友倉庫	49,000	736.00	36,064,000
澁澤倉庫	5,200	1,772.00	9,214,400
東陽倉庫	22,300	373.00	8,317,900
日本トランスシティ	22,000	485.00	10,670,000
川西倉庫	2,200	1,810.00	3,982,000
安田倉庫	8,700	1,001.00	8,708,700
東洋埠頭	3,600	1,708.00	6,148,800
上組	40,900	2,300.00	94,070,000
キューソー流通システム	2,400	2,842.00	6,820,800
近鉄エクスプレス	12,800	2,021.00	25,868,800
エーアイティー	6,300	1,184.00	7,459,200
N E C ネットズエスアイ	7,600	2,768.00	21,036,800
システナ	5,900	4,245.00	25,045,500
デジタルアーツ	3,700	4,385.00	16,224,500
新日鉄住金ソリューションズ	10,200	3,115.00	31,773,000
キューブシステム	6,900	809.00	5,582,100
コア	3,800	1,318.00	5,008,400
ソフトクリエイイトホールディングス	5,000	1,561.00	7,805,000

T I S	23,600	4,155.00	98,058,000
電算システム	3,700	2,074.00	7,673,800
グリー	38,700	588.00	22,755,600
コーエーテクモホールディングス	11,900	2,098.00	24,966,200
三菱総合研究所	3,300	3,190.00	10,527,000
ファインデックス	8,000	680.00	5,440,000
ヒト・コミュニケーションズ	2,100	1,829.00	3,840,900
K L a b	14,200	1,868.00	26,525,600
ポルトウウィン・ピットクルーホールディングス	5,900	1,882.00	11,103,800
ネクソン	157,000	1,647.00	258,579,000
アイスタイル	17,800	1,431.00	25,471,800
エムアップ	3,000	1,075.00	3,225,000
エイチーム	5,300	2,425.00	12,852,500
テクノスジャパン	7,700	981.00	7,553,700
コロプラ	23,600	824.00	19,446,400
ブロードリーフ	37,600	521.00	19,589,600
ハーツユナイテッドグループ	4,600	1,826.00	8,399,600
メディアドゥホールディングス	2,800	1,795.00	5,026,000
フィックスターズ	7,000	1,547.00	10,829,000
VOYAGE GROUP	4,400	1,327.00	5,838,800
オブティム	1,700	2,442.00	4,151,400
セレス	2,600	1,627.00	4,230,200
ティーガイア	6,800	3,085.00	20,978,000
日本アジアグループ	11,000	569.00	6,259,000
豆蔵ホールディングス	6,600	1,189.00	7,847,400
テクマトリックス	4,800	1,614.00	7,747,200
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	194,700	353.00	68,729,100
GMOペイメントゲートウェイ	5,000	9,980.00	49,900,000
インターネットイニシアティブ	11,800	2,055.00	24,249,000
さくらインターネット	9,900	783.00	7,751,700
GMOクラウド	2,100	2,241.00	4,706,100
SRAホールディングス	4,100	3,140.00	12,874,000
フリービット	6,400	1,196.00	7,654,400
コムチュア	4,400	4,125.00	18,150,000
メディカル・データ・ビジョン	3,300	4,190.00	13,827,000
gumi	9,200	1,019.00	9,374,800
PCIホールディングス	1,600	3,085.00	4,936,000
オープンドア	3,300	2,162.00	7,134,600
アカツキ	1,500	4,490.00	6,735,000
LINE	20,600	4,195.00	86,417,000
オークネット	3,700	1,501.00	5,553,700
AOI TYO Holdings	6,600	1,624.00	10,718,400



マクロミル	7,100	2,911.00	20,668,100
ソルクシーズ	3,100	1,095.00	3,394,500
フェイス	5,000	1,188.00	5,940,000
野村総合研究所	44,500	5,170.00	230,065,000
サイバネットシステム	7,900	888.00	7,015,200
インテージホールディングス	9,500	1,189.00	11,295,500
ソースネクスト	10,800	824.00	8,899,200
フォーカスシステムズ	5,600	934.00	5,230,400
クレスコ	1,800	3,675.00	6,615,000
フジ・メディア・ホールディングス	73,800	1,763.00	130,109,400
オービック	22,200	9,000.00	199,800,000
ジャストシステム	11,800	2,618.00	30,892,400
TDCソフト	4,800	1,306.00	6,268,800
ヤフー	505,300	459.00	231,932,700
トレンドマイクロ	34,500	6,240.00	215,280,000
日本オラクル	11,400	8,770.00	99,978,000
アルファシステムズ	3,300	2,388.00	7,880,400
フューチャー	11,100	1,229.00	13,641,900
CAC Holdings	7,900	1,052.00	8,310,800
ソフトバンク・テクノロジー	3,600	1,876.00	6,753,600
トーセ	2,300	1,181.00	2,716,300
オービックビジネスコンサルタント	3,600	7,020.00	25,272,000
伊藤忠テクノソリューションズ	32,200	2,162.00	69,616,400
アイティフォー	11,300	909.00	10,271,700
大塚商会	42,000	4,950.00	207,900,000
サイボウズ	13,400	528.00	7,075,200
電通国際情報サービス	4,900	2,787.00	13,656,300
デジタルガレージ	12,900	3,385.00	43,666,500
EMシステムズ	7,000	1,274.00	8,918,000
ウェザーニューズ	3,300	3,265.00	10,774,500
WOWOW	3,700	3,230.00	11,951,000
スカラ	7,000	804.00	5,628,000
イマジカ・ロボットホールディングス	6,800	1,173.00	7,976,400
ネットワンシステムズ	29,100	1,572.00	45,745,200
アルゴグラフィックス	3,800	3,485.00	13,243,000
マーベラス	13,200	900.00	11,880,000
エイベックス	13,600	1,456.00	19,801,600
日本ユニシス	19,300	2,225.00	42,942,500
兼松エレクトロニクス	4,500	3,250.00	14,625,000
東京放送ホールディングス	39,300	2,240.00	88,032,000
日本テレビホールディングス	64,300	1,819.00	116,961,700
朝日放送グループホールディングス	9,700	883.00	8,565,100

テレビ朝日ホールディングス	19,900	2,384.00	47,441,600
スカパーJ S A Tホールディングス	52,500	480.00	25,200,000
テレビ東京ホールディングス	5,800	2,775.00	16,095,000
ビジョン	2,200	3,105.00	6,831,000
ワイヤレスゲート	4,400	1,506.00	6,626,400
コネクシオ	5,400	2,394.00	12,927,600
日本電信電話	503,500	5,073.00	2,554,255,500
K D D I	631,600	2,774.50	1,752,374,200
光通信	8,500	17,350.00	147,475,000
N T T ドコモ	518,700	2,734.50	1,418,385,150
エムティーアイ	11,400	628.00	7,159,200
G M O インターネット	25,900	1,912.00	49,520,800
カドカワ	20,300	1,127.00	22,878,100
学研ホールディングス	2,700	4,885.00	13,189,500
ゼンリン	13,200	2,178.00	28,749,600
アイネット	5,600	1,673.00	9,368,800
松竹	4,800	15,590.00	74,832,000
東宝	46,100	3,610.00	166,421,000
東映	2,700	11,490.00	31,023,000
エヌ・ティ・ティ・データ	216,100	1,133.00	244,841,300
D T S	7,300	3,795.00	27,703,500
スクウェア・エニックス・ホールディングス	32,700	4,490.00	146,823,000
シーイーシー	4,400	3,460.00	15,224,000
カプコン	30,800	2,135.00	65,758,000
ジャステック	5,800	1,269.00	7,360,200
S C S K	16,500	4,660.00	76,890,000
日本システムウエア	2,800	2,640.00	7,392,000
アイネス	11,300	1,129.00	12,757,700
T K C	6,600	4,095.00	27,027,000
富士ソフト	9,700	4,210.00	40,837,000
N S D	10,800	2,198.00	23,738,400
コナミホールディングス	28,800	5,340.00	153,792,000
福井コンピュータホールディングス	2,500	2,315.00	5,787,500
J B C C ホールディングス	8,000	1,089.00	8,712,000
ミロク情報サービス	6,400	3,250.00	20,800,000
ソフトバンクグループ	317,900	8,028.00	2,552,101,200
伊藤忠食品	1,900	6,080.00	11,552,000
エレマテック	3,800	2,549.00	9,686,200
J A L U X	2,600	3,095.00	8,047,000
あらた	3,600	6,380.00	22,968,000
東京エレクトロン デバイス	3,800	2,041.00	7,755,800
フィールズ	6,700	1,182.00	7,919,400

双日	415,300	343.00	142,447,900
アルフレッサ ホールディングス	77,900	2,278.00	177,456,200
横浜冷凍	18,400	1,096.00	20,166,400
アルコニックス	8,000	1,992.00	15,936,000
神戸物産	4,700	4,875.00	22,912,500
ペッパーフードサービス	3,900	6,050.00	23,595,000
あい ホールディングス	10,700	2,839.00	30,377,300
ダイワボウホールディングス	6,100	4,820.00	29,402,000
マクニカ・富士エレホールディングス	13,100	1,888.00	24,732,800
ラクト・ジャパン	1,200	4,470.00	5,364,000
バイタルケーエスケー・ホールディングス	13,600	1,050.00	14,280,000
U K Cホールディングス	5,400	2,197.00	11,863,800
ジュテックホールディングス	2,400	1,127.00	2,704,800
T O K A Iホールディングス	37,800	1,097.00	41,466,600
三洋貿易	4,400	2,125.00	9,350,000
ウイン・パートナーズ	5,800	1,469.00	8,520,200
シップヘルスケアホールディングス	14,600	3,770.00	55,042,000
コメダホールディングス	14,300	2,107.00	30,130,100
小野建	7,200	1,857.00	13,370,400
佐島電機	7,600	1,149.00	8,732,400
伯東	5,300	1,672.00	8,861,600
コンドーテック	8,000	923.00	7,384,000
ナガイレーベン	9,400	3,060.00	28,764,000
三菱食品	7,100	3,170.00	22,507,000
松田産業	5,800	1,843.00	10,689,400
第一興商	10,700	5,540.00	59,278,000
メディバルホールディングス	70,400	2,179.00	153,401,600
萩原電気ホールディングス	2,900	3,125.00	9,062,500
アズワン	5,600	7,090.00	39,704,000
尾家産業	4,400	1,309.00	5,759,600
シモジマ	6,000	1,162.00	6,972,000
ドウシシャ	7,500	2,510.00	18,825,000
高速	6,400	1,359.00	8,697,600
丸文	8,400	992.00	8,332,800
ハビネット	5,400	1,501.00	8,105,400
日本ライフライン	20,300	2,974.00	60,372,200
エクセル	3,300	2,840.00	9,372,000
マルカキカイ	3,700	2,106.00	7,792,200
I D O M	22,700	835.00	18,954,500
日本エム・ディ・エム	6,500	1,019.00	6,623,500
進和	5,100	2,402.00	12,250,200
ダイトロン	4,100	2,121.00	8,696,100

シークス	9,000	2,265.00	20,385,000
オーハシテクニカ	5,600	1,766.00	9,889,600
伊藤忠商事	516,700	2,117.00	1,093,853,900
丸紅	580,400	787.50	457,065,000
長瀬産業	43,200	1,840.00	79,488,000
蝶理	5,400	2,101.00	11,345,400
豊田通商	77,900	3,670.00	285,893,000
三共生興	18,800	500.00	9,400,000
兼松	29,500	1,583.00	46,698,500
三井物産	598,500	1,847.50	1,105,728,750
日本紙パルプ商事	3,800	4,340.00	16,492,000
日立ハイテクノロジーズ	24,600	5,030.00	123,738,000
カメイ	9,700	1,466.00	14,220,200
スターゼン	3,000	5,620.00	16,860,000
山善	25,900	1,086.00	28,127,400
住友商事	444,900	1,844.50	820,618,050
内田洋行	3,800	2,883.00	10,955,400
三菱商事	494,300	2,921.50	1,444,097,450
第一実業	3,900	3,145.00	12,265,500
キャノンマーケティングジャパン	20,400	2,856.00	58,262,400
西華産業	5,000	2,798.00	13,990,000
佐藤商事	8,500	1,165.00	9,902,500
菱洋エレクトロ	7,300	1,756.00	12,818,800
東京産業	12,500	556.00	6,950,000
ユアサ商事	6,400	3,425.00	21,920,000
神鋼商事	2,000	3,700.00	7,400,000
阪和興業	13,400	4,320.00	57,888,000
正栄食品工業	4,200	4,230.00	17,766,000
カナデン	8,200	1,413.00	11,586,600
菱電商事	6,700	1,766.00	11,832,200
フルサト工業	5,700	1,788.00	10,191,600
岩谷産業	16,000	3,975.00	63,600,000
すてきナイスグループ	2,000	1,457.00	2,914,000
イワキ	14,000	394.00	5,516,000
三愛石油	18,900	1,671.00	31,581,900
稲畑産業	16,400	1,665.00	27,306,000
ワキタ	16,000	1,134.00	18,144,000
東邦ホールディングス	21,300	2,503.00	53,313,900
サンゲツ	24,000	2,222.00	53,328,000
ミツウロコグループホールディングス	12,500	837.00	10,462,500
シナネンホールディングス	4,200	2,695.00	11,319,000
伊藤忠エネクス	15,000	1,041.00	15,615,000

サンリオ	20,500	2,001.00	41,020,500
サンワテクノス	5,000	1,610.00	8,050,000
リョーサン	9,200	3,845.00	35,374,000
新光商事	8,400	1,920.00	16,128,000
トーホー	4,100	2,503.00	10,262,300
三信電気	7,300	2,191.00	15,994,300
東陽テクニカ	11,000	957.00	10,527,000
モスフードサービス	8,900	3,230.00	28,747,000
加賀電子	6,600	2,702.00	17,833,200
ソーダニッカ	12,900	770.00	9,933,000
立花エレテック	5,500	2,066.00	11,363,000
PALTA C	9,700	5,350.00	51,895,000
三谷産業	13,600	438.00	5,956,800
太平洋興発	6,600	1,038.00	6,850,800
西本Wismettacホールディングス	1,600	4,770.00	7,632,000
ヤマタネ	5,200	1,925.00	10,010,000
日鉄住金物産	5,200	5,960.00	30,992,000
泉州電業	2,800	3,285.00	9,198,000
トラスコ中山	14,300	2,708.00	38,724,400
オートバックスセブン	28,700	2,004.00	57,514,800
モリト	7,900	1,007.00	7,955,300
加藤産業	10,600	3,845.00	40,757,000
イノテック	8,000	1,291.00	10,328,000
イエローハット	6,800	3,120.00	21,216,000
J Kホールディングス	10,000	923.00	9,230,000
日伝	6,600	2,118.00	13,978,800
杉本商事	6,000	1,876.00	11,256,000
因幡電機産業	8,800	4,680.00	41,184,000
バイテックホールディングス	4,300	2,642.00	11,360,600
ミスミグループ本社	81,900	2,993.00	245,126,700
タキヒヨー	3,700	2,388.00	8,835,600
スズケン	32,100	4,350.00	139,635,000
ジェコス	6,500	1,156.00	7,514,000
ローソン	17,800	6,740.00	119,972,000
サンエー	5,100	5,810.00	29,631,000
カワチ薬品	5,500	2,654.00	14,597,000
エービーシー・マート	12,800	6,690.00	85,632,000
ハードオフコーポレーション	5,500	1,064.00	5,852,000
アスクル	6,200	3,345.00	20,739,000
ゲオホールディングス	13,200	1,697.00	22,400,400
アダストリア	11,000	1,984.00	21,824,000
くらコーポレーション	4,200	7,290.00	30,618,000

キャンドウ	5,000	1,798.00	8,990,000
パルグループホールディングス	4,000	2,697.00	10,788,000
エディオン	26,000	1,263.00	32,838,000
サーラコーポレーション	14,300	660.00	9,438,000
ハローズ	3,200	2,649.00	8,476,800
あみやき亭	1,900	5,410.00	10,279,000
ひらまつ	14,400	504.00	7,257,600
大黒天物産	2,000	5,310.00	10,620,000
ハニーズホールディングス	8,800	1,019.00	8,967,200
アルペン	5,900	2,330.00	13,747,000
クオール	8,000	2,293.00	18,344,000
ジーンズ	5,000	5,620.00	28,100,000
ビックカメラ	41,100	1,774.00	72,911,400
D C Mホールディングス	37,400	1,081.00	40,429,400
MonotaRO	25,500	3,825.00	97,537,500
DDホールディングス	1,700	3,420.00	5,814,000
アークランドサービスホールディングス	6,300	2,351.00	14,811,300
J.フロント リテイリング	84,100	1,635.00	137,503,500
ドトール・日レスホールディングス	11,900	2,446.00	29,107,400
マツモトキヨシホールディングス	29,200	4,605.00	134,466,000
ブロンコピリー	4,200	3,575.00	15,015,000
スタートトゥデイ	69,700	2,966.00	206,730,200
物語コーポレーション	2,100	11,300.00	23,730,000
ココカラファイン	7,300	7,290.00	53,217,000
三越伊勢丹ホールディングス	132,000	1,134.00	149,688,000
Hamee	2,700	1,561.00	4,214,700
ウエルシアホールディングス	18,700	5,190.00	97,053,000
クリエイトSDホールディングス	10,300	2,842.00	29,272,600
チムニー	2,700	2,870.00	7,749,000
シュッピン	4,800	1,229.00	5,899,200
ネクステージ	8,100	1,000.00	8,100,000
ジョイフル本田	10,200	3,645.00	37,179,000
鳥貴族	3,100	2,981.00	9,241,100
ホットランド	5,300	1,336.00	7,080,800
すかいらーく	44,400	1,541.00	68,420,400
綿半ホールディングス	3,000	4,100.00	12,300,000
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホール	20,200	1,373.00	27,734,600
あさひ	6,500	1,318.00	8,567,000
日本調剤	2,900	3,425.00	9,932,500
コスモス薬品	3,600	21,070.00	75,852,000
セブン&アイ・ホールディングス	295,000	4,684.00	1,381,780,000
薬王堂	3,300	3,680.00	12,144,000

クリエイト・レストランツ・ホールディング	19,200	1,228.00	23,577,600
ツルハホールディングス	15,300	14,560.00	222,768,000
サンマルクホールディングス	4,800	3,115.00	14,952,000
トリドールホールディングス	8,700	3,675.00	31,972,500
T O K Y O B A S E	4,500	1,485.00	6,682,500
パロックジャパンリミテッド	7,200	1,075.00	7,740,000
クスリのアオキホールディングス	5,500	7,110.00	39,105,000
スシログローバルホールディングス	6,800	5,130.00	34,884,000
L I X I L ビバ	6,800	2,058.00	13,994,400
メディカルシステムネットワーク	10,700	533.00	5,703,100
総合メディカル	6,200	2,921.00	18,110,200
ノジマ	12,400	2,554.00	31,669,600
カップ・クリエイト	11,000	1,282.00	14,102,000
ライトオン	8,300	999.00	8,291,700
良品計画	9,300	36,100.00	335,730,000
アドヴァン	9,000	957.00	8,613,000
アルビス	2,000	3,635.00	7,270,000
コナカ	14,000	581.00	8,134,000
G - 7ホールディングス	2,600	2,527.00	6,570,200
コジマ	16,600	434.00	7,204,400
コーナン商事	10,100	2,694.00	27,209,400
エコス	4,800	1,527.00	7,329,600
ワタミ	10,000	1,409.00	14,090,000
ドンキホーテホールディングス	45,700	5,640.00	257,748,000
西松屋チェーン	15,500	1,229.00	19,049,500
ゼンショーホールディングス	37,100	2,488.00	92,304,800
幸楽苑ホールディングス	5,500	1,856.00	10,208,000
サイゼリヤ	10,400	2,589.00	26,925,600
V Tホールディングス	26,000	517.00	13,442,000
ユナイテッドアローズ	8,800	4,110.00	36,168,000
ハイデイ日高	9,400	2,901.00	27,269,400
京都きもの友禅	9,600	752.00	7,219,200
コロワイド	23,000	2,676.00	61,548,000
ピーシーデポコーポレーション	11,900	725.00	8,627,500
壱番屋	4,700	4,410.00	20,727,000
スギホールディングス	15,600	6,020.00	93,912,000
ヴィア・ホールディングス	9,900	697.00	6,900,300
スクロール	15,000	428.00	6,420,000
ヨンドシーホールディングス	7,300	2,702.00	19,724,600
ユニー・ファミリーマートホールディングス	22,500	9,130.00	205,425,000
木曽路	8,700	2,801.00	24,368,700
S R Sホールディングス	12,200	957.00	11,675,400

千趣会	15,300	571.00	8,736,300
ケーヨー	15,800	566.00	8,942,800
上新電機	8,400	4,275.00	35,910,000
日本瓦斯	13,000	5,110.00	66,430,000
ロイヤルホールディングス	12,400	2,870.00	35,588,000
いなげや	7,900	1,761.00	13,911,900
鳥忠	17,300	3,545.00	61,328,500
チヨダ	8,200	2,521.00	20,672,200
ライフコーポレーション	5,100	2,707.00	13,805,700
リンガーハット	9,000	2,456.00	22,104,000
MrMaxHD	10,500	696.00	7,308,000
AOKIホールディングス	13,700	1,582.00	21,673,400
オークワ	11,000	1,193.00	13,123,000
コメリ	11,500	2,888.00	33,212,000
青山商事	13,600	4,020.00	54,672,000
しまむら	8,200	13,320.00	109,224,000
高島屋	111,000	909.00	100,899,000
松屋	15,000	1,484.00	22,260,000
エイチ・ツー・オー リテイリング	33,900	1,952.00	66,172,800
近鉄百貨店	2,800	3,840.00	10,752,000
パルコ	7,000	1,286.00	9,002,000
丸井グループ	67,900	2,170.00	147,343,000
アクシアル リテイリング	5,900	4,180.00	24,662,000
イオン	271,000	2,004.50	543,219,500
イズミ	12,900	6,590.00	85,011,000
平和堂	13,900	2,439.00	33,902,100
フジ	8,700	2,407.00	20,940,900
ヤオコー	7,700	5,790.00	44,583,000
ゼビオホールディングス	9,600	2,004.00	19,238,400
ケースホールディングス	60,000	1,549.00	92,940,000
Olympicグループ	9,000	568.00	5,112,000
日産東京販売ホールディングス	15,700	413.00	6,484,100
Genky DrugStores	3,300	3,630.00	11,979,000
アインホールディングス	9,400	7,700.00	72,380,000
元気寿司	2,400	2,816.00	6,758,400
ヤマダ電機	234,500	656.00	153,832,000
アークランドサカモト	12,000	1,666.00	19,992,000
ニトリホールディングス	28,000	18,180.00	509,040,000
グルメ杵屋	9,000	1,167.00	10,503,000
吉野家ホールディングス	24,300	2,009.00	48,818,700
松屋フーズ	3,800	3,750.00	14,250,000
サガミチェーン	11,900	1,351.00	16,076,900



関西スーパーマーケット	6,900	1,191.00	8,217,900
王将フードサービス	5,000	5,420.00	27,100,000
プレナス	7,700	1,847.00	14,221,900
ミニストップ	5,700	2,113.00	12,044,100
アークス	12,700	2,704.00	34,340,800
パローホールディングス	16,800	3,010.00	50,568,000
ベルク	3,100	5,850.00	18,135,000
大庄	5,200	1,694.00	8,808,800
ファーストリテイリング	11,800	46,870.00	553,066,000
サンドラッグ	29,800	5,220.00	155,556,000
サックスパー ホールディングス	7,900	1,188.00	9,385,200
ベルーナ	17,700	1,236.00	21,877,200
じもとホールディングス	55,300	191.00	10,562,300
めぶきフィナンシャルグループ	360,900	424.00	153,021,600
東京ＴＹフィナンシャルグループ	9,800	2,917.00	28,586,600
九州フィナンシャルグループ	115,900	528.00	61,195,200
ゆうちょ銀行	197,600	1,466.00	289,681,600
富山第一銀行	21,300	501.00	10,671,300
コンコルディア・フィナンシャルグループ	428,000	609.00	260,652,000
西日本フィナンシャルホールディングス	48,500	1,254.00	60,819,000
関西みらいフィナンシャルグループ	32,596	877.00	28,586,692
三十三フィナンシャルグループ	7,500	2,397.00	17,977,500
新生銀行	61,000	1,684.00	102,724,000
あおぞら銀行	41,800	4,290.00	179,322,000
三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	4,938,000	715.40	3,532,645,200
りそなホールディングス	774,500	592.40	458,813,800
三井住友トラスト・ホールディングス	138,700	4,502.00	624,427,400
三井住友フィナンシャルグループ	533,600	4,560.00	2,433,216,000
第四銀行	8,800	4,945.00	43,516,000
北越銀行	7,700	2,443.00	18,811,100
千葉銀行	247,000	865.00	213,655,000
群馬銀行	142,700	614.00	87,617,800
武蔵野銀行	11,600	3,520.00	40,832,000
千葉興業銀行	22,900	502.00	11,495,800
筑波銀行	33,500	374.00	12,529,000
七十七銀行	22,500	2,573.00	57,892,500
青森銀行	6,000	3,380.00	20,280,000
秋田銀行	5,100	2,973.00	15,162,300
山形銀行	7,800	2,467.00	19,242,600
岩手銀行	5,000	4,425.00	22,125,000
東邦銀行	58,900	425.00	25,032,500
東北銀行	4,500	1,476.00	6,642,000

みちのく銀行	5,300	1,801.00	9,545,300
ふくおかフィナンシャルグループ	285,000	582.00	165,870,000
静岡銀行	182,000	1,047.00	190,554,000
十六銀行	9,300	2,835.00	26,365,500
スルガ銀行	72,500	1,594.00	115,565,000
八十二銀行	122,600	563.00	69,023,800
山梨中央銀行	44,000	466.00	20,504,000
大垣共立銀行	11,500	2,682.00	30,843,000
福井銀行	6,600	2,447.00	16,150,200
北國銀行	8,200	4,350.00	35,670,000
清水銀行	2,900	2,998.00	8,694,200
富山銀行	1,700	3,985.00	6,774,500
滋賀銀行	67,000	547.00	36,649,000
南都銀行	8,200	3,010.00	24,682,000
百五銀行	62,200	512.00	31,846,400
京都銀行	26,900	6,230.00	167,587,000
紀陽銀行	27,000	1,739.00	46,953,000
ほくほくフィナンシャルグループ	46,900	1,540.00	72,226,000
広島銀行	103,100	828.00	85,366,800
山陰合同銀行	42,000	969.00	40,698,000
中国銀行	49,100	1,256.00	61,669,600
伊予銀行	99,900	836.00	83,516,400
百十四銀行	71,000	364.00	25,844,000
四国銀行	11,700	1,549.00	18,123,300
阿波銀行	54,000	724.00	39,096,000
大分銀行	4,300	3,980.00	17,114,000
宮崎銀行	5,100	3,475.00	17,722,500
佐賀銀行	4,800	2,406.00	11,548,800
十八銀行	48,000	281.00	13,488,000
沖縄銀行	6,700	4,605.00	30,853,500
琉球銀行	14,100	1,668.00	23,518,800
セブン銀行	267,000	353.00	94,251,000
みずほフィナンシャルグループ	9,582,500	195.20	1,870,504,000
山口フィナンシャルグループ	65,000	1,358.00	88,270,000
名古屋銀行	5,800	4,085.00	23,693,000
北洋銀行	110,000	358.00	39,380,000
愛知銀行	2,600	5,340.00	13,884,000
中京銀行	3,700	2,340.00	8,658,000
大光銀行	3,000	2,382.00	7,146,000
愛媛銀行	11,000	1,340.00	14,740,000
京葉銀行	59,000	491.00	28,969,000
栃木銀行	38,100	410.00	15,621,000

北日本銀行	2,500	2,909.00	7,272,500
東和銀行	13,300	1,488.00	19,790,400
福島銀行	8,000	809.00	6,472,000
大東銀行	4,200	1,297.00	5,447,400
トモニホールディングス	59,000	479.00	28,261,000
フィデアホールディングス	74,500	196.00	14,602,000
池田泉州ホールディングス	72,800	421.00	30,648,800
F P G	25,000	1,347.00	33,675,000
S B Iホールディングス	79,900	2,727.00	217,887,300
ジャフコ	10,200	4,875.00	49,725,000
大和証券グループ本社	602,000	675.50	406,651,000
野村ホールディングス	1,213,000	639.80	776,077,400
岡三証券グループ	60,000	629.00	37,740,000
丸三証券	23,000	1,054.00	24,242,000
東洋証券	28,000	290.00	8,120,000
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	78,200	760.00	59,432,000
水戸証券	25,000	426.00	10,650,000
いちよし証券	15,000	1,254.00	18,810,000
松井証券	35,000	991.00	34,685,000
マネックスグループ	76,800	572.00	43,929,600
カブドットコム証券	46,900	384.00	18,009,600
極東証券	10,000	1,589.00	15,890,000
岩井コスモホールディングス	8,000	1,419.00	11,352,000
藍澤証券	15,000	799.00	11,985,000
マネーパートナーズグループ	12,000	420.00	5,040,000
かんぽ生命保険	26,800	2,560.00	68,608,000
S O M P Oホールディングス	138,600	4,380.00	607,068,000
アニコム ホールディングス	5,000	3,660.00	18,300,000
M S & A D インシュアランスグループホールディングス	184,700	3,527.00	651,436,900
ソニーフィナンシャルホールディングス	58,100	1,981.00	115,096,100
第一生命ホールディングス	399,400	2,022.50	807,786,500
東京海上ホールディングス	266,000	4,962.00	1,319,892,000
T & Dホールディングス	218,300	1,705.50	372,310,650
全国保証	20,500	4,590.00	94,095,000
アルヒ	6,000	1,487.00	8,922,000
クレディセゾン	53,500	1,795.00	96,032,500
芙蓉総合リース	7,900	6,940.00	54,826,000
興銀リース	12,700	2,927.00	37,172,900
東京センチュリー	14,000	6,510.00	91,140,000
日本証券金融	32,000	666.00	21,312,000
アイフル	123,500	338.00	41,743,000
リコーリース	5,300	3,590.00	19,027,000

イオンフィナンシャルサービス	50,000	2,404.00	120,200,000
アコム	143,600	490.00	70,364,000
ジャックス	9,000	2,324.00	20,916,000
オリエントコーポレーション	142,700	169.00	24,116,300
日立キャピタル	19,900	2,694.00	53,610,600
アプラスフィナンシャル	40,900	117.00	4,785,300
オリックス	470,800	1,862.50	876,865,000
三菱UFJリース	176,600	640.00	113,024,000
日本取引所グループ	202,700	1,980.00	401,346,000
イー・ギャランティ	4,800	2,118.00	10,166,400
NECキャピタルソリューション	3,700	2,016.00	7,459,200
いちご	101,500	476.00	48,314,000
日本駐車場開発	92,300	176.00	16,244,800
ヒューリック	147,300	1,132.00	166,743,600
三栄建築設計	3,300	2,214.00	7,306,200
野村不動産ホールディングス	47,200	2,613.00	123,333,600
三重交通グループホールディングス	17,500	507.00	8,872,500
サムティ	6,800	1,944.00	13,219,200
日本商業開発	4,700	1,757.00	8,257,900
プレサンスコーポレーション	10,000	1,645.00	16,450,000
ユニゾホールディングス	8,700	2,574.00	22,393,800
日本管理センター	5,800	1,672.00	9,697,600
フージャースホールディングス	10,300	804.00	8,281,200
オープンハウス	11,500	6,310.00	72,565,000
東急不動産ホールディングス	171,000	760.00	129,960,000
飯田グループホールディングス	59,000	2,035.00	120,065,000
ムゲンエステート	5,600	1,348.00	7,548,800
ケイアイスター不動産	2,800	2,640.00	7,392,000
パーク24	39,600	2,927.00	115,909,200
パラカ	3,400	2,308.00	7,847,200
三井不動産	352,300	2,723.50	959,489,050
三菱地所	525,500	1,865.50	980,320,250
平和不動産	12,900	2,226.00	28,715,400
東京建物	77,400	1,573.00	121,750,200
ダイビル	18,700	1,263.00	23,618,100
京阪神ビルディング	15,700	897.00	14,082,900
住友不動産	170,000	3,994.00	678,980,000
大京	10,700	2,280.00	24,396,000
テーオーシー	25,400	953.00	24,206,200
東京楽天地	1,900	5,250.00	9,975,000
レオパレス21	85,400	953.00	81,386,200
スターツコーポレーション	9,500	2,849.00	27,065,500

フジ住宅	12,900	887.00	11,442,300
空港施設	12,900	630.00	8,127,000
ゴールドクレスト	6,100	2,281.00	13,914,100
日本エスリード	3,700	2,091.00	7,736,700
日神不動産	10,800	805.00	8,694,000
日本エスコン	14,100	937.00	13,211,700
タカラレーベン	34,100	425.00	14,492,500
サンヨーハウジング名古屋	6,500	1,237.00	8,040,500
イオンモール	45,800	2,130.00	97,554,000
カチタス	7,000	3,440.00	24,080,000
トーセイ	10,100	1,492.00	15,069,200
エヌ・ティ・ティ都市開発	44,800	1,243.00	55,686,400
サンフロンティア不動産	9,300	1,238.00	11,513,400
エフ・ジェー・ネクスト	7,200	845.00	6,084,000
日本空港ビルデング	20,900	4,205.00	87,884,500
日本工営	4,800	3,125.00	15,000,000
L I F U L L	24,700	885.00	21,859,500
ジェイエイシーリクルートメント	6,100	2,273.00	13,865,300
日本M&Aセンター	47,600	3,500.00	166,600,000
タケエイ	8,700	1,284.00	11,170,800
トラスト・テック	3,300	3,415.00	11,269,500
コシダカホールディングス	3,700	6,400.00	23,680,000
パソナグループ	5,900	1,711.00	10,094,900
リンクアンドモチベーション	13,100	1,177.00	15,418,700
G C A	9,500	936.00	8,892,000
エス・エム・エス	13,600	4,625.00	62,900,000
パーソルホールディングス	62,900	2,864.00	180,145,600
リニカル	5,400	1,837.00	9,919,800
クックパッド	23,900	610.00	14,579,000
学情	4,000	1,361.00	5,444,000
スタジオアリス	4,300	2,603.00	11,192,900
シミックホールディングス	4,700	2,573.00	12,093,100
総合警備保障	27,200	5,240.00	142,528,000
カカクコム	52,300	1,926.00	100,729,800
アイロムグループ	3,000	2,798.00	8,394,000
ルネサンス	4,600	1,898.00	8,730,800
ディップ	9,600	2,776.00	26,649,600
オプトホールディング	6,100	1,628.00	9,930,800
ツクイ	17,600	857.00	15,083,200
エムスリー	72,100	4,390.00	316,519,000
アウトソーシング	20,400	1,877.00	38,290,800
ウェルネット	7,400	1,117.00	8,265,800

ワールドホールディングス	2,400	4,440.00	10,656,000
ディー・エヌ・エー	37,400	2,018.00	75,473,200
博報堂DYホールディングス	94,300	1,440.00	135,792,000
ぐるなび	11,500	1,471.00	16,916,500
エスアールジータカミヤ	10,700	653.00	6,987,100
ジャパンベストレスキューシステム	10,800	900.00	9,720,000
ファンコミュニケーションズ	20,200	695.00	14,039,000
ライク	3,200	1,988.00	6,361,600
WDBホールディングス	3,400	3,530.00	12,002,000
バリューコマース	7,900	1,435.00	11,336,500
インフォマート	35,400	1,030.00	36,462,000
J Pホールディングス	27,400	305.00	8,357,000
E P Sホールディングス	10,700	2,208.00	23,625,600
プレステージ・インターナショナル	15,000	1,393.00	20,895,000
アミューズ	4,900	3,080.00	15,092,000
ドリームインキュベータ	3,100	2,816.00	8,729,600
クイック	5,100	1,811.00	9,236,100
ケネディクス	91,200	644.00	58,732,800
電通	83,100	4,870.00	404,697,000
テイクアンドギヴ・ニーズ	4,600	1,141.00	5,248,600
ぴあ	2,400	5,920.00	14,208,000
イオンファンタジー	2,400	5,830.00	13,992,000
シーティーエス	8,500	751.00	6,383,500
ネクシィーズグループ	3,200	1,689.00	5,404,800
みらかホールディングス	20,700	4,235.00	87,664,500
アルプス技研	6,300	2,526.00	15,913,800
日本空調サービス	10,100	755.00	7,625,500
オリエンタルランド	80,800	10,580.00	854,864,000
ダスキン	19,000	2,688.00	51,072,000
明光ネットワークジャパン	10,600	1,248.00	13,228,800
ファルコホールディングス	5,500	1,794.00	9,867,000
ラウンドワン	21,600	1,565.00	33,804,000
リゾートトラスト	29,700	2,144.00	63,676,800
ビー・エム・エル	8,900	2,701.00	24,038,900
りらいあコミュニケーションズ	10,700	1,325.00	14,177,500
リソー教育	13,600	875.00	11,900,000
ユー・エス・エス	84,000	2,227.00	187,068,000
サイバーエージェント	45,000	5,400.00	243,000,000
楽天	350,000	794.10	277,935,000
クリーク・アンド・リバー社	4,500	1,184.00	5,328,000
テー・オー・ダブリュー	8,700	961.00	8,360,700
セントラルスポーツ	3,100	3,775.00	11,702,500

フルキャストホールディングス	6,000	2,547.00	15,282,000
テクノプロ・ホールディングス	12,400	6,280.00	77,872,000
Gunosy	3,000	2,434.00	7,302,000
イー・ガーディアン	3,700	4,150.00	15,355,000
ジャパンマテリアル	19,000	1,409.00	26,771,000
ベクトル	8,500	2,526.00	21,471,000
I B J	6,600	950.00	6,270,000
アサンテ	4,100	1,997.00	8,187,700
N・フィールド	4,800	1,826.00	8,764,800
バリューHR	2,200	1,973.00	4,340,600
M&Aキャピタルパートナーズ	1,500	8,810.00	13,215,000
アビスト	1,300	4,850.00	6,305,000
ウィルグループ	3,700	1,330.00	4,921,000
エスクロー・エージェント・ジャパン	11,000	418.00	4,598,000
リクルートホールディングス	527,700	2,525.50	1,332,706,350
日本郵政	384,800	1,307.00	502,933,600
ベルシステム24ホールディングス	12,000	1,479.00	17,748,000
エボラブルアジア	2,000	2,126.00	4,252,000
ストライク	800	6,330.00	5,064,000
ソラスト	4,800	2,908.00	13,958,400
インソース	1,000	5,180.00	5,180,000
リログループ	37,600	2,736.00	102,873,600
東祥	4,500	3,985.00	17,932,500
エイチ・アイ・エス	10,600	3,745.00	39,697,000
共立メンテナンス	12,200	4,885.00	59,597,000
イチネンホールディングス	8,900	1,493.00	13,287,700
建設技術研究所	7,000	1,398.00	9,786,000
スペース	5,700	1,452.00	8,276,400
東京テアトル	4,800	1,421.00	6,820,800
ナガワ	1,500	4,635.00	6,952,500
よみうりランド	2,100	4,625.00	9,712,500
東京都競馬	5,400	4,045.00	21,843,000
常磐興産	5,300	1,885.00	9,990,500
カナモト	10,500	3,490.00	36,645,000
東京ドーム	28,000	1,019.00	28,532,000
西尾レントオール	6,200	3,220.00	19,964,000
トランス・コスモス	7,500	2,880.00	21,600,000
乃村工藝社	15,800	2,266.00	35,802,800
藤田観光	3,400	3,175.00	10,795,000
KNT-CTホールディングス	4,900	1,701.00	8,334,900
日本管財	6,800	2,084.00	14,171,200
トーカイ	6,700	2,233.00	14,961,100

セコム	72,300	8,018.00	579,701,400
セントラル警備保障	4,100	3,240.00	13,284,000
丹青社	14,200	1,241.00	17,622,200
メイテック	8,300	6,050.00	50,215,000
応用地質	9,000	1,553.00	13,977,000
船井総研ホールディングス	14,500	2,568.00	37,236,000
オオバ	11,300	584.00	6,599,200
ベネッセホールディングス	25,300	3,810.00	96,393,000
イオンディライト	8,200	3,845.00	31,529,000
ナック	7,400	962.00	7,118,800
ニチイ学館	13,700	1,199.00	16,426,300
ダイセキ	11,500	3,265.00	37,547,500
合 計	86,251,786		176,796,539,042

## (b)株式以外の有価証券

該当事項はありません。

## デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

## 国内債券パッシブ・マザーファンド

## 貸借対照表

(単位：円)

(平成29年 4月13日現在) (平成30年 4月13日現在)

資産の部		
流動資産		
金銭信託	-	346,911,843
コール・ローン	768,938,987	105,158,766
国債証券	162,458,114,390	154,889,533,040
地方債証券	17,624,303,937	18,967,191,978
特殊債券	27,348,154,557	25,348,519,878
社債券	9,912,712,000	7,833,085,000
未収入金	405,372,350	104,805,000
未収利息	454,630,526	395,912,903
前払費用	9,628,079	11,735,452
流動資産合計	218,981,854,826	208,002,853,860
資産合計	218,981,854,826	208,002,853,860
負債の部		
流動負債		
未払金	-	100,000,000
未払解約金	446,626,938	21,072,431
未払利息	1,242	308
その他未払費用	14,366	161,740
流動負債合計	446,642,546	121,234,479
負債合計	446,642,546	121,234,479



（平成29年 4月13日現在）

（平成30年 4月13日現在）

純資産の部		
元本等		
元本	174,107,403,486	164,426,145,427
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	44,427,808,794	43,455,473,954
元本等合計	218,535,212,280	207,881,619,381
純資産合計	218,535,212,280	207,881,619,381
負債純資産合計	218,981,854,826	208,002,853,860

## 注記表

（重要な会計方針の注記）

項目	自 平成29年 4月14日 至 平成30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29年 4月13日現在）	（平成30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	174,107,403,486口	164,426,145,427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) 1.2552円 12,552円)	1口当たり純資産額 (10,000口当たりの純資産額) 1.2643円 12,643円)

（金融商品に関する注記）

. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 平成29年 4月14日 至 平成30年 4月13日

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

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	(平成30年 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)

自 平成29年 4月14日 至 平成30年 4月13日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。

## (その他の注記)

(平成29年 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	197,030,769,648円
同期中における追加設定元本額	22,609,712,207円
同期中における一部解約元本額	45,533,078,369円
平成29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）	2,954,754,744円
三井住友・DC年金バランス50（標準型）	5,151,261,045円
三井住友・DC年金バランス70（株式重点型）	1,115,404,053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）	391,231,709円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2020（4資産タイプ）	56,151,029円

三井住友・DCターゲットイヤーファンド2025(4資産タイプ)	124,275,519円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2030(4資産タイプ)	200,278,528円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2035(4資産タイプ)	113,795,533円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2040(4資産タイプ)	47,792,735円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2045(4資産タイプ)	99,507,796円
三井住友・DC年金バランスゼロ(債券型)	44,917,557円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	3,262,249,111円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	467,447,025円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	19,246,606円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2050	3,627,980円
SMAM・年金グローバル債券ファンド<適格機関投資家限定>	5,939,168,435円
SMAM・バランスファンドVA25<適格機関投資家専用>	25,795,943,932円
SMAM・バランスファンドVA37.5<適格機関投資家専用>	8,885,214,929円
SMAM・バランスファンドVA50<適格機関投資家専用>	21,761,438,700円
SMAM・バランスファンドVL30<適格機関投資家限定>	371,792,432円
SMAM・バランスファンドVL50<適格機関投資家限定>	699,393,788円
世界6資産バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	26,026,110円
SMAM・バランスファンドVA75<適格機関投資家専用>	341,352,610円
SMAM・バランスファンドVL国際分散型<適格機関投資家限定>	138,667,534円
SMAM・インデックス・バランスVA25<適格機関投資家専用>	2,276,740,738円
SMAM・インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用>	2,596,557,914円
SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用>	6,636,944,876円
SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>	13,373,249,245円
SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定>	191,948,032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)	7,033,153,609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)	21,738,000,166円
SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	651,014,789円
SMAM・バランスファンドVA20<適格機関投資家専用>	1,053,237,212円
三井住友・7資産バランスファンド・VAS(適格機関投資家専用)	18,123,117,490円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>	1,085,035,477円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>	234,065,710円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用>	51,593,207円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>	2,558,679,987円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	2,985,271,586円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T<適格機関投資家専用>	2,867,795,194円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A2<適格機関投資家専用>	1,180,956,571円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A2<適格機関投資家専用>	260,122,395円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A2<適格機関投資家専用>	22,161,672円
SMAM・アセットバランスファンドVA30L2<適格機関投資家専用>	410,813,102円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L2<適格機関投資家専用>	7,584,878,612円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T2<適格機関投資家専用>	334,094,169円
SMAM・FG新興国重視型バランス20VA<適格機関投資家限定>	36,019円
SMAM・FGグローバルバランス25VA<適格機関投資家限定>	229,301円
SMAM・年金Wリスクコントロールファンド<適格機関投資家限定>	2,626,591円
SMAM・マルチアセットストラテジーファンド2016-04<適格機関投資家限定>	1,346,675,341円
SMAM・マルチアセットストラテジーファンド2016-05<適格機関投資家限定>	645,366,680円

S M A M ・ マルチアセットストラテジー ・ オープン < 適格機関投資家限定 >	852,098,361円
合計	174,107,403,486円

(平成30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	174,107,403,486円
同期中における追加設定元本額	24,974,986,318円
同期中における一部解約元本額	34,656,244,377円
平成30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)	3,731,623,951円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	6,582,077,843円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	1,468,021,352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)	519,902,102円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2020(4資産タイプ)	55,572,714円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2025(4資産タイプ)	149,647,674円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2030(4資産タイプ)	242,124,819円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2035(4資産タイプ)	163,622,986円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2040(4資産タイプ)	65,165,843円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2045(4資産タイプ)	148,161,438円
三井住友・DC年金バランスゼロ(債券型)	63,300,147円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	4,982,790,671円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	770,645,782円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	666,729,382円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2050	4,618,820円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	108,862円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	197,123円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	1,114,968円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	991,818円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	2,912,601円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	6,933,292円
S M A M ・ 年金グローバル債券ファンド<適格機関投資家限定>	5,893,054,891円
S M A M ・ バランスファンドVA25<適格機関投資家専用>	22,108,583,158円
S M A M ・ バランスファンドVA37.5<適格機関投資家専用>	8,267,510,005円
S M A M ・ バランスファンドVA50<適格機関投資家専用>	20,010,677,598円
S M A M ・ バランスファンドVL30<適格機関投資家限定>	366,643,600円
S M A M ・ バランスファンドVL50<適格機関投資家限定>	640,083,663円
世界6資産バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	4,683,310円
S M A M ・ バランスファンドVA75<適格機関投資家専用>	307,803,288円
S M A M ・ バランスファンドVL国際分散型<適格機関投資家限定>	120,663,689円
S M A M ・ インデックス・バランスVA25<適格機関投資家専用>	2,173,224,706円
S M A M ・ インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用>	2,296,820,245円
S M A M ・ バランスファンドVA40<適格機関投資家専用>	3,722,888,775円
S M A M ・ バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>	12,265,266,018円
S M A M ・ バランスVA株40T<適格機関投資家限定>	123,224,826円
三井住友・国内債券インデックスファンド・VAS(適格機関投資家専用)	6,708,409,211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)	19,051,899,331円
S M A M・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	603,732,535円
S M A M・バランスファンドVA20<適格機関投資家専用>	958,092,973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)	16,541,301,861円
S M A M・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>	1,015,363,497円
S M A M・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>	204,634,192円
S M A M・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用>	45,922,082円
S M A M・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>	2,337,131,046円
S M A M・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	2,834,171,771円
S M A M・アセットバランスファンドVA20T<適格機関投資家専用>	2,615,488,146円
S M A M・アセットバランスファンドVA20A2<適格機関投資家専用>	1,101,467,242円
S M A M・アセットバランスファンドVA35A2<適格機関投資家専用>	248,597,307円
S M A M・アセットバランスファンドVA50A2<適格機関投資家専用>	22,951,295円
S M A M・アセットバランスファンドVA30L2<適格機関投資家専用>	389,089,332円
S M A M・アセットバランスファンドVA25L2<適格機関投資家専用>	7,056,525,713円
S M A M・アセットバランスファンドVA20T2<適格機関投資家専用>	318,754,686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>	200,325,538円
S M A M・マルチアセットストラテジーファンド2016-04<適格機関投資家限定>	1,734,019,761円
S M A M・マルチアセットストラテジーファンド2016-05<適格機関投資家限定>	830,924,791円
S M A M・マルチアセットストラテジー・オープン<適格機関投資家限定>	1,679,399,252円
S M A M・マルチアセット・ダイナミックアロケーション・ストラテジー・ファンド<適格機関投資家限定>	551,905円
合計	164,426,145,427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386回利付国債(2年)	3,000,000,000	3,014,940,000	
	第123回利付国債(5年)	10,000,000	10,047,200	
	第125回利付国債(5年)	1,060,000,000	1,065,936,000	
	第126回利付国債(5年)	910,000,000	915,614,700	

第127回利付国債(5年)	920,000,000	926,200,800	
第128回利付国債(5年)	1,465,000,000	1,475,504,050	
第129回利付国債(5年)	1,610,000,000	1,622,187,700	
第130回利付国債(5年)	1,000,000,000	1,007,930,000	
第131回利付国債(5年)	2,270,000,000	2,289,226,900	
第132回利付国債(5年)	655,000,000	660,908,100	
第133回利付国債(5年)	600,000,000	605,736,000	
第134回利付国債(5年)	1,150,000,000	1,161,891,000	
第135回利付国債(5年)	250,000,000	252,660,000	
第1回利付国債(40年)	40,000,000	58,265,200	
第2回利付国債(40年)	287,000,000	404,664,260	
第3回利付国債(40年)	255,000,000	361,403,850	
第4回利付国債(40年)	387,000,000	551,169,270	
第5回利付国債(40年)	390,000,000	534,108,900	
第6回利付国債(40年)	405,000,000	543,672,000	
第7回利付国債(40年)	400,000,000	513,344,000	
第8回利付国債(40年)	460,000,000	547,248,200	
第9回利付国債(40年)	741,000,000	639,860,910	
第10回利付国債(40年)	775,000,000	792,119,750	
第310回利付国債(10年)	1,480,000,000	1,520,907,200	
第312回利付国債(10年)	2,145,000,000	2,221,619,400	
第313回利付国債(10年)	2,105,000,000	2,192,989,000	
第315回利付国債(10年)	1,800,000,000	1,876,320,000	
第317回利付国債(10年)	1,005,000,000	1,047,551,700	
第318回利付国債(10年)	895,000,000	929,815,500	
第319回利付国債(10年)	980,000,000	1,024,335,200	
第320回利付国債(10年)	960,000,000	999,888,000	
第321回利付国債(10年)	960,000,000	1,002,374,400	
第322回利付国債(10年)	1,065,000,000	1,107,813,000	
第323回利付国債(10年)	510,000,000	531,715,800	
第324回利付国債(10年)	790,000,000	820,320,200	
第325回利付国債(10年)	1,365,000,000	1,420,255,200	
第326回利付国債(10年)	527,000,000	547,062,890	
第327回利付国債(10年)	375,000,000	391,038,750	
第328回利付国債(10年)	380,000,000	393,254,400	
第329回利付国債(10年)	2,530,000,000	2,648,454,600	

第330回利付国債(10年)	1,335,000,000	1,400,174,700	
第332回利付国債(10年)	793,000,000	824,220,410	
第333回利付国債(10年)	815,000,000	848,227,550	
第334回利付国債(10年)	1,265,000,000	1,318,383,000	
第335回利付国債(10年)	1,250,000,000	1,296,412,500	
第336回利付国債(10年)	920,000,000	955,171,600	
第337回利付国債(10年)	120,000,000	122,977,200	
第338回利付国債(10年)	1,205,000,000	1,243,957,650	
第339回利付国債(10年)	1,655,000,000	1,709,846,700	
第340回利付国債(10年)	2,030,000,000	2,098,086,200	
第341回利付国債(10年)	1,187,000,000	1,218,538,590	
第342回利付国債(10年)	1,520,000,000	1,536,902,400	
第343回利付国債(10年)	1,620,000,000	1,637,253,000	
第344回利付国債(10年)	2,201,000,000	2,223,274,120	
第345回利付国債(10年)	1,528,000,000	1,542,592,400	
第346回利付国債(10年)	2,040,000,000	2,058,196,800	
第347回利付国債(10年)	1,520,000,000	1,533,239,200	
第348回利付国債(10年)	635,000,000	640,378,450	
第349回利付国債(10年)	2,020,000,000	2,035,594,400	
第350回利付国債(10年)	520,000,000	523,598,400	
第2回利付国債(30年)	510,000,000	646,950,300	
第4回利付国債(30年)	300,000,000	403,224,000	
第5回利付国債(30年)	290,000,000	366,322,200	
第7回利付国債(30年)	474,000,000	610,829,580	
第9回利付国債(30年)	100,000,000	116,693,000	
第10回利付国債(30年)	585,000,000	657,481,500	
第11回利付国債(30年)	430,000,000	521,538,400	
第12回利付国債(30年)	590,000,000	752,132,000	
第14回利付国債(30年)	822,000,000	1,089,297,960	
第16回利付国債(30年)	465,000,000	626,136,450	
第18回利付国債(30年)	500,000,000	659,460,000	
第19回利付国債(30年)	490,000,000	647,422,300	
第21回利付国債(30年)	345,000,000	456,990,450	
第22回利付国債(30年)	335,000,000	456,085,750	
第23回利付国債(30年)	329,000,000	448,723,100	
第24回利付国債(30年)	310,000,000	423,177,900	



第25回利付国債(30年)	300,000,000	399,402,000	
第26回利付国債(30年)	383,000,000	517,750,890	
第27回利付国債(30年)	440,000,000	604,384,000	
第28回利付国債(30年)	386,000,000	532,139,600	
第29回利付国債(30年)	177,000,000	241,343,040	
第30回利付国債(30年)	572,000,000	772,137,080	
第31回利付国債(30年)	425,000,000	567,026,500	
第32回利付国債(30年)	735,000,000	998,357,850	
第33回利付国債(30年)	483,000,000	627,832,380	
第34回利付国債(30年)	682,000,000	918,551,700	
第35回利付国債(30年)	735,000,000	961,159,500	
第36回利付国債(30年)	280,000,000	367,388,000	
第37回利付国債(30年)	790,000,000	1,021,857,100	
第38回利付国債(30年)	445,000,000	566,921,100	
第39回利付国債(30年)	395,000,000	512,919,350	
第40回利付国債(30年)	455,000,000	580,575,450	
第41回利付国債(30年)	475,000,000	595,222,500	
第42回利付国債(30年)	445,000,000	557,941,000	
第43回利付国債(30年)	485,000,000	608,442,200	
第44回利付国債(30年)	520,000,000	652,704,000	
第45回利付国債(30年)	285,000,000	343,983,600	
第46回利付国債(30年)	600,000,000	725,166,000	
第47回利付国債(30年)	600,000,000	741,054,000	
第48回利付国債(30年)	415,000,000	492,032,300	
第49回利付国債(30年)	575,000,000	681,754,500	
第50回利付国債(30年)	565,000,000	583,645,000	
第51回利付国債(30年)	520,000,000	469,939,600	
第52回利付国債(30年)	633,000,000	603,698,430	
第53回利付国債(30年)	477,000,000	466,720,650	
第54回利付国債(30年)	630,000,000	649,051,200	
第55回利付国債(30年)	595,000,000	612,379,950	
第56回利付国債(30年)	320,000,000	329,011,200	
第57回利付国債(30年)	930,000,000	955,193,700	
第58回利付国債(30年)	210,000,000	215,462,100	
第46回利付国債(20年)	775,000,000	814,664,500	
第48回利付国債(20年)	955,000,000	1,022,661,750	

第50回利付国債(20年)	918,000,000	972,786,240	
第52回利付国債(20年)	720,000,000	775,180,800	
第54回利付国債(20年)	965,000,000	1,047,478,550	
第56回利付国債(20年)	818,000,000	890,393,000	
第59回利付国債(20年)	1,455,000,000	1,578,427,650	
第61回利付国債(20年)	1,215,000,000	1,281,436,200	
第64回利付国債(20年)	1,025,000,000	1,136,243,250	
第65回利付国債(20年)	1,020,000,000	1,135,484,400	
第69回利付国債(20年)	1,020,000,000	1,152,334,800	
第70回利付国債(20年)	780,000,000	899,769,000	
第72回利付国債(20年)	753,000,000	858,495,300	
第74回利付国債(20年)	664,000,000	760,399,520	
第75回利付国債(20年)	490,000,000	563,578,400	
第78回利付国債(20年)	590,000,000	673,089,700	
第82回利付国債(20年)	620,000,000	719,107,000	
第84回利付国債(20年)	850,000,000	983,518,000	
第85回利付国債(20年)	645,000,000	754,411,350	
第88回利付国債(20年)	742,000,000	883,321,320	
第89回利付国債(20年)	20,000,000	23,645,400	
第90回利付国債(20年)	580,000,000	688,402,000	
第92回利付国債(20年)	734,000,000	868,116,480	
第93回利付国債(20年)	632,000,000	744,458,080	
第95回利付国債(20年)	305,000,000	369,025,600	
第97回利付国債(20年)	677,000,000	816,252,130	
第99回利付国債(20年)	693,000,000	832,209,840	
第100回利付国債(20年)	207,000,000	251,440,830	
第101回利付国債(20年)	355,000,000	438,240,400	
第102回利付国債(20年)	457,000,000	566,296,120	
第105回利付国債(20年)	390,000,000	472,933,500	
第106回利付国債(20年)	370,000,000	452,517,400	
第107回利付国債(20年)	378,000,000	459,802,980	
第108回利付国債(20年)	390,000,000	466,128,000	
第109回利付国債(20年)	410,000,000	491,331,700	
第111回利付国債(20年)	456,000,000	563,073,360	
第113回利付国債(20年)	327,000,000	401,343,450	
第114回利付国債(20年)	508,000,000	625,261,640	

第116回利付国債(20年)	830,000,000	1,034,155,100	
第118回利付国債(20年)	460,000,000	563,776,000	
第119回利付国債(20年)	425,000,000	510,680,000	
第120回利付国債(20年)	280,000,000	329,529,200	
第121回利付国債(20年)	255,000,000	310,197,300	
第122回利付国債(20年)	535,000,000	644,263,050	
第123回利付国債(20年)	380,000,000	472,769,400	
第124回利付国債(20年)	365,000,000	449,559,550	
第125回利付国債(20年)	455,000,000	573,245,400	
第126回利付国債(20年)	280,000,000	345,668,400	
第127回利付国債(20年)	335,000,000	409,319,750	
第128回利付国債(20年)	445,000,000	544,906,950	
第129回利付国債(20年)	440,000,000	533,108,400	
第130回利付国債(20年)	485,000,000	588,780,300	
第131回利付国債(20年)	460,000,000	552,391,000	
第132回利付国債(20年)	970,000,000	1,166,803,300	
第133回利付国債(20年)	60,000,000	72,973,800	
第134回利付国債(20年)	50,000,000	60,919,000	
第135回利付国債(20年)	275,000,000	331,325,500	
第136回利付国債(20年)	320,000,000	381,200,000	
第137回利付国債(20年)	415,000,000	500,805,400	
第138回利付国債(20年)	25,000,000	29,479,750	
第139回利付国債(20年)	280,000,000	334,034,400	
第140回利付国債(20年)	850,000,000	1,027,344,000	
第141回利付国債(20年)	445,000,000	538,254,200	
第142回利付国債(20年)	380,000,000	465,359,400	
第143回利付国債(20年)	360,000,000	430,848,000	
第144回利付国債(20年)	150,000,000	177,357,000	
第145回利付国債(20年)	485,000,000	588,246,800	
第146回利付国債(20年)	460,000,000	558,660,800	
第147回利付国債(20年)	960,000,000	1,152,028,800	
第148回利付国債(20年)	474,000,000	562,149,780	
第149回利付国債(20年)	1,040,000,000	1,234,428,000	
第150回利付国債(20年)	901,000,000	1,054,512,380	
第151回利付国債(20年)	980,000,000	1,116,533,600	
第152回利付国債(20年)	525,000,000	597,728,250	

	第153回利付国債(20年)	627,000,000	724,084,680	
	第154回利付国債(20年)	1,060,000,000	1,206,004,400	
	第155回利付国債(20年)	820,000,000	904,960,200	
	第156回利付国債(20年)	770,000,000	769,353,200	
	第157回利付国債(20年)	555,000,000	533,926,650	
	第158回利付国債(20年)	725,000,000	734,287,250	
	第159回利付国債(20年)	798,000,000	820,743,000	
	第160回利付国債(20年)	1,025,000,000	1,070,612,500	
	第161回利付国債(20年)	550,000,000	563,563,000	
	第162回利付国債(20年)	830,000,000	848,450,900	
	第163回利付国債(20年)	1,160,000,000	1,183,954,000	
	第164回利付国債(20年)	100,000,000	100,000,000	
国債証券合計		139,693,000,000	154,889,533,040	
地方債証券	第1回東京都公募公債(20年)	100,000,000	107,792,000	
	第1回東京都公募公債(30年)	100,000,000	126,275,000	
	第6回東京都公募公債(20年)	100,000,000	113,347,000	
	第7回東京都公募公債(20年)	100,000,000	115,420,000	
	第8回東京都公募公債(20年)	100,000,000	117,880,000	
	第8回東京都公募公債(30年)	400,000,000	517,252,000	
	第13回東京都公募公債(30年)	500,000,000	626,805,000	
	第668回東京都公募公債	200,000,000	202,820,000	
	第674回東京都公募公債	100,100,000	102,042,941	
	第684回東京都公募公債	100,000,000	102,684,000	
	第685回東京都公募公債	100,000,000	102,400,000	
	第688回東京都公募公債	193,500,000	197,782,155	
	第689回東京都公募公債	200,000,000	205,106,000	
	第703回東京都公募公債	100,000,000	103,536,000	
	第705回東京都公募公債	100,000,000	104,042,000	
	第710回東京都公募公債	100,000,000	103,239,000	
	平成21年度第14回北海道公募公債	100,000,000	102,790,000	
	平成24年度第1回北海道公募公債	100,000,000	103,863,000	
	平成24年度第14回北海道公募公債	100,000,000	103,707,000	
	平成25年度第15回北海道公募公債	100,000,000	103,544,000	
	平成26年度第15回北海道公募公債	100,000,000	102,380,000	
	平成29年度第6回北海道公募公債(5年)	300,000,000	299,676,000	
	第1回神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	115,349,000	

第3回神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	114,548,000	
第7回神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	118,309,000	
第157回神奈川県公募公債	115,600,000	116,839,232	
第167回神奈川県公募公債	100,000,000	102,142,000	
第326回大阪府公募公債(10年)	200,000,000	203,658,000	
第332回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	102,516,000	
第342回大阪府公募公債(10年)	200,000,000	205,760,000	
第361回大阪府公募公債(10年)	200,000,000	207,438,000	
第373回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	104,434,000	
第377回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	103,726,000	
平成22年度第5回京都府公募公債	110,000,000	113,636,600	
平成26年度第13回京都府公募公債	100,000,000	102,813,000	
平成27年度第4回京都府公募公債	100,000,000	103,378,000	
平成29年度第12回京都府公募公債	300,000,000	300,075,000	
第5回兵庫県公募公債(15年)	300,000,000	333,024,000	
平成21年度第3回兵庫県公募公債	390,000,000	396,856,200	
平成21年度第11回兵庫県公募公債	200,000,000	203,856,000	
平成22年度第1回兵庫県公募公債	100,000,000	102,870,000	
平成25年度第15回兵庫県公募公債(5年)	100,000,000	100,133,000	
第7回静岡県公募公債(30年)	100,000,000	127,324,000	
平成20年度第1回静岡県公募公債	200,000,000	230,794,000	
平成21年度第5回静岡県公募公債	300,000,000	305,997,000	
平成21年度第1回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	101,652,000	
平成21年度第7回愛知県公募公債(10年)	200,000,000	204,134,000	
平成21年度第8回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	101,992,000	
平成21年度第10回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	102,088,000	
平成22年度第12回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	102,775,000	
平成23年度第18回愛知県公募公債(7年)	100,000,000	100,455,000	
平成21年度第1回広島県公募公債	100,000,000	101,729,000	
平成20年度第7回埼玉県公募公債	100,000,000	101,266,000	
平成21年度第1回埼玉県公募公債	100,000,000	101,540,000	
平成21年度第2回埼玉県公募公債	100,000,000	101,724,000	
平成21年度第4回埼玉県公募公債	200,000,000	203,696,000	
平成29年度第7回埼玉県公募公債(5年)	400,000,000	399,764,000	
平成20年度第10回福岡県公募公債	100,000,000	101,284,000	

平成 2 1 年度第 3 回福岡県公募公債	100,000,000	102,085,000	
平成 2 1 年度第 8 回福岡県公募公債	100,000,000	102,228,000	
平成 2 5 年度第 1 1 回福岡県公募公債	100,000,000	103,741,000	
平成 2 5 年度第 1 2 回福岡県公募公債	100,000,000	100,123,000	
平成 2 6 年度第 4 回福岡県公募公債	100,000,000	100,152,000	
平成 2 6 年度第 1 0 回福岡県公募公債	100,000,000	102,580,000	
平成 2 0 年度第 8 回千葉県公募公債	100,000,000	101,262,000	
平成 2 1 年度第 2 回千葉県公募公債	345,000,000	350,902,950	
平成 2 1 年度第 6 回千葉県公募公債	100,000,000	102,003,000	
第 9 回群馬県公募公債（ 1 0 年）	100,000,000	103,550,000	
平成 2 1 年度第 1 回岐阜県公募公債（ 1 0 年）	200,000,000	204,070,000	
第 7 3 回共同発行市場公募地方債	400,000,000	406,440,000	
第 7 4 回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,711,000	
第 7 5 回共同発行市場公募地方債	900,000,000	917,370,000	
第 7 6 回共同発行市場公募地方債	300,000,000	305,265,000	
第 7 7 回共同発行市場公募地方債	300,000,000	306,165,000	
第 7 9 回共同発行市場公募地方債	200,000,000	204,018,000	
第 8 1 回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,193,000	
第 8 2 回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,478,000	
第 9 1 回共同発行市場公募地方債	300,000,000	306,597,000	
第 1 1 0 回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,519,000	
第 1 1 1 回共同発行市場公募地方債	300,000,000	310,749,000	
第 1 1 2 回共同発行市場公募地方債	150,000,000	155,163,000	
第 1 1 4 回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,483,000	
第 1 1 5 回共同発行市場公募地方債	600,000,000	620,832,000	
第 1 1 8 回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,861,000	
第 1 3 7 回共同発行市場公募地方債	200,000,000	206,348,000	
第 1 7 2 回共同発行市場公募地方債	500,000,000	502,970,000	
平成 2 1 年度第 4 回大阪市公募公債	300,000,000	306,450,000	
平成 2 6 年度第 2 回大阪市公募公債（ 5 年）	200,000,000	200,410,000	
第 1 回名古屋市公募公債（ 2 0 年）	200,000,000	222,008,000	
第 3 回名古屋市公募公債（ 2 0 年）	100,000,000	113,976,000	
第 4 6 7 回名古屋市公募公債（ 1 0 年）	100,000,000	101,885,000	
第 1 回京都市公募公債（ 7 年）	300,000,000	301,689,000	
第 1 回京都市公募公債（ 3 0 年）	100,000,000	135,111,000	
第 7 回京都市公募公債（ 2 0 年）	100,000,000	122,296,000	

	平成26年度第1回京都市公募公債	100,000,000	100,175,000	
	平成29年度第5回京都市公募公債	100,000,000	100,024,000	
	平成26年度第17回神戸市公募公債	100,000,000	101,382,000	
	第4回横浜市公募公債(20年)	100,000,000	113,515,000	
	第9回横浜市公募公債(20年)	100,000,000	118,075,000	
	第14回横浜市公募公債(20年)	100,000,000	120,927,000	
	第47回横浜市公募公債(5年)	100,000,000	100,037,000	
	平成25年度第11回札幌市公募公債(5年)	100,000,000	100,158,000	
	平成26年度第4回札幌市公募公債(10年)	100,000,000	102,958,000	
	第2回川崎市15年公募公債	100,000,000	103,505,000	
	第4回川崎市15年公募公債	100,000,000	107,661,000	
	平成24年度第2回北九州市公募公債	100,000,000	103,216,000	
	平成23年度第9回福岡市公募公債	147,000,000	152,688,900	
	平成21年度第1回千葉市公募公債	200,000,000	203,228,000	
地方債証券合計		18,051,200,000	18,967,191,978	
特殊債券	第3回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	200,000,000	223,930,000	
	第5回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	101,442,000	
	第9回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	102,509,000	
	第15回政府保証日本政策投資銀行債券	100,000,000	107,525,000	
	第20回政府保証日本政策投資銀行債券	100,000,000	109,548,000	
	第27回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	100,402,000	
	第34回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	300,000,000	300,390,000	
	第36回日本政策投資銀行債券	100,000,000	118,443,000	
	第2回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	314,910,000	
	第7回道路債券	100,000,000	111,025,000	
	第8回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	118,077,000	
	第9回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,699,000	
	第9回道路債券	100,000,000	134,061,000	
	第18回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	150,163,000	
	第22回日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	436,251,000	
	第42回道路債券	100,000,000	114,442,000	
	第42回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,092,000	
第47回日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	246,194,000		

第81回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	241,904,000	
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	132,589,000	
第89回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1,251,000,000	1,275,482,070	
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	364,062,000	
第95回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,109,000	
第98回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	159,000,000	162,827,130	
第99回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	122,851,000	
第103回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1,500,000,000	1,538,685,000	
第104回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	308,814,000	
第107回日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	313,248,000	
第120回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,385,000	
第120回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,740,000	
第137回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1,000,000,000	1,039,720,000	
第227回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	206,834,000	
第231回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	309,435,000	
第340回政府保証道路債券	100,000,000	103,543,000	
第1回政府保証地方公共団体金融機構債券	300,000,000	305,385,000	
第1回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,954,000	
第2回政府保証地方公共団体金融機構債券	200,000,000	203,578,000	
第2回地方公営企業等金融機構債券(20年)	100,000,000	121,782,000	
第3回公営企業債券(20年)	100,000,000	104,726,000	
第3回地方公共団体金融機構債券	300,000,000	306,363,000	
第4回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,895,000	
第5回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,871,000	
第5回公営企業債券(20年)	100,000,000	110,990,000	
第6回政府保証地方公営企業等金融機構債券	100,000,000	101,228,000	



第6回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	204,824,000	
第7回政府保証地方公営企業等金融機構債券	500,000,000	507,210,000	
第8回政府保証地方公共団体金融機構債券	129,000,000	132,053,430	
第8回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,186,000	
第11回公営企業債券(20年)	100,000,000	113,780,000	
第11回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,906,000	
第14回政府保証地方公共団体金融機構債券 (6年)	200,000,000	201,020,000	
第15回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,421,000	
第16回政府保証地方公共団体金融機構債券	201,000,000	206,043,090	
第16回公営企業債券(20年)	100,000,000	114,992,000	
第17回公営企業債券(20年)	100,000,000	117,683,000	
第18回政府保証地方公共団体金融機構債券	500,000,000	512,150,000	
第18回政府保証地方公共団体金融機構債券 (6年)	800,000,000	801,056,000	
第18回公営企業債券(20年)	100,000,000	119,696,000	
第22回公営企業債券(20年)	100,000,000	119,380,000	
第24回公営企業債券(20年)	200,000,000	240,638,000	
第27回政府保証地方公共団体金融機構債券	200,000,000	206,910,000	
第42回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,366,000	
第44回地方公共団体金融機構債券	300,000,000	310,299,000	
第45回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	206,972,000	
第61回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,640,000	
第63回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,014,000	
第65回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,794,000	
第67回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,970,000	
F74回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,581,000	
第15回首都高速道路株式会社社債	100,000,000	100,402,000	
第11回阪神高速道路株式会社社債	200,000,000	200,382,000	
第7回本州四国連絡橋債券	100,000,000	115,290,000	
第332回東京交通債券	100,000,000	104,313,000	
第342回東京交通債券	100,000,000	109,687,000	
第13回関西国際空港株式会社社債	100,000,000	100,740,000	
第16回関西国際空港株式会社社債	100,000,000	101,244,000	
第51回政府保証関西国際空港債券	100,000,000	109,349,000	
第203回政府保証預金保険機構債	600,000,000	601,428,000	
第208回政府保証預金保険機構債	600,000,000	602,016,000	

第 2 0 9 回政府保証預金保険機構債	600,000,000	602,154,000	
第 3 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	9,894,000	9,964,148	
第 3 回貸付債権担保 S 種住宅金融公庫債券	14,712,000	15,310,484	
第 4 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	10,378,000	10,450,023	
第 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	18,209,000	19,305,363	
第 5 回貸付債権担保 S 種住宅金融公庫債券	15,117,000	15,707,167	
第 6 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	23,504,000	24,012,626	
第 7 回貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券	19,402,000	20,628,400	
第 8 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	11,729,000	11,940,004	
第 9 回貸付債権担保 S 種住宅金融公庫債券	33,340,000	35,308,060	
第 9 回貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券	19,549,000	20,838,843	
第 1 0 回貸付債権担保 S 種住宅金融公庫債券	51,345,000	54,418,511	
第 1 0 回貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券	19,140,000	20,192,508	
第 1 1 回貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券	20,421,000	21,721,817	
第 1 2 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	13,219,000	13,592,833	
第 1 4 回貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券	20,543,000	21,143,061	
第 1 7 回貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券	46,808,000	48,502,917	
第 1 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	25,861,000	27,732,043	
第 2 1 回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	100,821,000	
第 2 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	53,628,000	58,193,351	
第 2 5 回一般担保住宅金融支援機構債券	200,000,000	202,240,000	
第 2 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	81,948,000	88,428,447	
第 2 7 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	29,202,000	31,424,856	
第 2 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	32,499,000	34,914,975	
第 2 9 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	16,211,000	16,838,041	
第 2 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	35,244,000	37,854,170	
第 3 0 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	34,737,000	37,262,379	
第 3 2 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	18,513,000	19,238,154	
第 3 2 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	68,602,000	73,187,357	
第 3 5 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	19,035,000	19,896,714	
第 3 5 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	37,952,000	40,391,554	
第 3 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	38,643,000	41,006,792	
第 3 9 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	17,342,000	18,105,221	

第4 1 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	18,833,000	19,886,518	
第4 3 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	35,652,000	37,911,623	
第4 3 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	49,800,000	52,794,972	
第4 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	42,099,000	44,938,156	
第4 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	79,196,000	84,630,429	
第4 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	38,959,000	41,406,404	
第5 1 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	16,828,000	17,787,869	
第5 1 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	85,438,000	90,565,134	
第5 2 回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	120,075,000	
第5 3 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	18,234,000	19,296,130	
第5 5 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	108,470,000	114,312,194	
第5 7 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	51,663,000	54,485,349	
第5 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	54,722,000	57,642,513	
第5 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	106,142,000	111,994,669	
第6 0 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	166,092,000	174,469,680	
第6 1 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	53,495,000	56,043,501	
第6 7 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	59,661,000	62,125,595	
第6 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	121,938,000	128,240,975	
第7 0 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	109,192,000	114,450,686	
第7 3 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	61,234,000	64,531,450	
第9 5 回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	104,020,000	
第9 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	83,307,000	86,134,439	
第1 2 3 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	97,543,000	98,369,189	
第1 2 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	97,844,000	98,357,681	
第1 2 5 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	98,123,000	98,629,314	
第1 2 7 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	98,773,000	99,091,049	
第1 2 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	99,038,000	99,514,372	
第1 2 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	99,347,000	100,107,004	
第1 3 0 回一般担保住宅金融支援機構債券	200,000,000	238,146,000	
第1 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	34,524,000	36,313,378	
第2 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	37,040,000	39,213,507	
第3 回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	18,019,000	19,162,665	
第6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	17,996,000	18,989,739	
第5 回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	37,112,000	39,261,155	
い第7 6 8号農林債	100,000,000	100,290,000	
い第8 1 0号農林債	300,000,000	299,703,000	

	第291回信金中金債(5年)	100,000,000	100,201,000	
	第293回信金中金債(5年)	100,000,000	100,216,000	
	第297回信金中金債(5年)	200,000,000	200,438,000	
	第301回信金中金債(5年)	300,000,000	300,945,000	
	第197号商工債(3年)	200,000,000	199,818,000	
	第12回国際協力機構債券	100,000,000	103,533,000	
	第15回政府保証東日本高速道路債券	100,000,000	101,162,000	
	第28回東日本高速道路株式会社社債	100,000,000	100,342,000	
	第35回東日本高速道路株式会社社債	200,000,000	200,318,000	
	第5回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	100,801,000	
	第6回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	101,164,000	
	第25回政府保証中日本高速道路債券	200,000,000	203,590,000	
	第45回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	103,552,000	
	第19回政府保証西日本高速道路債券	100,000,000	101,446,000	
	第20回西日本高速道路株式会社社債	100,000,000	103,422,000	
	第22回西日本高速道路株式会社社債	100,000,000	103,583,000	
	第23回西日本高速道路株式会社社債	100,000,000	102,833,000	
特殊債券合計		24,093,041,000	25,348,519,878	
社債券	第11回ジェー・ピー・モルガン・チェース・アンド・カンパニー	200,000,000	200,214,000	
	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	200,558,000	
	第21回コーペラティブ・セントラル・ライフアイゼン・ボエレンリールバンク・ピー・エー	200,000,000	200,158,000	
	第13回大和ハウス工業株式会社無担保社債	100,000,000	100,181,000	
	第10回アサヒグループホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	100,140,000	
	第9回株式会社セブン&アイ・ホールディングス無担保社債	100,000,000	102,117,000	
	第30回東レ株式会社無担保社債	100,000,000	99,865,000	
	第56回住友化学株式会社無担保社債	200,000,000	200,094,000	
	第24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	100,239,000	
	第3回新日鐵住金株式会社無担保社債	100,000,000	100,071,000	
	第8回株式会社ジェイテクト無担保社債	100,000,000	99,973,000	
	第16回株式会社日立製作所無担保社債	100,000,000	103,233,000	
	第36回富士通株式会社無担保社債	100,000,000	101,245,000	

第12回パナソニック株式会社無担保社債	200,000,000	201,178,000	
第13回パナソニック株式会社無担保社債	200,000,000	203,296,000	
第1回日本生命2012基金特定目的会社特定社債	100,000,000	100,238,000	
第1回明治安田生命2013基金特定目的会社特定社債	100,000,000	100,232,000	
第1回明治安田生命2014基金特定目的会社特定社債	100,000,000	100,384,000	
第1回ユニ・ファミリーマートホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	100,130,000	
第63回三井物産株式会社無担保社債	100,000,000	117,755,000	
第47回住友商事株式会社無担保社債	100,000,000	103,189,000	
第8回株式会社みずほコーポレート銀行無担保社債	100,000,000	120,574,000	
第25回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	300,000,000	308,838,000	
第110回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	100,000,000	102,180,000	
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	102,307,000	
第4回株式会社りそな銀行無担保社債	100,000,000	103,094,000	
第9回三菱UFJ信託銀行株式会社無担保社債	100,000,000	104,407,000	
第8回住友信託銀行株式会社無担保社債	100,000,000	117,946,000	
第1回株式会社みずほフィナンシャルグループ無担保社債	100,000,000	102,897,000	
第20回株式会社三井住友銀行無担保社債	200,000,000	205,332,000	
第24回株式会社三井住友銀行無担保社債	100,000,000	104,292,000	
第9回株式会社みずほ銀行無担保社債	100,000,000	118,242,000	
第17回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	104,292,000	
第53回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	100,030,000	
第54回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	100,856,000	
第83回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	100,000,000	
第70回日立キャピタル株式会社無担保社債	100,000,000	100,038,000	
第48回三菱UFJリース株式会社無担保社債	100,000,000	99,921,000	
第21回野村ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	103,341,000	

第58回三井不動産株式会社無担保社債	100,000,000	100,015,000	
第58回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	131,576,000	
第38回京王電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	100,001,000	
第15回東日本旅客鉄道株式会社社債	100,000,000	106,224,000	
第34回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	114,836,000	
第110回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	121,503,000	
第41回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	120,143,000	
第42回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	200,000,000	244,006,000	
第528回東京電力株式会社社債	100,000,000	102,068,000	
第537回東京電力株式会社社債	100,000,000	103,079,000	
第544回東京電力株式会社社債	100,000,000	100,382,000	
第547回東京電力株式会社社債	100,000,000	103,907,000	
第507回中部電力株式会社社債	100,000,000	102,318,000	
第518回中部電力株式会社社債	100,000,000	100,085,000	
第467回関西電力株式会社社債	100,000,000	100,725,000	
第512回関西電力株式会社社債	100,000,000	100,063,000	
第308回北陸電力株式会社社債	100,000,000	103,328,000	
第471回東北電力株式会社社債	100,000,000	105,131,000	
第472回東北電力株式会社社債	100,000,000	103,949,000	
第476回東北電力株式会社社債	100,000,000	101,860,000	
第253回四国電力株式会社社債	100,000,000	104,139,000	
第328回北海道電力株式会社社債	100,000,000	100,889,000	
第11回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	112,045,000	
第18回大阪瓦斯株式会社無担保社債	200,000,000	212,882,000	
第27回東邦瓦斯株式会社無担保社債	100,000,000	104,854,000	
社債券合計	7,500,000,000	7,833,085,000	
合計		207,038,329,896	

## デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## 外国株式インデックス・マザーファンド

## 貸借対照表

	(単位：円)	
	(平成29年 4月13日現在)	(平成30年 4月13日現在)
資産の部		
流動資産		
預金	2,185,463,083	2,988,902,702
金銭信託	-	296,893,770
コール・ローン	410,533,400	89,996,877
株式	188,918,250,224	168,541,223,522
投資証券	5,026,285,203	3,751,670,756
派生商品評価勘定	14,842,315	52,253,403
未収入金	1,904,428	61,847,957
未収配当金	316,599,965	255,760,533
前払金	-	58,873,541
差入委託証拠金	1,596,288,097	2,110,640,254
流動資産合計	198,470,166,715	178,208,063,315
資産合計	198,470,166,715	178,208,063,315
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	1,934,567	110,763,744
前受金	12,330,578	-
未払解約金	375,879,554	270,724,989
未払利息	663	263
その他未払費用	4,353	32,409
流動負債合計	390,149,715	381,521,405
負債合計	390,149,715	381,521,405
純資産の部		
元本等		
元本	68,241,612,029	53,755,349,667
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	129,838,404,971	124,071,192,243
元本等合計	198,080,017,000	177,826,541,910
純資産合計	198,080,017,000	177,826,541,910
負債純資産合計	198,470,166,715	178,208,063,315

## 注記表

(重要な会計方針の注記)

項 目	自 平成29年 4月14日 至 平成30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29年 4月13日現在)	(平成30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	68,241,612,029口	53,755,349,667口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 2.9026円 (10,000口当たりの純資産額 29,026円)	1口当たり純資産額 3.3081円 (10,000口当たりの純資産額 33,081円)

## (金融商品に関する注記)

## . 金融商品の状況に関する事項

項目	自 平成29年 4月14日 至 平成30年 4月13日
----	--------------------------------



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

## . 金融商品の時価等に関する事項

項目	(平成30年 4月13日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券（株式、投資証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(デリバティブ取引に関する注記)

(平成29年 4月13日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	4,018,839,375	-	4,031,169,953	12,330,578
	SPMINI 1706	2,791,141,244	-	2,789,504,440	1,636,804
	DJ EUR 1706	741,109,273	-	746,213,750	5,104,477
	FTSE 1706	287,847,874	-	288,870,624	1,022,750
	SPI200 1706	198,740,984	-	206,581,139	7,840,155
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	97,094,570	-	96,517,400	577,170
	米ドル	48,273,174	-	47,872,000	401,174
	カナダドル	2,471,502	-	2,464,500	7,002
	ユーロ	5,821,050	-	5,804,500	16,550
	英ポンド	5,484,200	-	5,464,800	19,400
	スイスフラン	29,424,060	-	29,316,600	107,460
	スウェーデンクローナ	1,459,200	-	1,455,600	3,600
	オーストラリアドル	2,467,380	-	2,459,400	7,980
	香港ドル	1,694,004	-	1,680,000	14,004

合計	4,115,933,945	-	4,127,687,353	12,907,748
----	---------------	---	---------------	------------

(平成30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	5,549,165,281	-	5,490,291,740	58,873,541
	SPMINI 1806	3,864,248,754	-	3,777,051,168	87,197,586
	DJ EUR 1806	1,028,097,916	-	1,051,441,360	23,343,444
	FTSE 1806	387,073,821	-	395,890,822	8,817,001
	SPI200 1806	269,744,790	-	265,908,390	3,836,400
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	75,109,900	-	75,493,100	383,200
	米ドル	53,430,000	-	53,690,000	260,000
	英ポンド	13,654,800	-	13,767,300	112,500
	スイスフラン	2,232,200	-	2,231,200	1,000
	スウェーデンクローナ	898,800	-	893,900	4,900
	香港ドル	2,041,500	-	2,050,500	9,000
	シンガポールドル	1,634,200	-	1,638,200	4,000
	イスラエルシケル	1,218,400	-	1,222,000	3,600
	売建	72,913,500	-	72,933,500	20,000
	米ドル	42,944,000	-	42,952,000	8,000
	カナダドル	2,558,100	-	2,559,600	1,500
	ユーロ	13,237,000	-	13,240,000	3,000
	英ポンド	6,115,200	-	6,118,400	3,200
	スイスフラン	2,230,200	-	2,231,200	1,000
	スウェーデンクローナ	1,276,000	-	1,277,000	1,000
	ノルウェークローネ	276,400	-	276,200	200
	デンマーククローネ	1,777,000	-	1,778,000	1,000
	オーストラリアドル	2,499,600	-	2,501,100	1,500

合計	5,697,188,681	-	5,638,718,340	58,510,341
----	---------------	---	---------------	------------

## (注) 1. 時価の算定方法

## (1) 株価指数先物取引の時価の算定方法について

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

2) 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

## (2) 為替予約取引の時価の算定方法について

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

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

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

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

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

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

## 2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

## (関連当事者との取引に関する注記)

自 平成29年 4月14日 至 平成30年 4月13日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。

## (その他の注記)

(平成29年 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	60,593,406,071円
同期中における追加設定元本額	29,541,772,647円
同期中における一部解約元本額	21,893,566,689円
平成29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	10,441,488,856円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	227,458,140円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	935,783,173円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	626,513,923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)	59,724,217円

三井住友・DCターゲットイヤーファンド2020(4資産タイプ)	3,182,251円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2025(4資産タイプ)	8,789,280円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2030(4資産タイプ)	26,099,614円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2035(4資産タイプ)	32,539,661円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2040(4資産タイプ)	18,177,564円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2045(4資産タイプ)	48,001,285円
外国株式指数ファンド	413,768,587円
三井住友・DC全海外株式インデックスファンド	1,188,860,823円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	923,443,886円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	941,207,460円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	919,694,471円
イオン・バランス戦略ファンド	12,928,350円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2050	2,396,324円
SMAM・外国株式バッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	4,950,243,708円
バランスファンドVA(安定運用型)〈適格機関投資家限定〉	19,943,923円
SMAM・バランスファンドVA安定成長型〈適格機関投資家限定〉	2,837,018,575円
SMAM・バランスファンドVA25〈適格機関投資家専用〉	2,669,039,616円
SMAM・バランスファンドVA37.5〈適格機関投資家専用〉	2,174,701,240円
SMAM・バランスファンドVA50〈適格機関投資家専用〉	9,165,841,912円
SMAM・バランスファンドVL30〈適格機関投資家限定〉	25,330,001円
SMAM・バランスファンドVL50〈適格機関投資家限定〉	146,511,419円
世界6資産バランスファンドVA〈適格機関投資家限定〉	4,482,815円
SMAM・バランスファンドVA75〈適格機関投資家専用〉	1,113,631,695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〉	88,388,252円
SMAM・インデックス・バランスVA25〈適格機関投資家専用〉	238,655,942円
SMAM・インデックス・バランスVA50〈適格機関投資家専用〉	1,083,665,388円
SMAM・バランスファンドVA40〈適格機関投資家専用〉	1,860,359,937円
SMAM・バランスファンドVA35〈適格機関投資家専用〉	2,379,275,574円
SMAM・バランスVA株40T〈適格機関投資家限定〉	80,843,554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)	1,065,225,286円
三井住友・5資産バランスファンド・VAS(適格機関投資家専用)	1,515,857,893円
SMAM・グローバルバランス40VA〈適格機関投資家限定〉	202,333,290円
SMAM・バランスファンドVA20〈適格機関投資家専用〉	109,672,141円
三井住友・7資産バランスファンド・VAS(適格機関投資家専用)	1,680,619,492円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A〈適格機関投資家専用〉	34,200,641円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A〈適格機関投資家専用〉	19,069,543円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A〈適格機関投資家専用〉	9,334,115円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L〈適格機関投資家専用〉	71,351,535円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L〈適格機関投資家専用〉	161,423,410円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T〈適格機関投資家専用〉	164,923,475円
SMAM・グローバルバランスファンド(標準型)VA〈適格機関投資家限定〉	1,785,260,105円
SMAM・グローバルバランスファンド(債券重視型)VA〈適格機関投資家限定〉	296,907,571円
SMAM・世界バランスファンドVA〈適格機関投資家限定〉	9,480,190,036円
SMAM・世界バランスファンドVA2〈適格機関投資家限定〉	3,374,649,105円
SMAM・FG新興国重視型バランス20VA〈適格機関投資家限定〉	17,298円
SMAM・FGグローバルバランス25VA〈適格機関投資家限定〉	95,538円
SMAM・外国株式インデックスファンドSA〈適格機関投資家限定〉	2,441,436,609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〉	127,797円

S M A M ・ マルチアセットストラテジーファンド 2 0 1 6 - 0 4 < 適格機関投資家限定 >	76,227,799円
S M A M ・ マルチアセットストラテジーファンド 2 0 1 6 - 0 5 < 適格機関投資家限定 >	36,503,645円
S M A M ・ マルチアセットストラテジー・オープン < 適格機関投資家限定 >	48,194,289円
合計	68,241,612,029円

(平成30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	68,241,612,029円
同期中における追加設定元本額	6,553,544,669円
同期中における一部解約元本額	21,039,807,031円
平成30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	12,306,830,683円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	269,401,414円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	1,118,175,577円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	768,789,110円
S M A M ・ グローバルバランスファンド(機動的資産配分型)	88,928,836円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2020(4資産タイプ)	3,023,693円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2025(4資産タイプ)	9,140,770円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2030(4資産タイプ)	25,231,773円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2035(4資産タイプ)	36,982,056円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2040(4資産タイプ)	22,367,694円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2045(4資産タイプ)	63,089,993円
外国株式指数ファンド	477,230,356円
三井住友・DCつみたてNISA・全海外株インデックスファンド	1,834,046,241円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	505,594,952円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	546,677,956円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	480,607,175円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2050	2,844,074円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	258,118円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	1,128,067円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	9,135,207円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	10,473,788円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	39,901,346円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	3,615,637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)	2,950,224,751円
バランスファンドVA(安定運用型)<適格機関投資家限定>	12,102,560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>	836,784,489円
S M A M ・ バランスファンドVA25<適格機関投資家専用>	2,087,096,531円
S M A M ・ バランスファンドVA37.5<適格機関投資家専用>	1,837,700,430円
S M A M ・ バランスファンドVA50<適格機関投資家専用>	7,621,846,055円
S M A M ・ バランスファンドVL30<適格機関投資家限定>	23,184,564円
S M A M ・ バランスファンドVL50<適格機関投資家限定>	123,614,027円
世界6資産バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	772,703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 >	960,151,440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 >	70,572,501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 >	211,727,164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 >	909,876,599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 >	955,057,949円
S M A M ・ バランスファンド V A 3 5 < 適格機関投資家専用 >	2,015,353,572円
S M A M ・ バランス V A 株 4 0 T < 適格機関投資家限定 >	46,673,622円
三井住友・外国株式インデックスファンド・ V A S ( 適格機関投資家専用 )	883,583,465円
三井住友・ 5 資産バランスファンド・ V A S ( 適格機関投資家専用 )	1,195,139,569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 >	175,494,800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 >	89,537,244円
三井住友・ 7 資産バランスファンド・ V A S ( 適格機関投資家専用 )	1,378,857,819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 >	29,139,560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 >	15,585,889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 >	7,525,974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 >	58,355,726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 >	136,603,968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 >	137,243,424円
S M A M ・ グローバルバランスファンド ( 標準型 ) V A < 適格機関投資家限定 >	1,427,941,057円
S M A M ・ グローバルバランスファンド ( 債券重視型 ) V A < 適格機関投資家限定 >	210,986,415円
S M A M ・ 世界バランスファンド V A < 適格機関投資家限定 >	7,630,165,231円
S M A M ・ 世界バランスファンド V A 2 < 適格機関投資家限定 >	790,224,790円
S M A M ・ 外国株式インデックスファンド S A < 適格機関投資家限定 >	87,684,238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 >	8,869,456円
S M A M ・ マルチアセットストラテジーファンド 2 0 1 6 - 0 4 < 適格機関投資家限定 >	84,319,064円
S M A M ・ マルチアセットストラテジーファンド 2 0 1 6 - 0 5 < 適格機関投資家限定 >	40,344,880円
S M A M ・ マルチアセットストラテジー・オープン < 適格機関投資家限定 >	81,519,080円
S M A M ・ マルチアセット・ダイナミックアロケーション・ストラテジー・ファンド < 適格機関投資家限定 >	14,545円
合計	53,755,349,667円

## 附属明細表

## 有価証券明細表

## (a) 株式

通貨	銘柄	株数	評価額		備考
			単価	金額	
米ドル	ANADARKO PETROLEUM CORP	24,280	62.75	1,523,570.00	
	ANDEAVOR	6,701	110.13	737,981.13	
	ANTERO RESOURCES CORP	9,233	20.74	191,492.42	
	APACHE CORPORATION	16,399	39.38	645,792.62	
	BAKER HUGHES A GE CO	16,513	32.13	530,562.69	
	CABOT OIL & GAS CORPORATION	19,632	23.56	462,529.92	

CHENIERE ENERGY INC	8,184	56.20	459,940.80
CHEVRON CORPORATION	83,703	119.23	9,979,908.69
CIMAREX ENERGY CO	4,080	93.54	381,643.20
CONCHO RESOURCES INC	6,589	146.32	964,102.48
CONOCOPHILLIPS	52,158	63.24	3,298,471.92
CONTINENTAL RESOURCES, INC.	4,535	60.99	276,589.65
DEVON ENERGY CORPORATION	22,056	32.83	724,098.48
DIAMONDBACK ENERGY INC	3,558	116.34	413,937.72
EOG RESOURCES INC	25,021	109.98	2,751,809.58
EQT CORPORATION	11,310	48.33	546,612.30
EXXON MOBIL CORPORATION	186,473	77.22	14,399,445.06
HALLIBURTON CO	38,995	50.21	1,957,938.95
HELMERICH & PAYNE INC	5,249	72.51	380,604.99
HESS CORPORATION	12,398	55.00	681,890.00
HOLLYFRONTIER CORP	6,601	54.19	357,708.19
KINDER MORGAN INC	85,839	15.34	1,316,770.26
MARATHON OIL CORP	36,817	17.63	649,083.71
MARATHON PETROLEUM CORPORATION	21,936	74.25	1,628,748.00
NATIONAL-OILWELL VARCO INC.	16,848	40.64	684,702.72
NEWFIELD EXPLORATION CO	8,254	26.01	214,686.54
NOBLE ENERGY INC	20,924	31.50	659,106.00
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	34,086	71.78	2,446,693.08
ONEOK INC	16,822	58.32	981,059.04
PARSLEY ENERGY INC-CLASS A	9,208	28.22	259,849.76
PHILLIPS 66	19,267	102.63	1,977,372.21
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	7,478	182.61	1,365,557.58
PLAINS GP HOLDINGS LP-CL A	7,806	24.04	187,656.24
RANGE RESOURCES CORPORATION	12,946	14.67	189,917.82
SCHLUMBERGER LTD	60,206	67.56	4,067,517.36
TARGA RESOURCES CORP	8,672	45.08	390,933.76
TECHNIPFMC PLC	18,187	32.34	588,167.58
VALERO ENERGY CORP	19,549	100.53	1,965,260.97
WILLIAMS COS INC	37,449	25.08	939,220.92
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	9,800	163.04	1,597,792.00
ALBEMARLE CORPORATION	5,093	93.39	475,635.27
AVERY DENNISON CORP	3,941	105.49	415,736.09
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	10,777	32.35	348,635.95
BALL CORPORATION	13,670	40.51	553,771.70
CELANESE CORPORATION	5,647	104.37	589,377.39
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	10,139	38.20	387,309.80
CHEMOURS CO	8,067	50.62	408,351.54
CROWN HOLDINGS INC	5,272	51.69	272,509.68



DOWDUPONT INC	102,761	66.47	6,830,523.67
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	5,956	106.21	632,586.76
ECOLAB INC	11,670	141.38	1,649,904.60
FMC CORPORATION	5,698	80.00	455,840.00
FREEMPORT-MCMORAN INC	60,238	17.86	1,075,850.68
INTERNATIONAL PAPER CO	17,131	52.59	900,919.29
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	3,501	137.34	480,827.34
LYONDELLBASELL INDU-CL A	14,870	103.70	1,542,019.00
MARTIN MARIETTA MATERIALS	2,577	202.42	521,636.34
MONSANTO CO	19,036	125.31	2,385,401.16
MOSAIC CO/THE	15,550	24.82	385,951.00
NEWMONT MINING CORP	23,519	40.40	950,167.60
NUCOR CORP	14,127	61.92	874,743.84
PACKAGING CORP OF AMERICA	4,046	113.37	458,695.02
PPG INDUSTRIES INC	11,270	110.04	1,240,150.80
PRAXAIR INC	12,573	146.92	1,847,225.16
SEALED AIR CORP	7,922	43.69	346,112.18
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	3,778	386.65	1,460,763.70
STEEL DYNAMICS, INC.	10,191	45.09	459,512.19
VULCAN MATERIALS CO	5,483	114.89	629,941.87
WESTROCK CO	11,330	64.84	734,637.20
WR GRACE & CO	3,500	66.03	231,105.00
3M COMPANY	26,156	216.42	5,660,681.52
ACUITY BRANDS INC	1,884	131.18	247,143.12
AERCAP HOLDINGS NV	6,145	51.86	318,679.70
AGCO CORP	2,297	64.97	149,236.09
ALLEGION PLC	4,545	85.31	387,733.95
AMETEK INC	10,396	75.15	781,259.40
ARCONIC INC	19,024	23.48	446,683.52
BOEING CO	24,939	337.48	8,416,413.72
CATERPILLAR INC	26,127	150.14	3,922,707.78
CUMMINS INC	6,990	161.79	1,130,912.10
DEERE & CO	11,993	150.26	1,802,068.18
DOVER CORP	6,689	93.69	626,692.41
EATON CORP PLC	18,883	77.44	1,462,299.52
EMERSON ELECTRIC CO	28,186	68.20	1,922,285.20
FASTENAL COMPANY	12,895	50.71	653,905.45
FLOWSERVE CORPORATION	6,566	45.91	301,445.06
FLUOR CORP	5,677	58.62	332,785.74
FORTIVE CORP	13,617	74.75	1,017,870.75
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY	6,450	58.85	379,582.50
GENERAL DYNAMICS CORP	11,029	218.22	2,406,748.38

GENERAL ELECTRIC CO	382,731	13.18	5,044,394.58
HARRIS CORP	4,981	162.76	810,707.56
HD SUPPLY HOLDINGS INC	7,787	38.53	300,033.11
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	31,994	146.47	4,686,161.18
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES	1,832	257.21	471,208.72
IDEX CORP	3,078	142.20	437,691.60
ILLINOIS TOOL WORKS	13,541	155.74	2,108,875.34
INGERSOLL-RAND PLC	11,061	84.30	932,442.30
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	4,922	59.46	292,662.12
JARDINE MATHESON HOLDINGS LIMITED	9,400	61.50	578,100.00
JARDINE STRATEGIC HOLDINGS LIMITED	9,100	38.80	353,080.00
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	39,553	34.21	1,353,108.13
L3 TECHNOLOGIES INC	3,361	211.48	710,784.28
LENNOX INTERNATIONAL INC	1,823	202.11	368,446.53
LOCKHEED MARTIN CORPORATION	11,333	342.88	3,885,859.04
MASCO CORP	14,295	40.82	583,521.90
MIDDLEBY CORP	2,764	122.55	338,728.20
NORTHROP GRUMMAN CORP	7,169	352.05	2,523,846.45
OWENS CORNING	4,859	81.37	395,376.83
PACCAR INC	15,381	68.18	1,048,676.58
PARKER HANNIFIN CORPORATION	5,939	172.56	1,024,833.84
PENTAIR PLC-REGISTERED	7,006	70.08	490,980.48
RAYTHEON COMPANY	12,577	220.94	2,778,762.38
ROCKWELL AUTOMATION INC	5,618	173.97	977,363.46
ROCKWELL COLLINS INC	7,154	133.96	958,349.84
ROPER TECHNOLOGIES INC	4,481	274.39	1,229,541.59
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	8,127	53.77	436,988.79
SMITH(A.O.) CORP	6,960	63.99	445,370.40
SNAP-ON INC	2,448	145.44	356,037.12
SPIRIT AEROSYSTEMS HOLD CL A	5,166	79.95	413,021.70
STANLEY BLACK & DECKER INC	6,734	151.27	1,018,652.18
TEXTRON INC	12,033	59.05	710,548.65
TRANSDIGM GROUP INC	2,341	308.19	721,472.79
UNITED RENTALS INC	3,677	176.32	648,328.64
UNITED TECHNOLOGIES CORP	33,562	123.25	4,136,516.50
WABCO HOLDINGS INC	2,109	133.45	281,446.05
WABTEC CORP	4,279	82.73	354,001.67
WW GRAINGER INC	2,422	283.90	687,605.80
XYLEM INC	7,965	77.12	614,260.80
CINTAS CORP	4,082	172.17	702,797.94
COSTAR GROUP INC	1,621	367.73	596,090.33
EQUIFAX INC	5,368	116.91	627,572.88

IHS MARKIT LTD	18,255	48.71	889,201.05
MANPOWERGROUP	3,240	116.40	377,136.00
NIELSEN HOLDINGS PLC	15,136	32.49	491,768.64
REPUBLIC SERVICES INC	9,721	65.65	638,183.65
ROBERT HALF INTL INC	5,854	58.92	344,917.68
ROLLINS INC	4,301	51.32	220,727.32
STERICYCLE, INC.	4,280	58.74	251,407.20
TRANSUNION	6,673	57.98	386,900.54
VERISK ANALYTICS INC	7,039	106.34	748,527.26
WASTE CONNECTIONS INC	10,953	72.46	793,654.38
WASTE MANAGEMENT INC	18,677	83.02	1,550,564.54
AMERCO	390	341.44	133,161.60
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	5,676	46.57	264,331.32
C.H.ROBINSON WORLDWIDE, INC.	6,063	95.41	578,470.83
CSX CORPORATION	37,286	56.11	2,092,117.46
DELTA AIR LINES INC	7,251	52.98	384,157.98
EXPEDITORS INTL WASH INC	7,961	63.98	509,344.78
FEDEX CORP	11,187	241.91	2,706,247.17
J.B. HUNT TRANSPORT SERVICES INC	3,523	114.18	402,256.14
KANSAS CITY SOUTHERN	4,649	110.62	514,272.38
KNIGHT-SWIFT TRANSPORATION	5,115	43.20	220,968.00
MACQUARIE INFRASTRUCTURE CORP	3,832	38.15	146,190.80
NORFOLK SOUTHERN CORP	12,264	133.17	1,633,196.88
OLD DOMINION FREIGHT LINE	2,639	145.39	383,684.21
SOUTHWEST AIRLINES	6,837	54.94	375,624.78
UNION PACIFIC CORP	34,434	134.42	4,628,618.28
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS INC	3,729	66.10	246,486.90
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	30,172	106.99	3,228,102.28
APTIV PLC	11,653	85.86	1,000,526.58
AUTOLIV INC	4,001	149.71	598,989.71
BORGWARNER INC	8,566	53.57	458,880.62
FORD MOTOR COMPANY	160,576	11.31	1,816,114.56
GENERAL MOTORS CO	56,075	38.83	2,177,392.25
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	10,333	27.74	286,637.42
HARLEY-DAVIDSON INC	7,347	42.14	309,602.58
LEAR CORP	3,136	195.86	614,216.96
TESLA INC	5,905	294.08	1,736,542.40
D.R.HORTON INC	15,658	44.22	692,396.76
GARMIN LTD	5,834	59.30	345,956.20
HANESBRANDS INC	17,562	18.56	325,950.72
HASBRO INC	4,566	86.83	396,465.78
LEGGETT & PLATT INC	5,036	44.41	223,648.76

LENNAR CORP-CL A	13,092	56.75	742,971.00
LULULEMON ATHLETICA INC	4,279	92.02	393,753.58
MATTEL INC	14,058	14.68	206,371.44
MICHAEL KORS HOLDINGS LIMITED	7,155	66.08	472,802.40
MOHAWK INDUSTRIES INC	2,863	239.57	685,888.91
NEWELL BRANDS INC	22,542	25.76	580,681.92
NIKE INC -CL B	58,105	67.77	3,937,775.85
NVR INC	143	2,988.02	427,286.86
POLARIS INDUSTRIES INC	2,467	124.09	306,130.03
PULTE GROUP INC	12,930	29.11	376,392.30
PVH CORP	3,303	162.25	535,911.75
RALPH LAUREN CORPORATION	2,646	113.99	301,617.54
TAPESTRY INC	11,987	52.68	631,475.16
TOLL BROTHERS INC	7,061	42.26	298,397.86
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	8,634	17.04	147,123.36
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	8,291	14.99	124,282.09
VF CORP	14,902	77.71	1,158,034.42
WHIRLPOOL CORP	3,391	149.03	505,360.73
ARAMARK	10,783	37.81	407,705.23
CARNIVAL CORP	15,490	63.75	987,487.50
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	995	325.08	323,454.60
DARDEN RESTAURANTS INC	5,372	86.85	466,558.20
DOMINO'S PIZZA INC	1,940	231.48	449,071.20
H&R BLOCK INC	7,820	26.27	205,431.40
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS INC	8,498	79.95	679,415.10
LAS VEGAS SANDS CORP	17,144	72.37	1,240,711.28
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	13,716	133.01	1,824,365.16
MCDONALD'S CORPORATION	35,097	161.62	5,672,377.14
MELCO RESORTS & ENTERTAINMENT-ADR	11,150	31.16	347,434.00
MGM MIRAGE	20,106	34.93	702,302.58
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDINGS	7,616	53.34	406,237.44
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	7,457	114.73	855,541.61
STARBUCKS CORP	62,564	59.43	3,718,178.52
VAIL RESORTS INC	1,924	225.87	434,573.88
WYNDHAM WORLDWIDE CORP	4,622	112.03	517,802.66
WYNN RESORTS LTD	3,489	186.64	651,186.96
YUM! BRANDS INC	14,192	85.75	1,216,964.00
CBS CORP-CL B	15,692	50.06	785,541.52
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	8,293	306.34	2,540,477.62
COMCAST CORP-CLASS A	204,835	33.13	6,786,183.55
DISCOVERY INC-A	7,075	23.18	163,998.50
DISCOVERY INC-C	11,249	21.35	240,166.15

DISH NETWORK CORP.	9,780	38.68	378,290.40
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	15,544	23.30	362,175.20
LIBERTY BROADBAND-C	4,953	81.95	405,898.35
LIBERTY GLOBAL PLC-A	8,432	31.05	261,813.60
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	23,590	30.16	711,474.40
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	8,568	29.49	252,670.32
LIBERTY SIRIUS GROUP-C	7,648	40.55	310,126.40
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-A	4,141	40.63	168,248.83
LIVE NATION ENTERTAINMENT INC	6,065	38.03	230,651.95
NEWS CORP-CLASS A	16,662	15.91	265,092.42
OMNICOM GROUP	10,146	71.65	726,960.90
SIRIUS XM HOLDINGS INC	68,252	6.23	425,209.96
THE WALT DISNEY CO.	66,487	100.39	6,674,629.93
TIME WARNER INC	34,216	96.34	3,296,369.44
TWENTY-FIRST CE CL-A	47,150	36.49	1,720,503.50
TWENTY-FIRST CE CL-B	19,170	36.07	691,461.90
VIACOM INC-CLASS B	16,489	30.52	503,244.28
ADVANCE AUTO PARTS	3,304	110.57	365,323.28
AMAZON.COM INC	18,009	1,448.50	26,086,036.50
AUTONATION INC	2,851	46.53	132,657.03
AUTOZONE INC	1,219	616.51	751,525.69
BEST BUY COMPANY INC	11,445	71.30	816,028.50
BOOKING HOLDINGS INC	2,126	2,085.81	4,434,432.06
CARMAX INC	7,453	61.00	454,633.00
DOLLAR GENERAL CORP	11,840	96.89	1,147,177.60
DOLLAR TREE INC	10,263	98.10	1,006,800.30
EXPEDIA GROUP INC	5,168	107.20	554,009.60
GAP INC/THE	9,218	30.64	282,439.52
GENUINE PARTS CO	6,648	90.13	599,184.24
HOME DEPOT INC	51,078	173.36	8,854,882.08
KOHL'S CORP	7,962	63.06	502,083.72
L BRANDS INC	10,675	36.17	386,114.75
LKQ CORPORATION	13,945	38.29	533,954.05
LOWE'S COMPANIES INC	36,267	87.04	3,156,679.68
MACY'S INC	13,521	28.90	390,756.90
NETFLIX INC	19,118	309.25	5,912,241.50
NORDSTROM INC	4,756	48.37	230,047.72
O'REILLY AUTOMOTIVE INC NEW	3,687	229.85	847,456.95
QURATE RETAIL GROUP INC QVC-A	18,982	24.89	472,461.98
ROSS STORES INC	17,122	78.15	1,338,084.30
TARGET CORP	22,678	72.43	1,642,567.54
TIFFANY & CO	5,367	98.45	528,381.15

TJX COMPANIES INC	28,189	82.53	2,326,438.17
TRACTOR SUPPLY COMPANY	5,278	60.20	317,735.60
TRIPADVISOR INC-W/I	5,813	40.71	236,647.23
ULTA BEAUTY INC	2,623	217.81	571,315.63
COSTCO WHOLESALE CORP	19,190	188.82	3,623,455.80
CVS HEALTH CORPORATION	44,048	64.00	2,819,072.00
KROGER CO	38,882	23.60	917,615.20
SYSCO CORP	22,052	60.51	1,334,366.52
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	36,968	64.04	2,367,430.72
WALMART INC	65,592	85.43	5,603,524.56
ALTRIA GROUP INC	83,798	63.40	5,312,793.20
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	25,078	45.30	1,136,033.40
BROWN-FORMAN CORPORATION	11,326	55.39	627,347.14
BUNGE LIMITED	5,968	75.05	447,898.40
CAMPBELL SOUP CO	7,879	42.67	336,196.93
COCA-COLA CO/THE	178,187	44.03	7,845,573.61
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS PLC	9,352	40.86	382,122.72
CONAGRA BRANDS INC	17,122	36.78	629,747.16
CONSTELLATION BRANDS INC-A	7,451	224.22	1,670,663.22
DR.PEPPER SNAPPLE GROUP, INC	8,175	120.75	987,131.25
GENERAL MILLS INC	25,006	44.58	1,114,767.48
HORMEL FOODS CORPORATION	12,443	35.09	436,624.87
INGREDION INC	3,320	129.89	431,234.80
JM SMUCKER CO/THE-NEW COM	4,914	122.64	602,652.96
KELLOGG CO	11,216	62.61	702,233.76
KRAFT HEINZ COMPANY	26,755	60.94	1,630,449.70
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	5,606	105.08	589,078.48
MOLSON COORS BREWING COMPANY	8,674	73.61	638,493.14
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	65,326	42.03	2,745,651.78
MONSTER BEVERAGE CORPORATION	17,233	56.53	974,181.49
PEPSICO INC	62,454	108.31	6,764,392.74
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL INC.	68,209	100.25	6,837,952.25
THE HERSHEY COMPANY	6,522	95.57	623,307.54
TYSON FOODS INC-CL A	12,620	70.15	885,293.00
CHURCH & DWIGHT CO INC	11,613	48.80	566,714.40
CLOROX COMPANY	5,583	124.67	696,032.61
COLGATE-PALMOLIVE COMPANY	36,634	70.94	2,598,815.96
COTY INC-CL A	22,574	18.00	406,332.00
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	9,831	151.49	1,489,298.19
KIMBERLY-CLARK CORP	15,309	106.16	1,625,203.44
PROCTER & GAMBLE CO	111,411	77.79	8,666,661.69
SPECTRUM BRANDS HOLDINGS INC	942	98.00	92,316.00

ABBOTT LABORATORIES	76,439	58.83	4,496,906.37
AETNA INC	14,197	173.28	2,460,056.16
ALIGN TECHNOLOGY INC	3,299	263.76	870,144.24
AMERISOURCEBERGEN CORP	7,058	88.19	622,445.02
ANTHEM INC	11,378	220.46	2,508,393.88
BAXTER INTERNATIONAL INC	21,609	65.77	1,421,223.93
BECTON DICKINSON & CO	11,459	223.45	2,560,513.55
BOSTON SCIENTIFIC CORP	59,455	28.23	1,678,414.65
CARDINAL HEALTH INC	13,707	62.26	853,397.82
CENTENE CORP	7,473	106.02	792,287.46
CERNER CORP	13,575	57.17	776,082.75
CIGNA CORP	10,910	170.56	1,860,809.60
COOPER COMPANIES INC (THE)	2,055	221.02	454,196.10
DANAHER CORP	27,493	99.00	2,721,807.00
DAVITA INC	6,953	62.87	437,135.11
DENTSPLY SIRONA INC	9,944	49.19	489,145.36
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	9,150	139.28	1,274,412.00
ENVISION HEALTHCARE CORP	6,386	37.76	241,135.36
EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO	25,001	71.61	1,790,321.61
HCA HEALTHCARE INC	12,883	96.63	1,244,884.29
HENRY SCHEIN INC	7,253	69.72	505,679.16
HOLOGIC INC	12,110	37.05	448,675.50
HUMANA INC.	6,262	285.56	1,788,176.72
IDEXX LABORATORIES INC	3,797	194.21	737,415.37
INTUITIVE SURGICAL INC	4,847	415.05	2,011,747.35
LABORATORY CRP OF AMR HLDGS	4,405	164.90	726,384.50
MCKESSON CORP	9,111	143.94	1,311,437.34
MEDTRONIC PLC	59,851	79.84	4,778,503.84
QUEST DIAGNOSTICS	5,910	100.25	592,477.50
RESMED INC	6,572	98.50	647,342.00
STRYKER CORP	14,587	158.56	2,312,914.72
TELEFLEX INC	1,951	258.22	503,787.22
UNITEDHEALTH GROUP INC	42,557	224.24	9,542,981.68
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	3,760	120.10	451,576.00
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	4,120	121.01	498,561.20
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	5,035	73.28	368,964.80
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	8,837	106.42	940,433.54
ABBVIE INC	70,107	92.12	6,458,256.84
AGILENT TECHNOLOGIES INC	14,256	67.20	958,003.20
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	9,671	111.29	1,076,285.59
ALKERMES PLC	6,413	42.96	275,502.48
ALLERGAN PLC	14,808	166.31	2,462,718.48

ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	3,908	100.75	393,731.00
AMGEN INC	29,596	171.02	5,061,507.92
BIOGEN INC	9,161	267.44	2,450,017.84
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	7,516	83.89	630,517.24
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	71,876	58.84	4,229,183.84
CELGENE CORP	34,918	89.74	3,133,541.32
ELI LILLY & CO	43,936	79.29	3,483,685.44
GILEAD SCIENCES INC	57,365	75.29	4,319,010.85
ILLUMINA INC	6,326	242.09	1,531,461.34
INCYTE CORP	7,576	69.83	529,032.08
IQVIA HOLDINGS INC	6,098	96.12	586,139.76
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	2,604	156.46	407,421.84
JOHNSON & JOHNSON	117,979	130.43	15,388,000.97
MERCK & CO. INC.	120,242	56.74	6,822,531.08
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL INC	1,112	569.76	633,573.12
MYLAN NV	19,783	41.26	816,246.58
PERRIGO CO PLC	5,561	80.86	449,662.46
PFIZER INC	262,144	36.32	9,521,070.08
REGENERON PHARMACEUTICALS	3,392	325.08	1,102,671.36
SEATTLE GENETICS INC	4,290	51.63	221,492.70
TESARO INC	1,725	54.20	93,495.00
TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES-SP ADR	40,020	18.18	727,563.60
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	17,610	213.33	3,756,741.30
UNITED THERAPEUTICS CORP	2,169	110.80	240,325.20
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	11,149	161.98	1,805,915.02
WATERS CORP	3,459	202.32	699,824.88
ZOETIS INC	21,193	83.96	1,779,364.28
BANK OF AMERICA CORP	434,276	30.65	13,310,559.40
BB & T CORPORATION	35,023	53.05	1,857,970.15
CIT GROUP INC	5,683	52.67	299,323.61
CITIGROUP INC	116,537	72.13	8,405,813.81
CITIZENS FINANCIAL GROUP	21,812	43.24	943,150.88
COMERICA INC	7,688	98.48	757,114.24
EAST WEST BANCORP INC	6,233	62.14	387,318.62
FIFTH THIRD BANCORP	30,937	32.26	998,027.62
FIRST REPUBLIC BANK/CA	7,244	90.24	653,698.56
HUNTINGTON BANCSHARES INC	48,927	14.99	733,415.73
JPMORGAN CHASE & CO	152,195	113.37	17,254,347.15
KEYCORP	45,615	19.85	905,457.75
M & T BANK CORP	5,753	187.14	1,076,616.42
NEW YORK COMMUNITY BANCORP	21,911	12.86	281,775.46
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL INC	14,035	18.80	263,858.00



PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	20,764	152.49	3,166,302.36
REGIONS FINANCIAL CORPORATION	51,992	18.98	986,808.16
SIGNATURE BANK	2,508	139.88	350,819.04
SUNTRUST BANKS INC	20,334	69.12	1,405,486.08
SVB FINANCIAL GROUP	2,333	250.56	584,556.48
US BANCORP	72,481	51.24	3,713,926.44
WELLS FARGO & COMPANY	205,992	52.70	10,855,778.40
ZIONS BANCORPORATION	8,874	54.13	480,349.62
AFFILIATED MANAGERS GROUP	2,602	173.31	450,952.62
ALLY FINANCIAL INC	20,762	27.60	573,031.20
AMERICAN EXPRESS COMPANY	32,558	93.35	3,039,289.30
AMERIPRISE FINANCIAL INC	6,298	143.53	903,951.94
BANK OF NEW YORK MELLON CORP(THE)	44,767	52.01	2,328,331.67
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	55,936	198.13	11,082,599.68
BLACKROCK INC	5,231	533.01	2,788,175.31
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	21,619	96.88	2,094,448.72
CBOE GLOBAL MARKETS INC	4,473	109.67	490,553.91
CME GROUP INC.	14,728	164.21	2,418,484.88
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	16,122	71.61	1,154,496.42
E*TRADE FINANCIAL CORPORATION	11,942	57.74	689,531.08
EATON VANCE CORP	5,530	55.26	305,587.80
FRANKLIN RESOURCES INC	15,511	33.34	517,136.74
GOLDMAN SACHS GROUP INC	15,767	259.59	4,092,955.53
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	25,499	72.46	1,847,657.54
INVESCO LIMITED	18,328	30.82	564,868.96
LEUCADIA NATIONAL CORPORATION	15,290	24.36	372,464.40
MOODY'S CORP	7,529	163.95	1,234,379.55
MORGAN STANLEY	59,685	53.85	3,214,037.25
MSCI INC-A	3,805	149.30	568,086.50
NASDAQ INC	5,343	86.62	462,810.66
NORTHERN TRUST CORP	9,731	105.04	1,022,144.24
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	5,490	87.13	478,343.70
S&P GLOBAL INC	11,370	192.17	2,184,972.90
SCHWAB (CHARLES) CORP	53,607	51.73	2,773,090.11
SEI INVESTMENTS COMPANY	5,862	70.40	412,684.80
STATE STREET CORP	16,204	101.09	1,638,062.36
SYNCHRONY FINANCIAL	34,462	34.83	1,200,311.46
T ROWE PRICE GROUP INC	10,711	108.05	1,157,323.55
TD AMERITRADE HOLDING CORPORATION	13,040	60.29	786,181.60
VOYA FINANCIAL INC	7,528	51.35	386,562.80
AFLAC INC	34,250	44.65	1,529,262.50
ALLEGHANY CORPORATION	735	593.67	436,347.45

ALLSTATE CORP	15,658	96.75	1,514,911.50
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	3,539	111.71	395,341.69
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	40,024	53.49	2,140,883.76
AON PLC	11,059	141.60	1,565,954.40
ARCH CAPITAL GROUP LTD.	5,941	80.95	480,923.95
ARTHUR J GALLAGHER & CO	7,587	68.56	520,164.72
ASSURANT INC	2,198	91.80	201,776.40
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	4,807	48.31	232,226.17
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	3,961	56.47	223,677.67
BRIGHTHOUSE FINANCIAL INC	4,258	50.56	215,284.48
CHUBB LTD	20,167	134.78	2,718,108.26
CINCINNATI FINANCIAL CORP	6,311	73.98	466,887.78
EVEREST RE GROUP LTD	1,650	250.65	413,572.50
FNF GROUP	10,851	38.53	418,089.03
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	15,215	52.02	791,484.30
LINCOLN NATIONAL CORP	9,193	69.38	637,810.34
LOEWS CORPORATION	12,803	50.54	647,063.62
MARKEL CORP	629	1,153.83	725,759.07
MARSH & MCLENNAN COS	22,208	81.99	1,820,833.92
METLIFE INC	39,146	47.03	1,841,036.38
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	12,796	61.05	781,195.80
PROGRESSIVE CORP	25,621	60.50	1,550,070.50
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	18,252	105.03	1,917,007.56
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	2,972	151.94	451,565.68
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	1,504	136.06	204,634.24
TORCHMARK CORPORATION	4,615	84.23	388,721.45
TRAVELERS COS INC(THE)	12,182	137.29	1,672,466.78
UNUM GROUP	9,769	47.99	468,814.31
W.R.BERKLEY CORPORATION	3,873	73.23	283,619.79
WILLIS TOWERS WATSON PLC	5,339	147.89	789,584.71
XL GROUP LTD	11,562	55.39	640,419.18
CBRE GROUP INC-A	13,193	47.21	622,841.53
CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP	17,990	103.86	1,868,441.40
EQUINIX INC	3,436	401.20	1,378,523.20
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	52,300	7.12	372,376.00
JONES LANG LASALLE INC	2,007	173.50	348,214.50
SBA COMMUNICATIONS CORP	5,325	164.45	875,696.25
ACCENTURE PLC-CL A	26,777	150.09	4,018,959.93
ACTIVISION BLIZZARD INC	31,544	67.22	2,120,387.68
ADOBE SYSTEMS INC	21,580	226.96	4,897,796.80
AKAMAI TECHNOLOGIES	8,040	71.92	578,236.80
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	2,222	207.95	462,064.90

ALPHABET INC-CL A	13,099	1,037.29	13,587,461.71
ALPHABET INC-CL C	13,813	1,032.51	14,262,060.63
ANSYS INC	3,662	159.04	582,404.48
AUTODESK INC	8,636	132.17	1,141,420.12
AUTOMATIC DATA PROCESSING	19,255	115.26	2,219,331.30
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS	5,375	107.20	576,200.00
CA INC	12,753	34.54	440,488.62
CADENCE DESIGN SYS INC	13,205	37.47	494,791.35
CDK GLOBAL INC	5,003	64.45	322,443.35
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES	5,747	102.68	590,101.96
CITRIX SYSTEMS INC	7,019	94.55	663,646.45
COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS CORPORATION	25,894	81.55	2,111,655.70
DELL TECHNOLOGIES INC-CL V	8,755	72.68	636,313.40
DXC TECHNOLOGY CO	12,719	104.00	1,322,776.00
EBAY INC	44,058	40.53	1,785,670.74
ELECTRONIC ARTS INC	13,523	121.09	1,637,500.07
FACEBOOK INC-A	104,729	163.87	17,161,941.23
FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES	14,635	96.68	1,414,911.80
FIRST DATA CORP-CLASS A	20,984	15.44	323,992.96
FISERV INC	18,478	70.98	1,311,568.44
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	3,824	200.68	767,400.32
FORTINET INC	6,882	56.09	386,011.38
GARTNER INC	4,011	116.64	467,843.04
GLOBAL PAYMENTS INC	7,016	109.56	768,672.96
IAC/INTERACTIVECORP	3,231	157.27	508,139.37
INTL BUSINESS MACHINES CORP	38,623	158.07	6,105,137.61
INTUIT INC	10,765	173.63	1,869,126.95
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	3,649	120.14	438,390.86
LEIDOS HOLDINGS INC	6,074	65.69	399,001.06
MASTERCARD INC-CL A	41,154	174.80	7,193,719.20
MERCADOLIBRE INC	1,842	327.40	603,070.80
MICROSOFT CORP	321,848	93.58	30,118,535.84
ORACLE CORPORATION	137,460	45.88	6,306,664.80
PAYCHEX INC	14,156	61.65	872,717.40
PAYPAL HOLDINGS INC	50,143	77.46	3,884,076.78
RED HAT INC	7,729	159.20	1,230,456.80
SABRE CORP	9,850	20.05	197,492.50
SALESFORCE.COM, INC.	30,134	121.40	3,658,267.60
SERVICENOW INC	7,584	168.57	1,278,434.88
SPLUNK INC	6,247	106.39	664,618.33
SQUARE INC-A	11,069	49.69	550,018.61
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	8,124	50.41	409,530.84

SYMANTEC CORPORATION	27,227	27.60	751,465.20
SYNOPSIS INC	6,139	84.48	518,622.72
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE INC	4,808	97.84	470,414.72
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	7,179	85.42	613,230.18
TWITTER INC	27,825	29.00	806,925.00
VERISIGN INC	3,837	121.71	467,001.27
VISA INC	79,638	121.07	9,641,772.66
VMWARE INC	3,055	122.15	373,168.25
WESTERN UNION COMPANY	21,476	19.01	408,258.76
WORKDAY INC-CLASS A	6,016	128.23	771,431.68
WORLDPAY INC-CL A	13,361	81.20	1,084,913.20
ZILLOW GROUP INC-C	5,320	53.60	285,152.00
AMPHENOL CORPORATION -CL A	13,389	86.14	1,153,328.46
APPLE INC	225,474	174.14	39,264,042.36
ARISTA NETWORKS INC	1,990	268.89	535,091.10
ARROW ELECTRONICS INC	4,130	76.94	317,762.20
AVNET INC	4,559	41.94	191,204.46
CDW CORP/DE	6,951	70.07	487,056.57
CISCO SYSTEMS INC	217,100	43.34	9,409,114.00
COGNEX CORP	8,160	50.72	413,875.20
COMMSCOPE HOLDING CO INC	8,803	41.02	361,099.06
CORNING INC	38,165	27.57	1,052,209.05
F5 NETWORKS INC	2,620	148.35	388,677.00
FLEX LTD	23,204	16.74	388,434.96
FLIR SYSTEMS INC	5,286	51.52	272,334.72
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE C	70,980	17.41	1,235,761.80
HP INC	71,437	21.94	1,567,327.78
IPG PHOTONICS CORP	1,776	227.58	404,182.08
JUNIPER NETWORKS INC	16,739	24.85	415,964.15
MOTOROLA SOLUTIONS INC	7,367	108.33	798,067.11
NETAPP INC	11,136	67.57	752,459.52
PALO ALTO NETWORKS INC	3,917	190.48	746,110.16
SEAGATE TECHNOLOGY	12,422	59.87	743,705.14
TE CONNECTIVITY LTD	15,442	99.10	1,530,302.20
TRIMBLE INC	11,778	34.96	411,758.88
WESTERN DIGITAL CORP	12,990	90.50	1,175,595.00
XEROX CORP	9,697	28.23	273,746.31
AT&T INC	269,898	35.16	9,489,613.68
CENTURYLINK INC	42,717	17.25	736,868.25
SPRINT CORP	36,740	5.88	216,031.20
T-MOBILE US INC	12,603	63.02	794,241.06
VERIZON COMMUNICATIONS INC	179,149	47.74	8,552,573.26

ZAYO GROUP HOLDINGS INC	7,915	35.92	284,306.80
AES CORPORATION	27,194	11.29	307,020.26
ALLIANT ENERGY CORP	9,162	40.52	371,244.24
AMEREN CORPORATION	10,336	55.33	571,890.88
AMERICAN ELECTRIC POWER	21,673	66.64	1,444,288.72
AMERICAN WATER WORKS CO INC	8,207	80.65	661,894.55
ATMOS ENERGY CORP	4,697	82.68	388,347.96
CENTERPOINT ENERGY INC	17,622	26.53	467,511.66
CMS ENERGY CORPORATION	11,464	43.96	503,957.44
CONSOLIDATED EDISON INC	13,546	76.31	1,033,695.26
DOMINION ENERGY INC	28,261	64.07	1,810,682.27
DTE ENERGY COMPANY	7,944	102.10	811,082.40
DUKE ENERGY CORP	30,740	76.14	2,340,543.60
EDISON INTERNATIONAL	14,473	62.84	909,483.32
ENERGY CORP	8,107	77.35	627,076.45
EVERSOURCE ENERGY	13,730	58.64	805,127.20
EXELON CORP	42,162	37.76	1,592,037.12
FIRSTENERGY CORP	18,217	34.09	621,017.53
NEXTERA ENERGY INC	20,658	159.07	3,286,068.06
NISOURCE INC	15,794	23.52	371,474.88
OGE ENERGY CORP	9,056	31.56	285,807.36
P G & E CORPORATION	22,921	44.63	1,022,964.23
PINNACLE WEST CAPITAL CORPORATION	5,120	77.30	395,776.00
PPL CORPORATION	30,510	27.54	840,245.40
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	22,788	49.44	1,126,638.72
SCANA CORP	6,498	35.90	233,278.20
SEMPRA ENERGY	10,435	110.27	1,150,667.45
SOUTHERN CO	44,075	43.82	1,931,366.50
UGI CORPORATION	7,497	44.75	335,490.75
VISTRA ENERGY CORP	11,939	21.46	256,210.94
WEC ENERGY GROUP INC	13,142	61.55	808,890.10
WESTAR ENERGY INC	6,480	50.65	328,212.00
XCEL ENERGY INC	22,653	44.02	997,185.06
ADVANCED MICRO DEVICES	36,014	10.08	363,021.12
ANALOG DEVICES INC	16,189	93.02	1,505,900.78
APPLIED MATERIALS INC	46,835	56.43	2,642,899.05
BROADCOM INC	17,916	239.43	4,289,627.88
INTEL CORP	204,835	52.72	10,798,901.20
KLA-TENCOR CORPORATION	6,485	109.12	707,643.20
LAM RESEARCH CORP	7,275	206.02	1,498,795.50
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	18,948	22.42	424,814.16
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	12,942	58.60	758,401.20

	MICROCHIP TECHNOLOGY INC	10,117	89.06	901,020.02
	MICRON TECHNOLOGY INC	50,579	52.59	2,659,949.61
	NVIDIA CORP	26,613	234.60	6,243,409.80
	NXP SEMICONDUCTORS NV	14,992	114.17	1,711,636.64
	QORVO INC	5,998	72.51	434,914.98
	QUALCOMM INC	64,738	55.20	3,573,537.60
	SKYWORKS SOLUTIONS INC	7,938	99.91	793,085.58
	TEXAS INSTRUMENTS INC	42,899	104.24	4,471,791.76
	XILINX INC	11,021	69.53	766,290.13
	米ドル 小計	13,439,256		1,026,426,804.59 (110,248,503,081)
カナダドル	ALTAGAS LTD	6,948	24.51	170,295.48
	ARC RESOURCES LTD	17,074	15.03	256,622.22
	CAMECO CORP	16,384	12.51	204,963.84
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	48,502	43.44	2,106,926.88
	CENOVUS ENERGY INC	41,433	12.44	515,426.52
	CRESCENT POINT ENERGY CORP	22,509	9.99	224,864.91
	ENBRIDGE INC	73,593	40.22	2,959,910.46
	ENCANA CORP	41,829	14.72	615,722.88
	HUSKY ENERGY INC	14,553	18.64	271,267.92
	IMPERIAL OIL LTD	12,999	36.69	476,933.31
	INTER PIPELINE LTD	18,081	23.16	418,755.96
	KEYERA CORP	8,467	34.84	294,990.28
	PEMBINA PIPELINE CORP	21,701	39.62	859,793.62
	PRAIRIESKY ROYALTY LTD	9,038	29.66	268,067.08
	SEVEN GENERATIONS ENERGY-A	14,441	17.22	248,674.02
	SUNCOR ENERGY INC	70,959	47.19	3,348,555.21
	TOURMALINE OIL CORP	12,887	23.05	297,045.35
	TRANSCANADA CORP	38,551	53.17	2,049,756.67
	VERMILION ENERGY INC	5,586	43.80	244,666.80
	AGNICO EAGLE MINES LIMITED	9,697	54.79	531,298.63
	BARRICK GOLD CORP	50,240	16.17	812,380.80
	CCL INDUSTRIES INC-CL B	5,358	64.22	344,090.76
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	31,672	17.62	558,060.64
	FRANCO-NEVADA CORPORATION	8,072	87.66	707,591.52
	GOLDCORP INC	40,330	17.91	722,310.30
	KINROSS GOLD CORP	57,099	4.77	272,362.23
	LUNDIN MINING CORP	28,209	8.05	227,082.45
	METHANEX CORPORATION	4,361	84.16	367,021.76
	NUTRIEN LTD	28,662	59.16	1,695,643.92
	TECK RESOURCES LIMITED-CL B	23,969	32.90	788,580.10
	TURQUOISE HILL RESOURCES LTD	45,107	3.86	174,113.02

WEST FRASER TIMBER CO LTD	2,873	90.94	261,270.62
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	19,578	26.48	518,425.44
BOMBARDIER INC 'B'	75,852	3.65	276,859.80
CAE INC	13,932	24.56	342,169.92
FINNING INTERNATIONAL INC	6,115	31.52	192,744.80
SNC-LAVALIN GROUP INC	8,250	53.99	445,417.50
CANADIAN NATL RAILWAY CO	32,541	94.08	3,061,457.28
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	6,397	223.54	1,429,985.38
LINAMAR CORP	2,200	72.52	159,544.00
MAGNA INTERNATIONAL INC	14,641	76.21	1,115,790.61
GILDAN ACTIVEWEAR INC	9,066	37.25	337,708.50
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	9,162	70.69	647,661.78
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	19,379	26.42	511,993.18
CANADIAN TIRE CORP -CL A	3,029	169.20	512,506.80
DOLLARAMA INC	4,808	149.20	717,353.60
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC-B	18,360	54.19	994,928.40
EMPIRE CO LTD A	7,235	24.69	178,632.15
JEAN COUTU GROUP INC A	2,801	24.56	68,792.56
LOBLAW COMPANIES LTD	9,974	63.84	636,740.16
METRO INC	9,866	41.30	407,465.80
WESTON (GEORGE) LTD	1,960	102.80	201,488.00
SAPUTO INC	9,854	41.03	404,309.62
VALEANT PHARMACEUTICALS INTERN	14,555	20.92	304,490.60
BANK OF MONTREAL	27,699	95.06	2,633,066.94
BANK OF NOVA SCOTIA	53,195	76.85	4,088,035.75
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	19,150	110.63	2,118,564.50
NATIONAL BANK OF CANADA	14,715	59.24	871,716.60
ROYAL BANK OF CANADA	64,430	96.76	6,234,246.80
TORONTO-DOMINION BANK	81,666	70.27	5,738,669.82
BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT INC	37,852	49.84	1,886,543.68
CI FINANCIAL CORP	11,041	27.05	298,659.05
ELEMENT FLEET MANAGEMENT CORP	19,611	4.71	92,367.81
IGM FINANCIAL INC	3,023	36.74	111,065.02
ONEX CORPORATION	4,217	91.21	384,632.57
THOMSON REUTERS CORP	12,371	49.66	614,343.86
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	1,153	665.28	767,067.84
GREAT-WEST LIFECO INC	14,200	32.89	467,038.00
INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANCE AND FINANC	4,851	52.36	253,998.36
INTACT FINANCIAL CORPORATION	6,264	96.95	607,294.80
MANULIFE FINANCIAL CORP	87,588	23.31	2,041,676.28
POWER CORP OF CANADA	14,595	29.06	424,130.70
POWER FINANCIAL CORP	11,076	31.60	350,001.60

	SUN LIFE FINANCIAL INC	25,824	51.53	1,330,710.72
	FIRST CAPITAL REALTY INC	6,546	20.39	133,472.94
	BLACKBERRY LIMITED	23,701	13.29	314,986.29
	CGI GROUP INC - CL A	11,705	73.36	858,678.80
	CONSTELLATION SOFTWARE	848	861.17	730,272.16
	OPEN TEXT CORPORATION	11,689	43.37	506,951.93
	SHOPIFY INC-CLASS A	3,397	151.98	516,276.06
	BCE INC	6,928	54.30	376,190.40
	ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	15,965	56.66	904,576.90
	TELUS CORPORATION	7,611	44.56	339,146.16
	ATCO LTD-CLASS I	3,030	40.69	123,290.70
	CANADIAN UTILITIES LIMITED	6,417	34.69	222,605.73
	EMERA INC	2,409	40.11	96,624.99
	FORTIS INC	17,933	41.98	752,827.34
	HYDRO ONE LTD	15,052	20.95	315,339.40
	カナダドル 小計	1,778,491		74,266,582.54 (6,337,910,153)
ユーロ	ENAGAS	10,471	22.90	239,785.90
	ENI SPA	108,967	15.33	1,670,464.11
	GALP ENERGIA SGPS S.A	20,924	16.17	338,445.70
	NESTE OYJ	5,632	55.54	312,801.28
	OMV AG	6,314	48.52	306,355.28
	REPSOL SA	53,823	15.52	835,602.07
	SNAM SPA	99,978	3.81	381,815.98
	TENARIS S.A.	23,321	15.05	351,097.65
	TOTAL SA	106,057	48.89	5,185,657.01
	VOPAK	3,130	38.70	121,131.00
	AIR LIQUIDE SA	18,345	101.00	1,852,845.00
	AKZO NOBEL	11,379	77.88	886,196.52
	ARCELORMITTAL	29,490	26.23	773,670.15
	ARKEMA	3,250	108.00	351,000.00
	BASF SE	40,335	83.95	3,386,123.25
	COVESTRO AG	6,687	80.22	536,431.14
	CRH PLC	37,164	27.45	1,020,151.80
	EVONIK INDUSTRIES AG	6,449	29.43	189,794.07
	FUCHS PETROLUB SE-PREF	3,370	43.60	146,932.00
	HEIDELBERGCEMENT AG	6,574	79.20	520,660.80
	IMERYS SA	1,384	76.00	105,184.00
	K+S AG	9,644	23.60	227,598.40
	KONINKLIJKE DSM NV	7,986	86.50	690,789.00
	LANXESS	4,159	61.98	257,774.82
	LINDE AG - TENDER	7,910	175.65	1,389,391.50



SOLVAY SA	3,317	113.55	376,645.35
STORA ENSO OYJ-R SHS	24,709	15.37	379,900.87
SYMRISE AG	6,010	63.32	380,553.20
THYSSENKRUPP AG	19,367	22.13	428,591.71
UMICORE	9,568	42.17	403,482.56
UPM-KYMMENE OYJ	23,383	29.05	679,276.15
VOESTALPINE AG	5,079	43.33	220,073.07
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	11,265	33.11	372,984.15
AIRBUS SE	25,783	92.96	2,396,787.68
ALSTOM RGPT	6,452	36.80	237,433.60
ANDRITZ AG	3,606	46.32	167,029.92
BOSKALIS WESTMINSTER NV	3,784	24.04	90,967.36
BOUYGUES SA	10,290	41.84	430,533.60
BRENTAG AG	6,629	47.90	317,529.10
CNH INDUSTRIAL NV	43,160	9.90	427,542.96
COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	21,266	43.56	926,453.29
DASSAULT AVIATION SA	89	1,600.00	142,400.00
EIFFAGE SA	3,580	93.66	335,302.80
FERROVIAL SA	22,033	17.08	376,323.64
GEA GROUP AG	8,178	31.72	259,406.16
HOCHTIEF AG	825	148.60	122,595.00
KION GROUP AG	3,179	76.60	243,511.40
KONE OYJ-B	14,652	40.15	588,277.80
LEGRAND SA	11,992	62.38	748,060.96
LEONARDO SPA	18,310	9.44	172,883.02
MAN SE	1,403	96.10	134,828.30
METSO OYJ	5,502	25.81	142,006.62
MTU AERO ENGINES AG	2,451	134.90	330,639.90
OSRAM LICHT AG	4,588	59.30	272,068.40
PRYSMIAN SPA	9,379	24.46	229,410.34
REXEL SA	12,854	13.59	174,750.13
SAFRAN SA	14,456	88.38	1,277,621.28
SCHNEIDER ELECTRIC SE	24,254	70.62	1,712,817.48
SIEMENS AG-REG	33,836	104.72	3,543,305.92
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY	8,238	13.26	109,235.88
THALES SA	4,530	101.20	458,436.00
VINCI S.A.	22,403	80.62	1,806,129.86
WARTSILA OYJ-B SHARES	18,903	18.33	346,491.99
BIC	1,337	81.10	108,430.70
BUREAU VERITAS SA	12,626	20.96	264,640.96
EDENRED	9,497	27.92	265,156.24
RANDSTAD NV	4,694	54.86	257,512.84

RELX NV	43,033	17.26	742,964.74
TELEPERFORMANCE	2,489	125.90	313,365.10
WOLTERS KLUWER-CVA	13,701	43.48	595,719.48
ABERTIS INFRASTRUCTURAS SA	31,359	18.20	570,890.59
AENA SME SA	2,881	169.70	488,905.70
AEROPORTS DE PARIS (ADP)	1,346	180.00	242,280.00
ATLANTIA SPA	20,462	26.88	550,018.56
BOLLORE	39,433	4.44	175,319.11
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	9,260	26.99	249,927.40
DEUTSCHE POST AG-REG	41,384	36.34	1,503,894.56
FRAPORT AG	1,856	79.62	147,774.72
GETLINK	23,484	11.59	272,179.56
INTERNATIONAL CONSOLIDATED AIRLINES GROUP	23,274	7.02	163,430.02
RYANAIR HOLDINGS PLC	1,614	16.09	25,969.26
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	14,056	89.93	1,264,056.08
BAYERISCHE MOTOREN WERKE(BMW)AG-PFD	2,508	78.50	196,878.00
CONTINENTAL AG	4,655	225.30	1,048,771.50
DAIMLER AG	42,431	65.47	2,777,957.57
FAURECIA	3,127	68.68	214,762.36
FERRARI NV	5,395	98.98	533,997.10
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	47,196	18.97	895,308.12
MICHELIN (CGDE)-B	7,634	120.55	920,278.70
NOKIAN RENKAAT OYJ	5,507	33.45	184,209.15
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE PREF	6,624	73.52	486,996.48
PSA PEUGEOT CITROEN	26,121	20.39	532,607.19
RENAULT SA	8,755	93.88	821,919.40
SCHAEFFLER AG	9,576	13.10	125,445.60
VALEO SA	9,959	54.84	546,151.56
VOLKSWAGEN AG	1,256	173.70	218,167.20
VOLKSWAGEN AG PFD	8,314	176.60	1,468,252.40
ADIDAS AG	8,339	210.30	1,753,691.70
HERMES INTERNATIONAL	1,312	511.60	671,219.20
HUGO BOSS AG	3,149	75.66	238,253.34
KERING	3,379	439.90	1,486,422.10
LUXOTTICA GROUP SPA	7,229	51.70	373,739.30
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	12,354	281.00	3,471,474.00
SEB SA	1,032	159.90	165,016.80
ACCOR SA	7,551	43.66	329,676.66
PADDY POWER BETFAIR PLC	3,448	82.50	284,460.00
SODEXO	3,900	78.12	304,668.00
ALTICE NV -A W/I	22,625	7.50	169,778.00
AXEL SPRINGER SE	1,698	69.00	117,162.00

EUTELSAT COMMUNICATIONS	8,726	17.75	154,886.50
JC DECAUX SA	2,828	28.38	80,258.64
LAGARDERE S.C.A.	6,108	23.42	143,049.36
PROSIEBEN SAT.1 MEDIA SE-REG	10,851	29.60	321,189.60
PUBLICIS GROUPE	9,116	55.52	506,120.32
RTL GROUP	1,615	69.15	111,677.25
SES	17,656	11.53	203,573.68
TELENET GROUP HOLDINGS NV	2,181	53.60	116,901.60
VIVENDI SA	45,432	21.37	970,881.84
INDITEX	48,190	25.18	1,213,424.20
ZALANDO SE	5,372	44.66	239,913.52
CARREFOUR SA	26,320	15.92	419,014.40
CASINO GUICHARD PERRACHON	1,833	41.36	75,812.88
COLRUYT NV	2,173	45.47	98,806.31
JERONIMO MARTINS SGPS S.A.	12,270	14.33	175,890.45
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	54,058	19.72	1,066,239.99
METRO AG	8,344	14.30	119,360.92
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	33,462	85.99	2,877,397.38
DANONE	26,156	64.91	1,697,785.96
DAVIDE CAMPARI-MILANO SPA	22,958	6.30	144,750.19
HEINEKEN HOLDING NV	5,292	86.10	455,641.20
HEINEKEN NV	11,685	88.94	1,039,263.90
KERRY GROUP PLC-A	7,289	83.30	607,173.70
PERNOD-RICARD SA	9,357	138.50	1,295,944.50
REMY COINTREAU	1,273	114.00	145,122.00
BEIERSDORF AG	4,089	92.58	378,559.62
HENKEL AG & CO KGAA	4,681	98.05	458,972.05
HENKEL AG & CO KGAA	7,824	103.80	812,131.20
L'OREAL	11,214	190.70	2,138,509.80
UNILEVER NV-CVA	71,537	46.21	3,306,082.45
BIOMERIEUX	1,779	65.30	116,168.70
ESSILOR INTERNATIONAL	8,802	112.20	987,584.40
FRESENIUS MEDICAL CARE AG AND CO.KGAA	9,181	82.70	759,268.70
FRESENIUS SE & CO KGAA	18,310	64.00	1,171,840.00
KONINKLIJKE PHILIPS NV	40,770	32.12	1,309,532.40
SIEMENS HEALTHINEERS AG	6,584	32.45	213,650.80
BAYER AG	36,504	98.50	3,595,644.00
EUROFINS SCIENTIFIC	484	436.80	211,411.20
GRIFOLS S.A.	13,951	23.19	323,523.69
IPSEN	1,807	126.75	229,037.25
MERCK KGAA	5,705	80.94	461,762.70
ORION OYJ	4,259	24.87	105,921.33

QIAGEN N.V.	10,011	26.44	264,690.84
RECORDATI SPA	4,578	29.67	135,829.26
SANOFI	50,032	66.30	3,317,121.60
UCB SA	5,753	66.86	384,645.58
ABN AMRO GROUP NV-CVA	18,916	24.83	469,684.28
AIB GROUP PLC	36,918	5.15	190,127.70
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	292,821	6.32	1,853,264.10
BANCO DE SABADELL SA	235,029	1.78	418,351.62
BANCO ESPIRITO SANTO,S.A(BES)	187,906	0.01	1,879.06
BANCO SANTANDER SA	708,624	5.34	3,786,178.03
BANK OF IRELAND GROUP PLC	43,692	7.48	326,816.16
BANKIA SA	48,396	3.70	179,113.59
BANKINTER,S.A.	26,969	8.40	226,539.60
BNP PARIBAS	49,754	61.23	3,046,437.42
CAIXABANK	166,584	3.94	656,340.96
COMMERZBANK AG	46,644	10.81	504,408.21
CREDIT AGRICOLE SA	49,578	13.33	661,122.63
ERSTE GROUP BANK AG	13,095	40.65	532,311.75
ING GROEP NV-CVA	171,125	14.07	2,407,728.75
INTESA SANPAOLO	584,126	3.05	1,781,584.30
INTESA SANPAOLO-RSP	32,509	3.18	103,541.16
KBC GROUPE SA	10,878	71.20	774,513.60
MEDIOBANCA SPA	26,782	9.84	263,588.44
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG	6,677	27.89	186,221.53
SOCIETE GENERALE	32,955	44.21	1,457,105.32
UNICREDIT SPA	89,256	17.24	1,539,130.46
AMUNDI SA	2,379	66.16	157,394.64
DEUTSCHE BANK AG -REG	87,576	11.66	1,021,836.76
DEUTSCHE BOERSE AG	8,227	108.80	895,097.60
EURAZEO	2,022	74.80	151,245.60
EXOR NV	4,683	59.48	278,544.84
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	3,375	94.26	318,127.50
NATIXIS	45,362	6.69	303,743.95
WENDEL	1,082	122.90	132,977.80
AEGON NV	74,580	5.88	438,679.56
AGEAS	8,915	43.60	388,694.00
ALLIANZ SE-REG	19,730	188.64	3,721,867.20
ASSICURAZIONI GENERALI	56,608	16.20	917,332.64
AXA SA	83,032	22.57	1,874,032.24
CNP ASSURANCES	8,978	20.94	187,999.32
HANNOVER RUECKVERSICHERUNG SE	3,033	113.70	344,852.10
MAPFRE SA	46,367	2.76	128,390.22

MUENCHENER RUECKVER AG-REG	6,847	191.05	1,308,119.35
NN GROUP NV	14,071	37.89	533,150.19
POSTE ITALIANE SPA	26,562	7.67	203,943.03
SAMPO OYJ-A SHS	19,358	45.73	885,241.34
SCOR SE	8,353	34.68	289,682.04
UNIPOLSAI SPA	49,963	2.04	102,024.44
DEUTSCHE WOHNEN SE	15,822	37.48	593,008.56
VONOVIA SE	21,002	39.86	837,139.72
AMADEUS IT GROUP SA	19,271	61.52	1,185,551.92
ATOS SE	4,258	113.15	481,792.70
CAPGEMINI SA	6,963	104.80	729,722.40
DASSAULT SYSTEMES SA	5,529	110.35	610,125.15
SAP SE	43,413	87.74	3,809,056.62
UBISOFT ENTERTAINMENT SA	2,839	73.16	207,701.24
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	5,981	53.56	320,342.36
WIRECARD AG	5,168	105.45	544,965.60
INGENICO S.A.	2,691	71.32	191,922.12
NOKIA OYJ	260,197	4.54	1,181,294.38
1&1 DRILLISCH AG	2,188	57.00	124,716.00
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	145,054	13.87	2,011,898.98
ELISA OYJ	5,909	38.37	226,728.33
ILIAD SA	1,016	164.35	166,979.60
KONINKLIJKE KPN NV	141,551	2.47	350,621.82
ORANGE S.A.	87,968	14.20	1,249,145.60
PROXIMUS SA	6,313	25.65	161,928.45
TELECOM ITALIA SPA	494,065	0.86	425,488.77
TELECOM ITALIA-RNC	251,378	0.74	186,522.47
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	40,394	3.79	153,456.80
TELEFONICA S.A.	204,731	8.19	1,676,746.89
E.ON SE	97,365	8.95	871,708.84
EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	101,010	3.15	318,282.51
ELECTRICITE DE FRANCE(EDF)	23,877	11.48	274,227.34
ENDESA S.A.	15,037	18.03	271,192.29
ENEL SPA	354,797	5.11	1,813,722.26
ENGIE	77,173	13.95	1,076,563.35
FORTUM OYJ	19,563	17.63	344,895.69
GAS NATURAL SDG SA	16,170	19.88	321,540.45
IBERDROLA SA	253,332	6.15	1,559,005.12
INNOGY SE	5,851	37.96	222,103.96
RED ELECTRICA CORPORATION SA	18,384	16.58	304,898.64
RWE AG	22,852	20.70	473,036.40
SUEZ	17,725	11.84	209,952.62

	TERNA SPA	66,384	4.77	316,718.06
	UNIPER SE	8,953	23.67	211,917.51
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	21,587	19.01	410,476.80
	ASML HOLDING NV	16,826	167.65	2,820,878.90
	INFINEON TECHNOLOGIES AG	48,425	21.81	1,056,149.25
	STMICROELECTRONICS NV	28,042	18.50	518,777.00
	ユーロ 小計	8,810,697		174,113,521.29 (23,052,630,218)
英ポンド	BP PLC	873,772	5.04	4,408,179.74
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	199,974	23.68	4,736,384.19
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	162,293	24.11	3,912,884.23
	WOOD GROUP (JOHN) PLC	32,660	5.57	181,916.20
	ANGLO AMERICAN PLC	58,674	16.70	980,090.49
	ANTOFAGASTA PLC	19,439	9.49	184,514.98
	BHP BILLITON PLC	89,998	14.45	1,301,191.08
	CRODA INTERNATIONAL PLC	6,223	46.47	289,182.81
	FRESNILLO PLC	8,512	12.66	107,804.48
	GLENCORE PLC	541,600	3.42	1,854,709.20
	JOHNSON MATTHEY PLC	9,426	32.70	308,230.20
	MONDI PLC	17,158	19.07	327,203.06
	RANDGOLD RESOURCES LTD	3,897	56.92	221,817.24
	RIO TINTO PLC	52,904	37.50	1,983,900.00
	ASHTREAD GROUP PLC	23,067	20.31	468,490.77
	BAE SYSTEMS PLC	141,730	5.91	838,474.68
	BUNZL PLC	13,431	20.99	281,916.69
	COBHAM PLC	108,087	1.18	128,461.39
	DCC PLC	3,732	65.90	245,938.80
	FERGUSON PLC	11,452	53.06	607,643.12
	IMI PLC	12,034	10.41	125,273.94
	MEGGITT PLC	36,960	4.36	161,293.44
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	71,679	8.81	631,635.34
	SMITHS GROUP PLC	18,742	15.01	281,411.13
	TRAVIS PERKINS PLC	9,272	12.45	115,436.40
	WEIR GROUP PLC/THE	9,222	20.90	192,739.80
	BABCOCK INTERNATIONAL GROUP PLC	11,442	7.09	81,146.66
	CAPITA PLC	30,870	1.41	43,573.00
	EXPERIAN PLC	41,178	15.45	636,200.10
	G4S PLC	74,291	2.53	188,253.39
	INTERTEK GROUP PLC	6,794	48.10	326,791.40
	RELX PLC	45,547	15.05	685,710.08
	EASYJET PLC	7,630	16.61	126,734.30
	ROYAL MAIL PLC	36,064	5.70	205,853.31

GKN PLC	75,902	4.39	333,513.38
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	39,736	5.50	218,706.94
BURBERRY GROUP PLC	20,414	17.18	350,712.52
PERSIMMON PLC	13,916	26.60	370,165.60
TAYLOR WIMPEY PLC	129,687	1.90	246,729.51
THE BERKELEY GROUP HOLDINGS	5,336	38.83	207,196.88
CARNIVAL PLC	8,091	45.10	364,904.10
COMPASS GROUP PLC	70,275	14.61	1,027,069.12
GVC HOLDINGS PLC	23,842	9.28	221,253.76
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	7,601	42.53	323,270.53
MERLIN ENTERTAINMENTS PLC	32,557	3.39	110,368.23
TUI AG-DI	17,636	15.87	279,883.32
WHITBREAD PLC	7,771	38.09	295,997.39
ITV PLC	151,064	1.42	215,870.45
PEARSON PLC	38,689	7.69	297,595.78
SKY PLC	46,118	13.01	599,995.18
WPP PLC	54,571	11.87	647,757.77
KINGFISHER PLC	100,357	3.02	303,379.21
MARKS & SPENCER GROUP PLC	71,350	2.70	193,215.80
NEXT PLC	6,971	50.28	350,501.88
SAINSBURY (J) PLC	64,136	2.53	162,264.08
TESCO PLC	426,993	2.33	995,747.67
WILLIAM MORRISON SUPERMARKETS PLC	100,809	2.30	231,961.50
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	16,771	25.81	432,859.51
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	101,110	41.74	4,220,331.40
COCA-COLA HBC AG-CDI	8,704	25.01	217,687.04
DIAGEO PLC	108,215	24.93	2,698,341.02
IMPERIAL BRANDS PLC	42,416	24.66	1,046,190.64
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	28,609	60.36	1,726,839.24
UNILEVER PLC	54,125	39.24	2,124,135.62
CONVATEC GROUP PLC	61,239	2.05	125,539.95
MEDICLINIC INTERNATIONAL PLC	19,832	5.80	115,184.25
SMITH & NEPHEW PLC	39,633	13.26	525,533.58
ASTRAZENECA PLC	55,594	50.45	2,804,717.30
GLAXOSMITHKLINE PLC	217,148	14.29	3,104,347.80
SHIRE PLC	38,624	36.85	1,423,487.52
BARCLAYS PLC	759,705	2.16	1,640,962.80
HSBC HOLDINGS PLC	878,070	6.81	5,984,925.12
LLOYDS BANKING GROUP PLC	3,194,667	0.68	2,177,165.56
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	152,437	2.64	403,500.73
STANDARD CHARTERED PLC	145,314	7.33	1,065,296.93
3I GROUP PLC	44,300	8.92	395,333.20

	HARGREAVES LANSDOWN PLC	11,038	17.03	188,032.33
	INVESTEC PLC	33,008	5.65	186,627.23
	LONDON STOCK EXCHANGE GROUP PLC	12,977	42.38	549,965.26
	SCHRODERS PLC	6,213	32.25	200,369.25
	ST JAMES'S PLACE PLC	21,830	10.82	236,309.75
	STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	117,114	3.77	441,519.78
	ADMIRAL GROUP PLC	7,842	19.05	149,429.31
	AVIVA PLC	180,213	5.09	918,365.44
	DIRECT LINE INSURANCE GROUP	63,289	3.57	226,258.17
	LEGAL & GENERAL GROUP PLC	249,238	2.69	671,696.41
	OLD MUTUAL PLC	225,291	2.37	535,741.99
	PRUDENTIAL PLC	111,192	18.17	2,020,914.60
	RSA INSURANCE GROUP PLC	40,508	6.54	265,003.33
	AUTO TRADER GROUP PLC	42,053	3.39	142,643.77
	MICRO FOCUS INTERNATIONAL	18,215	12.58	229,235.77
	SAGE GROUP PLC/THE	49,630	6.72	333,513.60
	BT GROUP PLC	365,274	2.40	878,483.97
	VODAFONE GROUP PLC	1,179,668	2.07	2,446,041.59
	CENTRICA PLC	254,915	1.39	355,733.88
	NATIONAL GRID PLC	145,154	8.23	1,195,488.34
	SEVERN TRENT PLC	9,868	18.47	182,311.30
	SSE PLC	44,560	12.96	577,720.40
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	33,192	7.03	233,538.91
	英債券 小計	13,492,371		80,916,369.83 (12,378,586,256)
スイスフラン	CLARIANT AG-REG	10,101	23.83	240,706.83
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	321	597.50	191,797.50
	GIVAUDAN-REG	409	2,160.00	883,440.00
	LAFARGEHOLCIM LTD	19,169	52.82	1,012,506.58
	SIKA AG	99	7,325.00	725,175.00
	ABB LTD	81,802	21.93	1,793,917.86
	GEBERIT AG-REG	1,593	412.90	657,749.70
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	1,025	193.80	198,645.00
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	1,977	201.40	398,167.80
	ADECCO GROUP AG-REG	7,019	67.38	472,940.22
	SGS SA	219	2,373.00	519,687.00
	KUEHNE&NAGEL INTL AG-REG	2,362	151.05	356,780.10
	CIE FINANCIERE RICHEMONT SA-REGD A	23,163	90.68	2,100,420.84
	THE SWATCH GROUP AG-B	1,330	446.10	593,313.00
	THE SWATCH GROUP AG-REG	2,516	83.55	210,211.80
	DUFREY AG-REG	1,650	131.00	216,150.00
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	109	1,752.00	190,968.00



	LINDT & SPRUENGLI AG	45	6,025.00	271,125.00	
	LINDT & SPRUENGLI AG-REG	4	71,300.00	285,200.00	
	NESTLE SA-REGISTERED	136,671	76.14	10,406,129.94	
	SONOVA HOLDING AG	2,643	150.40	397,507.20	
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	435	606.50	263,827.50	
	LONZA GROUP AG-REG	3,160	233.50	737,860.00	
	NOVARTIS AG-REG SHS	97,442	78.72	7,670,634.24	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	30,853	218.50	6,741,380.50	
	VIFOR PHARMA AG	2,258	155.85	351,909.30	
	CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	107,601	15.90	1,711,393.90	
	JULIUS BAER GROUP LTD	9,558	58.34	557,613.72	
	PARGESA HOLDING SA-BR	1,867	88.60	165,416.20	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	818	714.50	584,461.00	
	UBS GROUP AG	162,424	16.83	2,734,408.04	
	BALOISE HOLDING AG	1,987	148.20	294,473.40	
	SWISS LIFE HOLDING AG	1,472	344.90	507,692.80	
	SWISS RE AG	13,294	94.72	1,259,207.68	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	6,458	307.30	1,984,543.40	
	SWISS PRIME SITE-REG	3,061	90.15	275,949.15	
	SWISSCOM AG-REG	1,163	451.10	524,629.30	
	スイスフラン 小計	738,078		48,487,939.50 (5,409,314,530)	
スウェーデンク ローナ	LUNDIN PETROLEUM AB	8,864	229.50	2,034,288.00	
	BOLIDEN AB	12,103	290.10	3,511,080.30	
	ALFA LAVAL AB	12,041	198.00	2,384,118.00	
	ASSA ABLOY AB-B	43,430	176.75	7,676,252.50	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	30,249	350.10	10,590,174.90	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	16,107	314.00	5,057,598.00	
	SANDVIK AB	50,953	156.55	7,976,692.15	
	SKANSKA AB-B SHS	15,711	164.00	2,576,604.00	
	SKF AB-B SHARES	16,642	176.45	2,936,480.90	
	VOLVO AB-B SHS	69,797	151.35	10,563,775.95	
	SECURITAS AB-B SHS	12,234	138.35	1,692,573.90	
	ELECTROLUX AB-SER B	11,046	253.30	2,797,951.80	
	HUSQVARNA AB-B SHS	18,593	78.00	1,450,254.00	
	HENNES & MAURITZ AB-B SHS	40,173	134.10	5,387,199.30	
	ICA GRUPPEN AB	3,550	301.70	1,071,035.00	
	SWEDISH MATCH AB	7,555	370.60	2,799,883.00	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	26,240	223.80	5,872,512.00	
	GETINGE AB-B SHS	9,989	96.06	959,543.34	
	NORDEA BANK AB	131,614	85.28	11,224,041.92	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN AB-A	66,708	83.96	5,600,803.68	

	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	69,942	98.30	6,875,298.60	
	SWEDBANK AB - A SHARES	39,030	181.20	7,072,236.00	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	6,266	189.20	1,185,527.20	
	INVESTOR AB-B SHS	19,895	370.50	7,371,097.50	
	KINNEVIK AB-B SHS	11,257	308.90	3,477,287.30	
	LUNDBERGS AB-B SHS	1,567	589.00	922,963.00	
	ERICSSON LM-B SHS	136,331	53.56	7,301,888.36	
	HEXAGON AB-B SHS	11,065	497.20	5,501,518.00	
	MILLICOM INTL CELLULAR-SDR	2,694	558.00	1,503,252.00	
	TELE2 AB-B SHS	18,224	104.95	1,912,608.80	
	TELIA CO AB	126,963	37.90	4,811,897.70	
	スウェーデンクローナ 小計	1,046,833		142,098,437.10 (1,814,597,041)	
ノルウェーク ローネ	STATOIL ASA	49,847	198.90	9,914,568.30	
	NORSK HYDRO ASA	60,434	50.36	3,043,456.24	
	YARA INTERNATIONAL ASA	7,492	318.70	2,387,700.40	
	SCIBSTED ASA-B SHS	3,724	194.60	724,690.40	
	MARINE HARVEST ASA	18,939	174.60	3,306,749.40	
	ORKLA ASA	33,915	83.68	2,838,007.20	
	DNB ASA	43,520	149.55	6,508,416.00	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	9,988	133.80	1,336,394.40	
	TELENOR ASA	33,605	174.95	5,879,194.75	
	ノルウェークローネ 小計	261,464		35,939,177.09 (496,679,427)	
デンマークク ローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	4,096	553.60	2,267,545.60	
	NOVOZYMES A/S-B SHARES	10,279	308.00	3,165,932.00	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	9,608	412.60	3,964,260.80	
	ISS A/S	6,409	210.00	1,345,890.00	
	A P MOLLER-MAERSK A/S-A	168	8,810.00	1,480,080.00	
	A P MOLLER-MAERSK A/S-B	295	9,354.00	2,759,430.00	
	DSV A/S	8,324	478.90	3,986,363.60	
	PANDORA A/S	4,763	677.80	3,228,361.40	
	CARLSBERG AS-B	4,678	687.60	3,216,592.80	
	COLOPLAST-B	4,991	511.00	2,550,401.00	
	WILLIAM DEMANT HOLDING	4,455	227.00	1,011,285.00	
	GENMAB A/S	2,773	1,215.00	3,369,195.00	
	H LUNDBECK A/S	3,618	344.60	1,246,762.80	
	NOVO NORDISK A/S-B	81,148	301.70	24,482,351.60	
	DANSKE BANK A/S	32,840	221.40	7,270,776.00	
	TRYG A/S	5,005	139.10	696,195.50	
ORSTED A/S	8,516	386.50	3,291,434.00		
		191,966		69,332,857.10	

デンマーククローネ 小計				(1,232,738,199)
オーストラリア ドル	CALTEX AUSTRALIA LIMITED	12,579	31.80	400,012.20
	OIL SEARCH LTD	60,868	7.59	461,988.12
	ORIGIN ENERGY LIMITED	74,587	8.99	670,537.13
	SANTOS LTD	80,415	5.97	480,077.55
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	41,107	30.48	1,252,941.36
	ALUMINA LTD	106,977	2.52	269,582.04
	AMCOR LIMITED	50,321	14.06	707,513.26
	BHP BILLITON LTD	141,042	29.64	4,180,484.88
	BLUESCOPE STEEL LTD	23,089	15.84	365,729.76
	BORAL LIMITED	55,663	7.30	406,339.90
	FORTESCUE METALS GROUP LIMITED	72,860	4.45	324,227.00
	INCITEC PIVOT LTD	85,406	3.58	305,753.48
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	18,691	22.89	427,836.99
	NEWCREST MINING LIMITED	31,386	20.24	635,252.64
	ORICA LIMITED	17,981	18.54	333,367.74
	RIO TINTO LIMITED	17,862	76.70	1,370,015.40
	SOUTH32 LTD	223,474	3.46	773,220.04
	CIMIC GROUP LTD	4,062	43.20	175,478.40
	BRAMBLES LIMITED	72,482	9.62	697,276.84
	SEEK LIMITED	16,538	18.68	308,929.84
	AURIZON HOLDINGS LTD	86,884	4.34	377,076.56
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	23,822	23.50	559,817.00
	CROWN RESORTS LTD	16,521	12.47	206,016.87
	DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES LIMITED	2,137	40.53	86,612.61
	FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD	2,650	56.97	150,970.50
	TABCORP HOLDINGS LIMITED	88,199	4.37	385,429.63
	HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	20,543	3.39	69,640.77
	WESFARMERS LIMITED	49,585	41.12	2,038,935.20
	WOOLWORTHS GROUP LTD	55,613	26.64	1,481,530.32
	COCA-COLA AMATIL LIMITED	26,828	8.83	236,891.24
	TREASURY WINE ESTATES LTD	31,984	17.54	560,999.36
	COCHLEAR LIMITED	2,344	177.77	416,692.88
	HEALTHSCOPE LTD	76,014	1.96	148,987.44
	RAMSAY HEALTH CARE LTD	6,175	61.74	381,244.50
SONIC HEALTHCARE LTD	17,837	22.85	407,575.45	
CSL LIMITED	20,122	159.29	3,205,233.38	
AUST AND NZ BANKING GROUP LT	130,470	26.82	3,499,205.40	
BANK OF QUEENSLAND LIMITED	17,851	10.95	195,468.45	
BENDIGO AND ADELAIDE BANK	19,841	10.14	201,187.74	
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	77,456	73.09	5,661,259.04	
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	114,924	28.71	3,299,468.04	

	WESTPAC BANKING CORPORATION	146,383	28.95	4,237,787.85	
	AMP LIMITED	129,763	4.80	622,862.40	
	ASX LTD	9,287	55.92	519,329.04	
	CHALLENGER FINANCIAL SERVICE	23,022	11.32	260,609.04	
	MACQUARIE GROUP LTD	14,151	103.36	1,462,647.36	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP LT	112,664	7.57	852,866.48	
	MEDIBANK PRIVATE LTD	128,724	2.82	363,001.68	
	QBE INSURANCE GROUP LIMITED	58,227	9.70	564,801.90	
	SUNCORP GROUP LTD	59,211	13.53	801,124.83	
	COMPUTERSHARE LIMITED	19,458	17.10	332,731.80	
	REA GROUP LTD	2,727	76.55	208,751.85	
	TELSTRA CORPORATION LIMITED	169,731	3.09	524,468.79	
	TPG TELECOM LTD	17,758	5.41	96,070.78	
	AGL ENERGY LIMITED	29,039	20.92	607,495.88	
	AUSNET SERVICES	85,220	1.61	137,630.30	
	オーストラリアドル 小計	3,100,555		49,708,986.93 (4,145,729,509)	
ニュージーランドドル	FLETCHER BUILDING LTD	33,434	5.84	195,254.56	
	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	46,513	6.39	297,218.07	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	21,979	12.75	280,232.25	
	RYMAN HEALTHCARE LIMITED	19,820	10.89	215,839.80	
	SPARK NEW ZEALAND LIMITED	79,808	3.40	271,347.20	
	MERCURY NZ LTD	34,827	3.39	118,063.53	
	MERIDIAN ENERGY LTD	41,571	2.89	120,140.19	
	ニュージーランドドル 小計	277,952		1,498,095.60 (118,784,000)	
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	119,924	93.15	11,170,920.60	
	NWS HOLDINGS LTD	69,500	14.40	1,000,800.00	
	MTR CORPORATION	67,000	43.30	2,901,100.00	
	MINTH GROUP LTD	32,000	39.00	1,248,000.00	
	LI & FUNG LTD	237,200	3.94	934,568.00	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	56,000	45.00	2,520,000.00	
	YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	27,000	28.40	766,800.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LIMITED	106,000	70.85	7,510,100.00	
	MGM CHINA HOLDINGS LTD	44,000	20.00	880,000.00	
	SANDS CHINA LTD	107,200	43.65	4,679,280.00	
	SHANGRI-LA ASIA LTD.	64,000	15.42	986,880.00	
	SJM HOLDINGS LIMITED	80,000	6.95	556,000.00	
	WYNN MACAU LTD	70,800	28.95	2,049,660.00	
	WH GROUP LIMITED	397,500	8.68	3,450,300.00	
	BANK OF EAST ASIA	52,820	32.30	1,706,086.00	
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	170,000	37.10	6,307,000.00		

	HANG SENG BANK LTD	33,100	188.90	6,252,590.00	
	FIRST PACIFIC COMPANY	86,000	4.15	356,900.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEARING LIMITED	51,700	265.40	13,721,180.00	
	KINGSTON FINANCIAL GROUP LIMITED	162,000	3.19	516,780.00	
	AIA GROUP LTD	529,000	70.60	37,347,400.00	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	113,924	66.65	7,593,034.60	
	HANG LUNG GROUP LTD	42,000	25.70	1,079,400.00	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	98,000	18.62	1,824,760.00	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	56,020	51.85	2,904,637.00	
	HYSAN DEVELOPMENT CO	29,000	43.70	1,267,300.00	
	KERRY PROPERTIES LTD	27,500	36.75	1,010,625.00	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	261,333	11.46	2,994,876.18	
	SINO LAND CO	124,200	13.30	1,651,860.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	64,000	129.50	8,288,000.00	
	SWIRE PACIFIC LTD 'A'	24,500	79.15	1,939,175.00	
	SWIRE PROPERTIES LIMITED	53,000	27.95	1,481,350.00	
	WHARF HOLDINGS LTD	59,000	26.35	1,554,650.00	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	48,000	54.30	2,606,400.00	
	WHEELLOCK&COMPANY LTD	33,000	57.25	1,889,250.00	
	PCCW LIMITED	194,000	4.70	911,800.00	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD	30,000	63.45	1,903,500.00	
	CLP HOLDINGS LTD	70,100	80.55	5,646,555.00	
	HK ELECTRIC INVESTMENTS-SS	111,000	7.53	835,830.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	379,079	16.22	6,148,661.38	
	POWER ASSETS HOLDINGS LIMITED	60,000	59.15	3,549,000.00	
	ASM PACIFIC TECHNOLOGY	12,300	108.20	1,330,860.00	
	香港ドル 小計	4,452,700		165,273,868.76 (2,260,946,524)	
シンガポールドル	KEPPEL CORP LTD	58,600	7.83	458,838.00	
	SEMBCORP INDUSTRIES LTD	43,720	3.11	135,969.20	
	SINGAPORE TECHNOLOGIES ENG	68,300	3.67	250,661.00	
	YANGZIJANG SHIPBUILDING HOLDINGS LTD	90,000	1.21	108,900.00	
	COMFORTDELGRO CORP LTD	107,000	2.11	225,770.00	
	SATS LTD	26,800	5.18	138,824.00	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	25,066	10.78	270,211.48	
	GENTING SINGAPORE PLC	280,700	1.16	325,612.00	
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	56,350	2.55	143,692.50	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	4,700	34.95	164,265.00	
	GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	353,600	0.34	120,224.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	69,900	3.16	220,884.00	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	76,900	28.08	2,159,352.00	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	139,100	12.84	1,786,044.00	

	UNITED OVERSEAS BANK LTD	59,500	27.93	1,661,835.00
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	35,600	7.37	262,372.00
	CAPITALAND LTD	104,500	3.66	382,470.00
	CITY DEVELOPMENTS LTD	16,100	12.57	202,377.00
	UOL GROUP LIMITED	21,700	8.64	187,488.00
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	355,515	3.35	1,190,975.25
	STARHUB LIMITED	42,500	2.29	97,325.00
	シンガポールドル 小計	2,036,151		10,494,089.43 (859,675,806)
イスラエルシ ケル	FRUTAROM INDUSTRIES LTD	1,842	357.70	658,883.40
	ISRAEL CHEMICALS LIMITED	21,574	15.37	331,592.38
	ELBIT SYSTEMS LTD	1,198	430.00	515,140.00
	BANK HAPOALIM BM	44,062	24.35	1,072,909.70
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	65,574	21.30	1,396,726.20
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	5,442	66.27	360,641.34
	AZRIELI GROUP	2,140	171.60	367,224.00
	NICE LTD	2,768	328.80	910,118.40
	BEZEQ ISRAELI TELECOMMUNICATION CORP LTD	100,118	4.46	446,626.39
	イスラエルシケル 小計	244,718		6,059,861.81 (185,128,778)
	合 計	49,871,232		168,541,223,522 (168,541,223,522)

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

通貨	銘柄数	組入株式時価比率	合計金額に対する比率
米ドル	株式 603銘柄	62.0%	65.4%
カナダドル	株式 88銘柄	3.6%	3.8%
ユーロ	株式 241銘柄	13.0%	13.7%
英ポンド	株式 99銘柄	7.0%	7.3%
スイスフラン	株式 37銘柄	3.0%	3.2%
スウェーデンクローナ	株式 31銘柄	1.0%	1.1%
ノルウェークローネ	株式 9銘柄	0.3%	0.3%
デンマーククローネ	株式 17銘柄	0.7%	0.7%
オーストラリアドル	株式 56銘柄	2.3%	2.5%
ニュージーランドドル	株式 7銘柄	0.1%	0.1%
香港ドル	株式 42銘柄	1.3%	1.3%
シンガポールドル	株式 21銘柄	0.5%	0.5%
イスラエルシケル	株式 9銘柄	0.1%	0.1%

(b) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	米ドル	AGNC INVESTMENT CORPORATION	15,080	280,789.60	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITIES, INC.	4,326	522,537.54	
		AMERICAN TOWER CORP	18,886	2,613,444.68	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	46,842	483,409.44	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	6,026	995,495.20	
		BOSTON PROPERTIES INC	7,005	832,404.15	
		BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	12,150	177,633.00	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	4,242	359,848.86	
		COLONY NORTHSTAR INC-CLASS A	24,561	137,050.38	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	8,934	902,244.66	
		DUKE REALTY CORP	16,657	422,921.23	
		EQUITY RESIDENTIAL	16,005	983,507.25	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	2,713	651,825.38	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	5,405	462,073.45	
		FEDERAL REALTY INVESTMENT TRUST	3,224	370,631.04	
		GGP INC	25,302	502,244.70	
		HCP, INC.	22,100	491,504.00	
		HOST HOTELS AND RESORTS INC	32,068	616,667.64	
		HUTCHISON PORT HOLDINGS TRUST	283,000	94,805.00	
		INVITATION HOMES INC	14,734	332,104.36	
		IRON MOUNTAIN INC	12,165	403,391.40	
		KIMCO REALTY CORPORATION	20,926	293,173.26	
		LIBERTY PROPERTY TRUST	6,876	267,545.16	
		MACERICH COMPANY/THE	5,229	301,190.40	
		MID-AMERICA APARTMENT COMMUNITIES	4,759	430,356.37	
		NATIONAL RETAIL PROPERTIES	6,416	243,872.16	
		PROLOGIS INC	23,366	1,440,280.24	
		PUBLIC STORAGE	6,879	1,350,416.49	
		REALTY INCOME CORPORATION	11,714	593,899.80	
		REGENCY CENTERS CORP	6,080	353,795.20	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	13,651	2,046,557.92	
		SL GREEN REALTY CORP	3,945	374,775.00	
		UDR INC	10,651	375,554.26	
VENTAS INC	14,830	717,030.50			
VEREIT INC	44,740	299,310.60			
VORNADO REALTY TRUST	7,603	501,798.00			
WELLTOWER INC	16,264	854,510.56			
WEYERHAEUSER CO	33,634	1,208,133.28			
	米ドル 小計		818,988	24,288,732.16 (2,608,852,721)	

カナダドル	H&R REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	7,257	149,349.06
	RIOCAN REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	7,441	172,184.74
	SMARTCENTRES REAL ESTATE INVESTMENT TRUS	3,585	103,857.45
カナダドル 小計		18,283	425,391.25 (36,302,889)
ユーロ	FONCIERE DES REGIONS	1,550	137,640.00
	GECINA SA	2,152	302,356.00
	ICADE	1,265	100,314.50
	KLEPIERRE	9,305	307,344.15
	UNIBAIL-RODAMCO SE	4,523	852,811.65
ユーロ 小計		18,795	1,700,466.30 (225,141,738)
英ポンド	BRITISH LAND CO PLC	42,136	275,148.08
	HAMMERSON PLC	34,414	178,952.80
	LAND SECURITIES GROUP PLC	32,703	308,912.53
	SEGRO PLC	40,873	248,262.60
英ポンド 小計		150,126	1,011,276.01 (154,705,004)
オーストラリアドル	APA GROUP	48,387	377,418.60
	DEXUS	47,512	437,585.52
	GOODMAN GROUP	84,182	716,388.82
	GPT GROUP	69,713	326,256.84
	LENDLEASE GROUP	25,262	443,853.34
	MIRVAC GROUP	140,993	304,544.88
	SCENTRE GROUP	234,290	909,045.20
	STOCKLAND	103,417	408,497.15
	SYDNEY AIRPORT	49,760	325,928.00
	TRANSURBAN GROUP	93,469	1,046,852.80
	VICINITY CENTRES	146,656	350,507.84
	WESTFIELD CORP	87,803	766,520.19
オーストラリアドル 小計		1,131,444	6,413,399.18 (534,877,491)
香港ドル	HKT TRUST AND HKT LTD	182,000	1,820,000.00
	LINK REIT	92,500	6,317,750.00
香港ドル 小計		274,500	8,137,750.00 (111,324,420)
シンガポールドル	ASCENDAS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	118,300	319,410.00
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	130,000	237,900.00
	CAPITALAND MALL TRUST	102,800	213,824.00
	SUNTEC REIT	112,900	211,123.00



	シンガポールドル 小計	464,000	982,257.00 (80,466,493)
	合計		3,751,670,756 (3,751,670,756)

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

通貨	銘柄数	組入投資証券 時価比率	合計金額に対する比率
米ドル	投資証券 38銘柄	1.5%	69.5%
カナダドル	投資証券 3銘柄	0.0%	1.0%
ユーロ	投資証券 5銘柄	0.1%	6.0%
英ポンド	投資証券 4銘柄	0.1%	4.1%
オーストラリアドル	投資証券 12銘柄	0.3%	14.3%
香港ドル	投資証券 2銘柄	0.1%	3.0%
シンガポールドル	投資証券 4銘柄	0.0%	2.1%

#### デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

#### 外国債券パッシブ・マザーファンド

#### 貸借対照表

（単位：円）

	（平成29年 4月13日現在）	（平成30年 4月13日現在）
資産の部		
流動資産		
預金	591,078,577	279,357,946
金銭信託	-	265,009,262
コール・ローン	701,419,762	80,331,784
国債証券	201,489,716,795	180,700,350,119
派生商品評価勘定	-	53,964
未収入金	-	38,590,000
未収利息	1,593,045,139	1,610,127,707
前払費用	183,784,741	41,085,598
流動資産合計	204,559,045,014	183,014,906,380
資産合計	204,559,045,014	183,014,906,380
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	-	31,012
未払解約金	146,279,306	379,000,804
未払利息	1,133	235
その他未払費用	11,874	38,814
流動負債合計	146,292,313	379,070,865
負債合計	146,292,313	379,070,865
純資産の部		
元本等		
元本	125,951,607,749	105,069,479,839
剰余金		

	(平成29年 4月13日現在)	(平成30年 4月13日現在)
剰余金又は欠損金( )	78,461,144,952	77,566,355,676
元本等合計	204,412,752,701	182,635,835,515
純資産合計	204,412,752,701	182,635,835,515
負債純資産合計	204,559,045,014	183,014,906,380

## 注記表

## (重要な会計方針の注記)

項目	自平成29年 4月14日 至平成30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29年 4月13日現在)	(平成30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	125,951,607,749口	105,069,479,839口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.6229円 (10,000口当たりの純資産額 16,229円)	1口当たり純資産額 1.7382円 (10,000口当たりの純資産額 17,382円)

## (金融商品に関する注記)

## . 金融商品の状況に関する事項

項目	自 平成29年 4月14日 至 平成30年 4月13日
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2.金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>(1)金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、国債証券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。 当計算期間については、為替予約取引を行っております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2)金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>
3.金融商品に係るリスク管理体制	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する委員会をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用グループに是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用グループは、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。その後、当該関連運用グループの対処の実施や対処方針の決定等に関し、必要に応じてリスク管理を行う部署が当該部署の担当役員、当該関連運用グループの担当役員およびリスク管理委員会へ報告を行う体制となっております。</p> <p>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する部会にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。</p>

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

・金融商品の時価等に関する事項

項目	(平成30年 4月13日現在)
1.貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1) 有価証券（国債証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

（デリバティブ取引に関する注記）

（平成29年 4月13日現在）

該当事項はありません。

（平成30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
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	740,408,652	-	740,385,700	22,952
	米ドル	413,167,506	-	413,138,071	29,435
	カナダドル	8,401,693	-	8,403,166	1,473
	ユーロ	263,807,489	-	263,815,738	8,249
	英ポンド	26,696,388	-	26,714,005	17,617
オーストラリアドル	19,494,925	-	19,470,396	24,529	

	南アフリカランド	8,840,651	-	8,844,324	3,673
	合計	740,408,652	-	740,385,700	22,952

## (注) 1. 時価の算定方法

## (1) 為替予約取引の時価の算定方法について

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

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

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

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

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

## 2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

## (関連当事者との取引に関する注記)

自 平成29年 4月14日 至 平成30年 4月13日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。

## (その他の注記)

(平成29年 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	105,056,343,629円
同期中における追加設定元本額	35,711,259,463円
同期中における一部解約元本額	14,815,995,343円
平成29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	8,558,030,650円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	408,028,815円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	1,116,063,124円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	561,304,415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)	41,542,505円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2020(4資産タイプ)	10,088,242円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2025(4資産タイプ)	30,849,302円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2030(4資産タイプ)	71,866,545円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2035(4資産タイプ)	58,275,556円

三井住友・DCターゲットイヤーファンド2040(4資産タイプ)	28,913,333円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2045(4資産タイプ)	70,069,173円
三井住友・DC年金バランスゼロ(債券型)	9,170,938円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	262,700,886円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	517,788,536円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	688,113,764円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2050	1,732,409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>	1,888,364,489円
SMAM・バランスファンドVA安定成長型<適格機関投資家限定>	2,587,955,363円
SMAM・バランスファンドVA25<適格機関投資家専用>	17,122,964,697円
SMAM・バランスファンドVA37.5<適格機関投資家専用>	7,309,378,762円
SMAM・バランスファンドVA50<適格機関投資家専用>	16,474,464,883円
SMAM・バランスファンドVL30<適格機関投資家限定>	44,556,535円
SMAM・バランスファンドVL50<適格機関投資家限定>	130,729,850円
世界6資産バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	5,171,525円
SMAM・バランスファンドVA75<適格機関投資家専用>	1,011,323,171円
SMAM・バランスファンドVL国際分散型<適格機関投資家限定>	152,420,385円
SMAM・インデックス・バランスVA25<適格機関投資家専用>	1,498,884,649円
SMAM・インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用>	1,946,874,902円
SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用>	5,025,358,072円
SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>	8,690,839,456円
SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定>	145,519,059円
SMAM・外国債券パッシブファンドVA<適格機関投資家限定>	13,902,580,709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)	1,224,206,318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)	2,746,130,830円
SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	243,908,916円
SMAM・バランスファンドVA20<適格機関投資家専用>	791,607,832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)	3,043,553,302円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>	184,222,109円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>	51,598,551円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用>	16,758,843円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>	192,439,673円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	668,513,101円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T<適格機関投資家専用>	220,923,296円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A2<適格機関投資家専用>	200,754,871円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A2<適格機関投資家専用>	59,274,719円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A2<適格機関投資家専用>	7,027,104円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L2<適格機関投資家専用>	1,723,836,681円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T2<適格機関投資家専用>	25,670,897円
SMAM・グローバルバランスファンド(標準型)VA<適格機関投資家限定>	5,275,114,213円
SMAM・グローバルバランスファンド(債券重視型)VA<適格機関投資家限定>	2,697,490,904円
SMAM・世界バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	8,378,009,216円
SMAM・世界バランスファンドVA2<適格機関投資家限定>	7,143,473,258円
SMAM・FG新興国重視型バランス20VA<適格機関投資家限定>	177,313円
SMAM・FGグローバルバランス25VA<適格機関投資家限定>	669,495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>	45,591,795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>	402,977円

S M A M ・ マルチアセットストラテジーファンド 2 0 1 6 - 0 4 < 適格機関投資家限定 >	302,296,032円
S M A M ・ マルチアセットストラテジーファンド 2 0 1 6 - 0 5 < 適格機関投資家限定 >	144,824,274円
S M A M ・ マルチアセットストラテジー・オープン < 適格機関投資家限定 >	191,206,529円
合計	125,951,607,749円

(平成30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	125,951,607,749円
同期中における追加設定元本額	5,714,674,001円
同期中における一部解約元本額	26,596,801,911円
平成30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	9,683,114,666円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	496,733,438円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	1,387,380,953円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	715,051,428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)	22,197,297円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2020(4資産タイプ)	9,847,725円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2025(4資産タイプ)	32,425,458円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2030(4資産タイプ)	80,647,575円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2035(4資産タイプ)	74,257,225円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2040(4資産タイプ)	37,838,418円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2045(4資産タイプ)	98,716,884円
三井住友・DC年金バランスゼロ(債券型)	12,375,668円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	76,402,108円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	232,152,798円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	376,245,574円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2050	2,123,153円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	872,720円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	2,400,130円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	11,398,762円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	8,265,261円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	9,448,668円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	6,751,925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>	1,814,572,362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>	732,328,307円
S M A M ・ バランスファンドVA25<適格機関投資家専用>	14,280,488,490円
S M A M ・ バランスファンドVA37.5<適格機関投資家専用>	6,545,080,511円
S M A M ・ バランスファンドVA50<適格機関投資家専用>	14,627,123,390円
S M A M ・ バランスファンドVL30<適格機関投資家限定>	43,495,798円
S M A M ・ バランスファンドVL50<適格機関投資家限定>	117,273,174円
世界6資産バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	953,417円
S M A M ・ バランスファンドVA75<適格機関投資家専用>	909,532,934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>	134,073,743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 >	1,413,798,037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 >	1,712,577,611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 >	2,719,742,501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 >	7,696,849,134円
S M A M ・ バランス V A 株 4 0 T < 適格機関投資家限定 >	90,449,750円
S M A M ・ 外国債券バッシブファンド V A < 適格機関投資家限定 >	12,533,173,156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 )	1,111,219,982円
三井住友 ・ 5 資産バランスファンド ・ V A S ( 適格機関投資家専用 )	2,276,903,513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 >	221,148,580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 >	702,294,439円
三井住友 ・ 7 資産バランスファンド ・ V A S ( 適格機関投資家専用 )	2,660,961,718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 >	170,058,697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 >	45,728,304円
S M A M ・ アセットバランスファンド V A 5 0 A < 適格機関投資家専用 >	14,667,943円
S M A M ・ アセットバランスファンド V A 2 0 L < 適格機関投資家専用 >	171,087,626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 >	629,568,293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 >	191,711,885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 >	185,753,722円
S M A M ・ アセットバランスファンド V A 3 5 A 2 < 適格機関投資家専用 >	55,155,762円
S M A M ・ アセットバランスファンド V A 5 0 A 2 < 適格機関投資家専用 >	7,151,827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 >	1,573,385,690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 >	24,063,953円
S M A M ・ グローバルバランスファンド ( 標準型 ) V A < 適格機関投資家限定 >	4,486,876,371円
S M A M ・ グローバルバランスファンド ( 債券重視型 ) V A < 適格機関投資家限定 >	2,081,595,073円
S M A M ・ 世界バランスファンド V A < 適格機関投資家限定 >	7,274,876,655円
S M A M ・ 世界バランスファンド V A 2 < 適格機関投資家限定 >	1,757,740,314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 >	29,486,396円
S M A M ・ マルチアセットストラテジーファンド 2 0 1 6 - 0 4 < 適格機関投資家限定 >	265,457,486円
S M A M ・ マルチアセットストラテジーファンド 2 0 1 6 - 0 5 < 適格機関投資家限定 >	127,190,307円
S M A M ・ マルチアセットストラテジー ・ オープン < 適格機関投資家限定 >	257,215,943円
S M A M ・ マルチアセット ・ ダイナミックアロケーション ・ ストラテジー ・ ファンド < 適格機関投資家限定 >	19,211円
合計	105,069,479,839円

## 附属明細表

### 有価証券明細表

#### (a) 株式

該当事項はありません。

#### (b) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
----	----	----	------	-----	----



国債証券	米ドル			
		US TREASURY N/B 0.75	2,000,000.00	1,962,968.76
		US TREASURY N/B 0.75	3,000,000.00	2,940,468.75
		US TREASURY N/B 0.875	4,000,000.00	3,948,437.52
		US TREASURY N/B 0.875	3,000,000.00	2,957,578.14
		US TREASURY N/B 0.875	3,000,000.00	2,953,593.75
		US TREASURY N/B 0.875	2,000,000.00	1,965,156.26
		US TREASURY N/B 0.875	3,000,000.00	2,940,234.39
		US TREASURY N/B 1	4,000,000.00	3,957,500.00
		US TREASURY N/B 1	3,000,000.00	2,956,406.25
		US TREASURY N/B 1	2,300,000.00	2,260,289.07
		US TREASURY N/B 1	2,000,000.00	1,962,500.00
		US TREASURY N/B 1	2,000,000.00	1,961,250.00
		US TREASURY N/B 1	2,000,000.00	1,958,750.00
		US TREASURY N/B 1	3,000,000.00	2,937,187.50
		US TREASURY N/B 1.125	2,000,000.00	1,976,250.00
		US TREASURY N/B 1.125	3,000,000.00	2,939,296.89
		US TREASURY N/B 1.125	2,800,000.00	2,733,281.26
		US TREASURY N/B 1.125	3,000,000.00	2,923,828.14
		US TREASURY N/B 1.125	3,800,000.00	3,655,421.89
		US TREASURY N/B 1.125	3,000,000.00	2,869,453.14
		US TREASURY N/B 1.125	3,000,000.00	2,865,234.39
		US TREASURY N/B 1.125	4,000,000.00	3,814,375.00
		US TREASURY N/B 1.125	3,500,000.00	3,332,929.70
		US TREASURY N/B 1.25	3,000,000.00	2,973,750.00
		US TREASURY N/B 1.25	2,000,000.00	1,980,625.00
		US TREASURY N/B 1.25	2,000,000.00	1,978,750.00
		US TREASURY N/B 1.25	2,000,000.00	1,968,125.00
		US TREASURY N/B 1.25	3,000,000.00	2,942,109.39
		US TREASURY N/B 1.25	3,000,000.00	2,938,359.39
		US TREASURY N/B 1.25	3,600,000.00	3,471,187.50
		US TREASURY N/B 1.25	3,500,000.00	3,344,414.08
		US TREASURY N/B 1.25	3,000,000.00	2,786,015.64
		US TREASURY N/B 1.375	2,000,000.00	1,986,562.50
		US TREASURY N/B 1.375	3,000,000.00	2,952,890.64
		US TREASURY N/B 1.375	3,000,000.00	2,950,312.50
		US TREASURY N/B 1.375	4,000,000.00	3,932,187.52
		US TREASURY N/B 1.375	3,000,000.00	2,946,796.89
		US TREASURY N/B 1.375	5,000,000.00	4,908,593.75
		US TREASURY N/B 1.375	4,000,000.00	3,922,500.00
		US TREASURY N/B 1.375	4,000,000.00	3,918,437.52
		US TREASURY N/B 1.375	3,000,000.00	2,935,312.50
		US TREASURY N/B 1.375	4,000,000.00	3,900,625.00

US TREASURY N/B 1.375	1,900,000.00	1,852,500.00
US TREASURY N/B 1.375	3,000,000.00	2,922,421.89
US TREASURY N/B 1.375	3,700,000.00	3,600,273.45
US TREASURY N/B 1.375	3,000,000.00	2,909,765.64
US TREASURY N/B 1.375	4,000,000.00	3,867,187.52
US TREASURY N/B 1.375	4,000,000.00	3,861,562.52
US TREASURY N/B 1.375	3,000,000.00	2,807,812.50
US TREASURY N/B 1.375	2,500,000.00	2,333,984.37
US TREASURY N/B 1.375	3,000,000.00	2,797,031.25
US TREASURY N/B 1.5	1,400,000.00	1,391,687.50
US TREASURY N/B 1.5	3,000,000.00	2,976,796.89
US TREASURY N/B 1.5	3,000,000.00	2,962,500.00
US TREASURY N/B 1.5	5,000,000.00	4,934,375.00
US TREASURY N/B 1.5	3,000,000.00	2,942,812.50
US TREASURY N/B 1.5	1,000,000.00	980,703.13
US TREASURY N/B 1.5	2,000,000.00	1,959,218.76
US TREASURY N/B 1.5	3,000,000.00	2,881,171.89
US TREASURY N/B 1.5	3,000,000.00	2,838,984.39
US TREASURY N/B 1.5	3,000,000.00	2,835,937.50
US TREASURY N/B 1.5	5,800,000.00	5,230,421.90
US TREASURY N/B 1.625	5,000,000.00	4,973,437.50
US TREASURY N/B 1.625	4,000,000.00	3,976,250.00
US TREASURY N/B 1.625	3,000,000.00	2,978,203.14
US TREASURY N/B 1.625	2,000,000.00	1,983,750.00
US TREASURY N/B 1.625	3,000,000.00	2,973,515.64
US TREASURY N/B 1.625	4,000,000.00	3,952,187.52
US TREASURY N/B 1.625	2,000,000.00	1,971,875.00
US TREASURY N/B 1.625	3,500,000.00	3,439,843.75
US TREASURY N/B 1.625	3,000,000.00	2,945,625.00
US TREASURY N/B 1.625	3,500,000.00	3,424,257.82
US TREASURY N/B 1.625	3,000,000.00	2,876,484.39
US TREASURY N/B 1.625	4,000,000.00	3,832,500.00
US TREASURY N/B 1.625	3,500,000.00	3,344,687.50
US TREASURY N/B 1.625	3,000,000.00	2,850,000.00
US TREASURY N/B 1.625	3,000,000.00	2,846,953.14
US TREASURY N/B 1.625	3,000,000.00	2,832,890.64
US TREASURY N/B 1.625	6,000,000.00	5,499,375.00
US TREASURY N/B 1.625	6,300,000.00	5,757,609.37
US TREASURY N/B 1.75	4,000,000.00	3,968,125.00
US TREASURY N/B 1.75	2,300,000.00	2,259,570.32
US TREASURY N/B 1.75	2,000,000.00	1,961,718.76
US TREASURY N/B 1.75	3,000,000.00	2,913,984.39
US TREASURY N/B 1.75	3,000,000.00	2,908,359.39

US TREASURY N/B 1.75	3,500,000.00	3,388,164.08	
US TREASURY N/B 1.75	3,000,000.00	2,900,390.64	
US TREASURY N/B 1.75	3,000,000.00	2,899,921.89	
US TREASURY N/B 1.75	3,000,000.00	2,897,578.14	
US TREASURY N/B 1.75	3,000,000.00	2,895,468.75	
US TREASURY N/B 1.75	3,000,000.00	2,886,562.50	
US TREASURY N/B 1.75	3,000,000.00	2,876,015.64	
US TREASURY N/B 1.75	5,700,000.00	5,445,726.59	
US TREASURY N/B 1.875	3,000,000.00	2,965,078.14	
US TREASURY N/B 1.875	3,000,000.00	2,928,750.00	
US TREASURY N/B 1.875	4,000,000.00	3,895,000.00	
US TREASURY N/B 1.875	4,000,000.00	3,892,187.52	
US TREASURY N/B 1.875	2,000,000.00	1,944,687.50	
US TREASURY N/B 1.875	3,000,000.00	2,913,984.39	
US TREASURY N/B 1.875	3,000,000.00	2,913,750.00	
US TREASURY N/B 1.875	700,000.00	678,289.06	
US TREASURY N/B 1.875	4,000,000.00	3,873,750.00	
US TREASURY N/B 1.875	3,000,000.00	2,900,859.39	
US TREASURY N/B 1.875	1,800,000.00	1,707,609.38	
US TREASURY N/B 2	3,000,000.00	2,970,703.14	
US TREASURY N/B 2	2,300,000.00	2,274,843.75	
US TREASURY N/B 2	1,600,000.00	1,581,125.00	
US TREASURY N/B 2	3,000,000.00	2,961,562.50	
US TREASURY N/B 2	3,000,000.00	2,958,750.00	
US TREASURY N/B 2	3,000,000.00	2,953,125.00	
US TREASURY N/B 2	3,000,000.00	2,945,859.39	
US TREASURY N/B 2	3,000,000.00	2,941,640.64	
US TREASURY N/B 2	4,300,000.00	4,216,687.50	
US TREASURY N/B 2	3,500,000.00	3,426,992.20	
US TREASURY N/B 2	3,100,000.00	3,033,640.62	
US TREASURY N/B 2	3,000,000.00	2,923,828.14	
US TREASURY N/B 2	500,000.00	485,976.56	
US TREASURY N/B 2	3,000,000.00	2,914,453.14	
US TREASURY N/B 2	5,500,000.00	5,331,992.21	
US TREASURY N/B 2	2,000,000.00	1,916,718.76	
US TREASURY N/B 2	5,000,000.00	4,788,281.25	
US TREASURY N/B 2	2,500,000.00	2,392,187.50	
US TREASURY N/B 2	5,600,000.00	5,326,125.00	
US TREASURY N/B 2	4,300,000.00	4,072,234.37	
US TREASURY N/B 2	6,200,000.00	5,807,656.25	
US TREASURY N/B 2.125	3,000,000.00	2,977,031.25	
US TREASURY N/B 2.125	2,700,000.00	2,673,421.87	

US TREASURY N/B 2.125	1,700,000.00	1,678,351.57
US TREASURY N/B 2.125	4,000,000.00	3,945,000.00
US TREASURY N/B 2.125	3,000,000.00	2,955,937.50
US TREASURY N/B 2.125	3,000,000.00	2,951,250.00
US TREASURY N/B 2.125	3,000,000.00	2,940,703.14
US TREASURY N/B 2.125	4,000,000.00	3,904,062.52
US TREASURY N/B 2.125	4,000,000.00	3,875,937.52
US TREASURY N/B 2.125	2,000,000.00	1,933,750.00
US TREASURY N/B 2.125	4,000,000.00	3,864,375.00
US TREASURY N/B 2.125	3,500,000.00	3,372,304.70
US TREASURY N/B 2.125	5,900,000.00	5,676,906.25
US TREASURY N/B 2.125	1,800,000.00	1,729,687.50
US TREASURY N/B 2.125	6,000,000.00	5,742,656.28
US TREASURY N/B 2.25	4,000,000.00	3,974,062.52
US TREASURY N/B 2.25	3,000,000.00	2,978,203.14
US TREASURY N/B 2.25	2,000,000.00	1,984,687.50
US TREASURY N/B 2.25	2,800,000.00	2,773,312.50
US TREASURY N/B 2.25	3,000,000.00	2,925,234.39
US TREASURY N/B 2.25	2,000,000.00	1,948,281.26
US TREASURY N/B 2.25	1,500,000.00	1,453,476.57
US TREASURY N/B 2.25	6,300,000.00	6,101,156.25
US TREASURY N/B 2.25	3,100,000.00	3,000,460.95
US TREASURY N/B 2.25	6,500,000.00	6,252,187.50
US TREASURY N/B 2.25	7,000,000.00	6,680,078.16
US TREASURY N/B 2.25	6,600,000.00	6,281,859.40
US TREASURY N/B 2.25	6,200,000.00	5,893,875.00
US TREASURY N/B 2.25	4,200,000.00	3,569,015.64
US TREASURY N/B 2.375	2,000,000.00	1,994,375.00
US TREASURY N/B 2.375	3,000,000.00	2,989,687.50
US TREASURY N/B 2.375	8,000,000.00	7,820,000.00
US TREASURY N/B 2.375	6,000,000.00	5,779,218.78
US TREASURY N/B 2.5	5,000,000.00	4,950,781.25
US TREASURY N/B 2.5	5,700,000.00	5,622,070.34
US TREASURY N/B 2.5	4,600,000.00	4,521,296.89
US TREASURY N/B 2.5	5,100,000.00	4,597,570.33
US TREASURY N/B 2.5	4,900,000.00	4,402,343.75
US TREASURY N/B 2.5	4,900,000.00	4,399,664.08
US TREASURY N/B 2.625	4,000,000.00	4,016,250.00
US TREASURY N/B 2.625	5,500,000.00	5,520,625.00
US TREASURY N/B 2.625	4,000,000.00	3,992,187.52
US TREASURY N/B 2.75	6,200,000.00	6,212,109.40
US TREASURY N/B 2.75	5,100,000.00	5,103,984.37
US TREASURY N/B 2.75	4,700,000.00	4,666,585.95

US TREASURY N/B 2.75	2,000,000.00	1,909,687.50	
US TREASURY N/B 2.75	5,000,000.00	4,769,531.25	
US TREASURY N/B 2.75	2,400,000.00	2,263,500.00	
US TREASURY N/B 2.75	1,500,000.00	1,414,570.32	
US TREASURY N/B 2.875	3,000,000.00	2,923,593.75	
US TREASURY N/B 2.875	4,000,000.00	3,880,312.52	
US TREASURY N/B 2.875	3,600,000.00	3,485,250.00	
US TREASURY N/B 3	1,800,000.00	1,798,312.50	
US TREASURY N/B 3	4,000,000.00	3,977,500.00	
US TREASURY N/B 3	4,000,000.00	3,974,687.52	
US TREASURY N/B 3	4,900,000.00	4,868,226.58	
US TREASURY N/B 3	2,500,000.00	2,480,859.37	
US TREASURY N/B 3	2,200,000.00	2,182,125.00	
US TREASURY N/B 3	2,200,000.00	2,182,640.63	
US TREASURY N/B 3.125	2,000,000.00	2,020,000.00	
US TREASURY N/B 3.125	3,000,000.00	3,053,906.25	
US TREASURY N/B 3.125	2,000,000.00	2,042,656.26	
US TREASURY N/B 3.125	2,000,000.00	2,042,500.00	
US TREASURY N/B 3.125	1,400,000.00	1,426,140.63	
US TREASURY N/B 3.125	5,400,000.00	5,493,656.25	
US TREASURY N/B 3.375	5,000,000.00	5,082,812.50	
US TREASURY N/B 3.375	4,000,000.00	4,250,000.00	
US TREASURY N/B 3.5	4,500,000.00	4,599,843.75	
US TREASURY N/B 3.5	1,500,000.00	1,631,132.82	
US TREASURY N/B 3.625	5,000,000.00	5,088,671.90	
US TREASURY N/B 3.625	6,000,000.00	6,136,406.28	
US TREASURY N/B 3.625	5,000,000.00	5,155,078.15	
US TREASURY N/B 3.625	5,300,000.00	5,867,265.62	
US TREASURY N/B 3.625	5,000,000.00	5,535,937.50	
US TREASURY N/B 3.75	1,500,000.00	1,691,718.75	
US TREASURY N/B 3.75	4,000,000.00	4,517,500.00	
US TREASURY N/B 3.875	1,500,000.00	1,719,257.82	
US TREASURY N/B 4.25	1,000,000.00	1,204,687.50	
US TREASURY N/B 4.25	2,000,000.00	2,415,937.50	
US TREASURY N/B 4.375	500,000.00	609,140.62	
US TREASURY N/B 4.375	1,500,000.00	1,839,023.44	
US TREASURY N/B 4.375	1,400,000.00	1,717,515.63	
US TREASURY N/B 4.375	1,800,000.00	2,216,390.63	
US TREASURY N/B 4.5	1,200,000.00	1,469,250.00	
US TREASURY N/B 4.5	1,000,000.00	1,239,296.88	
US TREASURY N/B 4.5	1,000,000.00	1,244,921.88	
US TREASURY N/B 4.625	2,100,000.00	2,659,781.25	

	US TREASURY N/B 4.75	1,500,000.00	1,938,046.87
	US TREASURY N/B 5	500,000.00	653,007.81
	US TREASURY N/B 5.25	500,000.00	609,609.37
	US TREASURY N/B 5.375	1,320,000.00	1,676,296.88
	US TREASURY N/B 5.5	500,000.00	618,945.31
	US TREASURY N/B 6	1,000,000.00	1,226,484.38
	US TREASURY N/B 6.125	1,000,000.00	1,276,484.38
	US TREASURY N/B 6.25	800,000.00	942,250.00
	US TREASURY N/B 6.25	500,000.00	673,046.87
	US TREASURY N/B 6.5	500,000.00	641,132.81
	US TREASURY N/B 8	1,300,000.00	1,541,312.50
	US TREASURY N/B 8.75	1,000,000.00	1,143,593.75
	米ドル 小計	715,620,000.00	705,543,907.74 (75,782,471,130)
カナダドル	CANADA-GOV'T 0.5	600,000.00	596,682.00
	CANADA-GOV'T 0.5	2,000,000.00	1,982,020.00
	CANADA-GOV'T 0.5	2,000,000.00	1,882,180.00
	CANADA-GOV'T 0.75	2,000,000.00	1,980,400.00
	CANADA-GOV'T 0.75	1,300,000.00	1,264,380.00
	CANADA-GOV'T 0.75	2,000,000.00	1,931,500.00
	CANADA-GOV'T 0.75	2,000,000.00	1,917,600.00
	CANADA-GOV'T 1	1,000,000.00	895,700.00
	CANADA-GOV'T 1.25	1,500,000.00	1,484,025.00
	CANADA-GOV'T 1.5	2,000,000.00	1,985,900.00
	CANADA-GOV'T 1.5	2,000,000.00	1,936,960.00
	CANADA-GOV'T 1.5	1,600,000.00	1,513,280.00
	CANADA-GOV'T 1.75	1,000,000.00	1,000,730.00
	CANADA-GOV'T 1.75	1,000,000.00	999,030.00
	CANADA-GOV'T 1.75	900,000.00	884,250.00
	CANADA-GOV'T 2	400,000.00	389,608.00
	CANADA-GOV'T 2.25	1,100,000.00	1,101,155.00
	CANADA-GOV'T 2.5	2,500,000.00	2,543,075.00
	CANADA-GOV'T 2.75	1,000,000.00	1,028,000.00
	CANADA-GOV'T 2.75	1,800,000.00	1,944,900.00
	CANADA-GOV'T 2.75	500,000.00	556,415.00
	CANADA-GOV'T 3.25	1,000,000.00	1,036,540.00
	CANADA-GOV'T 3.5	2,000,000.00	2,064,360.00
	CANADA-GOV'T 3.5	1,500,000.00	1,835,820.00
	CANADA-GOV'T 3.75	2,500,000.00	2,556,500.00
	CANADA-GOV'T 4	1,500,000.00	1,926,075.00
	CANADA-GOV'T 5	1,300,000.00	1,823,965.00
	CANADA-GOV'T 5.75	800,000.00	1,068,280.00
	CANADA-GOV'T 5.75	1,200,000.00	1,718,568.00

	CANADA-GOV'T 8	500,000.00	735,110.00	
	カナダドル 小計	42,500,000.00	44,583,008.00	(3,804,713,902)
メキシコペソ	MEXICAN BONOS 10	40,000,000.00	45,987,600.00	
	MEXICAN BONOS 5.75	20,000,000.00	18,206,600.00	
	MEXICAN BONOS 6.5	35,000,000.00	34,168,400.00	
	MEXICAN BONOS 8	50,000,000.00	50,835,000.00	
	MEXICAN BONOS 8	20,000,000.00	20,773,600.00	
	MEXICAN BONOS 8.5	37,000,000.00	40,125,390.00	
	MEXICAN BONOS 8.5	40,000,000.00	43,983,200.00	
	メキシコペソ 小計	242,000,000.00	254,079,790.00	(1,501,611,558)
ユーロ	BELGIAN 0326 4	1,000,000.00	1,389,260.00	
	BELGIAN 0.8	1,300,000.00	1,337,115.00	
	BELGIAN 0.8	700,000.00	707,973.00	
	BELGIAN 0291 5.5	2,000,000.00	2,929,860.00	
	BELGIAN 0304 5	2,000,000.00	3,181,180.00	
	BELGIAN 0308 4	1,500,000.00	1,751,130.00	
	BELGIAN 0318 3.75	2,000,000.00	2,207,300.00	
	BELGIAN 0320 4.25	1,700,000.00	2,652,986.00	
	BELGIAN 0321 4.25	1,700,000.00	1,968,073.00	
	BELGIAN 0324 4.5	1,000,000.00	1,317,880.00	
	BELGIAN 0325 4.25	2,000,000.00	2,390,800.00	
	BELGIAN 0327 3	1,000,000.00	1,051,750.00	
	BELGIAN 0328 2.25	1,500,000.00	1,672,320.00	
	BELGIAN 0332 2.6	2,000,000.00	2,291,380.00	
	BELGIAN 0333 3	500,000.00	633,305.00	
	BELGIAN 0338 0.5	1,000,000.00	1,012,680.00	
	BELGIAN 0338 2.25	500,000.00	569,270.00	
	BELGIAN 1	1,400,000.00	1,452,794.00	
	BELGIAN 1	1,500,000.00	1,496,325.00	
	BELGIAN 1.25	400,000.00	404,568.00	
	BELGIAN 1.6	500,000.00	501,875.00	
	BELGIAN 1.9	700,000.00	765,891.00	
	BELGIAN 2.15	500,000.00	548,895.00	
	BELGIAN 3.75	1,000,000.00	1,496,740.00	
	BTPS 0.05	1,000,000.00	1,005,330.00	
	BTPS 0.1	500,000.00	502,385.00	
	BTPS 0.2	2,000,000.00	2,012,460.00	
	BTPS 0.35	500,000.00	505,370.00	
	BTPS 0.35	1,500,000.00	1,508,310.00	
	BTPS 0.45	2,000,000.00	2,022,640.00	

BTPS 0.65	1,600,000.00	1,628,944.00
BTPS 0.65	2,000,000.00	1,980,120.00
BTPS 0.7	2,000,000.00	2,035,800.00
BTPS 0.9	800,000.00	813,888.00
BTPS 0.95	2,000,000.00	2,026,080.00
BTPS 1.05	2,000,000.00	2,043,620.00
BTPS 1.2	1,000,000.00	1,031,910.00
BTPS 1.25	2,000,000.00	1,949,340.00
BTPS 1.35	2,000,000.00	2,074,640.00
BTPS 1.45	2,000,000.00	2,080,000.00
BTPS 1.5	2,000,000.00	2,048,300.00
BTPS 1.5	2,000,000.00	2,026,320.00
BTPS 1.6	2,000,000.00	2,013,300.00
BTPS 1.65	2,000,000.00	1,879,700.00
BTPS 1.85	1,000,000.00	1,048,490.00
BTPS 2	2,000,000.00	2,084,360.00
BTPS 2	2,000,000.00	2,035,660.00
BTPS 2.05	1,000,000.00	1,028,170.00
BTPS 2.15	2,000,000.00	2,136,940.00
BTPS 2.2	1,000,000.00	1,043,580.00
BTPS 2.25	1,200,000.00	1,166,388.00
BTPS 2.45	1,000,000.00	1,019,080.00
BTPS 2.5	2,600,000.00	2,678,208.00
BTPS 2.5	600,000.00	650,616.00
BTPS 2.7	1,900,000.00	1,868,308.00
BTPS 2.8	1,000,000.00	940,450.00
BTPS 2.95	1,000,000.00	1,056,350.00
BTPS 3.25	1,500,000.00	1,638,285.00
BTPS 3.45	800,000.00	891,656.00
BTPS 3.5	2,300,000.00	2,646,955.00
BTPS 3.75	2,500,000.00	2,768,025.00
BTPS 3.75	2,000,000.00	2,222,480.00
BTPS 3.75	3,200,000.00	3,577,632.00
BTPS 3.75	2,000,000.00	2,325,580.00
BTPS 4	2,500,000.00	2,744,025.00
BTPS 4	3,000,000.00	3,693,990.00
BTPS 4.25	3,500,000.00	3,722,285.00
BTPS 4.25	2,300,000.00	2,494,028.00
BTPS 4.5	2,700,000.00	2,931,633.00
BTPS 4.5	2,300,000.00	2,731,480.00
BTPS 4.5	3,000,000.00	3,603,360.00
BTPS 4.5	1,700,000.00	2,087,430.00
BTPS 4.75	2,600,000.00	2,999,594.00



BTPS 4.75	2,500,000.00	3,017,000.00	
BTPS 4.75	2,100,000.00	2,669,562.00	
BTPS 4.75	1,600,000.00	2,179,360.00	
BTPS 5	2,000,000.00	2,358,620.00	
BTPS 5	1,000,000.00	1,248,640.00	
BTPS 5	2,670,000.00	3,626,394.00	
BTPS 5	2,000,000.00	2,769,860.00	
BTPS 5	1,900,000.00	2,626,294.00	
BTPS 5.25	2,700,000.00	3,613,653.00	
BTPS 5.5	2,000,000.00	2,433,460.00	
BTPS 5.5	2,000,000.00	2,442,580.00	
BTPS 5.75	2,200,000.00	3,154,998.00	
BTPS 6	3,100,000.00	4,464,155.00	
BTPS 6.5	3,360,000.00	4,776,710.40	
BTPS 7.25	1,000,000.00	1,456,690.00	
BTPS 9	1,000,000.00	1,440,530.00	
BUNDESUBL-170 0.25	1,000,000.00	1,013,160.00	
BUNDESUBL-171 0	2,000,000.00	2,023,200.00	
BUNDESUBL-172 0.25	2,000,000.00	2,039,000.00	
BUNDESUBL-173 0	2,500,000.00	2,533,400.00	
BUNDESUBL-174 0	3,000,000.00	3,037,320.00	
DEUTSCHLAND REP 0	3,000,000.00	2,917,950.00	
DEUTSCHLAND REP 0.25	3,000,000.00	2,963,970.00	
DEUTSCHLAND REP 0.5	500,000.00	511,875.00	
DEUTSCHLAND REP 0.5	2,800,000.00	2,849,924.00	
DEUTSCHLAND REP 0.5	1,000,000.00	1,004,410.00	
DEUTSCHLAND REP 0.5	2,000,000.00	1,997,480.00	
DEUTSCHLAND REP 1	2,000,000.00	2,114,740.00	
DEUTSCHLAND REP 1	2,200,000.00	2,327,094.00	
DEUTSCHLAND REP 1.5	2,500,000.00	2,689,150.00	
DEUTSCHLAND REP 1.5	2,500,000.00	2,699,375.00	
DEUTSCHLAND REP 1.5	2,000,000.00	2,162,820.00	
DEUTSCHLAND REP 1.5	2,000,000.00	2,174,760.00	
DEUTSCHLAND REP 1.75	2,500,000.00	2,712,300.00	
DEUTSCHLAND REP 1.75	2,000,000.00	2,200,920.00	
DEUTSCHLAND REP 2	2,000,000.00	2,173,360.00	
DEUTSCHLAND REP 2	1,500,000.00	1,664,100.00	
DEUTSCHLAND REP 2.25	1,500,000.00	1,600,350.00	
DEUTSCHLAND REP 2.25	2,000,000.00	2,178,580.00	
DEUTSCHLAND REP 2.5	1,500,000.00	1,623,045.00	
DEUTSCHLAND REP 2.5	2,200,000.00	2,885,586.00	
DEUTSCHLAND REP 2.5	2,300,000.00	3,050,375.00	

DEUTSCHLAND REP 3	3,000,000.00	3,237,930.00
DEUTSCHLAND REP 3.25	3,000,000.00	3,201,660.00
DEUTSCHLAND REP 3.25	2,000,000.00	2,236,860.00
DEUTSCHLAND REP 3.25	1,500,000.00	2,196,675.00
DEUTSCHLAND REP 3.5	3,000,000.00	3,152,850.00
DEUTSCHLAND REP 4	2,700,000.00	4,120,281.00
DEUTSCHLAND REP 4.25	1,500,000.00	2,434,050.00
DEUTSCHLAND REP 4.75	800,000.00	1,138,216.00
DEUTSCHLAND REP 4.75	2,100,000.00	3,342,738.00
DEUTSCHLAND REP 4.75	1,700,000.00	2,964,528.00
DEUTSCHLAND REP 5.5	1,800,000.00	2,861,928.00
DEUTSCHLAND REP 5.625	1,580,000.00	2,356,096.00
DEUTSCHLAND REP 6.25	1,200,000.00	1,628,340.00
DEUTSCHLAND REP 6.25	1,000,000.00	1,641,610.00
DEUTSCHLAND REP 6.5	1,000,000.00	1,553,310.00
FINNISH GOV'T 0.75	500,000.00	490,015.00
FINNISH GOV'T 1.125	200,000.00	201,572.00
FINNISH GOV'T 1.5	1,000,000.00	1,073,610.00
FINNISH GOV'T 1.625	1,000,000.00	1,076,140.00
FINNISH GOV'T 2	1,000,000.00	1,108,560.00
FINNISH GOV'T 2.625	500,000.00	655,545.00
FINNISH GOV'T 2.75	600,000.00	723,306.00
FINNISH GOV'T 3.375	700,000.00	754,516.00
FINNISH GOV'T 3.5	1,000,000.00	1,115,000.00
FINNISH GOV'T 4	1,000,000.00	1,260,540.00
FINNISH GOV'T 4.375	1,000,000.00	1,060,880.00
FRANCE O.A.T. 0	3,000,000.00	3,029,700.00
FRANCE O.A.T. 0	2,000,000.00	2,019,580.00
FRANCE O.A.T. 0	1,000,000.00	1,005,440.00
FRANCE O.A.T. 0.25	2,300,000.00	2,339,008.00
FRANCE O.A.T. 0.25	3,000,000.00	2,926,020.00
FRANCE O.A.T. 0.5	3,000,000.00	3,051,540.00
FRANCE O.A.T. 0.5	2,500,000.00	2,528,800.00
FRANCE O.A.T. 0.5	3,000,000.00	3,007,560.00
FRANCE O.A.T. 1	2,000,000.00	2,034,980.00
FRANCE O.A.T. 1	2,000,000.00	2,090,020.00
FRANCE O.A.T. 1	2,000,000.00	2,067,440.00
FRANCE O.A.T. 1.25	2,000,000.00	1,998,660.00
FRANCE O.A.T. 1.5	4,400,000.00	4,676,584.00
FRANCE O.A.T. 1.75	4,000,000.00	4,351,600.00
FRANCE O.A.T. 1.75	5,400,000.00	5,927,688.00
FRANCE O.A.T. 1.75	1,400,000.00	1,500,254.00
FRANCE O.A.T. 1.75	1,000,000.00	998,600.00

FRANCE O.A.T. 2	1,000,000.00	1,094,810.00	
FRANCE O.A.T. 2.25	3,200,000.00	3,538,496.00	
FRANCE O.A.T. 2.25	5,100,000.00	5,741,121.00	
FRANCE O.A.T. 2.5	3,500,000.00	3,760,190.00	
FRANCE O.A.T. 2.5	3,200,000.00	3,787,072.00	
FRANCE O.A.T. 2.75	4,500,000.00	5,379,210.00	
FRANCE O.A.T. 3	5,000,000.00	5,640,800.00	
FRANCE O.A.T. 3.25	4,100,000.00	4,607,990.00	
FRANCE O.A.T. 3.25	2,700,000.00	3,740,580.00	
FRANCE O.A.T. 3.5	4,000,000.00	4,325,360.00	
FRANCE O.A.T. 3.5	4,000,000.00	4,976,360.00	
FRANCE O.A.T. 3.75	5,000,000.00	5,331,200.00	
FRANCE O.A.T. 3.75	3,900,000.00	4,385,979.00	
FRANCE O.A.T. 4	2,300,000.00	3,426,310.00	
FRANCE O.A.T. 4	1,370,000.00	2,252,663.60	
FRANCE O.A.T. 4	1,500,000.00	2,533,920.00	
FRANCE O.A.T. 4.25	1,900,000.00	1,994,354.00	
FRANCE O.A.T. 4.25	4,500,000.00	5,539,320.00	
FRANCE O.A.T. 4.5	3,500,000.00	5,664,715.00	
FRANCE O.A.T. 4.75	2,900,000.00	4,526,900.00	
FRANCE O.A.T. 5.5	3,000,000.00	4,498,800.00	
FRANCE O.A.T. 5.75	3,100,000.00	5,090,386.00	
FRANCE O.A.T. 6	3,000,000.00	4,266,930.00	
FRANCE O.A.T. 8.5	850,000.00	969,170.00	
FRANCE O.A.T. 8.5	600,000.00	856,830.00	
IRISH GOVT 0	400,000.00	399,304.00	
IRISH GOVT 0.8	700,000.00	725,242.00	
IRISH GOVT 1	1,000,000.00	1,029,060.00	
IRISH GOVT 1.7	300,000.00	311,142.00	
IRISH GOVT 2	1,000,000.00	1,072,560.00	
IRISH GOVT 2.4	1,000,000.00	1,149,900.00	
IRISH GOVT 3.4	1,000,000.00	1,184,960.00	
IRISH GOVT 3.9	500,000.00	593,890.00	
IRISH GOVT 4.4	1,000,000.00	1,058,000.00	
IRISH GOVT 4.5	990,000.00	1,089,316.80	
IRISH GOVT 5	1,000,000.00	1,137,040.00	
IRISH GOVT 5.4	1,200,000.00	1,604,484.00	
IRISH GOVT 5.9	800,000.00	877,928.00	
NETHERLANDS GOVT 0	2,000,000.00	2,018,660.00	
NETHERLANDS GOVT 0.25	2,000,000.00	2,030,720.00	
NETHERLANDS GOVT 0.25	1,700,000.00	1,692,707.00	
NETHERLANDS GOVT 0.5	1,500,000.00	1,509,180.00	

NETHERLANDS GOVT 0.75	1,400,000.00	1,425,984.00
NETHERLANDS GOVT 1.75	1,600,000.00	1,747,920.00
NETHERLANDS GOVT 2	1,000,000.00	1,114,570.00
NETHERLANDS GOVT 2.25	1,500,000.00	1,656,330.00
NETHERLANDS GOVT 2.5	2,400,000.00	2,933,112.00
NETHERLANDS GOVT 2.75	1,400,000.00	1,935,010.00
NETHERLANDS GOVT 3.25	800,000.00	894,904.00
NETHERLANDS GOVT 3.5	1,500,000.00	1,637,385.00
NETHERLANDS GOVT 3.75	1,000,000.00	1,183,750.00
NETHERLANDS GOVT 3.75	1,500,000.00	2,337,570.00
NETHERLANDS GOVT 4	1,500,000.00	1,587,675.00
NETHERLANDS GOVT 4	1,400,000.00	2,127,132.00
NETHERLANDS GOVT 5.5	700,000.00	1,029,707.00
REP OF AUSTRIA 0.25	1,000,000.00	1,012,440.00
REP OF AUSTRIA 0.5	2,400,000.00	2,376,936.00
REP OF AUSTRIA 0.75	1,900,000.00	1,934,523.00
REP OF AUSTRIA 1.2	900,000.00	953,838.00
REP OF AUSTRIA 1.5	200,000.00	181,036.00
REP OF AUSTRIA 1.5	500,000.00	508,760.00
REP OF AUSTRIA 1.65	1,000,000.00	1,090,290.00
REP OF AUSTRIA 1.75	1,000,000.00	1,091,250.00
REP OF AUSTRIA 1.95	1,000,000.00	1,029,710.00
REP OF AUSTRIA 2.4	800,000.00	954,872.00
REP OF AUSTRIA 3.15	500,000.00	702,575.00
REP OF AUSTRIA 3.4	1,000,000.00	1,160,690.00
REP OF AUSTRIA 3.5	2,000,000.00	2,258,660.00
REP OF AUSTRIA 3.65	1,000,000.00	1,152,970.00
REP OF AUSTRIA 3.8	500,000.00	854,810.00
REP OF AUSTRIA 3.9	1,500,000.00	1,646,580.00
REP OF AUSTRIA 4.15	1,300,000.00	1,967,043.00
REP OF AUSTRIA 4.85	1,000,000.00	1,347,810.00
REP OF AUSTRIA 6.25	1,000,000.00	1,513,300.00
SPANISH GOV'T 0.4	2,000,000.00	2,028,480.00
SPANISH GOV'T 0.75	2,000,000.00	2,057,580.00
SPANISH GOV'T 1.15	2,000,000.00	2,065,700.00
SPANISH GOV'T 1.3	2,000,000.00	2,044,540.00
SPANISH GOV'T 1.4	2,000,000.00	2,062,920.00
SPANISH GOV'T 1.45	1,000,000.00	1,024,500.00
SPANISH GOV'T 1.5	1,500,000.00	1,550,520.00
SPANISH GOV'T 1.6	1,200,000.00	1,272,648.00
SPANISH GOV'T 1.95	2,200,000.00	2,369,840.00
SPANISH GOV'T 1.95	2,000,000.00	2,101,260.00
SPANISH GOV'T 2.15	2,000,000.00	2,189,820.00

	SPANISH GOV'T 2.35	1,000,000.00	1,078,620.00	
	SPANISH GOV'T 2.75	3,000,000.00	3,099,330.00	
	SPANISH GOV'T 2.75	3,300,000.00	3,755,598.00	
	SPANISH GOV'T 2.9	2,100,000.00	2,388,120.00	
	SPANISH GOV'T 3.45	1,200,000.00	1,486,296.00	
	SPANISH GOV'T 3.8	2,400,000.00	2,867,064.00	
	SPANISH GOV'T 4	2,500,000.00	2,719,425.00	
	SPANISH GOV'T 4.2	2,050,000.00	2,800,956.00	
	SPANISH GOV'T 4.3	2,000,000.00	2,145,200.00	
	SPANISH GOV'T 4.4	2,000,000.00	2,439,160.00	
	SPANISH GOV'T 4.6	2,500,000.00	2,662,675.00	
	SPANISH GOV'T 4.65	3,100,000.00	3,954,081.00	
	SPANISH GOV'T 4.7	1,500,000.00	2,227,395.00	
	SPANISH GOV'T 4.8	2,000,000.00	2,497,360.00	
	SPANISH GOV'T 4.85	2,000,000.00	2,259,220.00	
	SPANISH GOV'T 4.9	2,000,000.00	3,018,400.00	
	SPANISH GOV'T 5.15	1,100,000.00	1,519,089.00	
	SPANISH GOV'T 5.15	1,200,000.00	1,918,308.00	
	SPANISH GOV'T 5.4	2,500,000.00	3,118,275.00	
	SPANISH GOV'T 5.5	2,700,000.00	3,164,643.00	
	SPANISH GOV'T 5.75	2,200,000.00	3,366,198.00	
	SPANISH GOV'T 5.85	2,500,000.00	3,057,525.00	
	SPANISH GOV'T 5.9	2,500,000.00	3,481,075.00	
	SPANISH GOV'T 6	2,600,000.00	3,831,984.00	
	ユーロ 小計	491,370,000.00	573,708,332.80 (75,958,983,262)	
英bond	UK TSY GILT 0.5	1,200,000.00	1,170,240.00	
	UK TSY GILT 1.25	900,000.00	881,064.00	
	UK TSY GILT 1.5	2,900,000.00	2,943,123.00	
	UK TSY GILT 1.5	2,500,000.00	2,520,700.00	
	UK TSY GILT 1.5	1,500,000.00	1,392,330.00	
	UK TSY GILT 1.75	2,400,000.00	2,428,080.00	
	UK TSY GILT 1.75	3,000,000.00	3,083,760.00	
	UK TSY GILT 1.75	600,000.00	594,306.00	
	UK TSY GILT 2	2,500,000.00	2,560,675.00	
	UK TSY GILT 2	2,200,000.00	2,308,020.00	
	UK TSY GILT 2.25	2,700,000.00	2,850,849.00	
	UK TSY GILT 2.5	1,500,000.00	1,935,255.00	
	UK TSY GILT 2.75	1,700,000.00	1,856,655.00	
	UK TSY GILT 3.25	2,500,000.00	3,222,025.00	
	UK TSY GILT 3.5	2,300,000.00	3,104,126.00	
	UK TSY GILT 3.5	2,000,000.00	3,291,080.00	

	UK TSY GILT 3.75	2,000,000.00	2,081,680.00
	UK TSY GILT 3.75	2,000,000.00	2,135,740.00
	UK TSY GILT 3.75	1,400,000.00	1,529,248.00
	UK TSY GILT 3.75	1,900,000.00	2,883,383.00
	UK TSY GILT 4	1,500,000.00	1,671,600.00
	UK TSY GILT 4	2,000,000.00	3,421,740.00
	UK TSY GILT 4.25	1,600,000.00	2,001,392.00
	UK TSY GILT 4.25	1,200,000.00	1,586,052.00
	UK TSY GILT 4.25	1,900,000.00	2,622,931.00
	UK TSY GILT 4.25	1,000,000.00	1,432,890.00
	UK TSY GILT 4.25	1,600,000.00	2,321,632.00
	UK TSY GILT 4.25	1,700,000.00	2,615,399.00
	UK TSY GILT 4.25	1,700,000.00	2,711,874.00
	UK TSY GILT 4.25	2,100,000.00	3,592,596.00
	UK TSY GILT 4.5	1,900,000.00	2,645,104.00
	UK TSY GILT 4.5	1,800,000.00	2,752,614.00
	UK TSY GILT 4.75	1,700,000.00	1,824,899.00
	UK TSY GILT 4.75	1,300,000.00	1,761,435.00
	UK TSY GILT 4.75	1,500,000.00	2,266,095.00
	UK TSY GILT 5	1,600,000.00	1,992,240.00
	UK TSY GILT 6	1,100,000.00	1,582,119.00
	UK TSY GILT 8	1,620,000.00	1,973,581.20
	英債券 小計	68,520,000.00	85,548,532.20 (13,087,214,455)
スイスフラン	SWISS (GOVT) 2.25	900,000.00	963,540.00
	SWISS (GOVT) 3	300,000.00	312,600.00
	SWISS (GOVT) 4	400,000.00	489,880.00
	SWISS (GOVT) 4	700,000.00	980,560.00
	スイスフラン 小計	2,300,000.00	2,746,580.00 (306,408,464)
スウェーデンクローナ	SWEDISH GOVRNMNT 1	8,000,000.00	8,362,240.00
	SWEDISH GOVRNMNT 1.5	7,000,000.00	7,562,100.00
	SWEDISH GOVRNMNT 2.5	5,000,000.00	5,775,450.00
	SWEDISH GOVRNMNT 3.5	11,000,000.00	12,695,540.00
	SWEDISH GOVRNMNT 3.5	6,000,000.00	8,401,020.00
	SWEDISH GOVRNMNT 5	11,000,000.00	12,608,200.00
	スウェーデンクローナ 小計	48,000,000.00	55,404,550.00 (707,516,103)
ノルウェークローネ	NORWEGIAN GOV'T 1.5	5,000,000.00	4,924,000.00
	NORWEGIAN GOV'T 1.75	5,000,000.00	5,046,000.00
	NORWEGIAN GOV'T 2	10,000,000.00	10,286,000.00
	NORWEGIAN GOV'T 3	4,000,000.00	4,335,600.00
	NORWEGIAN GOV'T 3.75	9,000,000.00	9,721,800.00

	NORWEGIAN GOV'T 4.5	6,000,000.00	6,243,000.00
ノルウェークローネ 小計		39,000,000.00	40,556,400.00 (560,489,448)
デンマーククローネ	DENMARK - BULLET 0.25	4,000,000.00	4,020,000.00
	DENMARK - BULLET 1.5	5,000,000.00	5,412,000.00
	DENMARK - BULLET 1.75	11,000,000.00	12,224,300.00
	DENMARK - BULLET 3	7,000,000.00	7,840,000.00
	DENMARK - BULLET 4	8,000,000.00	8,584,800.00
	DENMARK - BULLET 4.5	13,500,000.00	22,684,050.00
デンマーククローネ 小計		48,500,000.00	60,765,150.00 (1,080,404,367)
ポーランドズロチ	POLAND GOVT BOND 1.5	5,500,000.00	5,489,000.00
	POLAND GOVT BOND 1.75	3,000,000.00	2,996,700.00
	POLAND GOVT BOND 2	2,000,000.00	2,012,000.00
	POLAND GOVT BOND 2.5	4,000,000.00	3,899,600.00
	POLAND GOVT BOND 2.5	1,000,000.00	968,000.00
	POLAND GOVT BOND 3.25	5,000,000.00	5,174,500.00
	POLAND GOVT BOND 4	2,000,000.00	2,154,000.00
	POLAND GOVT BOND 5.25	2,000,000.00	2,180,000.00
	POLAND GOVT BOND 5.5	4,000,000.00	4,242,000.00
	POLAND GOVT BOND 5.75	4,000,000.00	4,516,000.00
	POLAND GOVT BOND 5.75	4,200,000.00	4,843,482.00
	POLAND GOVT BOND 5.75	1,000,000.00	1,255,010.00
	ポーランドズロチ 小計		37,700,000.00
オーストラリアドル	AUSTRALIAN GOVT. 1.75	3,000,000.00	2,971,350.00
	AUSTRALIAN GOVT. 2	1,000,000.00	991,300.00
	AUSTRALIAN GOVT. 2.25	400,000.00	397,980.00
	AUSTRALIAN GOVT. 2.25	2,100,000.00	2,014,740.00
	AUSTRALIAN GOVT. 2.75	1,600,000.00	1,617,152.00
	AUSTRALIAN GOVT. 2.75	2,500,000.00	2,540,360.00
	AUSTRALIAN GOVT. 2.75	2,000,000.00	2,008,400.00
	AUSTRALIAN GOVT. 2.75	1,500,000.00	1,509,616.50
	AUSTRALIAN GOVT. 2.75	500,000.00	498,300.00
	AUSTRALIAN GOVT. 2.75	1,000,000.00	961,000.00
	AUSTRALIAN GOVT. 3	1,000,000.00	953,324.00
	AUSTRALIAN GOVT. 3.25	2,900,000.00	3,023,830.00
	AUSTRALIAN GOVT. 3.25	2,100,000.00	2,202,060.00
	AUSTRALIAN GOVT. 3.25	1,000,000.00	1,014,800.00
	AUSTRALIAN GOVT. 3.75	1,200,000.00	1,320,528.00
	AUSTRALIAN GOVT. 4.25	3,300,000.00	3,681,810.00
	AUSTRALIAN GOVT. 4.5	3,000,000.00	3,144,402.00
	AUSTRALIAN GOVT. 4.5	1,600,000.00	1,905,280.00

	AUSTRALIAN GOVT. 4.75	3,200,000.00	3,738,240.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 5.5	2,500,000.00	2,865,375.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 5.75	3,000,000.00	3,317,250.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 5.75	3,000,000.00	3,415,650.00	
オーストラリアドル 小計		43,400,000.00	46,092,747.50	(3,844,135,141)
シンガポールドル	SINGAPORE GOV'T 2.25	800,000.00	807,040.00	
	SINGAPORE GOV'T 2.75	1,000,000.00	1,032,000.00	
	SINGAPORE GOV'T 2.75	400,000.00	396,600.00	
	SINGAPORE GOV'T 2.75	500,000.00	494,697.50	
	SINGAPORE GOV'T 2.875	400,000.00	414,600.00	
	SINGAPORE GOV'T 3	400,000.00	418,920.00	
	SINGAPORE GOV'T 3.125	1,000,000.00	1,047,800.00	
	SINGAPORE GOV'T 3.25	2,100,000.00	2,166,206.70	
	SINGAPORE GOV'T 3.375	500,000.00	547,200.00	
	SINGAPORE GOV'T 3.5	1,400,000.00	1,527,498.00	
シンガポールドル 小計		8,500,000.00	8,852,562.20	(725,201,895)
マレーシアリングgit	MALAYSIA GOVT 3.418	8,000,000.00	7,891,360.00	
	MALAYSIA GOVT 3.502	9,000,000.00	8,504,478.00	
	MALAYSIA GOVT 4.378	8,000,000.00	8,122,184.00	
	MALAYSIA GOVT 4.498	4,000,000.00	4,043,816.00	
	MALAYSIA GOVT 4.736	3,000,000.00	2,961,420.00	
マレーシアリングgit 小計		32,000,000.00	31,523,258.00	(872,879,014)
南アフリカランド	REP SOUTH AFRICA 6.5	65,000,000.00	49,627,500.00	
	REP SOUTH AFRICA 6.75	27,000,000.00	26,693,550.00	
	REP SOUTH AFRICA 7	63,000,000.00	55,433,700.00	
	REP SOUTH AFRICA 8	4,000,000.00	3,858,000.00	
南アフリカランド 小計		159,000,000.00	135,612,750.00	(1,209,665,730)
合計			180,700,350,119	(180,700,350,119)

(注) 金額欄の( )内は、外貨建保有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 224銘柄	41.5%	41.9%
カナダドル	国債証券 30銘柄	2.1%	2.1%
メキシコペソ	国債証券 7銘柄	0.8%	0.8%
ユーロ	国債証券 267銘柄	41.6%	42.0%
英ポンド	国債証券 38銘柄	7.2%	7.2%
スイスフラン	国債証券 4銘柄	0.2%	0.2%



スウェーデンクローナ	国債証券	6銘柄	0.4%	0.4%
ノルウェークローネ	国債証券	6銘柄	0.3%	0.3%
デンマーククローネ	国債証券	6銘柄	0.6%	0.6%
ポーランドズロチ	国債証券	12銘柄	0.7%	0.7%
オーストラリアドル	国債証券	22銘柄	2.1%	2.1%
シンガポールドル	国債証券	10銘柄	0.4%	0.4%
マレーシアリンギット	国債証券	5銘柄	0.5%	0.5%
南アフリカランド	国債証券	4銘柄	0.7%	0.7%

### デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

### マネーインカム・マザーファンド

#### 貸借対照表

	（単位：円）	
	（平成29年 4月13日現在）	（平成30年 4月13日現在）
資産の部		
流動資産		
金銭信託	-	470,935,467
コール・ローン	316,255,179	142,753,826
特殊債券	1,005,837,000	1,815,562,060
未収入金	-	1,040,000
未収利息	1,448,041	4,904,930
前払費用	213,697	299,178
流動資産合計	1,323,753,917	2,435,495,461
資産合計	1,323,753,917	2,435,495,461
負債の部		
流動負債		
未払解約金	-	13,718,962
未払利息	511	418
その他未払費用	3,177	57,925
流動負債合計	3,688	13,777,305
負債合計	3,688	13,777,305
純資産の部		
元本等		
元本	1,308,650,457	2,395,913,189
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	15,099,772	25,804,967
元本等合計	1,323,750,229	2,421,718,156
純資産合計	1,323,750,229	2,421,718,156
負債純資産合計	1,323,753,917	2,435,495,461

#### 注記表

（重要な会計方針の注記）

項 目	自 平成29年 4月14日 至 平成30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29年 4月13日現在）	（平成30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	1,308,650,457口	2,395,913,189口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.0115円 (10,000口当たりの純資産額 10,115円)	1口当たり純資産額 1.0108円 (10,000口当たりの純資産額 10,108円)

## (金融商品に関する注記)

## . 金融商品の状況に関する事項

項 目	自 平成29年 4月14日 至 平成30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せん。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク</p>

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

#### ・金融商品の時価等に関する事項

項目	(平成30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（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）

自 平成29年 4月14日 至 平成30年 4月13日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。

## （その他の注記）

（平成29年 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	1,290,985,957円
同期中における追加設定元本額	513,349,343円
同期中における一部解約元本額	495,684,843円
平成29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）	47,930,244円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2020（4資産タイプ）	44,555,236円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2025（4資産タイプ）	22,618,208円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2030（4資産タイプ）	10,711,788円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2035（4資産タイプ）	8,807,109円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2040（4資産タイプ）	4,363,551円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2045（4資産タイプ）	10,584,343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＞	488,389,420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＞	500,547,456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＞	169,746,590円
合計	1,308,650,457円

（平成30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	1,308,650,457円
同期中における追加設定元本額	2,291,651,696円
同期中における一部解約元本額	1,204,388,964円

平成30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）	64,196,678円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2020（4資産タイプ）	60,612,220円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2025（4資産タイプ）	39,269,806円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2030（4資産タイプ）	12,867,654円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2035（4資産タイプ）	12,031,132円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2040（4資産タイプ）	5,975,540円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2045（4資産タイプ）	15,944,434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＞	592,794,406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＞	477,799,755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＞	1,114,025,052円
合計	2,395,913,189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
特殊債券	第56回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,027,000	
	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	100,387,000	
	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	100,517,000	
	第64回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,617,000	
	第67回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	302,697,000	
	第69回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	202,050,000	
	第71回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	201,000,000	203,022,060	
	第4回政府保証地方公営企業等金融機構債券	200,000,000	202,076,000	
	第5回政府保証地方公営企業等金融機構債券	100,000,000	101,137,000	
	第885回政府保証公営企業債券	100,000,000	100,185,000	
	第15回政府保証東日本高速道路債券	100,000,000	101,162,000	
	第23回政府保証中日本高速道路債券	100,000,000	100,647,000	
	第24回政府保証中日本高速道路債券	100,000,000	101,038,000	

合計	1,801,000,000	1,815,562,060
----	---------------	---------------

## 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。

【中間財務諸表】

- 1 . 当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和52年大蔵省令第38号)ならびに同規則第38条の3、第57条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)に基づいて作成しております。  
なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
- 2 . 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第11期中間計算期間（平成30年 4月14日から平成30年10月13日まで）の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。

## 【三井住友・DCターゲットイヤーファンド2040(4資産タイプ)】

## (1)【中間貸借対照表】

(単位:円)

第11期中間計算期間  
(平成30年10月13日現在)

資産の部	
流動資産	
金銭信託	4,766,477
コール・ローン	154,666
親投資信託受益証券	423,463,811
流動資産合計	428,384,954
資産合計	428,384,954
負債の部	
流動負債	
未払解約金	1
未払受託者報酬	64,164
未払委託者報酬	834,123
その他未払費用	10,702
流動負債合計	908,990
負債合計	908,990
純資産の部	
元本等	
元本	276,346,763
剰余金	
中間剰余金又は中間欠損金( )	151,129,201
元本等合計	427,475,964
純資産合計	427,475,964
負債純資産合計	428,384,954



## （２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第11期中間計算期間 自 平成30年 4月14日 至 平成30年10月13日
営業収益	
有価証券売買等損益	492,859
営業収益合計	492,859
営業費用	
支払利息	1,012
受託者報酬	64,164
委託者報酬	834,123
その他費用	11,340
営業費用合計	910,639
営業利益又は営業損失（ ）	417,780
経常利益又は経常損失（ ）	417,780
中間純利益又は中間純損失（ ）	417,780
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（ ）	107,005
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	116,880,721
剰余金増加額又は欠損金減少額	36,669,072
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	36,669,072
剰余金減少額又は欠損金増加額	1,895,807
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	1,895,807
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-
分配金	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	151,129,201

## ( 3 ) 【中間注記表】

## ( 重要な会計方針の注記 )

項 目	第11期中間計算期間 自 平成30年 4月14日 至 平成30年10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>

## ( 中間貸借対照表に関する注記 )

項 目	第11期中間計算期間 (平成30年10月13日現在)	
1. 当中間計算期間の末日における受益権の総数		276,346,763口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額	1.5469円
	(10,000口当たりの純資産額)	15,469円)

## ( 中間損益及び剰余金計算書に関する注記 )

該当事項はありません。

## ( 金融商品に関する注記 )

金融商品の時価等に関する事項

項目	第11期中間計算期間 (平成30年10月13日現在)
1. 中間貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券（親投資信託受益証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

## (デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

## (その他の注記)

項目	第11期中間計算期間 (平成30年10月13日現在)
期首元本額	214,950,711円
期中追加設定元本額	64,867,044円
期中一部解約元本額	3,470,992円

## (参考)

三井住友・DCターゲットイヤーファンド2040（4資産タイプ）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、中間貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同マザーファンドの受益証券です。

なお、以下に記載した状況は、監査の対象外です。

## 国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

## 貸借対照表

(単位：円)

(平成30年10月13日現在)

## 資産の部

## 流動資産

金銭信託

1,581,729,291

コール・ローン

51,405,194

株式

168,988,995,810

(平成30年10月13日現在)

未収配当金	1,496,194,339
前払金	167,705,000
流動資産合計	172,286,029,634
資産合計	172,286,029,634
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	167,794,640
未払金	3,306,080
未払解約金	290,227,914
未払利息	150
その他未払費用	48,556
流動負債合計	461,377,340
負債合計	461,377,340
純資産の部	
元本等	
元本	64,920,502,941
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	106,904,149,353
元本等合計	171,824,652,294
純資産合計	171,824,652,294
負債純資産合計	172,286,029,634

## 注記表

(重要な会計方針の注記)

項目	自平成30年4月14日 至平成30年10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30年10月13日現在）	
1. 担保資産	代用として、担保に供している資産は次の通りであります。	
	株式	2,643,200,000円
2. 当計算期間の末日における受益権の総数		64,920,502,941口
3. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額	2.6467円
	(10,000口当たりの純資産額)	26,467円)

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	（平成30年10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ぬ。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券（株式） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

## （デリバティブ取引に関する注記）

（平成30年10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	2,966,194,640	-	2,798,400,000	167,794,640
	東証株価指数先物	2,966,194,640	-	2,798,400,000	167,794,640
合計		2,966,194,640	-	2,798,400,000	167,794,640

## （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。

(その他の注記)

(平成30年10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	68,068,329,504円
同期中における追加設定元本額	5,056,447,914円
同期中における一部解約元本額	8,204,274,477円
平成30年10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	10,030,549,449円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	699,223,841円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	3,411,947,658円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	2,545,034,876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)	126,447,310円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2020(4資産タイプ)	7,031,846円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2025(4資産タイプ)	22,628,288円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2030(4資産タイプ)	57,830,212円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2035(4資産タイプ)	80,247,072円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2040(4資産タイプ)	47,769,882円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2045(4資産タイプ)	119,947,123円
国内株式指数ファンド(T O P I X)	1,692,857,034円
三井住友・DCつみたてN I S A ・日本株インデックスファンド	6,817,329,772円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	341,264,998円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	550,152,277円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	551,378,803円
イオン・バランス戦略ファンド	69,645,037円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2050	7,291,213円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	5,159,858円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	6,949,322円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	27,313,707円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	22,270,630円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	52,182,416円
三井住友・DCつみたてN I S A ・世界分散ファンド	4,333,912円
S M A M ・ 国内株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	5,946,247,591円
バランスファンドV A (安定運用型) < 適格機関投資家限定 >	23,471,103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 >	604,776,391円
S M A M ・ バランスファンドV A 2 5 < 適格機関投資家専用 >	3,479,446,439円
S M A M ・ バランスファンドV A 3 7 . 5 < 適格機関投資家専用 >	2,452,216,244円
S M A M ・ バランスファンドV A 5 0 < 適格機関投資家専用 >	9,028,881,972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 >	55,931,035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 >	217,589,384円

世界6資産バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	779,654円
SMAM・バランスファンドVA75<適格機関投資家専用>	988,877,922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>	53,997,026円
SMAM・インデックス・バランスVA25<適格機関投資家専用>	369,425,008円
SMAM・インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用>	1,088,999,956円
SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用>	928,739,841円
SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>	3,098,232,570円
SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定>	1,443,205円
三井住友・5資産バランスファンド・VAS（適格機関投資家専用）	1,207,656,106円
SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	64,109,227円
SMAM・バランスファンドVA20<適格機関投資家専用>	87,464,654円
三井住友・7資産バランスファンド・VAS（適格機関投資家専用）	1,640,032,255円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>	101,677,344円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>	46,106,949円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用>	21,461,043円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>	200,324,710円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	367,139,910円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T<適格機関投資家専用>	159,692,005円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A2<適格機関投資家専用>	113,556,864円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A2<適格機関投資家専用>	57,774,586円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A2<適格機関投資家専用>	10,719,389円
SMAM・アセットバランスファンドVA30L2<適格機関投資家専用>	73,824,243円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L2<適格機関投資家専用>	938,647,417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）	198,712,851円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T2<適格機関投資家専用>	19,535,802円
SMAM・グローバルバランスファンド（標準型）VA<適格機関投資家限定>	1,677,781,097円
SMAM・グローバルバランスファンド（債券重視型）VA<適格機関投資家限定>	232,095,874円
SMAM・世界バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	1,575,906,619円
SMAM・世界バランスファンドVA2<適格機関投資家限定>	133,573,058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>	12,539,689円
SMAM・マルチアセットストラテジーファンド2016-04<適格機関投資家限定>	129,425,667円
SMAM・マルチアセットストラテジーファンド2016-05<適格機関投資家限定>	62,221,820円
SMAM・マルチアセットストラテジー・オープン<適格機関投資家限定>	152,667,380円
SMAM・マルチアセット・ダイナミックアロケーション・ストラテジー・ファンド<適格機関投資家限定>	14,505円
合計	64,920,502,941円

## 国内債券パッシブ・マザーファンド

## 貸借対照表

（単位：円）

（平成30年10月13日現在）

## 資産の部

## 流動資産

金銭信託

767,987,754

コール・ローン

24,959,113

(平成30年10月13日現在)

国債証券	143,813,912,110
地方債証券	18,199,780,239
特殊債証券	24,682,502,120
社債証券	7,681,060,000
未収入金	293,299,200
未収利息	376,096,413
前払費用	4,518,910
流動資産合計	195,844,115,859
資産合計	195,844,115,859
負債の部	
流動負債	
未払金	100,000,000
未払解約金	409,922,697
未払利息	73
その他未払費用	10,932
流動負債合計	509,933,702
負債合計	509,933,702
純資産の部	
元本等	
元本	156,087,547,058
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	39,246,635,099
元本等合計	195,334,182,157
純資産合計	195,334,182,157
負債純資産合計	195,844,115,859

## 注記表

(重要な会計方針の注記)

項目	自平成30年4月14日 至平成30年10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、特殊債証券、社債証券は個別法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)



項目	（平成30年10月13日現在）	
1. 当計算期間の末日における受益権の総数		156,087,547,058口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額	1.2514円
	(10,000口当たりの純資産額)	12,514円)

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	（平成30年10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。

## （その他の注記）

（平成30年10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	164,426,145,427円
同期中における追加設定元本額	8,356,164,176円
同期中における一部解約元本額	16,694,762,545円
平成30年10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）	4,285,186,154円
三井住友・DC年金バランス50（標準型）	7,677,309,755円
三井住友・DC年金バランス70（株式重点型）	1,725,571,261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）	449,477,606円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2020（4資産タイプ）	54,411,998円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2025（4資産タイプ）	162,158,001円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2030（4資産タイプ）	281,197,360円

(平成30年10月13日現在)	
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2035(4資産タイプ)	235,430,752円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2040(4資産タイプ)	91,172,620円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2045(4資産タイプ)	198,085,084円
三井住友・DC年金バランスゼロ(債券型)	75,033,069円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	3,701,542,465円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	498,028,134円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	447,170,366円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2050	8,744,073円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	9,565,010円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	4,411,713円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	2,777,049円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	1,829,845円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	3,708,883円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	14,626,055円
SMAM・年金グローバル債券ファンド<適格機関投資家限定>	5,825,296,562円
SMAM・バランスファンドVA25<適格機関投資家専用>	20,579,462,127円
SMAM・バランスファンドVA37.5<適格機関投資家専用>	8,001,319,507円
SMAM・バランスファンドVA50<適格機関投資家専用>	19,589,048,049円
SMAM・バランスファンドVL30<適格機関投資家限定>	366,844,194円
SMAM・バランスファンドVL50<適格機関投資家限定>	632,325,863円
世界6資産バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	2,980,578円
SMAM・バランスファンドVA75<適格機関投資家専用>	312,441,022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>	121,651,569円
SMAM・インデックス・バランスVA25<適格機関投資家専用>	2,164,026,925円
SMAM・インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用>	2,406,281,476円
SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用>	3,064,205,195円
SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>	11,858,000,050円
SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定>	3,271,137円
三井住友・国内債券インデックスファンド・VAS(適格機関投資家専用)	5,448,927,125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)	16,142,586,068円
SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	567,882,547円
SMAM・バランスファンドVA20<適格機関投資家専用>	785,519,474円
三井住友・7資産バランスファンド・VAS(適格機関投資家専用)	16,340,860,407円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>	982,336,698円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>	203,839,442円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用>	47,826,103円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>	2,190,461,997円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	2,708,039,874円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T<適格機関投資家専用>	2,578,464,051円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A2<適格機関投資家専用>	1,090,228,148円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A2<適格機関投資家専用>	256,779,768円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A2<適格機関投資家専用>	23,873,967円
SMAM・アセットバランスファンドVA30L2<適格機関投資家専用>	382,737,442円

(平成30年10月13日現在)	
SMAM・アセットバランスファンドVA25L2<適格機関投資家専用>	6,841,585,818円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T2<適格機関投資家専用>	310,068,743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>	159,584,601円
SMAM・マルチアセットストラテジーファンド2016-04<適格機関投資家限定>	1,568,399,842円
SMAM・マルチアセットストラテジーファンド2016-05<適格機関投資家限定>	751,930,159円
SMAM・マルチアセットストラテジー・オープン<適格機関投資家限定>	1,850,600,039円
SMAM・マルチアセット・ダイナミックアロケーション・ストラテジー・ファンド<適格機関投資家限定>	423,238円
合計	156,087,547,058円

## 外国株式インデックス・マザーファンド

### 貸借対照表

(単位：円)

(平成30年10月13日現在)

資産の部	
流動資産	
預金	517,283,231
金銭信託	535,380,393
コール・ローン	17,399,522
株式	171,235,576,563
投資証券	3,827,457,287
派生商品評価勘定	701,043
未収入金	134,499,922
未収配当金	210,974,714
前払金	144,329,064
差入委託証拠金	1,826,967,700
流動資産合計	178,450,569,439
資産合計	178,450,569,439
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	145,314,507
未払解約金	207,821,326
未払利息	51
その他未払費用	9,620
流動負債合計	353,145,504
負債合計	353,145,504
純資産の部	
元本等	
元本	51,917,448,823
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	126,179,975,112
元本等合計	178,097,423,935
純資産合計	178,097,423,935
負債純資産合計	178,450,569,439

### 注記表

(重要な会計方針の注記)

項目	自 平成30年 4月14日 至 平成30年10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</p> <p>受取配当金は原則として、配当落ち日において、確定配当金額または予想配当金額を計上しております。なお、配当金額が未確定の場合は、入金日基準で計上しております。</p>
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建資産等の会計処理</p> <p>「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。</p>

## (貸借対照表に関する注記)

項目	(平成30年10月13日現在)	
1. 当計算期間の末日における受益権の総数		51,917,448,823口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額	3.4304円
	(10,000口当たりの純資産額)	34,304円)

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	(平成30年10月13日現在)
1.貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1) 有価証券（株式、投資証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(デリバティブ取引に関する注記)

(平成30年10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	3,130,953,881	-	2,986,624,817	144,329,064
	SPMINI 1812	2,247,996,467	-	2,140,644,660	107,351,807
	DJ EUR 1812	542,561,364	-	520,805,300	21,756,064
	FTSE 1812	204,966,746	-	197,104,951	7,861,795
	SPI200 1812	135,429,304	-	128,069,906	7,359,398
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	248,350,600	-	248,059,900	290,700
	米ドル	224,640,000	-	224,320,000	320,000
	カナダドル	9,466,600	-	9,471,000	4,400
	スイスフラン	7,946,400	-	7,935,200	11,200
	スウェーデンクローナ	2,462,000	-	2,502,000	40,000
	ノルウェークローネ	683,000	-	683,500	500
	香港ドル	3,152,600	-	3,148,200	4,400
	売建	40,011,600	-	40,005,300	6,300
	米ドル	26,923,200	-	26,916,000	7,200
	カナダドル	1,721,600	-	1,722,000	400
	ユーロ	5,204,400	-	5,204,800	400
	英ポンド	2,970,600	-	2,970,800	200
	スイスフラン	1,133,500	-	1,133,600	100
	スウェーデンクローナ	375,000	-	375,300	300
ノルウェークローネ	136,700	-	136,700	-	

デンマーククローネ	174,400	-	174,400	-
オーストラリアドル	799,400	-	799,300	100
香港ドル	572,800	-	572,400	400
合計	3,419,316,081	-	3,274,690,017	144,613,464

## (注) 1. 時価の算定方法

## (1) 株価指数先物取引の時価の算定方法について

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

2) 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

## (2) 為替予約取引の時価の算定方法について

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

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

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

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

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

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

## 2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

## (その他の注記)

(平成30年10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	53,755,349,667円
同期中における追加設定元本額	5,638,102,646円
同期中における一部解約元本額	7,476,003,490円
平成30年10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	13,515,064,968円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	265,446,737円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	1,111,683,061円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	770,112,120円
S M A M ・ グローバルバランスファンド(機動的資産配分型)	71,758,657円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2020(4資産タイプ)	2,617,655円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2025(4資産タイプ)	7,745,122円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2030(4資産タイプ)	21,829,082円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2035(4資産タイプ)	39,058,958円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2040(4資産タイプ)	26,022,572円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2045(4資産タイプ)	68,351,037円

（平成30年10月13日現在）	
外国株式指数ファンド	497,401,086円
三井住友・DCつみたてNISA・全海外株インデックスファンド	2,389,538,879円
アセットアロケーション・ファンド（安定型）	306,989,826円
アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）	362,644,879円
アセットアロケーション・ファンド（成長型）	319,841,529円
イオン・バランス戦略ファンド	45,243,554円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2050	4,631,166円
三井住友・資産最適化ファンド（1安定重視型）	3,896,669円
三井住友・資産最適化ファンド（2やや安定型）	5,320,393円
三井住友・資産最適化ファンド（3バランス型）	20,607,336円
三井住友・資産最適化ファンド（4やや成長型）	16,973,874円
三井住友・資産最適化ファンド（5成長重視型）	39,441,881円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	6,583,723円
SMAM・外国株式パッシブ・ファンド（適格機関投資家専用）	2,145,635,458円
バランスファンドVA（安定運用型）＜適格機関投資家限定＞	8,824,440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＞	223,040,520円
SMAM・バランスファンドVA25＜適格機関投資家専用＞	1,755,823,811円
SMAM・バランスファンドVA37.5＜適格機関投資家専用＞	1,623,667,062円
SMAM・バランスファンドVA50＜適格機関投資家専用＞	6,831,946,687円
SMAM・バランスファンドVL30＜適格機関投資家限定＞	21,070,583円
SMAM・バランスファンドVL50＜適格機関投資家限定＞	109,197,074円
世界6資産バランスファンドVA＜適格機関投資家限定＞	448,417円
SMAM・バランスファンドVA75＜適格機関投資家専用＞	855,131,258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＞	61,708,673円
SMAM・インデックス・バランスVA25＜適格機関投資家専用＞	188,955,118円
SMAM・インデックス・バランスVA50＜適格機関投資家専用＞	825,048,969円
SMAM・バランスファンドVA40＜適格機関投資家専用＞	700,715,521円
SMAM・バランスファンドVA35＜適格機関投資家専用＞	1,758,084,467円
SMAM・バランスVA株40T＜適格機関投資家限定＞	1,098,601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）	695,729,653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）	913,949,581円
SMAM・グローバルバランス40VA＜適格機関投資家限定＞	144,875,919円
SMAM・バランスファンドVA20＜適格機関投資家専用＞	65,980,371円
三井住友・7資産バランスファンド・VAS（適格機関投資家専用）	1,238,982,181円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A＜適格機関投資家専用＞	25,787,340円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A＜適格機関投資家専用＞	14,190,765円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A＜適格機関投資家専用＞	6,986,832円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L＜適格機関投資家専用＞	50,091,943円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L＜適格機関投資家専用＞	117,258,620円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T＜適格機関投資家専用＞	120,634,183円
SMAM・グローバルバランスファンド（標準型）VA＜適格機関投資家限定＞	1,290,643,460円
SMAM・グローバルバランスファンド（債券重視型）VA＜適格機関投資家限定＞	176,401,107円
SMAM・世界バランスファンドVA＜適格機関投資家限定＞	6,487,462,055円

（平成30年10月13日現在）	
S M A M ・ 世界バランスファンドV A 2 < 適格機関投資家限定 >	331,629,889円
S M A M ・ 外国株式インデックスファンドS A < 適格機関投資家限定 >	2,869,813,512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 >	10,947,475円
S M A M ・ マルチアセットストラテジーファンド2 0 1 6 - 0 4 < 適格機関投資家限定 >	123,072,598円
S M A M ・ マルチアセットストラテジーファンド2 0 1 6 - 0 5 < 適格機関投資家限定 >	58,805,401円
S M A M ・ マルチアセットストラテジー・オープン< 適格機関投資家限定 >	144,985,517円
S M A M ・ マルチアセット・ダイナミックアロケーション・ストラテジー・ファンド< 適格機関投資家限定 >	18,998円
合計	51,917,448,823円

## 外国債券パッシブ・マザーファンド

### 貸借対照表

（単位：円）

（平成30年10月13日現在）

#### 資産の部

##### 流動資産

預金	362,762,564
金銭信託	192,422,310
コール・ローン	6,253,602
国債証券	171,348,490,940
派生商品評価勘定	56,800
未収利息	1,482,757,801
前払費用	34,232,861

流動資産合計	173,426,976,878
--------	-----------------

##### 資産合計

	173,426,976,878
--	-----------------

#### 負債の部

##### 流動負債

未払解約金	168,309,893
未払利息	18
その他未払費用	6,644

流動負債合計	168,316,555
--------	-------------

##### 負債合計

	168,316,555
--	-------------

#### 純資産の部

##### 元本等

元本	100,375,632,390
----	-----------------

##### 剰余金

剰余金又は欠損金（ ）	72,883,027,933
-------------	----------------

元本等合計	173,258,660,323
-------	-----------------

##### 純資産合計

	173,258,660,323
--	-----------------

#### 負債純資産合計

	173,426,976,878
--	-----------------

### 注記表

（重要な会計方針の注記）



項目	自 平成30年 4月14日 至 平成30年10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30年10月13日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	100,375,632,390口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.7261円
	(10,000口当たりの純資産額 17,261円)

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	(平成30年10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。

項目	(平成30年10月13日現在)
2.時価の算定方法	(1) 有価証券（国債証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

（デリバティブ取引に関する注記）

（平成30年10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
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	59,472,800	-	59,416,000	56,800
	英債券	59,472,800	-	59,416,000	56,800
	合計	59,472,800	-	59,416,000	56,800

（注）1.時価の算定方法

(1)為替予約取引の時価の算定方法について

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

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

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

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

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

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

2.ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

（その他の注記）

(平成30年10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	105,069,479,839円
同期中における追加設定元本額	3,474,124,701円
同期中における一部解約元本額	8,167,972,150円

（平成30年10月13日現在）

平成30年10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	10,362,510,507円
三井住友・DC年金バランス30（債券重点型）	556,863,835円
三井住友・DC年金バランス50（標準型）	1,561,272,201円
三井住友・DC年金バランス70（株式重点型）	819,404,047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）	125,732,442円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2020（4資産タイプ）	9,082,382円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2025（4資産タイプ）	31,884,240円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2030（4資産タイプ）	84,952,423円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2035（4資産タイプ）	96,890,014円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2040（4資産タイプ）	49,813,311円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2045（4資産タイプ）	122,555,460円
三井住友・DC年金バランスゼロ（債券型）	14,299,351円
アセットアロケーション・ファンド（安定型）	67,183,658円
アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）	195,296,928円
アセットアロケーション・ファンド（成長型）	301,668,598円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2050	3,931,190円
三井住友・資産最適化ファンド（1安定重視型）	15,198,829円
三井住友・資産最適化ファンド（2やや安定型）	12,644,963円
三井住友・資産最適化ファンド（3バランス型）	28,885,180円
三井住友・資産最適化ファンド（4やや成長型）	15,027,743円
三井住友・資産最適化ファンド（5成長重視型）	10,693,329円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	13,857,084円
S M A M ・ 年金外国債券パッシブ・ファンド＜適格機関投資家限定＞	2,140,221,554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＞	229,062,157円
S M A M ・ バランスファンドVA25＜適格機関投資家専用＞	12,959,085,819円
S M A M ・ バランスファンドVA37.5＜適格機関投資家専用＞	6,302,690,000円
S M A M ・ バランスファンドVA50＜適格機関投資家専用＞	14,266,614,664円
S M A M ・ バランスファンドVL30＜適格機関投資家限定＞	44,184,531円
S M A M ・ バランスファンドVL50＜適格機関投資家限定＞	114,146,360円
世界6資産バランスファンドVA＜適格機関投資家限定＞	600,777円
S M A M ・ バランスファンドVA75＜適格機関投資家専用＞	898,542,915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＞	127,886,244円
S M A M ・ インデックス・バランスVA25＜適格機関投資家専用＞	1,371,137,002円
S M A M ・ インデックス・バランスVA50＜適格機関投資家専用＞	1,727,753,184円
S M A M ・ バランスファンドVA40＜適格機関投資家専用＞	2,219,410,394円
S M A M ・ バランスファンドVA35＜適格機関投資家専用＞	7,382,131,295円
S M A M ・ バランスVA株40T＜適格機関投資家限定＞	2,321,047円
S M A M ・ 外国債券パッシブファンドVA＜適格機関投資家限定＞	11,932,809,759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）	953,905,227円
三井住友・5資産バランスファンド・VAS（適格機関投資家専用）	1,922,110,102円
S M A M ・ グローバルバランス40VA＜適格機関投資家限定＞	204,077,995円
S M A M ・ バランスファンドVA20＜適格機関投資家専用＞	561,559,240円

(平成30年10月13日現在)	
三井住友・7資産バランスファンド・V A S (適格機関投資家専用)	2,616,306,852円
S M A M ・ アセツトバランズファンドV A 2 0 A < 適格機関投資家専用 >	162,434,128円
S M A M ・ アセツトバランズファンドV A 3 5 A < 適格機関投資家専用 >	43,915,013円
S M A M ・ アセツトバランズファンドV A 5 0 A < 適格機関投資家専用 >	14,415,303円
S M A M ・ アセツトバランズファンドV A 2 0 L < 適格機関投資家専用 >	159,186,031円
S M A M ・ アセツトバランズファンドV A 2 5 L < 適格機関投資家専用 >	585,582,506円
S M A M ・ アセツトバランズファンドV A 2 0 T < 適格機関投資家専用 >	191,277,593円
S M A M ・ アセツトバランズファンドV A 2 0 A 2 < 適格機関投資家専用 >	182,591,770円
S M A M ・ アセツトバランズファンドV A 3 5 A 2 < 適格機関投資家専用 >	55,444,546円
S M A M ・ アセツトバランズファンドV A 5 0 A 2 < 適格機関投資家専用 >	7,191,746円
S M A M ・ アセツトバランズファンドV A 2 5 L 2 < 適格機関投資家専用 >	1,472,575,064円
S M A M ・ アセツトバランズファンドV A 2 0 T 2 < 適格機関投資家専用 >	23,188,295円
S M A M ・ グローバルバランズファンド(標準型) V A < 適格機関投資家限定 >	4,332,818,566円
S M A M ・ グローバルバランズファンド(債券重視型) V A < 適格機関投資家限定 >	1,898,212,800円
S M A M ・ 世界バランズファンドV A < 適格機関投資家限定 >	6,702,871,278円
S M A M ・ 世界バランズファンドV A 2 < 適格機関投資家限定 >	819,444,681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 >	47,899,506円
S M A M ・ マルチアセツトストラテジーファンド2 0 1 6 - 0 4 < 適格機関投資家限定 >	451,265,371円
S M A M ・ マルチアセツトストラテジーファンド2 0 1 6 - 0 5 < 適格機関投資家限定 >	216,234,292円
S M A M ・ マルチアセツトストラテジー・オープン< 適格機関投資家限定 >	532,852,010円
S M A M ・ マルチアセツト・ダイナミックアロケーション・ストラテジー・ファンド< 適格機関投資家限定 >	27,058円
合計	100,375,632,390円

## マネーインカム・マザーファンド

## 貸借対照表

(単位：円)

(平成30年10月13日現在)

## 資産の部

## 流動資産

金銭信託	837,177,954
コール・ローン	27,207,750
特殊債券	1,943,462,490
未収利息	4,562,145
前払費用	717,806
流動資産合計	2,813,128,145

## 資産合計

2,813,128,145

## 負債の部

## 流動負債

未払解約金	10,754,193
未払利息	79
その他未払費用	12,259
流動負債合計	10,766,531

## 負債合計

10,766,531

（平成30年10月13日現在）

純資産の部	
元本等	
元本	2,773,415,395
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	28,946,219
元本等合計	2,802,361,614
純資産合計	2,802,361,614
負債純資産合計	2,813,128,145

## 注記表

（重要な会計方針の注記）

項目	自 平成30年 4月14日 至 平成30年10月13日
有価証券の評価基準及び評価方法	<p>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30年10月13日現在）
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	2,773,415,395口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.0104円 (10,000口当たりの純資産額 10,104円)

（金融商品に関する注記）

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	（平成30年10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ぬ。

項 目	(平成30年10月13日現在)
2.時価の算定方法	(1) 有価証券(特殊債券) 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定(デリバティブ取引) デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

## (デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

## (その他の注記)

(平成30年10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	2,395,913,189円
同期中における追加設定元本額	1,101,340,288円
同期中における一部解約元本額	723,838,082円
平成30年10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)	73,149,785円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2020(4資産タイプ)	75,958,380円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2025(4資産タイプ)	53,062,417円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2030(4資産タイプ)	13,659,185円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2035(4資産タイプ)	15,504,251円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2040(4資産タイプ)	7,608,139円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2045(4資産タイプ)	19,556,281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>	588,717,491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>	477,799,755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>	1,448,003,199円
合計	2,773,415,395円

## 2【ファンドの現況】

### 【純資産額計算書】

三井住友・DCターゲットイヤーファンド2040（4資産タイプ）

2018年10月31日現在

資産総額	431,404,107円
負債総額	96,378円
純資産総額（ - ）	431,307,729円
発行済口数	281,925,027口
1口当たり純資産額（ / ）	1.5299円
（1万口当たり純資産額）	（15,299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

	2018年11月1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	60,000,000株
発行済株式総数	17,640,000株

###### ロ 最近5年間における資本金の額の増減 該当ありません。

##### 八 会社の機構

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

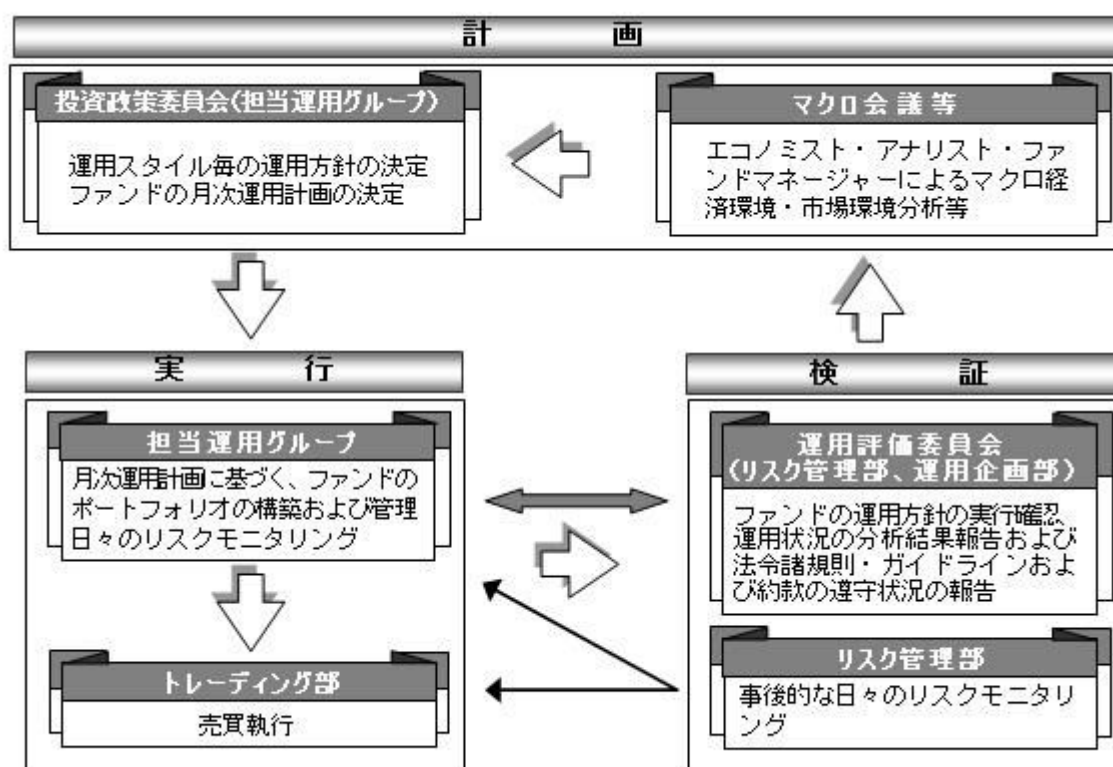
取締役の任期は、選任後1年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会の終結の時までとし、補欠または増員によって選任された取締役の任期は、他の現任取締役の任期の満了する時までとします。

委託会社の業務上重要な事項は、取締役会の決議により決定します。

取締役会は、取締役会の決議によって、代表取締役若干名を選定します。

また、取締役会の決議によって、取締役社長を1名選定します。

##### 二 投資信託の運用の流れ



## 2【事業の内容及び営業の概況】

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

2018年10月31日現在、委託会社が運用を行っている投資信託（親投資信託は除きます）は、以下の通りです。

（2018年10月31日現在）			
		本数(本)	純資産総額(百万円)
株式投資信託	単位型	91 ( 46)	392,054 ( 317,686)
	追加型	460 ( 197)	5,781,880 ( 2,738,089)
	計	551 ( 243)	6,173,934 ( 3,055,774)
公社債投資信託	単位型	111 ( 111)	300,362 ( 300,362)
	追加型	1 ( 0)	28,956 ( 0)
	計	112 ( 111)	329,319 ( 300,362)
合計		663 ( 354)	6,503,253 ( 3,356,137)

( )内は、私募投資信託分であり、内書き表記しております。

## 3【委託会社等の経理状況】

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

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

2 当社は、第33期（平成29年4月1日から平成30年3月31日まで）の財務諸表については、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、有限責任 あずさ監査法人の監査を受けており、第34期中間会計期間（平成30年4月1日から平成30年9月30日まで）の中間財務諸表については、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、有限責任 あずさ監査法人の中間監査を受けております。

### （1）【貸借対照表】

	(単位：千円)	
	前事業年度 (平成29年3月31日)	当事業年度 (平成30年3月31日)
資産の部		
流動資産		
現金及び預金	13,279,384	20,873,870

顧客分別金信託	20,008	20,010
前払費用	351,526	402,249
未収入金	40,544	39,030
未収委託者報酬	5,511,715	6,332,203
未収運用受託報酬	1,297,104	1,725,215
未収投資助言報酬	343,523	316,407
未収収益	20,789	50,321
繰延税金資産	482,535	715,988
その他の流動資産	5,560	10,891
流動資産合計	21,352,691	30,486,188
固定資産		
有形固定資産	1	
建物	198,767	185,371
器具備品	261,096	300,694
有形固定資産合計	459,864	486,065
無形固定資産		
ソフトウェア	493,806	409,765
ソフトウェア仮勘定	141,025	5,755
電話加入権	68	56
商標権	3	-
無形固定資産合計	634,903	415,576
投資その他の資産		
投資有価証券	12,098,372	10,616,594
関係会社株式	10,412,523	10,412,523
長期差入保証金	677,681	658,505
長期前払費用	61,282	69,423
会員権	7,819	7,819
繰延税金資産	871,577	678,459
投資その他の資産合計	24,129,257	22,443,325
固定資産合計	25,224,025	23,344,968
資産合計	46,576,717	53,831,157

(単位：千円)

	前事業年度 (平成29年3月31日)	当事業年度 (平成30年3月31日)
負債の部		
流動負債		
顧客からの預り金	304	84
その他の預り金	80,380	92,326
未払金		
未払収益分配金	655	649
未払償還金	140,124	137,522
未払手数料	2,424,318	2,783,763
その他未払金	52,903	236,739
未払費用	2,564,625	3,433,641
未払消費税等	160,571	547,706
未払法人税等	661,467	1,785,341
賞与引当金	1,001,068	1,507,256
その他の流動負債	445	1,408
流動負債合計	7,086,864	10,526,438
固定負債		
退職給付引当金	3,177,131	3,319,830

賞与引当金	40,167	99,721
その他の固定負債	2,174	3,363
固定負債合計	3,219,473	3,422,915
負債合計	10,306,337	13,949,354
純資産の部		
株主資本		
資本金	2,000,000	2,000,000
資本剰余金		
資本準備金	8,628,984	8,628,984
資本剰余金合計	8,628,984	8,628,984
利益剰余金		
利益準備金	284,245	284,245
その他利益剰余金		
配当準備積立金	60,000	60,000
別途積立金	1,476,959	1,476,959
繰越利益剰余金	23,493,074	26,561,078
利益剰余金合計	25,314,279	28,382,283
株主資本計	35,943,263	39,011,267
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	327,116	870,535
評価・換算差額等合計	327,116	870,535
純資産合計	36,270,379	39,881,802
負債・純資産合計	46,576,717	53,831,157

## (2) 【損益計算書】

(単位：千円)

	前事業年度		当事業年度	
	(自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)		(自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)	
営業収益				
委託者報酬	31,628,014		36,538,981	
運用受託報酬	5,649,190		8,362,118	
投資助言報酬	1,726,511		1,440,233	
その他営業収益				
情報提供コンサルタント				
業務報酬	5,000		5,000	
サービス支援手数料	61,268		128,324	
その他	54,261		55,820	
営業収益計	39,124,246		46,530,479	
営業費用				
支払手数料	14,908,517		16,961,384	
広告宣伝費	366,227		353,971	
公告費	1,140		1,140	
調査費				
調査費	1,325,978		1,654,233	
委託調査費	4,343,104		5,972,473	
営業雑経費				
通信費	46,030		40,066	
印刷費	338,254		339,048	

協会費		21,669	-
諸会費		20,054	45,465
情報機器関連費		2,516,497	2,582,734
販売促進費		24,896	34,333
その他		149,177	136,669
営業費用合計		24,061,549	28,121,520
一般管理費			
給料			
役員報酬		225,885	196,529
給料・手当		6,121,741	6,190,716
賞与		610,533	601,375
賞与引当金繰入額		989,925	1,566,810
交際費		23,136	25,709
事務委託費		317,928	256,413
旅費交通費		229,248	220,569
租税公課		268,527	282,036
不動産賃借料		622,662	654,286
退職給付費用		423,954	419,884
固定資産減価償却費		384,068	329,756
諸経費		335,840	285,490
一般管理費合計		10,553,451	11,029,580
営業利益		4,509,246	7,379,378
営業外収益			
受取配当金	1	106,651	51,335
受取利息	1	745	520
時効成立分配金・償還金		1,721	2,622
原稿・講演料		1,474	894
雑収入		12,592	10,669
営業外収益合計		123,184	66,042
営業外費用			
為替差損		9,737	5,125
雑損失		1,084	913
営業外費用合計		10,821	6,038
経常利益		4,621,608	7,439,383
特別利益			
投資有価証券償還益		353,462	61,842
投資有価証券売却益		2,579	30,980
特別利益合計		356,041	92,822
特別損失			
固定資産除却損	2	8,157	354,695
投資有価証券償還損		43,644	141,666
投資有価証券売却損		15,012	9,634
ゴルフ会員権売却損		3,894	-
事務所移転費用		21,175	-
特別損失合計		91,884	505,996
税引前当期純利益		4,885,765	7,026,209
法人税、住民税及び事業税		1,391,996	2,350,891
法人税等調整額		25,454	280,166
法人税等合計		1,366,541	2,070,725
当期純利益		3,519,223	4,955,483

## （ 3 ） 【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日）

（単位：千円）

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

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

当事業年度（自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日）

（単位：千円）

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

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価証券 評価差額金	評価・換算差 額等合計	
当期首残高	327,116	327,116	36,270,379
当期変動額			
剰余金の配当			1,887,480
当期純利益			4,955,483
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	543,419	543,419	543,419
当期変動額合計	543,419	543,419	3,611,423
当期末残高	870,535	870,535	39,881,802

## [注記事項]

### (重要な会計方針)

#### 1. 有価証券の評価基準及び評価方法

##### (1) 満期保有目的の債券

償却原価法

##### (2) 子会社株式及び関連会社株式

移動平均法による原価法

##### (3) その他有価証券

時価のあるもの

決算日の市場価格等に基づく時価法

（評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定）

時価のないもの

移動平均法による原価法

#### 2. 固定資産の減価償却の方法

##### (1) 有形固定資産

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

なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。

建物	3～50年
器具備品	3～20年

##### (2) 無形固定資産

定額法によっております。

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

#### 3. 引当金の計上基準

##### (1) 賞与引当金

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

##### (2) 退職給付引当金

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

退職給付見込額の期間帰属方法

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

数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法

過去勤務費用については、その発生時において一時に費用処理しております。

数理計算上の差異については、その発生時において一時に費用処理しております。

#### 4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

##### 消費税等の会計処理

消費税等の会計処理は税抜方式によっております。

#### (貸借対照表関係)

##### 1 有形固定資産の減価償却累計額

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

##### 2 当社は、運転資金の効率的な調達を行うため取引銀行1行と当座借越契約を締結しております。

当事業年度末における当座借越契約に係る借入金未実行残高等は次のとおりであります。

	前事業年度 (平成29年3月31日)	当事業年度 (平成30年3月31日)
当座借越極度額の総額	10,000,000千円	10,000,000千円
借入実行残高	-千円	-千円
差引額	10,000,000千円	10,000,000千円

##### 3 保証債務

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

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

#### (損益計算書関係)

##### 1 関係会社との取引に係るものが次のとおり含まれております。

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

##### 2 固定資産除却損

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

#### (株主資本等変動計算書関係)



前事業年度(自 平成28年 4月 1日 至 平成29年 3月31日)

## 1.発行済株式数に関する事項

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

## 2.剰余金の配当に関する事項

## (1)配当金支払額等

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

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

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

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

当事業年度(自 平成29年 4月 1日 至 平成30年 3月31日)

## 1.発行済株式数に関する事項

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

## 2.剰余金の配当に関する事項

## (1)配当金支払額等

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

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

平成30年 6月26日開催の第33回定時株主総会において次の通り付議いたします。

決議	株式の種類	配当の原資	配当金の総額 (千円)	一株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
平成30年 6月26日 定時株主総会	普通株式	利益剰余金	2,822,400	160,000	平成30年 3月31日	平成30年 6月27日

(リース取引関係)

オペレーティング・リース取引

(借主側)

オペレーティング・リース取引のうち解約不能のものに係る未経過リース料

(単位：千円)

	前事業年度 (平成29年 3月31日)	当事業年度 (平成30年 3月31日)
1年以内	626,698	208,187
1年超	191,491	42,916
合計	818,190	251,104

## (金融商品関係)

## 1.金融商品の状況に関する事項

## (1)金融商品に対する取組方針

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

## (2)金融商品の内容及びそのリスク

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

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

営業債務である未払手数料は、すべて1年以内の支払期日であります。

## (3)金融商品に係るリスク管理体制

## 信用リスクの管理

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

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

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

## 市場リスクの管理

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

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

## (4)金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

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

## 2.金融商品の時価等に関する事項

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

前事業年度（平成29年3月31日）

（単位：千円）

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

(1)現金及び預金	13,279,384	13,279,384	-
(2)顧客分別金信託	20,008	20,008	-
(3)未収委託者報酬	5,511,715	5,511,715	-
(4)未収運用受託報酬	1,297,104	1,297,104	-
(5)未収投資助言報酬	343,523	343,523	-
(6)投資有価証券 その他有価証券	12,098,074	12,098,074	-
(7)長期差入保証金	677,681	677,681	-
資産計	33,227,492	33,227,492	-
(1)顧客からの預り金	304	304	-
(2)未払手数料	2,424,318	2,424,318	-
負債計	2,424,622	2,424,622	-

当事業年度（平成30年3月31日）

（単位：千円）

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

（注1）金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

#### 資 産

(1)現金及び預金、(2)顧客分別金信託、(3)未収委託者報酬、(4)未収運用受託報酬、及び(5)未収投資助言報酬  
これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっています。

(6)投資有価証券

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

(7)長期差入保証金

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

#### 負 債

(1)顧客からの預り金、(2)未払手数料

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

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

（単位：千円）

	前事業年度 （平成29年3月31日）	当事業年度 （平成30年3月31日）
その他有価証券 非上場株式	298	298
合計	298	298

子会社株式及び関連会社株式 非上場株式	10,412,523	10,412,523
合計	10,412,523	10,412,523

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

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

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

（単位：千円）

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

当事業年度（平成30年3月31日）

（単位：千円）

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

(有価証券関係)

1. 子会社株式及び関連会社株式

前事業年度（平成29年3月31日）

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

当事業年度（平成30年3月31日）

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

2. その他有価証券

前事業年度（平成29年3月31日）

（単位：千円）

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

合計	12,098,074	11,626,589	471,485
----	------------	------------	---------

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

当事業年度(平成30年3月31日)

(単位:千円)

区分	貸借対照表計上額	取得原価	差額
(1)貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの 投資信託等	7,366,669	6,046,232	1,320,437
小計	7,366,669	6,046,232	1,320,437
(2)貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの 投資信託等	3,249,626	3,315,328	65,701
小計	3,249,626	3,315,328	65,701
合計	10,616,296	9,361,560	1,254,735

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

### 3. 事業年度中に売却したその他有価証券

前事業年度(自平成28年4月1日至平成29年3月31日)

(単位:千円)

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

当事業年度(自平成29年4月1日至平成30年3月31日)

(単位:千円)

売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
532,099	30,980	9,634

(退職給付関係)

#### 1. 採用している退職給付制度の概要

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

#### 2. 確定給付制度

##### (1)退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

(単位:千円)

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

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

(単位:千円)

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

未認識過去勤務費用	-	-
退職給付引当金	3,177,131	3,319,830

## (3)退職給付費用及びその内訳項目の金額

(単位：千円)

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

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

## (4)数理計算上の計算基礎に関する事項

主要な数理計算上の計算基礎(加重平均で表わしております。)

	前事業年度 (自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)	当事業年度 (自平成29年4月1日 至平成30年3月31日)
割引率	0.092%	0.000%

## 3.確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、前事業年度137,310千円、当事業年度147,195千円であります。

## (税効果会計関係)

## 1.繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

(単位：千円)

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

繰延税金資産小計	1,018,544	1,065,256
評価性引当額	2,597	2,597
繰延税金資産合計	1,015,946	1,062,659
繰延税金負債		
その他有価証券評価差額金	144,368	384,200
繰延税金負債合計	144,368	384,200
繰延税金資産の純額	1,354,113	1,394,447

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

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

(セグメント情報等)

前事業年度(自平成28年4月1日至平成29年3月31日)

1. セグメント情報

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

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

2. 関連情報

(1) 製品及びサービスごとの情報

(単位：千円)

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

(2) 地域ごとの情報

営業収益

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

有形固定資産

本邦に所在している有形固定資産の金額が貸借対照表の有形固定資産の金額の90%を超えるため、地域ごとの有形

固定資産の記載を省略しております。

(3)主要な顧客ごとの情報

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

3.報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

該当事項はありません。

4.報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

該当事項はありません。

5.報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

該当事項はありません。

当事業年度(自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)

1.セグメント情報

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

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

2.関連情報

(1)製品及びサービスごとの情報

(単位：千円)

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

(2)地域ごとの情報

営業収益

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

有形固定資産

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

(3)主要な顧客ごとの情報

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

3.報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

該当事項はありません。

4.報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

該当事項はありません。

5.報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

該当事項はありません。

(関連当事者情報)

前事業年度(自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)



## 1. 関連当事者との取引

## (1) 子会社及び関連会社等

(単位：千円)

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

(注) 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

## (2) 兄弟会社等

(単位：千円)

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

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

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

投信の販売委託については、一般取引条件を基に、協議の上決定しております。

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

4. SMBC日興証券㈱の属性が、平成28年10月1日付けで、「その他の関係会社の子会社」より「親会社の子会社」に異動となりました。

なお、取引金額の中には、「その他の関係会社の子会社」であった期間の取引金額が含まれております。

## 2. 親会社に関する注記

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

当事業年度(自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)

## 1. 関連当事者との取引

## (1) 兄弟会社等

(単位：千円)

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金、出資金又は基金	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額	科目	期末残高
親会社の子会社	㈱三井住友銀行	東京都千代田区	1,770,996,505	銀行業	% -	投信の販売 委託 役員の兼任	委託販売 手数料	2,761,066	未払 手数料	429,436
親会社の子会社	SMBC日興証券㈱	東京都千代田区	10,000,000	証券業	% -	投信の販売 委託 役員の 兼任	委託販売 手数料	5,685,815	未払 手数料	953,752

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

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

投信の販売委託については、一般取引条件を基に、協議の上決定しております。

## 2. 親会社に関する注記

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

## (1株当たり情報)

	前事業年度 (自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)	当事業年度 (自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)
1株当たり純資産額	2,056,143.98円	2,260,873.18円
1株当たり当期純利益金額	199,502.47円	280,923.11円

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

2. 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

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

## (重要な後発事象)

前事業年度(自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)

該当事項はありません。

当事業年度(自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)

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

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

## 中間財務諸表

## (1)中間貸借対照表

(単位：千円)

第34期中間会計期間 (平成30年9月30日)	
資産の部	
流動資産	
現金及び預金	19,085,678
顧客分別金信託	20,010
前払費用	414,616
未収委託者報酬	7,225,367
未収運用受託報酬	1,541,190
未収投資助言報酬	306,565
未収収益	51,614
その他	53,465
流動資産合計	28,698,508
固定資産	
有形固定資産	1 508,186
無形固定資産	437,397
投資その他の資産	
投資有価証券	9,519,317

関係会社株式		10,412,523
繰延税金資産		1,364,662
その他		1,500,406
投資その他の資産合計		22,796,910
固定資産合計		23,742,493
資産合計		52,441,002
負債の部		
流動負債		
顧客からの預り金		649
その他の預り金		116,730
未払金		3,491,463
未払費用		3,428,351
未払法人税等		1,080,277
前受収益		8,509
賞与引当金		1,233,571
その他	2	228,340
流動負債合計		9,587,893
固定負債		
退職給付引当金		3,435,254
賞与引当金		41,631
その他		1,383
固定負債合計		3,478,268
負債合計		13,066,162
純資産の部		
株主資本		
資本金		2,000,000
資本剰余金		
資本準備金		8,628,984
資本剰余金合計		8,628,984
利益剰余金		
利益準備金		284,245
その他利益剰余金		
配当準備積立金		60,000
別途積立金		1,476,959
繰越利益剰余金		26,222,740
利益剰余金合計		28,043,944
株主資本合計		38,672,928
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金		701,911
評価・換算差額等合計		701,911
純資産合計		39,374,840
負債純資産合計		52,441,002

## (2)中間損益計算書

(単位：千円)

		第34期中間会計期間 (自 平成30年 4月 1日 至 平成30年 9月30日)	
営業収益			
委託者報酬			20,003,107
運用受託報酬			3,216,910
投資助言報酬			696,543
その他の営業収益			117,677
営業収益計			24,034,239
営業費用			15,495,987
一般管理費	1		5,200,633
営業利益			3,337,618
営業外収益	2		13,622
営業外費用	3		10,296
経常利益			3,340,944
特別利益	4		293,441
特別損失	5		35,355
税引前中間純利益			3,599,031
法人税、住民税及び事業税			1,010,764
法人税等調整額			104,205
法人税等合計			1,114,969
中間純利益			2,484,061

## (3)中間株主資本等変動計算書

第34期中間会計期間（自 平成30年 4月 1日 至 平成30年 9月30日）

(単位：千円)

	株主資本								株主資本合計
	資本金	資本剰余金		利益準備金	利益剰余金			利益剰余金 合計	
		資本準備金	資本剰余金 合計		その他利益剰余金				
					配当準備積立金	別途積立金	繰越利益剰余金		
当期首残高	2,000,000	8,628,984	8,628,984	284,245	60,000	1,476,959	26,561,078	28,382,283	39,011,267
当中間期変動額									
剰余金の配当							2,822,400	2,822,400	2,822,400
中間純利益							2,484,061	2,484,061	2,484,061
株主資本以外の項目の 当中間期変動額（純額）									
当中間期変動額合計	-	-	-	-	-	-	338,338	338,338	338,338
当中間期末残高	2,000,000	8,628,984	8,628,984	284,245	60,000	1,476,959	26,222,740	28,043,944	38,672,928

	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	870,535	870,535	39,881,802
当中間期変動額			

剰余金の配当			2,822,400
中間純利益			2,484,061
株主資本以外の項目の 当中間期変動額（純額）	168,624	168,624	168,624
当中間期変動額合計	168,624	168,624	506,962
当中間期末残高	701,911	701,911	39,374,840

## 注記事項

### （重要な会計方針）

#### 1．資産の評価基準及び評価方法

##### (1)有価証券

子会社株式及び関連会社株式

移動平均法による原価法

その他有価証券

時価のあるもの

中間会計期間末日の市場価格等に基づく時価法

（評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定）

時価のないもの

移動平均法による原価法

#### 2．固定資産の減価償却の方法

##### (1)有形固定資産

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

なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。

建物 3～50年

器具備品 3～20年

##### (2)無形固定資産

定額法によっております。

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

#### 3．引当金の計上基準

##### (1)賞与引当金

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

##### (2)退職給付引当金

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

退職給付見込額の期間帰属方法

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

数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法

過去勤務費用については、その発生時において一時に費用処理しております。

数理計算上の差異については、その発生時において一時に費用処理しております。

#### 4．その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項

消費税等の会計処理

消費税等の会計処理は税抜方式によっております。

### （表示方法の変更）

「税効果会計に係る会計基準」の一部改正（企業会計基準第28号 平成30年2月16日）を当中間会計期間の期首から適用し、繰延税金資産は投資その他の資産の区分に表示し、繰延税金負債は固定負債の区分に表示する方法に変更しております。

### （中間貸借対照表関係）

第34期中間会計期間 (平成30年9月30日)	
1.有形固定資産の減価償却累計額	1,162,157千円
2.消費税等の取扱い 仮払消費税等及び仮受消費税等は、相殺のうえ、金額的重要性が乏しいため、流動負債のその他に含めて表示しております。	
3.当社は、運転資金の効率的な調達を行うため取引銀行1行と当座借越契約を締結しております。当中間会計期間末における当座借越契約に係る借入金未実行残高等は次のとおりであります。 当座借越極度額の総額 10,000,000千円 借入実行残高 - 差引額 10,000,000千円	
4.当社は、子会社であるSumitomo Mitsui Asset Management(New York) Inc.における賃貸借契約に係る賃借料に対し、平成35年6月までの賃借料総額198,989千円の支払保証を行っております。	

## (中間損益計算書関係)

第34期中間会計期間 (自平成30年4月1日至平成30年9月30日)	
1.減価償却実施額 有形固定資産 80,772千円 無形固定資産 84,457千円	
2.営業外収益のうち主要なもの 雑益 13,281千円	
3.営業外費用のうち主要なもの 為替差損 10,293千円	
4.特別利益のうち主要なもの 投資有価証券償還益 289,451千円 投資有価証券売却益 3,990千円	
5.特別損失のうち主要なもの 合併関連費用 23,103千円 合併関連費用は、当社と大和住銀投信投資顧問株式会社との合併に関する業務委託費用等 あります。 投資有価証券売却損 12,101千円	

## (中間株主資本等変動計算書関係)

第34期中間会計期間(自平成30年4月1日至平成30年9月30日)

## 1.発行済株式数に関する事項

	当事業年度期首 株式数	当中間会計期間 増加株式数	当中間会計期間 減少株式数	当中間会計期間末 株式数
普通株式	17,640株	-	-	17,640株

## 2.剰余金の配当に関する事項

決議	株式の種類	配当金の総額 (千円)	一株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
平成30年6月26日 定時株主総会	普通株式	2,822,400	160,000	平成30年 3月31日	平成30年 6月27日

## (リース取引関係)

第34期中間会計期間 (自平成30年4月1日至平成30年9月30日)	
1.オペレーティング・リース取引 (借主側) 未経過リース料(解約不能のもの)	
1年以内	595,231千円
1年超	3,853,814千円
合計	4,449,045千円

## (金融商品関係)

## 1.金融商品の時価等に関する事項

第34期中間会計期間（平成30年9月30日）

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

（単位：千円）

区分	中間貸借対照表計上額	時価	差額
(1)現金及び預金	19,085,678	19,085,678	-
(2)顧客分別金信託	20,010	20,010	-
(3)未収委託者報酬	7,225,367	7,225,367	-
(4)未収運用受託報酬	1,541,190	1,541,190	-
(5)未収投資助言報酬	306,565	306,565	-
(6)投資有価証券 其他有価証券	9,519,019	9,519,019	-
(7)投資その他の資産 長期差入保証金	1,434,365	1,434,365	-
資産計	39,132,197	39,132,197	-
(1)顧客からの預り金	649	649	-
(2)未払金 未払手数料	3,310,988	3,310,988	-
負債計	3,311,637	3,311,637	-

（注1）金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

#### 資 産

(1)現金及び預金、(2)顧客分別金信託、(3)未収委託者報酬、(4)未収運用受託報酬、及び(5)未収投資助言報酬  
これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

(6)投資有価証券

    其他有価証券

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。

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

(7)投資その他の資産

    長期差入保証金

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

#### 負 債

(1)顧客からの預り金、及び(2)未払金 未払手数料

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

（注2）時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

（単位：千円）

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

其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)其他有価証券」には含めておりません。

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

（有価証券関係）

第34期中間会計期間（平成30年9月30日）

1．子会社株式及び関連会社株式

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

2．其他有価証券

区分	中間貸借対照表計上額	取得原価	差額
(1)中間貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの 投資信託等	6,621,299	5,533,700	1,087,599
小計	6,621,299	5,533,700	1,087,599
(2)中間貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの 投資信託等	2,897,719	2,973,628	75,908
小計	2,897,719	2,973,628	75,908
合計	9,519,019	8,507,328	1,011,691

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

（デリバティブ取引関係）

当社は、デリバティブ取引を全く行っておりませんので、該当事項はありません。

（資産除去債務等）

該当事項はありません。

（セグメント情報等）

第34期中間会計期間（自 平成30年4月1日 至 平成30年9月30日）

1. セグメント情報

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

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

2. 関連情報

(1)製品及びサービスごとの情報

（単位：千円）

	委託者報酬	運用受託報酬	投資助言報酬	その他	合計
外部顧客への 営業収益	20,003,107	3,216,910	696,543	117,677	24,034,239

(2)地域ごとの情報

営業収益

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

有形固定資産

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

(3)主要な顧客ごとの情報

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

3. 報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

該当事項はありません。

4. 報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

該当事項はありません。

5. 報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

該当事項はありません。

（1株当たり情報）



第34期中間会計期間 (自 平成30年4月1日 至 平成30年9月30日)	
1株当たり純資産額	2,232円13銭
1株当たり中間純利益	140円81銭
<p>なお、潜在株式調整後1株当たり中間純利益については、潜在株式が存在しないため記載していません。</p> <p>(注)当社は、平成30年11月1日付で普通株式1株につき1,000株の割合で株式分割を行っております。これに伴い、当事業年度の期首に当該株式分割が行われたと仮定して、1株当たり純資産額及び1株当たり中間純利益を算定しております。</p>	
1株当たり純資産額の算定上の基礎	
中間貸借対照表の純資産の部の合計額	39,374,840千円
普通株式に係る純資産額	39,374,840千円
普通株式の発行済株式数	17,640株
1株当たり純資産額の算定に用いられた普通株式の数	17,640,000株
1株当たり中間純利益の算定上の基礎	
中間損益計算書上の中間純利益	2,484,061千円
普通株式に係る中間純利益	2,484,061千円
普通株主に帰属しない金額の主要な内訳	
該当事項はありません。	
普通株式の期中平均株式数	17,640株
1株当たり中間純利益の算定に用いられた普通株式の期中平均株式数	17,640,000株

## (追加情報)

当社と大和住銀投信投資顧問株式会社との間の合併契約の締結について

当社は、平成30年9月28日開催の当社取締役会において、当社と大和住銀投信投資顧問株式会社(以下「大和住銀」)との間で合併契約を締結することについて決議し、同日付で締結しました。また、平成30年10月31日に当社臨時株主総会において当該合併契約の承認を得ております。

## 1. 企業結合の概要

## (1)被取得企業の名称及び事業の内容

被取得企業の名称 大和住銀投信投資顧問株式会社  
事業の内容 投資運用業、投資助言・代理業等

## (2)企業結合を行う主な理由

資産運用ビジネスはグローバルに成長拡大しており、お客さまから求められる運用力やサービスはますます高度化しております。本件合併は、このようなお客さまからのニーズに対応するために、両運用会社の持つ強み・ノウハウを結集した、フィデューシャリー・デューティーに基づく最高品質の運用パフォーマンスとサービスを提供する資産運用会社の実現を図るものであります。

## (3)企業結合日

平成31年4月1日(予定)

## (4)企業結合の法的形式

当社を存続会社とし、大和住銀を消滅会社とする吸収合併方式であります。

## (5)結合後企業の名称

三井住友DSアセットマネジメント株式会社

## (6)取得企業を決定するに至った主な根拠

「企業結合に関する会計基準」(企業会計基準第21号 平成25年9月13日)及び「企業結合会計基準及び事業分離等会計基準に関する適用指針」(企業会計基準適用指針第10号 平成25年9月13日)の考え方に基づき、当社を取得企業とし

ております。

## 2. 合併比率及びその算定方法並びに交付予定の株式数

### (1) 合併比率

大和住銀の普通株式1株に対し、当社の普通株式4,2156株を割当て交付いたします。

### (2) 合併比率の算定方法

当社はEYトランザクション・アドバイザー・サービス株式会社を、大和住銀はPwCアドバイザー合同会社を、合併比率の算定に関する第三者算定機関としてそれぞれ選定し、各第三者算定機関による算定結果を参考に、両社の財務の状況、資産の状況、将来の見通し等の要因を総合的に勘案し、合併比率について慎重に協議を重ねた結果、合併比率が妥当であるとの判断し、合意に至ったものであります。

### (3) 交付予定の株式数

普通株式：16,230,060株

## (重要な後発事象)

### 株式分割

当社は、平成30年9月28日開催の取締役会決議に基づき、平成30年11月1日付で株式分割を行っております。

#### 1. 株式分割の目的

合併に伴い株主の議決権割合が変更となる見込みであり、円滑に変更手続きを行うために株式分割を行っております。

#### 2. 株式分割の概要

##### (1) 分割の方法

平成30年10月31日を基準日として、同日最終の株主名簿に記載された株主の所有する普通株式1株につき、1,000株の割合をもって分割しております。

##### (2) 分割により増加した株式数

株式分割前の発行済株式総数	17,640株
今回の分割により増加した株式数	17,622,360株
株式分割後の発行済株式数	17,640,000株
株式分割後の発行可能株式総数	60,000,000株

##### (3) 株式分割の日程

基準日公告日	平成30年10月12日
基準日	平成30年10月31日
効力発生日	平成30年11月1日

##### (4) 1株当たり情報に及ぼす影響

1株当たり情報に及ぼす影響については、当該箇所に記載しております。

## 4【利害関係人との取引制限】

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

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

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

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

## 5【その他】

### イ 定款の変更、その他の重要事項

(イ) 三井住友アセットマネジメント株式会社は、関係当局の認可等を得ることを前提に、2019年4月1日に大和住銀投信投資顧問株式会社と合併し、商号を三井住友DSアセットマネジメント株式会社に変更する予定です。

(ロ) 2018年11月1日付で、発行可能株式総数を変更する定款の変更を行いました。

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(2018年9月末現在)
- (ハ) 事業の内容 銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

#### 〔参考情報：再信託受託会社の概要〕

- ・ 名称 日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社
- ・ 資本金の額 51,000百万円(2018年9月末現在)
- ・ 事業の内容 銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

#### ロ 販売会社

(イ) 名称	(ロ) 資本金の額	(ハ) 事業の内容
エイチ・エス証券株式会社	3,000百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
S M B C 日興証券株式会社	10,000百万円	
株式会社 S B I 証券	48,323百万円	
カブドットコム証券株式会社	7,196百万円	
松井証券株式会社	11,945百万円	
マネックス証券株式会社	12,200百万円	
楽天証券株式会社	7,495百万円	

住友生命保険相互会社	639,000百万円	保険業法に基づき、生命保険業を営んでいます。
------------	------------	------------------------

資本金の額は、2018年9月末現在。

住友生命保険相互会社の資本金の額の箇所には、基金および基金償却積立金の合計額を記載しております。

## 2【関係業務の概要】

### イ 受託会社

信託契約の受託会社であり、信託財産の保管・管理・計算等を行います。

### ロ 販売会社

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

## 3【資本関係】

販売会社である住友生命保険相互会社は、委託会社株式を3,528,000株（持株比率20.0%）保有しています。

## 第3【その他】

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

**独立監査人の監査報告書**

平成30年6月14日

三井住友アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

## 有限責任 あずさ監査法人

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている三井住友アセットマネジメント株式会社の平成29年4月1日から平成30年3月31日までの第33期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

## 財務諸表に対する経営者の責任

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

## 監査人の責任

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

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

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

## 監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三井住友アセットマネジメント株式会社の平成30年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

## 強調事項

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

当該事項は、当監査法人の意見に影響を及ぼすものではない。

## 利害関係

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

以上

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

**独立監査人の監査報告書**

平成30年5月22日

三井住友アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている三井住友・DCターゲットイヤーファンド2040（4資産タイプ）の平成29年4月14日から平成30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、三井住友・DCターゲットイヤーファンド2040（4資産タイプ）の平成30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。

**独立監査人の中間監査報告書**

平成30年11月22日

三井住友アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「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30年4月1日から平成31年3月31日までの第34期事業年度の中間会計期間（平成30年4月1日から平成30年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

**中間財務諸表に対する経営者の責任**

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

**監査人の責任**

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

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

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

**中間監査意見**

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

**強調事項**

追加情報に記載されているとおり、会社は、平成30年9月28日開催の会社の取締役会において、会社と大和住銀投信投資顧問株式会社との間で合併契約を締結することについて決議し、同日付で締結した。また、平成30年10月31日に会社の臨時株主総会において当該合併契約の承認を得ている。

当該事項は、当監査法人の意見に影響を及ぼすものではない。

**利害関係**

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

以上

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

**独立監査人の中間監査報告書**

平成30年11月27日

三井住友アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている三井住友・DCターゲットイヤーファンド2040（4資産タイプ）の平成30年4月14日から平成30年10月13日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

**中間財務諸表に対する経営者の責任**

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

**監査人の責任**

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

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

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

**中間監査意見**

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、三井住友・DCターゲットイヤーファンド2040（4資産タイプ）の平成30年10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中間計算期間（平成30年4月14日から平成30年10月13日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

**利害関係**

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

以上

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