

**【表紙】**

【提出書類】	有価証券報告書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	平成29年7月13日提出
【計算期間】	第9期(自 平成28年4月14日至 平成29年4月13日)
【ファンド名】	三井住友・DCターゲットイヤーファンド2040(4資産タイプ)
【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
【連絡場所】	東京都港区愛宕二丁目5番1号
【電話番号】	03-5405-0740
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

## 第一部【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】

平成20年 3月31日	信託契約締結、設定、運用開始。
平成29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。

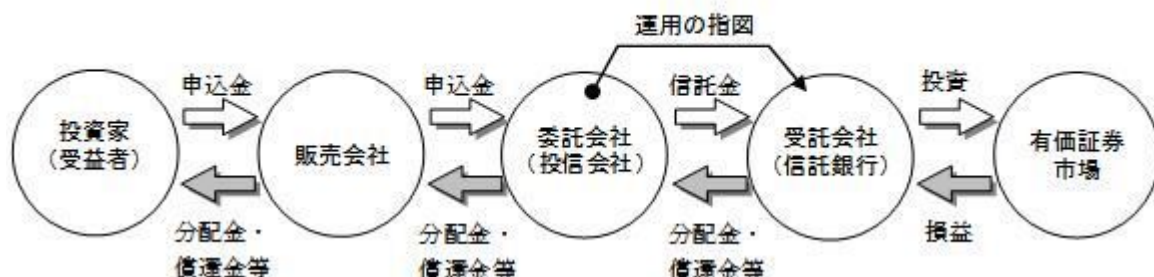
（ロ）受託会社 「三井住友信託銀行株式会社」

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、その業務を行うに充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。

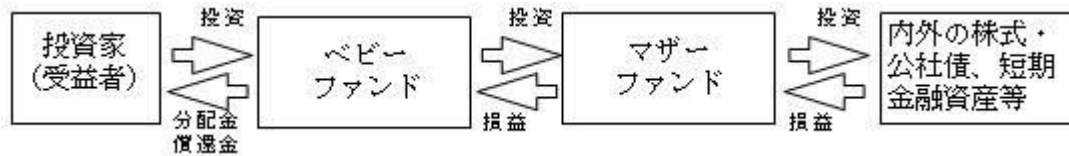
### 運営の仕組み



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（平成29年 4月28日現在）

### (ロ) 会社の沿革

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

### (ハ) 大株主の状況

（平成29年 4月28日現在）

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

## 2【投資方針】

### (1)【投資方針】

「(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。

[平成29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
30.5%	22.0%	20.0%	25.5%	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。

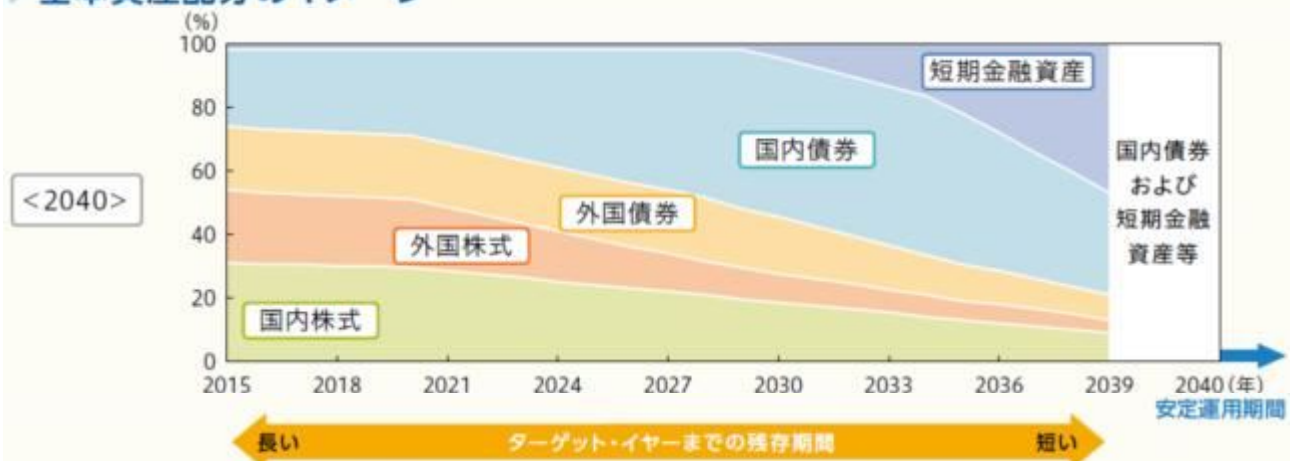
※資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

## 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。



## ▶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には、安定運用期間に向けて、順次、国内株式、外国株式および外国債券への配分を低減していきます。また、現時点で予定している基本資産配分をもとに作成したイメージ図であり、将来、実際に上記の通りの運用を行うことを保証するものではありません。

## 各マザーファンドの運用プロセス

### ▶国内株式インデックス・マザーファンド(B号)

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

### ▶国内債券パッシブ・マザーファンド

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

### ▶外国株式インデックス・マザーファンド

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



#### 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変離のことをいいます。

#### 層化抽出法とは

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



## ▶外国債券パッシブ・マザーファンド

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

## ▶マネーインカム・マザーファンド

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

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

### (2) 【投資対象】

#### イ 投資対象とする資産の種類

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

(イ) 次に掲げる特定資産（投資信託及び投資法人に関する法律第2条第1項の「特定資産」をいいます。以下同じ。）

1. 有価証券
2. デリバティブ取引にかかる権利
3. 約束手形
4. 金銭債権

(ロ) 特定資産以外の資産で、以下に掲げる資産

1. 為替手形

#### ロ 投資対象とする有価証券

委託会社は、信託金を、主として、マザーファンド受益証券および次の有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図します。

1. 株券または新株引受権証書
2. 国債証券
3. 地方債証券
4. 特別の法律により法人の発行する債券
5. 社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
6. 特定目的会社にかかる特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
7. 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。）
8. 協同組織金融機関にかかる優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。）
9. 特定目的会社にかかる優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券（金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。）

10. コマーシャル・ペーパー
  11. 新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）および新株予約権証券
  12. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前各号の証券または証書の性質を有するもの
  13. 投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）
  14. 投資証券もしくは投資法人債券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）
  15. 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
  16. オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券にかかるものに限ります。）
  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。

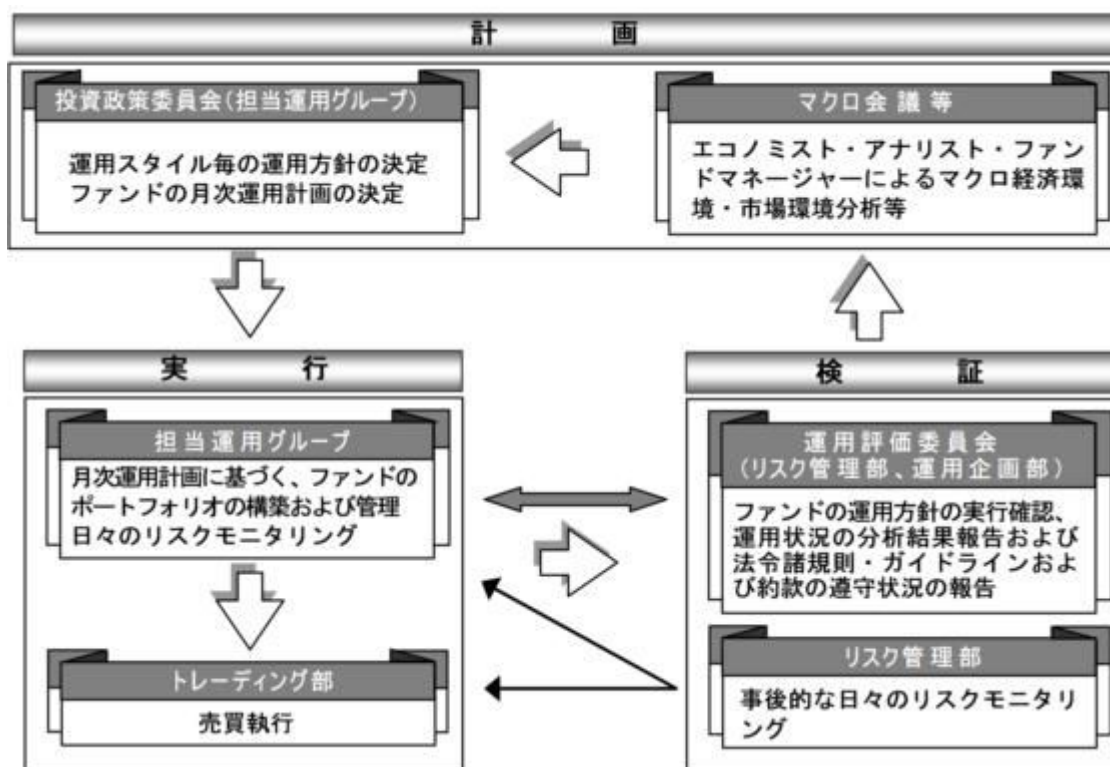
売買執行については、組織的に分離されたトレーディング部が、最良と思われる手法をもって売買を執行します。

#### （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12名程度、運用企画部は8名程度で構成されています。

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

#### □ 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 同一銘柄の株式への実質投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の10%以下とします。
- ヘ 同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- ト 同一銘柄の転換社債および転換社債型新株予約権付社債への実質投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の10%以下とします。

ファンドの信託約款に基づくその他の投資制限

- イ 投資する株式等の範囲
  - （イ）委託会社が投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、取引所に上場している株式の発行会社の発行するもの、取引所に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。
  - （ロ）上記（イ）にかかわらず、上場予定または登録予定の株式、新株引受権証券および新株予約権証券で目論見書等において上場または登録することが確認できるものについては委託会社が投資することを指図することができるものとします。
- ロ 信用取引の指図
  - （イ）委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売り付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、株券の引渡しまたは買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。
  - （ロ）信用取引の指図は、当該売付けにかかる建玉の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する当該売付けにかかる建玉の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
  - （ハ）上記（ロ）において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める当該売付けにかかる建玉の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
  - （ニ）信託財産の一部解約等の事由により、上記（ロ）の売付けにかかる建玉の時価総額の合計額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する売付けの一部を決済するための指図をするものとします。
- ハ 先物取引等の指図
  - （イ）委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクを回避するため、わが国の取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第

3号口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号八に掲げるものをいいます。)ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めて取り扱うものとします(以下同じ。)

- (ロ) 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、わが国の取引所における通貨にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。
- (ハ) 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクを回避するため、わが国の取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。

## ニ スワップ取引の指図

- (イ) 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引(以下「スワップ取引」といいます。)を行うことの指図をすることができます。
- (ロ) スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- (ハ) スワップ取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の合計額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記純資産総額が減少して、スワップ取引の想定元本の合計額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当するスワップ取引の一部の解約を指図するものとします。
- (ニ) スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額により行うものとします。
- (ホ) 委託会社は、スワップ取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

## ホ 金利先渡取引および為替先渡取引の指図

- (イ) 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことの指図をすることができます。
- (ロ) 金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- (ハ) 金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかる金利先渡取引および為替先渡取引の想定元本の合計額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記純資産総額が減少して、金利先渡取引および為替先渡取引の想定元本の合計額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する金利先渡取引および為替先渡取引の一部の解約を指図するものとします。
- (ニ) 金利先渡取引および為替先渡取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額により行うものとします。
- (ホ) 委託会社は、金利先渡取引および為替先渡取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。
- (ヘ) 「金利先渡取引」とは、当事者間において、あらかじめ将来の特定の日(以下「決済日」といいます。)における決済日から一定の期間を経過した日(以下「満期日」といいます。)までの期間にかかる国内または海外において代表的利率として公表される預金契約または金銭の貸借契約に基づく債権の利率(以下「指標利率」といいます。)の数値を取り決め、その取決め

にかかる数値と決済日における当該指標利率の現実の数値との差にあらかじめ元本として定めた金額および当事者間で約定した日数を基準とした数値を乗じた額を決済日における当該指標利率の現実の数値で決済日における現在価値に割り引いた額の金銭の授受を約する取引をいいます。

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

#### 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、わが国の国際収支上の理由等により特に必要と認められる場合には、制約されることがあります。

#### ヌ 外国為替予約取引の指図

- (イ) 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、ならびに信託財産に属する資産の為替変動リスクを回避するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。
- (ロ) 上記(イ)の予約取引の指図は、信託財産にかかる為替の買予約の合計額と売予約の合計額との差額につき円換算した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、信託財産に属する外貨建資産（マザーファンドの信託財産に属する外貨建資産のうち信託財産に属するとみなした額を含みます。）の為替変動リスクを回避するためにする当該予約取引の指図については、この限りではありません。
- (ハ) 上記(ロ)の限度額を超えることとなった場合には、委託会社は所定の期間内に、その超える額に相当する為替予約の一部を解消するための外国為替の売買の予約取引の指図をするものとします。
- (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。

(参考情報:マザーファンドの投資方針等)

(国内株式インデックス・マザーファンド(B号))

(1)投資方針等

イ 基本方針

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

ロ 投資態度

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

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

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

(2)投資対象

イ 投資対象とする資産の種類

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

ロ 投資対象とする有価証券

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

ハ 投資対象とする金融商品

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

(3)投資制限

イ ファンドの信託約款に基づく主要な投資制限

(イ)外貨建資産への投資は行いません。

(ロ)株式への投資割合には制限を設けません。

(国内債券パッシブ・マザーファンド)

(1)投資方針等

イ 基本方針

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

ロ 投資態度

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

(ロ)公社債の組入比率は原則として高位を保ちます。

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



## （２）投資対象

### イ 投資対象とする資産の種類

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

### ロ 投資対象とする有価証券

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

### ハ 投資対象とする金融商品

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

## （３）投資制限

### イ ファンドの信託約款に基づく主要な投資制限

- （イ）株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。
- （ロ）新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。
- （ハ）投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。
- （ニ）外貨建資産への投資は行いません。
- （ホ）同一銘柄の転換社債および転換社債型新株予約権付社債への投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の10%以内とします。

## （外国株式インデックス・マザーファンド）

### （１）投資方針等

#### イ 基本方針

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

#### ロ 投資態度

- （イ）主として世界各国の株式に投資し、MSCIコクサイインデックス（円ベース）と連動する投資成果を目指して運用を行います。
- （ロ）外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行わないものとします。
- （ハ）株価指数先物取引等を含む株式の実質組入比率は、原則として高位を保ちます。ただし、資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

### （２）投資対象

#### イ 投資対象とする資産の種類

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

#### ロ 投資対象とする有価証券

前記「２ 投資方針 （２）投資対象 ロ 投資対象とする有価証券」において記載したベビーファンドが投資対象とする有価証券の各号のうち、第1号、第2号、第4号、第5号、第10号から第21号に掲げるものに投資します（ただし、第14号に掲げるもののうち投資法人債券を除きます。）。

#### ハ 投資対象とする金融商品

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

### （３）投資制限

- イ ファンドの信託約款に基づく主要な投資制限
- (イ) 株式への投資割合には制限を設けません。
- (ロ) 外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

### (外国債券パッシブ・マザーファンド)

#### (1) 投資方針等

##### イ 基本方針

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

##### ロ 投資態度

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

#### (2) 投資対象

##### イ 投資対象とする資産の種類

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

##### ロ 投資対象とする有価証券

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

##### ハ 投資対象とする金融商品

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

#### (3) 投資制限

##### イ ファンドの信託約款に基づく主要な投資制限

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

## （マネーインカム・マザーファンド）

### （１）投資方針等

#### イ 基本方針

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

#### ロ 投資態度

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

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

### （２）投資対象

#### イ 投資対象とする資産の種類

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

#### ロ 投資対象とする有価証券

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

#### ハ 投資対象とする金融商品

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

### （３）投資制限

#### イ ファンドの信託約款に基づく主要な投資制限

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

（ロ）投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

（ハ）外貨建資産への投資は行いません。

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

## 3【投資リスク】

### イ ファンドのもつリスクの特性

当ファンドは、主に内外の株式、債券および短期金融資産を投資対象としています（マザーファンドを通じて間接的に投資する場合を含みます。）。当ファンドの基準価額は、組み入れた株式や債券等の値動き、当該発行者の経営・財務状況の変化、為替相場の変動等の影響により上下します。基準価額の下落により損失を被り、投資元本を割り込むことがあります。

運用の結果としてファンドに生じた利益および損失は、すべて受益者に帰属します。したがって、当ファンドは預貯金とは異なり、投資元本が保証されているものではなく、一定の投資成果を保証するものでもありません。また、当ファンドは、預貯金や保険契約と異なり、預金保険、貯金保険、保険契約者保護機構の保護の対象ではありません。登録金融機関は、投資者保護基金には加入していません。

当ファンドが有するリスク等（当ファンドが主要投資対象とするマザーファンドへの投資を通じて間接的に受ける実質的なリスク等を含みます。）のうち主要なものは、以下の通りです。

#### （イ）株式市場リスク

内外の政治、経済、社会情勢等の影響により株式相場が下落した場合、ファンドの基準価額が下落する要因となります。また、個々の株式の価格はその発行企業の事業活動や財務状況、これらに対する外部的評価の変化等によって変動し、ファンドの基準価額が下落する要因となります。特に、企業が倒産や大幅な業績悪化に陥った場合、当該企業の株式の価値が大きく下落

し、基準価額が大きく下落する要因となります。

(ロ) 債券市場リスク

内外の政治、経済、社会情勢等の影響により債券相場が下落（金利が上昇）した場合、ファンドの基準価額が下落する要因となります。また、ファンドが保有する個々の債券については、下記「信用リスク」を負うことにもなります。

(ハ) 信用リスク

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

(ニ) 為替変動リスク

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

(ホ) カントリーリスク

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

(ヘ) 市場流動性リスク

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

(ト) ファミリーファンド方式にかかる留意点

当ファンドは「ファミリーファンド方式」により運用するため、当ファンドと同じマザーファンドを投資対象とする他のベビーファンドに追加設定・一部解約により資金の流出入が生じた場合、その結果として、当該マザーファンドにおいても組入有価証券の売買等が生じ、当ファンドの基準価額に影響を及ぼすことがあります。

(チ) 換金制限等に関する留意点

投資資産の市場流動性が低下することにより投資資産の取引等が困難となった場合は、ファンドの換金申込みの受け付けを中止すること、および既に受け付けた換金申込みを取り消すことがあります。

(リ) 収益分配金に関する留意事項

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



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

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

## ロ 投資リスクの管理体制

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

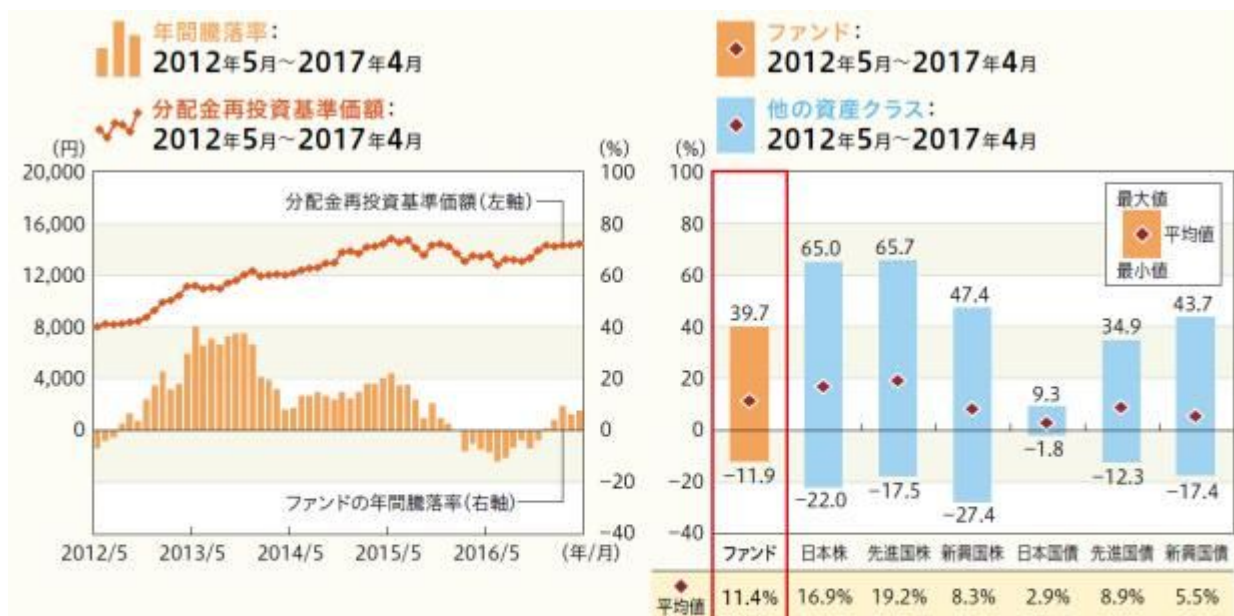
### （参考情報）投資リスクの定量的比較

#### 「ファンドの年間騰落率および 分配金再投資基準価額の推移」

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。

#### 「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。



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

※分配実績がない場合は、分配金再投資基準価額は基準価額と同じです。

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

※すべての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。

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

※海外の指数は、為替ヘッジなしによる投資を想定して、円ベースとしています。

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

## 4【手数料等及び税金】

## (1)【申込手数料】

無手数料です。

## (2)【換金（解約）手数料】

解約手数料はありません。

## (3)【信託報酬等】

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

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

信託報酬 = 運用期間中の基準価額 × 信託報酬率

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ついては、各販売会社毎に個別元本の算出が行われます。また、同一販売会社であっても同一受益者の顧客口座が複数存在する場合や、「分配金受取りコース」と「分配金自動再投資コース」を併用するファンドの場合には、別々に個別元本の算出が行われることがあります。
- (ハ) 受益者が元本払戻金(特別分配金)を受け取った場合、収益分配金発生時にその個別元本から当該元本払戻金(特別分配金)を控除した額が、その後の当該受益者の個別元本となります。(「元本払戻金(特別分配金)」については、下記の(収益分配金の課税について)を参照。)

### ロ 一部解約時および償還時の課税について

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

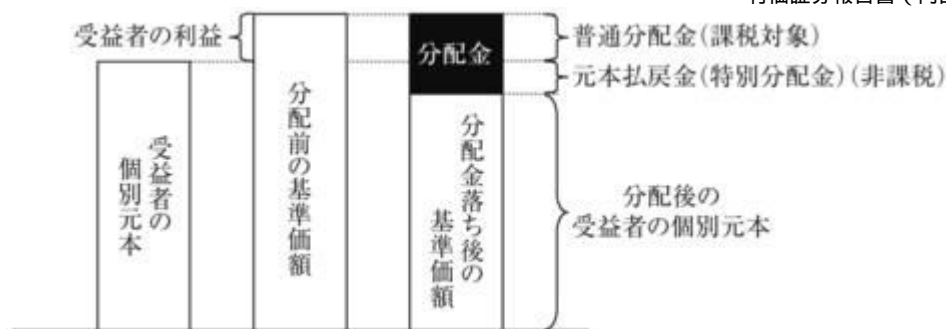
### ハ 収益分配金の課税について

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

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



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



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

## 二 個人、法人別の課税の取扱いについて

### (イ) 個人の受益者に対する課税

#### ・収益分配時

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

#### ・一部解約時および償還時

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

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

### (ロ) 法人の受益者に対する課税

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

当ファンドは、課税上は株式投資信託として取り扱われます。

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

なお、当ファンドは、配当控除の適用はありません。

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

当ファンドの外貨建資産割合および非株式割合

外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の70%以下とします。

非株式割合に関する制限はありません（約款規定なし）。

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

上記「(5)課税上の取扱い」ほか税制に関する本書の記載は、平成29年4月末現在の情報をもとに作成しています。税法の改正等により、変更されることがあります。



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

## 5【運用状況】

### (1)【投資状況】

三井住友・DCターゲットイヤーファンド2040(4資産タイプ)

平成29年 4月28日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
親投資信託受益証券	日本	245,073,553	99.02
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		2,429,873	0.98
合計(純資産総額)		247,503,426	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

平成29年 4月28日現在

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	投資 比率 (%)
日本	親投資信託受益証券	国内株式インデックス・マザーファンド(B号)	32,536,448	2.2090	71,875,033	2.3044	74,976,990	30.29
日本	親投資信託受益証券	国内債券バッシブ・マザーファンド	49,417,435	1.2552	62,029,440	1.2565	62,093,007	25.09
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	17,977,345	2.9031	52,191,670	3.0287	54,447,984	22.00
日本	親投資信託受益証券	外国債券バッシブ・マザーファンド	29,342,953	1.6236	47,643,448	1.6744	49,131,840	19.85
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	4,373,438	1.0114	4,423,731	1.0115	4,423,732	1.79

以上が、当ファンドが保有する有価証券のすべてです。

#### ロ 種類別の投資比率

平成29年 4月28日現在

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	99.02
合計	99.02

## 【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 (平成21年 4月13日)	789,754	789,754	7,898	7,898
第2期 (平成22年 4月13日)	921,372	921,372	9,072	9,072
第3期 (平成23年 4月13日)	3,130,163	3,130,163	8,674	8,674
第4期 (平成24年 4月13日)	20,230,023	20,230,023	8,618	8,618
第5期 (平成25年 4月15日)	10,961,140	10,961,140	11,020	11,020
第6期 (平成26年 4月14日)	17,867,281	17,867,281	11,765	11,765
第7期 (平成27年 4月13日)	81,578,616	81,578,616	14,379	14,379
第8期 (平成28年 4月13日)	178,916,663	178,916,663	13,267	13,267
第9期 (平成29年 4月13日)	236,077,626	236,077,626	14,009	14,009
平成28年 4月末日	181,876,972		13,408	
5月末日	191,123,219		13,594	
6月末日	181,342,413		12,787	
7月末日	192,155,478		13,212	
8月末日	194,671,198		13,170	
9月末日	198,240,130		13,061	
10月末日	206,825,807		13,321	
11月末日	220,221,315		13,899	
12月末日	226,538,270		14,307	
平成29年 1月末日	232,249,553		14,213	
2月末日	232,167,979		14,312	
3月末日	241,207,209		14,306	
4月末日	247,503,426		14,415	

## 【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	平成20年 3月31日～平成21年 4月13日	0
第2期	平成21年 4月14日～平成22年 4月13日	0
第3期	平成22年 4月14日～平成23年 4月13日	0
第4期	平成23年 4月14日～平成24年 4月13日	0
第5期	平成24年 4月14日～平成25年 4月15日	0
第6期	平成25年 4月16日～平成26年 4月14日	0
第7期	平成26年 4月15日～平成27年 4月13日	0
第8期	平成27年 4月14日～平成28年 4月13日	0
第9期	平成28年 4月14日～平成29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

（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

(注) 本邦外における設定および解約の実績はありません。

(参考)

### (1) 投資状況

#### 国内株式インデックス・マザーファンド(B号)

平成29年 4月28日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
株式	日本	200,714,456,820	98.62
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		2,805,098,681	1.38
合計(純資産総額)		203,519,555,501	100.00

その他以下の取引を行っております。

種類	買建/ 売建	国/地域	時価合計(円)	投資 比率 (%)
株価指数先物取引	買建	日本	2,662,200,000	1.30
合計	買建	-	2,662,200,000	1.30

#### 国内債券パッシブ・マザーファンド

平成29年 4月28日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
国債証券	日本	161,859,094,540	74.45
地方債証券	日本	17,882,529,004	8.23
特殊債券	日本	27,043,983,159	12.44
社債券	日本	8,704,738,000	4.00
	オランダ	501,762,000	0.23
	オーストラリア	200,794,000	0.09

	アメリカ	200,776,000	0.09
	小計	9,608,070,000	4.42
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1,002,311,310	0.46
合計(純資産総額)		217,395,988,013	100.00

## 外国株式インデックス・マザーファンド

平成29年 4月28日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
株式	アメリカ	121,609,610,842	59.05
	イギリス	13,704,725,396	6.65
	スイス	7,790,207,708	3.78
	ドイツ	7,752,171,774	3.76
	フランス	7,738,476,626	3.76
	カナダ	7,707,580,871	3.74
	オーストラリア	5,183,647,082	2.52
	オランダ	3,847,550,536	1.87
	アイルランド	3,241,905,131	1.57
	スペイン	2,777,261,721	1.35
	スウェーデン	2,356,238,003	1.14
	香港	1,955,784,521	0.95
	シンガポール	1,516,029,320	0.74
	イタリア	1,491,930,587	0.72
	デンマーク	1,397,346,319	0.68
	ジャージー	1,223,688,800	0.59
	バミューダ	996,203,161	0.48
	ベルギー	950,521,148	0.46
	フィンランド	810,498,752	0.39
	キュラソー	617,299,588	0.30
	ノルウェー	500,139,396	0.24
	ケイマン諸島	488,519,943	0.24
	イスラエル	470,350,960	0.23
ルクセンブルグ	265,018,145	0.13	
オーストリア	171,779,098	0.08	
ニュージーランド	133,206,727	0.06	

	ポルトガル	123,338,397	0.06
	リベリア	107,484,438	0.05
	パプアニューギニア	47,824,035	0.02
	英ヴァージン諸島	41,197,264	0.02
	マン島	31,687,435	0.02
	モーリシャス	10,005,837	0.00
	小計	197,059,229,561	95.68
投資証券	アメリカ	3,576,763,483	1.74
	オーストラリア	757,299,913	0.37
	フランス	275,559,061	0.13
	イギリス	220,878,618	0.11
	香港	128,989,575	0.06
	シンガポール	99,146,261	0.05
	カナダ	43,113,319	0.02
	小計	5,101,750,230	2.48
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		3,798,803,281	1.84
合計(純資産総額)		205,959,783,072	100.00

その他以下の取引を行っております。

種類	買建/ 売建	国/地域	時価合計(円)	投資 比率 (%)
株価指数先物取引	買建	アメリカ	2,190,779,819	1.06
	買建	ドイツ	596,565,148	0.28
	買建	イギリス	226,798,959	0.11
	買建	オーストラリア	196,746,064	0.09
合計	買建	-	3,210,889,990	1.54

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		267,208,000	0.12
	売建		868,557,300	0.42

外国債券パッシブ・マザーファンド

平成29年 4月28日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
国債証券	アメリカ	91,429,094,634	43.63
	フランス	20,099,307,580	9.59
	イタリア	19,517,232,171	9.31
	イギリス	15,130,336,167	7.22
	ドイツ	14,604,726,173	6.97
	スペイン	11,497,193,278	5.49
	ベルギー	5,148,523,123	2.46
	オランダ	4,528,794,412	2.16
	オーストラリア	4,435,637,598	2.12
	カナダ	4,245,718,744	2.03
	オーストリア	3,075,046,983	1.47
	メキシコ	1,781,757,136	0.85
	アイルランド	1,698,537,879	0.81
	ポーランド	1,374,698,749	0.66
	デンマーク	1,310,207,795	0.63
	フィンランド	1,285,267,667	0.61
	南アフリカ	1,098,830,028	0.52
	スウェーデン	982,265,144	0.47
	シンガポール	800,373,331	0.38
	マレーシア	675,317,594	0.32
ノルウェー	567,407,097	0.27	
スイス	415,948,207	0.20	
	小計	205,702,221,490	98.15
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		3,871,467,113	1.85
合計(純資産総額)		209,573,688,603	100.00

その他以下の取引を行っております。

種類	買建/ 売建	国/地域	時価合計(円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	買建		1,022,124,928	0.48
	売建		2,433,066,798	1.16

マネーインカム・マザーファンド

平成29年 4月28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	1,005,282,000	74.53
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		343,616,347	25.47
合計(純資産総額)		1,348,898,347	100.00

## (2) 投資資産

## 投資有価証券の主要銘柄

## 国内株式インデックス・マザーファンド(B号)

## イ 主要投資銘柄(上位30銘柄)

平成29年 4月28日現在

国/地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	投資 比率 (%)
日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	1,091,500	6,657.77	7,266,955,955	6,035.00	6,587,202,500	3.24
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	6,715,500	672.94	4,519,128,570	709.20	4,762,632,600	2.34
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	711,700	4,649.69	3,309,184,373	4,769.00	3,394,097,300	1.67
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	399,100	6,810.26	2,717,974,766	8,442.00	3,369,202,200	1.66
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	709,600	4,221.96	2,995,902,816	4,124.00	2,926,390,400	1.44
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	808,200	3,336.82	2,696,817,924	3,232.00	2,612,102,400	1.28
日本	株式	KDDI	情報・通信業	877,300	3,002.19	2,633,821,287	2,955.50	2,592,860,150	1.27
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	12,034,400	203.06	2,443,705,264	203.60	2,450,203,840	1.20
日本	株式	ソニー	電気機器	634,500	3,297.82	2,092,466,790	3,759.00	2,385,085,500	1.17
日本	株式	日本たばこ産業	食料品	557,800	3,938.50	2,196,895,300	3,706.00	2,067,206,800	1.02
日本	株式	ファナック	電気機器	91,000	19,363.02	1,762,034,820	22,655.00	2,061,605,000	1.01
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	352,800	4,696.37	1,656,879,336	5,342.00	1,884,657,600	0.93
日本	株式	キーエンス	電気機器	40,700	39,257.73	1,597,789,611	44,800.00	1,823,360,000	0.90
日本	株式	キヤノン	電気機器	483,400	3,262.91	1,577,290,694	3,696.00	1,786,646,400	0.88
日本	株式	NTTドコモ	情報・通信業	653,000	2,630.15	1,717,487,950	2,688.00	1,755,264,000	0.86
日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	371,000	4,445.09	1,649,128,390	4,710.00	1,747,410,000	0.86
日本	株式	東日本旅客鉄道	陸運業	173,700	9,802.42	1,702,680,354	9,954.00	1,729,009,800	0.85
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	356,900	4,889.20	1,744,955,480	4,692.00	1,674,574,800	0.82
日本	株式	信越化学工業	化学	168,700	8,514.34	1,436,369,158	9,684.00	1,633,690,800	0.80
日本	株式	三菱商事	卸売業	666,000	2,474.29	1,647,877,140	2,403.50	1,600,731,000	0.79
日本	株式	任天堂	その他製品	55,300	27,540.61	1,522,995,733	28,045.00	1,550,888,500	0.76
日本	株式	三菱電機	電気機器	957,200	1,579.37	1,511,772,964	1,554.00	1,487,488,800	0.73
日本	株式	ブリヂストン	ゴム製品	317,300	4,353.81	1,381,463,913	4,648.00	1,474,810,400	0.72
日本	株式	花王	化学	234,800	5,276.37	1,238,891,676	6,148.00	1,443,550,400	0.71
日本	株式	アステラス製薬	医薬品	960,400	1,581.18	1,518,565,272	1,468.00	1,409,867,200	0.69
日本	株式	村田製作所	電気機器	94,100	15,392.72	1,448,454,952	14,945.00	1,406,324,500	0.69
日本	株式	三菱地所	不動産業	659,200	2,305.43	1,519,739,456	2,130.00	1,404,096,000	0.69



日本	株式	東海旅客鉄道	陸運業	74,700	18,720.25	1,398,402,675	18,685.00	1,395,769,500	0.69
日本	株式	パナソニック	電気機器	1,032,000	1,164.70	1,201,970,400	1,330.50	1,373,076,000	0.67
日本	株式	ダイキン工業	機械	122,600	10,740.85	1,316,828,210	10,825.00	1,327,145,000	0.65

□ 種類別・業種別の投資比率

平成29年 4月28日現在

種類	国内 / 外国	業種	投資比率 (%)
株式	国内	水産・農林業	0.11
		鉱業	0.32
		建設業	2.98
		食料品	4.51
		繊維製品	0.71
		パルプ・紙	0.26
		化学	6.75
		医薬品	4.67
		石油・石炭製品	0.52
		ゴム製品	0.98
		ガラス・土石製品	0.99
		鉄鋼	1.21
		非鉄金属	0.95
		金属製品	0.72
		機械	5.12
		電気機器	12.67
		輸送用機器	8.82
		精密機器	1.57
		その他製品	1.87
		電気・ガス業	1.80
		陸運業	4.14
		海運業	0.23
		空運業	0.55
		倉庫・運輸関連業	0.19
		情報・通信業	7.77
		卸売業	4.40
		小売業	4.70
銀行業	8.01		
証券、商品先物取引業	1.14		
保険業	2.57		
その他金融業	1.22		
不動産業	2.41		
サービス業	3.77		
合計			98.62

## 国内債券パッシブ・マザーファンド

## イ 主要投資銘柄（上位30銘柄）

平成29年 4月28日現在

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
日本	国債証券	第310回利付国債(10年)	3,080,000,000	105.31	3,243,794,400	104.02	3,203,816,000	1.000	2020/9/20	1.47
日本	国債証券	第329回利付国債(10年)	2,650,000,000	107.16	2,839,933,000	105.75	2,802,375,000	0.800	2023/6/20	1.29
日本	国債証券	第128回利付国債(5年)	2,605,000,000	101.45	2,642,948,500	101.14	2,634,827,250	0.100	2021/6/20	1.21
日本	国債証券	第344回利付国債(10年)	2,386,000,000	101.05	2,411,053,000	101.03	2,410,647,380	0.100	2026/9/20	1.11
日本	国債証券	第124回利付国債(5年)	2,340,000,000	101.27	2,369,856,000	100.91	2,361,387,600	0.100	2020/6/20	1.09
日本	国債証券	第312回利付国債(10年)	2,145,000,000	106.55	2,285,518,950	105.05	2,253,322,500	1.200	2020/12/20	1.04
日本	国債証券	第313回利付国債(10年)	2,105,000,000	107.36	2,260,117,450	105.78	2,226,795,300	1.300	2021/3/20	1.02
日本	国債証券	第305回利付国債(10年)	2,070,000,000	105.48	2,183,436,000	103.96	2,151,972,000	1.300	2019/12/20	0.99
日本	国債証券	第345回利付国債(10年)	2,118,000,000	100.39	2,126,297,640	100.96	2,138,396,340	0.100	2026/12/20	0.98
日本	国債証券	第123回利付国債(5年)	2,030,000,000	101.26	2,055,578,000	100.85	2,047,356,500	0.100	2020/3/20	0.94
日本	国債証券	第341回利付国債(10年)	1,952,000,000	103.96	2,029,299,200	102.94	2,009,505,920	0.300	2025/12/20	0.92
日本	国債証券	第343回利付国債(10年)	1,925,000,000	102.35	1,970,237,500	101.09	1,946,136,500	0.100	2026/6/20	0.90
日本	国債証券	第339回利付国債(10年)	1,860,000,000	104.91	1,951,326,000	103.71	1,929,136,200	0.400	2025/6/20	0.89
日本	国債証券	第315回利付国債(10年)	1,800,000,000	107.27	1,930,860,000	105.70	1,902,672,000	1.200	2021/6/20	0.88
日本	国債証券	第333回利付国債(10年)	1,805,000,000	105.76	1,908,968,000	104.96	1,894,528,000	0.600	2024/3/20	0.87
日本	国債証券	第340回利付国債(10年)	1,810,000,000	104.94	1,899,414,000	103.78	1,878,580,900	0.400	2025/9/20	0.86
日本	国債証券	第342回利付国債(10年)	1,825,000,000	101.74	1,856,787,000	101.15	1,846,115,250	0.100	2026/3/20	0.85
日本	国債証券	第130回利付国債(5年)	1,800,000,000	101.17	1,821,060,000	101.30	1,823,544,000	0.100	2021/12/20	0.84
日本	国債証券	第306回利付国債(10年)	1,670,000,000	106.27	1,774,725,700	104.59	1,746,686,400	1.400	2020/3/20	0.80
日本	国債証券	第129回利付国債(5年)	1,610,000,000	101.24	1,630,006,700	101.19	1,629,207,300	0.100	2021/9/20	0.75
日本	国債証券	第59回利付国債(20年)	1,455,000,000	112.71	1,640,046,900	110.42	1,606,611,000	1.700	2022/12/20	0.74
日本	国債証券	第125回利付国債(5年)	1,520,000,000	101.41	1,541,432,000	100.97	1,534,759,200	0.100	2020/9/20	0.71
日本	国債証券	第338回利付国債(10年)	1,470,000,000	104.60	1,537,624,500	103.72	1,524,757,500	0.400	2025/3/20	0.70
日本	国債証券	第334回利付国債(10年)	1,370,000,000	105.94	1,451,484,900	105.10	1,439,938,500	0.600	2024/6/20	0.66
日本	国債証券	第335回利付国債(10年)	1,365,000,000	105.56	1,440,996,200	104.42	1,425,401,250	0.500	2024/9/20	0.66
日本	国債証券	第330回利付国債(10年)	1,335,000,000	107.27	1,432,115,950	105.95	1,414,485,900	0.800	2023/9/20	0.65

日本	国債証券	第147回利付国債(20年)	1,175,000,000	122.95	1,444,662,500	119.65	1,405,887,500	1.600	2033/12/20	0.65
日本	国債証券	第325回利付国債(10年)	1,290,000,000	106.08	1,368,523,700	105.13	1,356,177,000	0.800	2022/9/20	0.62
日本	特殊債券	第103回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1,300,000,000	104.27	1,355,592,000	103.90	1,350,804,000	1.300	2020/3/19	0.62
日本	国債証券	第127回利付国債(5年)	1,310,000,000	101.61	1,331,091,000	101.09	1,324,331,400	0.100	2021/3/20	0.61

## ロ 種類別の投資比率

平成29年 4月28日現在

種類	投資比率(%)
国債証券	74.45
地方債証券	8.23
特殊債券	12.44
社債券	4.42
合計	99.54

## 外国株式インデックス・マザーファンド

### イ 主要投資銘柄(上位30銘柄)

平成29年 4月28日現在

国/地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿単価(円)	帳簿価額(円)	評価額単価(円)	評価額(円)	投資比率(%)
アメリカ	株式	APPLE INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	293,337	12,605.81	3,697,752,922	16,002.38	4,694,092,811	2.28
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	406,146	6,835.43	2,776,183,284	7,597.76	3,085,803,204	1.50
アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	小売	22,196	86,022.71	1,909,360,257	102,206.51	2,268,575,700	1.10
アメリカ	株式	FACEBOOK INC-A	ソフトウェア・サービス	128,627	13,604.08	1,749,853,233	16,437.53	2,114,310,557	1.03
アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORPORATION	エネルギー	228,310	9,572.05	2,185,395,398	9,043.42	2,064,704,453	1.00
アメリカ	株式	JOHNSON & JOHNSON	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	149,506	12,566.86	1,878,821,988	13,771.02	2,058,850,804	1.00
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	196,607	8,918.78	1,753,494,697	9,750.11	1,916,941,233	0.93
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	ソフトウェア・サービス	17,057	86,635.92	1,477,748,995	97,295.28	1,659,565,634	0.81
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	ソフトウェア・サービス	16,260	88,817.21	1,444,167,840	99,208.35	1,613,127,895	0.78
アメリカ	株式	WELLS FARGO & COMPANY	銀行	262,693	5,834.93	1,532,796,501	6,058.62	1,591,559,060	0.77
アメリカ	株式	GENERAL ELECTRIC CO	資本財	486,743	3,455.55	1,681,966,964	3,236.31	1,575,252,796	0.76
アメリカ	株式	AT&T INC	電気通信サービス	338,113	4,434.90	1,499,499,541	4,441.58	1,501,757,257	0.73

スイス	株式	NESTLE SA-REGISTERED	食品・飲料・タバコ	170,893	7,777.74	1,329,162,177	8,667.42	1,481,203,030	0.72
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	556,366	2,314.83	1,287,893,820	2,632.00	1,464,360,041	0.71
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	140,778	9,287.15	1,307,426,473	9,759.02	1,373,855,332	0.67
アメリカ	株式	PFIZER INC	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	334,113	3,556.82	1,188,382,607	3,768.27	1,259,031,135	0.61
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	各種金融	67,424	17,617.20	1,187,822,565	18,535.34	1,249,727,405	0.61
アメリカ	株式	CHEVRON CORPORATION	エネルギー	103,937	12,332.04	1,281,755,751	11,737.75	1,219,987,177	0.59
アメリカ	株式	HOME DEPOT INC	小売	67,070	14,571.19	977,290,364	17,374.59	1,165,314,073	0.57
アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS INC	電気通信サービス	223,737	5,712.51	1,278,101,125	5,193.90	1,162,068,566	0.56
アメリカ	株式	COMCAST CORP-CLASS A	メディア	262,450	3,930.76	1,031,628,697	4,405.97	1,156,347,115	0.56
スイス	株式	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	38,795	25,545.69	991,045,265	29,130.17	1,130,105,062	0.55
アメリカ	株式	INTEL CORP	半導体・半導体製造装置	259,916	3,966.37	1,030,924,481	4,165.58	1,082,702,113	0.53
アメリカ	株式	COCA-COLA CO/THE	食品・飲料・タバコ	225,374	4,579.58	1,032,119,051	4,786.58	1,078,771,334	0.52
アメリカ	株式	THE WALT DISNEY CO.	メディア	82,925	11,290.37	936,253,973	12,891.83	1,069,055,301	0.52
スイス	株式	NOVARTIS AG-REG SHS	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	122,948	7,882.94	969,191,756	8,605.87	1,058,075,611	0.51
アメリカ	株式	MERCK & CO. INC.	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	151,803	6,917.78	1,050,140,729	6,964.52	1,057,236,274	0.51
アメリカ	株式	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL INC.	食品・飲料・タバコ	85,415	10,131.84	865,411,250	12,263.04	1,047,447,997	0.51
アメリカ	株式	VISA INC	ソフトウェア・サービス	102,424	8,866.47	908,139,764	10,194.16	1,044,127,054	0.51
アメリカ	株式	CISCO SYSTEMS INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	276,099	3,324.23	917,817,214	3,756.03	1,037,038,198	0.50

## □ 種類別・業種別の投資比率

平成29年 4月28日現在

種類	国内 / 外国	業種	投資比率 (%)
株式	外国	エネルギー	6.65
		素材	4.85
		資本財	7.27
		商業・専門サービス	0.99
		運輸	1.85
		自動車・自動車部品	1.51
		耐久消費財・アパレル	1.78

	消費者サービス	1.78
	メディア	2.82
	小売	3.90
	食品・生活必需品小売り	1.91
	食品・飲料・タバコ	6.19
	家庭用品・パーソナル用品	1.73
	ヘルスケア機器・サービス	3.88
	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	8.42
	銀行	9.13
	各種金融	4.37
	保険	4.16
	不動産	0.78
	ソフトウェア・サービス	9.15
	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	4.30
	電気通信サービス	2.84
	公益事業	3.24
	半導体・半導体製造装置	2.17
投資証券		2.48
合計		98.16

## 外国債券パッシブ・マザーファンド

## イ 主要投資銘柄（上位30銘柄）

平成29年 4月28日現在

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.375	8,000,000	11,060.58	884,846,414	11,308.10	904,648,588	2.375	2024/8/15	0.43
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.25	8,000,000	10,968.55	877,484,511	11,194.20	895,536,723	2.250	2024/11/15	0.43
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2	8,000,000	10,712.59	857,007,359	10,975.10	878,008,548	2.000	2025/2/15	0.42
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2	8,000,000	10,658.07	852,645,905	10,928.15	874,252,511	2.000	2025/8/15	0.42
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2	8,000,000	10,657.54	852,603,264	10,847.29	867,783,776	2.000	2026/11/15	0.41
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.75	8,000,000	10,274.29	821,943,425	10,713.40	857,072,113	2.750	2042/11/15	0.41
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 1.625	8,000,000	10,294.76	823,580,921	10,556.03	844,482,436	1.625	2026/2/15	0.40
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2	7,500,000	10,961.92	822,144,270	11,148.12	836,109,597	2.000	2023/2/15	0.40
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.25	7,500,000	10,884.81	816,361,118	11,122.91	834,218,541	2.250	2025/11/15	0.40
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 1.5	8,000,000	10,135.10	810,808,097	10,395.18	831,614,525	1.500	2026/8/15	0.40
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.75	7,000,000	11,422.07	799,544,993	11,598.50	811,895,328	2.750	2024/2/15	0.39
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.5	7,000,000	11,188.57	783,200,037	11,414.18	798,992,644	2.500	2024/5/15	0.38
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 4.5	4,200,000	19,038.34	799,610,672	19,003.17	798,133,522	4.500	2041/4/25	0.38

アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.25	7,000,000	11,032.08	772,245,763	11,079.44	775,560,887	2.250	2027/2/15	0.37
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.125	7,000,000	10,819.13	757,339,579	11,052.48	773,674,168	2.125	2025/5/15	0.37
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 1.75	7,000,000	10,757.88	753,051,787	10,964.67	767,527,139	1.750	2023/5/15	0.37
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 4.25	5,000,000	15,485.47	774,273,866	15,296.58	764,829,438	4.250	2023/10/25	0.36
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 3.625	6,000,000	12,076.70	724,602,234	12,525.34	751,520,503	3.625	2043/8/15	0.36
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 1.625	7,000,000	10,249.03	717,432,241	10,534.29	737,400,585	1.625	2026/5/15	0.35
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 5.75	3,700,000	20,003.87	740,143,408	19,851.30	734,498,263	5.750	2032/10/25	0.35
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.75	6,200,000	11,367.23	704,768,270	11,601.98	719,322,915	2.750	2023/11/15	0.34
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 3.625	6,000,000	11,807.17	708,430,406	11,807.17	708,430,406	3.625	2020/2/15	0.34
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 3	5,000,000	14,086.46	704,323,468	13,978.11	698,905,762	3.000	2022/4/25	0.33
イタリア	国債証券	BTPS 6	4,100,000	17,520.53	718,342,069	16,935.79	694,367,725	6.000	2031/5/1	0.33
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 3.125	6,000,000	11,117.11	667,026,631	11,474.17	688,450,377	3.125	2044/8/15	0.33
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 3.875	6,000,000	11,560.24	693,614,925	11,445.48	686,728,856	3.875	2018/5/15	0.33
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.5	6,000,000	11,248.77	674,926,552	11,435.91	686,155,021	2.500	2023/8/15	0.33
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2	6,000,000	11,143.20	668,592,204	11,245.50	674,730,404	2.000	2021/11/15	0.32
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 3.25	4,800,000	14,122.72	677,890,914	13,986.45	671,349,787	3.250	2021/10/25	0.32
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 3	6,000,000	10,820.63	649,238,319	11,182.90	670,974,366	3.000	2045/11/15	0.32

## ロ 種類別の投資比率

平成29年 4月28日現在

種類	投資比率 (%)
国債証券	98.15
合計	98.15

## マネーインカム・マザーファンド

### イ 主要投資銘柄

平成29年 4月28日現在

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額単価 (円)	評価額 (円)	利率 (%)	償還期限	投資比率 (%)
日本	特殊債券	第40回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	100.74	201,488,000	100.66	201,326,000	1.900	2017/8/31	14.93
日本	特殊債券	第876回政府保証公営企業債券	200,000,000	100.36	200,722,000	100.28	200,562,000	1.900	2017/6/20	14.87
日本	特殊債券	第195回政府保証預金保険機構債	200,000,000	100.18	200,372,000	100.17	200,354,000	0.200	2018/1/23	14.85
日本	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	101.46	101,467,000	101.41	101,411,000	1.400	2018/4/20	7.52

日本	特殊債券	第21回政府保証 日本政策投資銀行 債券	100,000,000	101.40	101,401,000	101.33	101,334,000	1.600	2018/2/19	7.51
日本	特殊債券	第1回政府保証地 方公共団体金融機 構債券(6年)	100,000,000	100.20	100,202,000	100.18	100,182,000	0.400	2017/9/27	7.43
日本	特殊債券	第875回政府保 証公営企業債券	100,000,000	100.18	100,185,000	100.11	100,113,000	1.700	2017/5/22	7.42

以上が、当ファンドが保有する有価証券のすべてです。

## □ 種類別の投資比率

平成29年 4月28日現在

種類	投資比率(%)
特殊債券	74.53
合計	74.53

### 投資不動産物件

#### 国内株式インデックス・マザーファンド(B号)

該当事項はありません。

#### 国内債券パッシブ・マザーファンド

該当事項はありません。

#### 外国株式インデックス・マザーファンド

該当事項はありません。

#### 外国債券パッシブ・マザーファンド

該当事項はありません。

#### マネーインカム・マザーファンド

該当事項はありません。

### その他投資資産の主要なもの

#### 国内株式インデックス・マザーファンド(B号)

平成29年 4月28日現在

種類	取引所等	名称	買建/ 売建	数量	通貨	簿価 (円)	時価 (円)	投資 比率 (%)
株価指数先物 取引	大阪取引所	東証株価指数先物	買建	174	日本円	2,658,835,760	2,662,200,000	1.30

(注) 主たる取引所の発表する清算値段または最終相場で評価しております。

#### 国内債券パッシブ・マザーファンド

該当事項はありません。

## 外国株式インデックス・マザーファンド

平成29年 4月28日現在

種類	地域	取引所等	名称	買建/ 売建	数量	通貨	帳簿価額	簿価 (円)	評価額	時価 (円)	投資 比率 (%)
株価指 数先物 取引	アメリカ	シカゴ商業 取引所	SPMINI 1706	買建	165	米ドル	19,356,945	2,154,234,409	19,685,325	2,190,779,819	1.06
	ドイツ	ユーレック ス・ドイツ 金融先物取 引所	DJ EUR 1706	買建	141	ユーロ	4,779,402	577,590,731	4,936,410	596,565,148	0.28
	オース トラリ ア	シドニー先 物取引所	SPI200 1706	買建	16	オースト ラリアド ル	2,289,747	190,598,540	2,363,600	196,746,064	0.09
	イギリ ス	ロンドン国 際金融先物 オプション 取引所	FTSE 1706	買建	22	英ポンド	1,593,664	228,786,404	1,579,820	226,798,959	0.11

(注) 主たる取引所の発表する清算値段または最終相場で評価しております。

平成29年 4月28日現在

種類	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	米ドル	買建	1,800,000.00	200,388,600	200,286,000	0.09
	カナダドル	買建	160,000.00	13,060,640	13,059,200	0.00
	英ポンド	買建	160,000.00	22,872,000	22,968,000	0.01
	スイスフラン	買建	110,000.00	12,320,000	12,310,100	0.00
	スウェーデンクローナ	買建	350,000.00	4,448,500	4,403,000	0.00
	ノルウェークローネ	買建	230,000.00	2,980,800	2,985,400	0.00
	デンマーククローネ	買建	160,000.00	2,609,920	2,600,000	0.00
	香港ドル	買建	370,000.00	5,291,000	5,287,300	0.00
	シンガポールドドル	買建	30,000.00	2,392,200	2,391,000	0.00
	イスラエルシェケル	買建	30,000.00	917,400	918,000	0.00
	米ドル	売建	6,500,000.00	722,800,000	723,255,000	0.35
	カナダドル	売建	350,000.00	28,563,500	28,567,000	0.01
	ユーロ	売建	200,000.00	24,162,200	24,170,000	0.01
	英ポンド	売建	220,000.00	31,569,340	31,581,000	0.01
	スイスフラン	売建	230,000.00	25,731,710	25,739,300	0.01
	スウェーデンクローナ	売建	530,000.00	6,668,990	6,667,400	0.00
	ノルウェークローネ	売建	270,000.00	3,504,870	3,504,600	0.00
	デンマーククローネ	売建	230,000.00	3,737,500	3,737,500	0.00
	オーストラリアドル	売建	110,000.00	9,159,260	9,154,200	0.00
	ニュージーランドドル	売建	10,000.00	767,950	765,500	0.00
香港ドル	売建	520,000.00	7,436,000	7,430,800	0.00	



	シンガポールドル	売建	50,000.00	3,984,400	3,985,000	0.00
--	----------	----	-----------	-----------	-----------	------

(注) わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しております。

#### 外国債券パッシブ・マザーファンド

平成29年 4月28日現在

種類	資産の名称	買建 / 売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資比率 (%)
為替予約取引	米ドル	買建	7,030,240.03	781,762,782	782,254,807	0.37
	ユーロ	買建	1,983,489.53	239,628,598	239,704,709	0.11
	英ポンド	買建	1,152.30	164,291	165,412	0.00
	米ドル	売建	11,062,781.59	1,230,257,485	1,230,955,707	0.58
	ユーロ	売建	9,098,209.64	1,100,931,806	1,099,518,634	0.52
	英ポンド	売建	714,681.00	102,070,311	102,592,457	0.04

(注) わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しております。

#### 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: 2017年4月28日

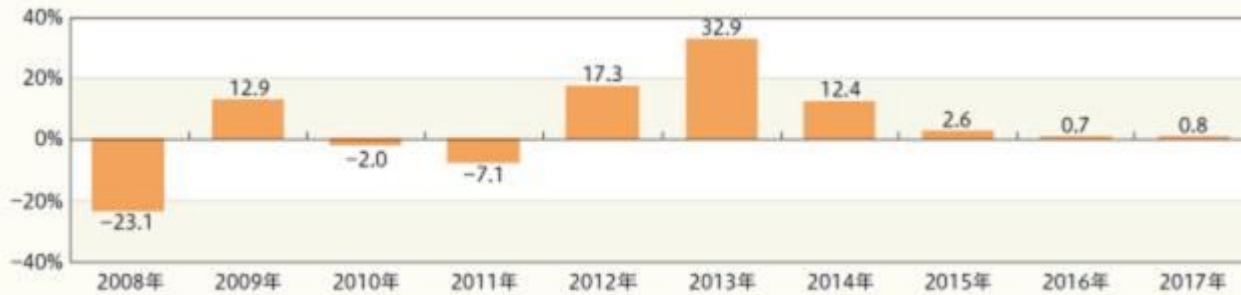
※ファンドの運用実績はあくまで過去の実績であり、将来の運用成果を約束するものではありません。

※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。



※基準価額は、1万口当たり、信託報酬控除後です。

#### 年間収益率の推移(暦年ベース)



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

※2017年のファンドの収益率は、年初から2017年4月28日までの騰落率を表示しています。

※ファンドにはベンチマークはありません。

## 第2【管理及び運営】

### 1【申込（販売）手続等】

#### イ 申込方法

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

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

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

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

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

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

ファンドのお買付けに関しましては、クーリング・オフ制度の適用はありません。

#### ロ 申込価額

取得申込受付日の翌営業日の基準価額となります。

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

#### ハ 申込手数料

無手数料です。

#### ニ 申込単位

お申込単位の詳細は、取扱いの販売会社または委託会社にお問い合わせください。

#### ホ 照会先

手続き等のご不明な点についての委託会社に対する照会は下記においてできます。

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

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

#### ヘ 申込取扱場所・払込取扱場所

販売会社において申込み・払込みを取り扱います。

#### ト 払込期日

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

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

## 2【換金（解約）手続等】

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

お買付けの販売会社にお申し出ください。

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

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

一部解約金は、解約請求受付日から起算して5営業日目からお支払いします。

一部解約価額は、解約請求受付日の翌営業日の基準価額となります。

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

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

## 3【資産管理等の概要】

### （1）【資産の評価】

#### イ 基準価額の算出方法

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

#### ロ 基準価額の算出頻度・照会方法

基準価額は、委託会社の営業日において日々算出されます。

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

平成20年3月31日から下記「(5)その他 イ 信託の終了」に記載された各事由が生じた場合における信託終了の日までとなります。

## (4)【計算期間】

毎年4月14日から翌年4月13日までとすることを原則としますが、各計算期間終了日に該当する日(以下「該当日」といいます。)が休業日のとき、各計算期間終了日は、該当日の翌営業日とし、その翌日より次の計算期間が開始するものとします。なお、最終計算期間の終了日は、信託期間の終了日とします。

## (5)【その他】

### イ 信託の終了

#### (イ) 信託契約の解約

- a. 委託会社は、当ファンドの信託契約を解約することが受益者にとって有利であると認めるとき、残存口数が1億口を下回ることとなったとき、その他やむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意の上、当ファンドの信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。
- b. 委託会社は、上記aの事項について、書面による決議(以下「書面決議」といいます。)を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに信託契約の解約の理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、当ファンドの知っている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発送します。
- 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。

(二) 受託会社の辞任および解任に伴う取扱い

- a. 受託会社は、委託会社の承諾を受けてその任務を辞任することができます。また、受託会社はその任務に違反して信託財産に著しい損害を与えたこと、その他重要な事由があるときは、委託会社または受益者は、裁判所に受託会社の解任を申し立てることができます。
- b. 上記により受託会社が辞任し、または解任された場合は、委託会社は新受託会社を選任します。
- c. 委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社は当ファンドの信託契約を解約し、信託を終了させます。

ロ 収益分配金、償還金の支払い

(イ) 収益分配金

- a. 分配金額は、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。分配対象額が少額の場合等には委託会社の判断により分配を行わない場合もあるため、将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。
- b. 分配金は、原則として、税金を差し引いた後、毎計算期間終了日後1ヵ月以内の委託会社の指定する日(原則として決算日から起算して5営業日目まで)から、販売会社において、決算日の振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者(当該収益分配金にかかる決算日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該収益分配金にかかる決算日以前に設定された受益権で取得申込代金支払い前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者として)に支払われます。  
ただし、分配金自動再投資コースにかかる収益分配金は、原則として、税金を差し引いた後、累積投資契約に基づいて、毎計算期間終了日の翌営業日に再投資され、再投資により増加した受益権は、振替口座簿に記載または記録されます。

(ロ) 償還金

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

八 信託約款の変更等

- (イ) 委託会社は、当ファンドの信託約款を変更することが受益者の利益のため必要と認めるとき、監督官庁より変更の命令を受けたとき、その他やむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意の上、当ファンドの信託約款を変更すること、または当ファンドと他のファンドとの併合(投資信託及び投資法人に関する法律第16条第2号に規定する「委託者指図型投資信託の併合」をいいます。)を行うことができるものとし、あらかじめ、変更または併合しようとする旨および内容を監督官庁に届け出ます。
  - (ロ) 委託会社は、上記(イ)の事項(変更についてはその内容が重大なものに該当する場合に限り、併合にあっては、その併合が受益者の利益に及ぼす影響が軽微なものに該当する場合を除きます。以下、合わせて「重大な信託約款の変更等」といいます。)について、書面決議を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに重大な信託約款の変更等の内容およびその理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、当ファンドの知っている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。
  - (ハ) 上記(ロ)の書面決議において、受益者(委託会社等を除きます。)は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行行使することができます。なお、知っている受益者が議決権を行行使しないときは、当該知っている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
- (二) 書面決議は議決権を行行使することができる受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもつ

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っても、相手方となる他のファンドにおいて当該併合の書面決議が否決された場合は、併合を行うことはできません。

## 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、日本経済新聞に掲載します。

## チ 運用にかかる報告書の開示方法

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

## 4【受益者の権利等】

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

受益者の有する主な権利は次の通りです。

### イ 分配金請求権

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

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

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

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

### ロ 償還金請求権

受益者は、持分に応じて償還金を請求する権利を有します。

償還金は、信託終了後1ヵ月以内の委託会社の指定する日（原則として償還日から起算して5営業日目まで）から、販売会社において、原則として、償還日の振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（償還日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該償還日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者とし、）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9期（平成28年 4月14日から平成29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8期 （平成28年 4月13日現在）	第9期 （平成29年 4月13日現在）
<b>資産の部</b>		
流動資産		
金銭信託	1,744,990	-
コール・ローン	-	2,042,548
親投資信託受益証券	177,564,809	234,553,849
流動資産合計	179,309,799	236,596,397
資産合計	179,309,799	236,596,397
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	-	5,220
未払受託者報酬	27,763	36,253
未払委託者報酬	360,809	471,291
未払利息	-	3
その他未払費用	4,564	6,004
流動負債合計	393,136	518,771
負債合計	393,136	518,771
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	134,853,371	168,519,500
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	44,063,292	67,558,126
元本等合計	178,916,663	236,077,626
純資産合計	178,916,663	236,077,626
負債純資産合計	179,309,799	236,596,397

## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第8期		第9期	
	自	平成27年 4月14日 至 平成28年 4月13日	自	平成28年 4月14日 至 平成29年 4月13日
営業収益				
受取利息		8		-
有価証券売買等損益		14,439,602		12,329,040
営業収益合計		14,439,594		12,329,040
営業費用				
支払利息		-		1,312
受託者報酬		49,369		66,644
委託者報酬		641,641		866,218
その他費用		8,107		11,248
営業費用合計		699,117		945,422
営業利益又は営業損失（ ）		15,138,711		11,383,618
経常利益又は経常損失（ ）		15,138,711		11,383,618
当期純利益又は当期純損失（ ）		15,138,711		11,383,618
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（ ）		514,725		614,493
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		24,842,203		44,063,292
剰余金増加額又は欠損金減少額		36,770,246		17,865,515
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		36,770,246		17,865,515
剰余金減少額又は欠損金増加額		2,925,171		5,139,806
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		2,925,171		5,139,806
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（ ）		44,063,292		67,558,126

## （ 3 ）【注記表】

## （ 重要な会計方針の注記 ）

項 目	第9期
	自 平成28年 4月14日 至 平成29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>

## （ 追加情報 ）

第9期
自 平成28年 4月14日 至 平成29年 4月13日
<p>スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2040は、販売会社を増やし販路を拡大するに当たり、汎用性の高いファンド名称に変更することとし、平成29年1月13日付けでファンドの名称を「三井住友・DCターゲットイヤーファンド2040（4資産タイプ）」に変更する約款変更を行いました。</p>

## （ 貸借対照表に関する注記 ）

項 目	第8期	第9期
	(平成28年 4月13日現在)	(平成29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	134,853,371口	168,519,500口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.3267円 (10,000口当たりの純資産額 13,267円)	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)

## （ 損益及び剰余金計算書に関する注記 ）

項目	第8期	第9期
	自 平成27年 4月14日 至 平成28年 4月13日	自 平成28年 4月14日 至 平成29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(2,525,811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(54,213,210円)、および分配準備積立金(10,313,393円)より、分配対象収益は67,052,414円(1万口当たり4,972.22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(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。

## (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9期
	自 平成28年 4月14日 至 平成29年 4月13日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、親投資信託受益証券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>

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

#### ・金融商品の時価等に関する事項

項目	第9期 (平成29年 4月13日現在)
1.貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	<p>(1) 有価証券（親投資信託受益証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

## 第8期（自 平成27年 4月14日 至 平成28年 4月13日）

種 類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	14,442,138円
合計	14,442,138円

## 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

## （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9期 自 平成28年 4月14日 至 平成29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8期 （平成28年 4月13日現在）	第9期 （平成29年 4月13日現在）
期首元本額	56,736,413円	134,853,371円
期中追加設定元本額	84,680,093円	49,340,920円
期中一部解約元本額	6,563,135円	15,674,791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）	31,907,731	70,465,033	
	外国株式インデックス・マザーファンド	18,177,564	52,762,197	
	外国債券パッシブ・マザーファンド	28,913,333	46,923,448	
	国内債券パッシブ・マザーファンド	47,792,735	59,989,440	
	マネーインカム・マザーファンド	4,363,551	4,413,731	
合計		131,154,914	234,553,849	

## 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28年 4月13日現在）	（平成29年 4月13日現在）
資産の部		
流動資産		
金銭信託	1,851,945,023	-
コール・ローン	-	2,834,577,861
株式	194,753,607,746	192,397,438,150
派生商品評価勘定	10,560,160	-
未収配当金	1,957,063,159	1,888,213,581
前払金	41,709,000	215,520,000
差入委託証拠金	110,540,000	-
流動資産合計	198,725,425,088	197,335,749,592
資産合計	198,725,425,088	197,335,749,592
負債の部		

	(平成28年 4月13日現在)	(平成29年 4月13日現在)
流動負債		
派生商品評価勘定	52,439,800	215,669,040
未払金	-	38,812,000
未払解約金	75,879,277	633,868,121
未払利息	-	4,581
その他未払費用	-	44,779
流動負債合計	128,319,077	888,398,521
負債合計	128,319,077	888,398,521
純資産の部		
元本等		
元本	101,243,854,770	88,953,399,408
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	97,353,251,241	107,493,951,663
元本等合計	198,597,106,011	196,447,351,071
純資産合計	198,597,106,011	196,447,351,071
負債純資産合計	198,725,425,088	197,335,749,592

## 注記表

## (重要な会計方針の注記)

項目	自平成28年 4月14日 至平成29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28年 4月13日現在)	(平成29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。 株式 2,811,500,000円	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
2. 当計算期間の末日における受益権の総数	101,243,854,770口	88,953,399,408口
3. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.9616円 (10,000口当たりの純資産額 19,616円)	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)

## (金融商品に関する注記)

## . 金融商品の状況に関する事項

項目	自平成28年 4月14日 至平成29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	(1)金融商品の内容 1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、株式を組み入れております。 2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいておりません。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。当計算期間については、先物取引を行っております。 3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 (2)金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。

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

#### ・金融商品の時価等に関する事項

項目	(平成29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28年 4月13日現在）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

（単位：円）

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	3,893,879,640	-	3,852,000,000	41,879,640
	東証株価指数先物	3,893,879,640	-	3,852,000,000	41,879,640
合計		3,893,879,640	-	3,852,000,000	41,879,640

（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

（注）1．時価の算定方法

(1) 株価指数先物取引の時価の算定方法について

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

2) 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

2．ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

自 平成28年 4月14日 至 平成29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28年 4月13日現在）
開示対象ファンドの

期首における当該親投資信託の元本額	119,948,691,565円
同期中における追加設定元本額	21,900,549,475円
同期中における一部解約元本額	40,605,386,270円
平成28年 4月13日現在における元本の内訳	
三井住友・日本株式インデックス年金ファンド	9,877,016,976円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	526,409,568円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	2,603,617,762円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	1,871,011,843円
SMAM・グローバルバランスファンド(機動的資産配分型)	82,073,887円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2020	8,599,842円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2025	19,254,141円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2030	62,363,262円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2035	47,388,076円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2040	28,126,160円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2045	62,046,755円
国内株式指数ファンド(TOPIX)	2,706,316,638円
三井住友・DC日本株式インデックスファンドS	897,341,453円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	277,828,450円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	556,342,681円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	760,763,475円
SMAM・国内株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	16,978,928,129円
バランスファンドVA(安定運用型)〈適格機関投資家限定〉	121,263,347円
SMAM・バランスファンドVA安定成長型〈適格機関投資家限定〉	14,348,302,910円
SMAM・バランスファンドVA25〈適格機関投資家専用〉	7,117,159,918円
SMAM・バランスファンドVA37.5〈適格機関投資家専用〉	4,034,957,665円
SMAM・バランスファンドVA50〈適格機関投資家専用〉	14,756,674,460円
SMAM・バランスファンドVL30〈適格機関投資家限定〉	85,242,090円
SMAM・バランスファンドVL50〈適格機関投資家限定〉	349,430,490円
世界6資産バランスファンドVA〈適格機関投資家限定〉	23,976,922円
SMAM・バランスファンドVA75〈適格機関投資家専用〉	1,535,018,129円
SMAM・バランスファンドVL国際分散型〈適格機関投資家限定〉	85,688,096円
SMAM・インデックス・バランスVA25〈適格機関投資家専用〉	573,208,020円
SMAM・インデックス・バランスVA50〈適格機関投資家専用〉	1,715,554,716円
SMAM・バランスファンドVA40〈適格機関投資家専用〉	2,896,392,095円
SMAM・バランスファンドVA35〈適格機関投資家専用〉	5,284,633,258円
SMAM・バランスVA株40T〈適格機関投資家限定〉	130,398,140円
三井住友・5資産バランスファンド・VAS(適格機関投資家専用)	3,489,737,244円
SMAM・グローバルバランス40VA〈適格機関投資家限定〉	102,988,021円
SMAM・バランスファンドVA20〈適格機関投資家専用〉	187,530,886円
三井住友・7資産バランスファンド・VAS(適格機関投資家専用)	3,136,160,809円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A〈適格機関投資家専用〉	170,710,285円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A〈適格機関投資家専用〉	76,427,722円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A〈適格機関投資家専用〉	36,368,520円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L〈適格機関投資家専用〉	373,012,538円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L〈適格機関投資家専用〉	629,102,601円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T〈適格機関投資家専用〉	267,908,539円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A2〈適格機関投資家専用〉	182,110,004円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A2〈適格機関投資家専用〉	82,740,483円

S M A M ・ アセットバランスファンドV A 5 0 A 2 < 適格機関投資家専用 >	13,703,184円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 3 0 L 2 < 適格機関投資家専用 >	134,242,920円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 2 5 L 2 < 適格機関投資家専用 >	1,562,934,340円
S M A M ・ 国内株式インデックスファンド・ V A ( 適格機関投資家専用 )	272,134,221円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 2 0 T 2 < 適格機関投資家専用 >	33,498,132円
S M A M ・ F G 新興国重視型バランス 2 0 V A < 適格機関投資家限定 >	305,920円
S M A M ・ F G グローバルバランス 2 5 V A < 適格機関投資家限定 >	1,635,871円
S M A M ・ 年金Wリスクコントロールファンド< 適格機関投資家限定 >	150,170円
S M A M ・ マルチアセットストラテジーファンド 2 0 1 6 - 0 1 < 適格機関投資家限定 >	67,123,006円
合計	101,243,854,770円

(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
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)	88,471,035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(T O P I X)	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
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)	11,563,234,699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 >	53,219,713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 >	7,407,446,299円
S M A M ・ バランスファンドV A 2 5 < 適格機関投資家専用 >	5,242,604,674円
S M A M ・ バランスファンドV A 3 7 . 5 < 適格機関投資家専用 >	3,233,328,475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 >	11,906,550,508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 >	66,465,825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 >	286,787,060円
世界6資産バランスファンドV A < 適格機関投資家限定 >	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
SMAM・アセットバランスファンドVA20A2<適格機関投資家専用>	146,623,095円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A2<適格機関投資家専用>	71,447,740円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A2<適格機関投資家専用>	12,212,418円
SMAM・アセットバランスファンドVA30L2<適格機関投資家専用>	97,696,853円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L2<適格機関投資家専用>	1,243,055,864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)	232,330,680円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T2<適格機関投資家専用>	24,843,673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>	2,318,364,544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>	381,908,627円
SMAM・世界バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	2,280,387,276円
SMAM・世界バランスファンドVA2<適格機関投資家限定>	1,360,250,642円
SMAM・FG新興国重視型バランス20VA<適格機関投資家限定>	21,880円
SMAM・FGグローバルバランス25VA<適格機関投資家限定>	60,899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>	227,744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>	115,594,073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>	55,350,457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>	73,118,668円
合計	88,953,399,408円

## 附属明細表

## 有価証券明細表

## (a)株式

(単位:円)

銘柄	株数	評価額		備考
		単価	金額	

極洋	4,500	2,883.00	12,973,500
日本水産	129,200	536.00	69,251,200
マルハニチロ	19,000	3,315.00	62,985,000
カネコ種苗	4,700	1,397.00	6,565,900
サカタのタネ	14,600	3,440.00	50,224,000
ホクト	10,000	2,034.00	20,340,000
日鉄鉱業	2,700	5,570.00	15,039,000
三井松島産業	6,700	1,382.00	9,259,400
国際石油開発帝石	532,000	1,073.00	570,836,000
日本海洋掘削	4,000	2,245.00	8,980,000
石油資源開発	15,800	2,554.00	40,353,200
K & O エナジーグループ	7,100	1,715.00	12,176,500
ショーボンドホールディングス	9,300	4,900.00	45,570,000
ミライト・ホールディングス	30,700	1,056.00	32,419,200
タマホーム	10,600	618.00	6,550,800
ダイセキ環境ソリューション	4,200	1,353.00	5,682,600
安藤・間	72,000	750.00	54,000,000
東急建設	35,000	850.00	29,750,000
コムシスホールディングス	39,500	2,015.00	79,592,500
ミサワホーム	13,300	956.00	12,714,800
ピーアールホールディングス	12,700	396.00	5,029,200
高松コンストラクショングループ	7,100	2,545.00	18,069,500
東建コーポレーション	3,600	8,470.00	30,492,000
大成建設	513,000	819.00	420,147,000
大林組	300,300	1,041.00	312,612,300
清水建設	306,000	1,020.00	312,120,000
飛鳥建設	98,400	161.00	15,842,400
長谷工コーポレーション	117,000	1,166.00	136,422,000
松井建設	12,800	906.00	11,596,800
銭高組	17,000	365.00	6,205,000
鹿島建設	441,000	739.00	325,899,000
不動テトラ	84,600	174.00	14,720,400
鉄建建設	63,000	312.00	19,656,000
西松建設	118,000	541.00	63,838,000
三井住友建設	391,300	115.00	44,999,500
大豊建設	36,000	537.00	19,332,000
前田建設工業	67,000	965.00	64,655,000
ナカノフドー建設	9,600	621.00	5,961,600
奥村組	84,000	637.00	53,508,000
東鉄工業	11,500	3,125.00	35,937,500
イチケン	11,000	404.00	4,444,000
浅沼組	37,000	303.00	11,211,000

戸田建設	118,000	653.00	77,054,000
熊谷組	156,000	282.00	43,992,000
青木あすなろ建設	8,000	802.00	6,416,000
北野建設	29,000	285.00	8,265,000
三井ホーム	16,000	603.00	9,648,000
矢作建設工業	14,900	916.00	13,648,400
日本ハウスホールディングス	24,700	465.00	11,485,500
大東建託	37,200	15,955.00	593,526,000
新日本建設	12,700	848.00	10,769,600
N I P P O	22,000	2,071.00	45,562,000
東亜道路工業	25,000	323.00	8,075,000
前田道路	31,000	1,931.00	59,861,000
日本道路	32,000	471.00	15,072,000
東亜建設工業	8,500	1,976.00	16,796,000
若築建設	73,000	138.00	10,074,000
東洋建設	33,100	375.00	12,412,500
五洋建設	113,600	534.00	60,662,400
大林道路	12,400	607.00	7,526,800
世紀東急工業	16,900	504.00	8,517,600
福田組	16,000	985.00	15,760,000
住友林業	69,200	1,588.00	109,889,600
日成ビルド工業	30,000	515.00	15,450,000
ヤマダ・エスバイエルホーム	83,000	77.00	6,391,000
巴コーポレーション	11,100	332.00	3,685,200
パナホーム	37,000	995.00	36,815,000
大和ハウス工業	297,400	3,142.00	934,430,800
ライト工業	19,700	1,059.00	20,862,300
積水ハウス	317,200	1,799.00	570,642,800
日特建設	12,500	421.00	5,262,500
北陸電気工事	5,600	863.00	4,832,800
ユアテック	17,000	715.00	12,155,000
中電工	11,800	2,332.00	27,517,600
関電工	39,000	1,026.00	40,014,000
きんでん	66,800	1,520.00	101,536,000
東京エネシス	12,000	888.00	10,656,000
トーエネック	17,000	534.00	9,078,000
住友電設	7,700	1,222.00	9,409,400
日本電設工業	16,100	2,070.00	33,327,000
協和エクシオ	39,500	1,593.00	62,923,500
新日本空調	9,100	1,274.00	11,593,400
N D S	2,100	2,721.00	5,714,100
九電工	19,500	3,185.00	62,107,500



三機工業	22,200	916.00	20,335,200
日揮	94,300	1,901.00	179,264,300
中外炉工業	40,000	211.00	8,440,000
ヤマト	12,400	514.00	6,373,600
太平電業	14,000	1,041.00	14,574,000
高砂熱学工業	27,200	1,550.00	42,160,000
朝日工業社	3,000	3,000.00	9,000,000
明星工業	20,000	589.00	11,780,000
大気社	13,200	2,651.00	34,993,200
ダイダン	14,000	1,016.00	14,224,000
日比谷総合設備	11,000	1,592.00	17,512,000
東芝プラントシステム	16,600	1,565.00	25,979,000
O S J Bホールディングス	38,500	249.00	9,586,500
東洋エンジニアリング	58,000	268.00	15,544,000
千代田化工建設	74,000	726.00	53,724,000
新興プランテック	21,700	799.00	17,338,300
日本製粉	29,000	1,650.00	47,850,000
日清製粉グループ本社	109,700	1,663.00	182,431,100
日東富士製粉	1,300	3,915.00	5,089,500
昭和産業	40,000	576.00	23,040,000
鳥越製粉	11,600	802.00	9,303,200
中部飼料	12,100	1,090.00	13,189,000
フィード・ワン	66,100	201.00	13,286,100
日本甜菜製糖	6,100	2,249.00	13,718,900
三井製糖	6,800	2,641.00	17,958,800
日新製糖	4,600	1,789.00	8,229,400
森永製菓	19,800	5,310.00	105,138,000
中村屋	2,600	4,730.00	12,298,000
江崎グリコ	25,300	5,660.00	143,198,000
名糖産業	5,000	1,424.00	7,120,000
不二家	65,000	256.00	16,640,000
山崎製パン	73,900	2,312.00	170,856,800
モロゾフ	17,000	553.00	9,401,000
亀田製菓	5,700	4,970.00	28,329,000
寿スピリッツ	7,200	2,853.00	20,541,600
カルビー	41,200	3,800.00	156,560,000
森永乳業	91,000	842.00	76,622,000
六甲バター	4,800	2,347.00	11,265,600
ヤクルト本社	54,100	6,350.00	343,535,000
明治ホールディングス	59,600	9,500.00	566,200,000
雪印メグミルク	22,100	3,155.00	69,725,500
プリマハム	62,000	498.00	30,876,000

日本ハム	68,000	3,030.00	206,040,000
丸大食品	48,000	483.00	23,184,000
S Foods	5,200	3,140.00	16,328,000
伊藤ハム米久ホールディングス	57,200	1,024.00	58,572,800
サッポロホールディングス	33,300	2,968.00	98,834,400
アサヒグループホールディングス	189,300	4,291.00	812,286,300
キリンホールディングス	434,200	2,101.50	912,471,300
宝ホールディングス	73,600	1,173.00	86,332,800
オエノンホールディングス	36,000	237.00	8,532,000
養命酒製造	4,500	1,951.00	8,779,500
コカ・コーラボトラーズジャパン	63,625	3,250.00	206,781,250
サントリー食品インターナショナル	68,800	4,720.00	324,736,000
ダイドーグループホールディングス	4,600	5,150.00	23,690,000
伊藤園	30,100	4,015.00	120,851,500
キーコーヒー	8,900	2,171.00	19,321,900
日清オイリオグループ	57,000	666.00	37,962,000
不二製油グループ本社	27,300	2,550.00	69,615,000
J・オイルミルズ	4,700	4,140.00	19,458,000
キッコーマン	70,000	3,345.00	234,150,000
味の素	208,400	2,149.50	447,955,800
キューピー	51,500	2,757.00	141,985,500
ハウス食品グループ本社	37,600	2,423.00	91,104,800
カゴメ	36,700	2,911.00	106,833,700
焼津水産化学工業	4,100	1,262.00	5,174,200
アリアケジャパン	8,100	7,070.00	57,267,000
ニチレイ	49,500	2,710.00	134,145,000
東洋水産	49,400	4,155.00	205,257,000
日清食品ホールディングス	39,200	6,270.00	245,784,000
永谷園ホールディングス	11,000	1,397.00	15,367,000
一正蒲鉾	5,300	1,207.00	6,397,100
フジッコ	9,900	2,491.00	24,660,900
ロック・フィールド	9,700	1,810.00	17,557,000
日本たばこ産業	558,400	3,647.00	2,036,484,800
ケンコーマヨネーズ	4,000	2,726.00	10,904,000
わらべや日洋ホールディングス	6,100	2,545.00	15,524,500
なとり	6,500	1,795.00	11,667,500
ユーグレナ	32,800	1,183.00	38,802,400
ミヨシ油脂	53,000	136.00	7,208,000
理研ビタミン	3,400	4,040.00	13,736,000
片倉工業	12,700	1,301.00	16,522,700
ゲンゼ	69,000	439.00	30,291,000
東洋紡	379,000	187.00	70,873,000

ユニチカ	263,000	88.00	23,144,000
富士紡ホールディングス	5,000	2,851.00	14,255,000
倉敷紡績	93,000	223.00	20,739,000
シキボウ	68,000	130.00	8,840,000
日本毛織	26,300	854.00	22,460,200
帝国繊維	10,300	1,741.00	17,932,300
帝人	76,500	2,047.00	156,595,500
東レ	684,000	959.00	655,956,000
サカイオーベックス	3,400	1,695.00	5,763,000
住江織物	32,000	266.00	8,512,000
アツギ	95,000	127.00	12,065,000
ダイニック	33,000	180.00	5,940,000
セーレン	23,400	1,563.00	36,574,200
小松精練	15,900	670.00	10,653,000
ワコールホールディングス	56,000	1,336.00	74,816,000
ホギメディカル	5,900	6,750.00	39,825,000
レナウン	47,600	107.00	5,093,200
T S Iホールディングス	38,500	790.00	30,415,000
三陽商会	62,000	161.00	9,982,000
ナイガイ	65,000	52.00	3,380,000
オンワードホールディングス	63,000	854.00	53,802,000
ルック	28,000	188.00	5,264,000
ゴールドウイン	4,200	5,590.00	23,478,000
デサント	21,300	1,296.00	27,604,800
特種東海製紙	5,500	4,060.00	22,330,000
王子ホールディングス	363,000	516.00	187,308,000
日本製紙	41,900	2,064.00	86,481,600
三菱製紙	16,000	722.00	11,552,000
北越紀州製紙	52,400	766.00	40,138,400
中越パルプ工業	43,000	222.00	9,546,000
巴川製紙所	21,000	210.00	4,410,000
大王製紙	36,700	1,402.00	51,453,400
レンゴー	91,800	638.00	58,568,400
トモク	33,000	322.00	10,626,000
ザ・パック	6,400	3,020.00	19,328,000
クラレ	157,700	1,674.00	263,989,800
旭化成	588,000	1,019.50	599,466,000
共和レザー	7,500	827.00	6,202,500
昭和電工	63,100	1,725.00	108,847,500
住友化学	690,000	588.00	405,720,000
住友精化	4,000	4,475.00	17,900,000
日産化学工業	51,400	3,345.00	171,933,000

ラサ工業	51,000	131.00	6,681,000
クレハ	7,100	4,710.00	33,441,000
テイカ	16,000	709.00	11,344,000
石原産業	17,400	1,026.00	17,852,400
日東エフシー	6,800	936.00	6,364,800
日本曹達	57,000	597.00	34,029,000
東ソー	271,000	952.00	257,992,000
トクヤマ	148,000	485.00	71,780,000
セントラル硝子	98,000	451.00	44,198,000
東亜合成	59,300	1,222.00	72,464,600
大阪ソーダ	40,000	472.00	18,880,000
関東電化工業	19,000	883.00	16,777,000
デンカ	195,000	541.00	105,495,000
信越化学工業	168,800	9,328.00	1,574,566,400
日本カーバイド工業	39,000	138.00	5,382,000
堺化学工業	38,000	370.00	14,060,000
エア・ウォーター	76,900	2,016.00	155,030,400
大陽日酸	72,300	1,237.00	89,435,100
日本化学工業	41,000	215.00	8,815,000
日本パーカラライジング	48,800	1,335.00	65,148,000
高压ガス工業	15,500	716.00	11,098,000
四国化成工業	14,000	1,144.00	16,016,000
戸田工業	28,000	257.00	7,196,000
ステラ ケミファ	4,500	2,785.00	12,532,500
保土谷化学工業	3,600	3,305.00	11,898,000
日本触媒	14,900	7,110.00	105,939,000
大日精化工業	38,000	695.00	26,410,000
カネカ	127,000	826.00	104,902,000
三菱瓦斯化学	87,600	2,185.00	191,406,000
三井化学	426,000	533.00	227,058,000
J S R	94,700	1,820.00	172,354,000
東京応化工業	17,800	3,290.00	58,562,000
大阪有機化学工業	7,700	1,101.00	8,477,700
三菱ケミカルホールディングス	634,600	812.20	515,422,120
K Hネオケム	12,100	1,423.00	17,218,300
ダイセル	127,300	1,236.00	157,342,800
住友ベークライト	84,000	642.00	53,928,000
積水化学工業	213,800	1,775.00	379,495,000
日本ゼオン	80,000	1,158.00	92,640,000
アイカ工業	30,500	2,951.00	90,005,500
宇部興産	475,000	243.00	115,425,000
積水樹脂	14,200	1,817.00	25,801,400

タキロンシーアイ	22,000	543.00	11,946,000
旭有機材	40,000	220.00	8,800,000
日立化成	52,000	2,965.00	154,180,000
ニチバン	11,000	825.00	9,075,000
リケンテクノス	21,700	514.00	11,153,800
大倉工業	26,000	486.00	12,636,000
積水化成成品工業	15,000	748.00	11,220,000
群栄化学工業	2,600	3,465.00	9,009,000
ダイキョーニシカワ	16,500	1,319.00	21,763,500
日本化薬	61,000	1,446.00	88,206,000
カーリットホールディングス	11,800	534.00	6,301,200
日本精化	10,400	913.00	9,495,200
扶桑化学工業	6,700	3,150.00	21,105,000
A D E K A	40,700	1,568.00	63,817,600
日油	73,000	1,171.00	85,483,000
花王	239,200	6,109.00	1,461,272,800
第一工業製薬	24,000	388.00	9,312,000
三洋化成工業	5,600	4,560.00	25,536,000
大日本塗料	59,000	234.00	13,806,000
日本ペイントホールディングス	72,300	3,920.00	283,416,000
関西ペイント	98,700	2,312.00	228,194,400
中国塗料	27,800	776.00	21,572,800
日本特殊塗料	7,000	1,638.00	11,466,000
藤倉化成	16,000	632.00	10,112,000
太陽ホールディングス	7,700	4,540.00	34,958,000
D I C	37,000	3,775.00	139,675,000
サカタインクス	18,600	1,468.00	27,304,800
東洋インキSCホールディングス	89,000	515.00	45,835,000
T & K T O K A	7,700	1,000.00	7,700,000
富士フイルムホールディングス	186,600	4,196.00	782,973,600
資生堂	179,200	2,910.00	521,472,000
ライオン	117,000	2,011.00	235,287,000
高砂香料工業	6,400	3,565.00	22,816,000
マンダム	9,200	5,230.00	48,116,000
ミルボン	4,900	5,320.00	26,068,000
ファンケル	20,000	1,643.00	32,860,000
コーセー	15,200	10,030.00	152,456,000
シーズ・ホールディングス	12,400	3,255.00	40,362,000
ポーラ・オルビスホールディングス	38,400	2,593.00	99,571,200
ノエビアホールディングス	5,700	4,485.00	25,564,500
エステー	7,800	1,708.00	13,322,400
コニシ	14,500	1,295.00	18,777,500

長谷川香料	11,700	2,066.00	24,172,200
星光PMC	5,600	1,147.00	6,423,200
小林製薬	26,200	5,590.00	146,458,000
荒川化学工業	8,000	1,815.00	14,520,000
メック	8,100	1,120.00	9,072,000
日本高純度化学	3,800	2,230.00	8,474,000
タカラバイオ	20,300	1,499.00	30,429,700
JCU	5,800	3,175.00	18,415,000
新田ゼラチン	8,100	706.00	5,718,600
デクセリアルズ	24,900	1,045.00	26,020,500
アース製薬	6,600	6,000.00	39,600,000
イハラケミカル工業	12,800	968.00	12,390,400
北興化学工業	14,000	430.00	6,020,000
大成ラミック	3,200	2,730.00	8,736,000
クミアイ化学工業	21,200	619.00	13,122,800
日本農薬	22,200	684.00	15,184,800
アキレス	8,700	1,682.00	14,633,400
有沢製作所	17,400	709.00	12,336,600
日東電工	67,900	8,185.00	555,761,500
レック	6,200	2,106.00	13,057,200
きもと	23,400	215.00	5,031,000
藤森工業	6,900	3,135.00	21,631,500
前澤化成工業	8,100	1,111.00	8,999,100
JSP	4,500	2,462.00	11,079,000
エフピコ	8,200	5,140.00	42,148,000
天馬	6,300	1,963.00	12,366,900
信越ポリマー	18,400	748.00	13,763,200
東リ	27,100	362.00	9,810,200
ニフコ	16,600	5,450.00	90,470,000
日本バルカー工業	8,600	1,793.00	15,419,800
ユニ・チャーム	191,500	2,607.00	499,240,500
協和発酵キリン	111,600	1,689.00	188,492,400
武田薬品工業	352,800	5,186.00	1,829,620,800
アステラス製薬	961,600	1,514.00	1,455,862,400
大日本住友製薬	66,300	1,787.00	118,478,100
塩野義製薬	119,400	5,708.00	681,535,200
田辺三菱製薬	108,700	2,295.00	249,466,500
あすか製薬	10,600	1,546.00	16,387,600
日本新薬	21,600	5,600.00	120,960,000
中外製薬	93,300	3,780.00	352,674,000
科研製薬	17,800	6,260.00	111,428,000
エーザイ	116,200	5,635.00	654,787,000

ロート製薬	46,300	1,929.00	89,312,700
小野薬品工業	214,600	2,236.00	479,845,600
久光製薬	26,600	5,690.00	151,354,000
持田製薬	6,500	8,170.00	53,105,000
参天製薬	169,800	1,520.00	258,096,000
扶桑薬品工業	4,200	2,752.00	11,558,400
日本ケミファ	1,800	5,020.00	9,036,000
ツムラ	32,000	3,425.00	109,600,000
日医工	22,700	1,757.00	39,883,900
キッセイ薬品工業	16,900	2,823.00	47,708,700
生化学工業	17,700	1,713.00	30,320,100
栄研化学	8,100	2,962.00	23,992,200
鳥居薬品	6,200	2,858.00	17,719,600
JCRファーマ	7,600	2,219.00	16,864,400
東和薬品	4,400	5,350.00	23,540,000
富士製薬工業	3,500	3,060.00	10,710,000
沢井製薬	16,200	5,830.00	94,446,000
ゼリア新薬工業	19,600	1,663.00	32,594,800
第一三共	277,500	2,418.50	671,133,750
キョーリン製薬ホールディングス	23,100	2,313.00	53,430,300
大幸薬品	5,500	1,810.00	9,955,000
ダイト	6,300	2,180.00	13,734,000
大塚ホールディングス	202,500	5,102.00	1,033,155,000
大正製薬ホールディングス	20,000	8,910.00	178,200,000
ペプチドリーム	17,400	6,460.00	112,404,000
日本コークス工業	90,300	92.00	8,307,600
昭和シェル石油	84,800	1,079.00	91,499,200
ニチレキ	13,300	880.00	11,704,000
ユシロ化学工業	6,700	1,340.00	8,978,000
ビーピー・カストロール	5,200	1,683.00	8,751,600
MORESCO	4,200	1,639.00	6,883,800
出光興産	44,800	3,720.00	166,656,000
JXTGホールディングス	1,434,750	504.60	723,974,850
コスモエネルギーホールディングス	27,500	1,778.00	48,895,000
横浜ゴム	57,000	2,065.00	117,705,000
東洋ゴム工業	50,100	1,800.00	90,180,000
ブリヂストン	317,500	4,392.00	1,394,460,000
住友ゴム工業	87,800	1,850.00	162,430,000
藤倉ゴム工業	10,400	626.00	6,510,400
オカモト	29,000	1,165.00	33,785,000
ニッタ	8,400	2,908.00	24,427,200
住友理工	17,600	1,050.00	18,480,000

三ツ星ベルト	24,000	1,010.00	24,240,000
バンドー化学	17,400	955.00	16,617,000
日東紡績	77,000	518.00	39,886,000
旭硝子	462,000	873.00	403,326,000
日本板硝子	41,500	772.00	32,038,000
日本山村硝子	49,000	182.00	8,918,000
日本電気硝子	194,000	644.00	124,936,000
オハラ	4,700	958.00	4,502,600
住友大阪セメント	175,000	453.00	79,275,000
太平洋セメント	568,000	358.00	203,344,000
日本ヒューム	11,600	667.00	7,737,200
日本コンクリート工業	26,400	331.00	8,738,400
三谷セキサン	5,100	2,454.00	12,515,400
アジアパイルホールディングス	13,800	544.00	7,507,200
東海カーボン	88,000	448.00	39,424,000
日本カーボン	48,000	289.00	13,872,000
東洋炭素	6,100	1,669.00	10,180,900
ノリタケカンパニーリミテド	5,300	2,853.00	15,120,900
TOTO	68,800	4,145.00	285,176,000
日本碍子	118,600	2,359.00	279,777,400
日本特殊陶業	81,000	2,259.00	182,979,000
MARUWA	3,800	3,635.00	13,813,000
品川リフラクトリーズ	28,000	280.00	7,840,000
黒崎播磨	23,000	415.00	9,545,000
ニッカトー	8,200	414.00	3,394,800
フジインコーポレーテッド	8,200	1,987.00	16,293,400
ニチアス	49,000	1,042.00	51,058,000
ニチハ	12,500	3,210.00	40,125,000
新日鐵住金	424,200	2,421.50	1,027,200,300
神戸製鋼所	162,500	962.00	156,325,000
中山製鋼所	12,400	674.00	8,357,600
合同製鐵	6,000	1,595.00	9,570,000
ジェイ エフ イー ホールディングス	257,300	1,787.00	459,795,100
日新製鋼	43,300	1,381.00	59,797,300
東京製鐵	47,600	874.00	41,602,400
共英製鋼	9,900	1,870.00	18,513,000
大和工業	18,900	2,729.00	51,578,100
東京鐵鋼	23,000	404.00	9,292,000
大阪製鐵	6,200	1,988.00	12,325,600
淀川製鋼所	12,300	2,827.00	34,772,100
東洋鋼鈹	24,300	361.00	8,772,300
丸一鋼管	31,200	3,105.00	96,876,000



モリ工業	3,800	2,027.00	7,702,600
大同特殊鋼	158,000	501.00	79,158,000
日本冶金工業	79,900	194.00	15,500,600
山陽特殊製鋼	56,000	547.00	30,632,000
愛知製鋼	5,400	4,055.00	21,897,000
日立金属	95,200	1,431.00	136,231,200
日本金属	3,600	1,331.00	4,791,600
大太平洋金属	61,000	371.00	22,631,000
新日本電工	54,900	331.00	18,171,900
栗本鐵工所	5,400	2,036.00	10,994,400
虹技	21,000	205.00	4,305,000
三菱製鋼	66,000	221.00	14,586,000
日亜鋼業	21,100	254.00	5,359,400
シンニッタン	9,700	665.00	6,450,500
大紀アルミニウム工業所	19,000	461.00	8,759,000
日本軽金属ホールディングス	234,200	234.00	54,802,800
三井金属鉱業	260,000	336.00	87,360,000
東邦亜鉛	56,000	473.00	26,488,000
三菱マテリアル	59,000	3,190.00	188,210,000
住友金属鉱山	245,000	1,488.50	364,682,500
D O W Aホールディングス	105,000	770.00	80,850,000
古河機械金属	150,000	195.00	29,250,000
大阪チタニウムテクノロジーズ	11,700	1,592.00	18,626,400
東邦チタニウム	18,300	794.00	14,530,200
U A C J	127,000	281.00	35,687,000
古河電気工業	31,800	4,170.00	132,606,000
住友電気工業	355,400	1,713.00	608,800,200
フジクラ	124,900	765.00	95,548,500
タツタ電線	20,100	521.00	10,472,100
平河ヒューテック	6,000	1,240.00	7,440,000
リョービ	59,000	460.00	27,140,000
アーレスティ	11,800	958.00	11,304,400
アサヒホールディングス	14,500	1,971.00	28,579,500
稲葉製作所	6,900	1,341.00	9,252,900
宮地エンジニアリンググループ	35,000	193.00	6,755,000
トーカロ	6,700	2,747.00	18,404,900
S U M C O	98,800	1,789.00	176,753,200
川田テクノロジーズ	1,900	6,490.00	12,331,000
東洋製罐グループホールディングス	67,000	1,791.00	119,997,000
ホッカンホールディングス	28,000	479.00	13,412,000
コロナ	7,300	1,082.00	7,898,600
横河ブリッジホールディングス	17,400	1,255.00	21,837,000

駒井ハルテック	2,700	2,016.00	5,443,200
三和ホールディングス	93,900	1,035.00	97,186,500
文化シャッター	26,800	797.00	21,359,600
三協立山	12,600	1,551.00	19,542,600
アルインコ	9,100	930.00	8,463,000
LIXILグループ	131,000	2,752.00	360,512,000
日本フィルコン	11,700	557.00	6,516,900
ノーリツ	18,700	2,060.00	38,522,000
長府製作所	10,100	2,589.00	26,148,900
リンナイ	16,100	9,000.00	144,900,000
日東精工	17,500	433.00	7,577,500
岡部	20,100	964.00	19,376,400
ジーテクト	9,900	1,830.00	18,117,000
東プレ	18,300	2,697.00	49,355,100
高周波熱錬	18,700	856.00	16,007,200
東京製網	7,600	1,565.00	11,894,000
パイオラックス	14,400	2,400.00	34,560,000
日本発條	89,400	1,173.00	104,866,200
三益半導体工業	8,700	1,607.00	13,980,900
日本製鋼所	31,300	1,710.00	53,523,000
三浦工業	38,500	1,764.00	67,914,000
タクマ	29,900	1,084.00	32,411,600
ツガミ	25,000	825.00	20,625,000
オークマ	61,000	1,092.00	66,612,000
東芝機械	56,000	438.00	24,528,000
アマダホールディングス	125,800	1,253.00	157,627,400
アイダエンジニアリング	26,300	900.00	23,670,000
滝澤鉄工所	38,000	153.00	5,814,000
富士機械製造	27,700	1,336.00	37,007,200
牧野フライス製作所	46,000	928.00	42,688,000
オーエスジー	43,100	2,198.00	94,733,800
旭ダイヤモンド工業	26,600	794.00	21,120,400
D M G 森精機	56,100	1,635.00	91,723,500
ソディック	24,300	978.00	23,765,400
ディスコ	11,000	16,010.00	176,110,000
日東工器	6,100	2,475.00	15,097,500
O K K	54,000	107.00	5,778,000
津田駒工業	32,000	155.00	4,960,000
島精機製作所	12,300	3,730.00	45,879,000
フリーー	6,600	1,352.00	8,923,200
ヤマシンフィルタ	2,200	1,755.00	3,861,000
日阪製作所	14,700	904.00	13,288,800

やまびこ	17,100	1,217.00	20,810,700
ペガサスミシン製造	10,200	819.00	8,353,800
ナブテスコ	49,000	2,965.00	145,285,000
三井海洋開発	9,600	2,311.00	22,185,600
レオン自動機	8,500	933.00	7,930,500
S M C	28,200	30,840.00	869,688,000
新川	9,500	697.00	6,621,500
ホソカワミクロン	3,600	3,920.00	14,112,000
ユニオンツール	3,900	3,185.00	12,421,500
オイレス工業	12,000	1,959.00	23,508,000
日精エー・エス・ピー機械	3,200	2,544.00	8,140,800
サトーホールディングス	11,900	2,286.00	27,203,400
日精樹脂工業	8,700	969.00	8,430,300
ワイエイシイホールディングス	4,500	1,208.00	5,436,000
小松製作所	434,500	2,753.00	1,196,178,500
住友重機械工業	274,000	736.00	201,664,000
日立建機	41,900	2,577.00	107,976,300
日工	3,900	1,916.00	7,472,400
巴工業	5,000	1,760.00	8,800,000
井関農機	96,000	223.00	21,408,000
T O W A	7,900	1,694.00	13,382,600
丸山製作所	3,200	1,680.00	5,376,000
北川鉄工所	5,200	2,052.00	10,670,400
ローツェ	3,500	2,223.00	7,780,500
クボタ	450,400	1,662.50	748,790,000
三菱化工機	38,000	208.00	7,904,000
月島機械	17,300	1,128.00	19,514,400
帝国電機製作所	8,200	977.00	8,011,400
新東工業	21,700	902.00	19,573,400
澁谷工業	8,000	2,746.00	21,968,000
アイチ コーポレーション	14,900	806.00	12,009,400
小森コーポレーション	22,600	1,384.00	31,278,400
鶴見製作所	7,600	1,568.00	11,916,800
住友精密工業	22,000	351.00	7,722,000
酒井重工業	22,000	284.00	6,248,000
荏原製作所	42,600	3,230.00	137,598,000
西島製作所	11,200	979.00	10,964,800
北越工業	11,100	946.00	10,500,600
ダイキン工業	122,600	10,590.00	1,298,334,000
オルガノ	22,000	467.00	10,274,000
トーヨーカネツ	48,000	264.00	12,672,000
栗田工業	53,200	2,731.00	145,289,200

椿本チエイン	52,000	910.00	47,320,000
大同工業	24,000	262.00	6,288,000
アネスト岩田	16,800	937.00	15,741,600
ダイフク	44,700	2,602.00	116,309,400
加藤製作所	5,300	2,601.00	13,785,300
タダノ	47,600	1,303.00	62,022,800
フジテック	25,700	1,226.00	31,508,200
C K D	26,400	1,303.00	34,399,200
キトー	12,400	1,037.00	12,858,800
平和	27,900	2,744.00	76,557,600
理想科学工業	8,600	1,843.00	15,849,800
S A N K Y O	25,100	3,710.00	93,121,000
日本金銭機械	9,200	1,292.00	11,886,400
マースエンジニアリング	5,600	2,184.00	12,230,400
福島工業	5,400	3,795.00	20,493,000
オーイズミ	5,200	547.00	2,844,400
ダイコク電機	4,500	1,533.00	6,898,500
竹内製作所	16,200	1,779.00	28,819,800
アマノ	27,000	2,039.00	55,053,000
J U K I	14,000	1,173.00	16,422,000
サンデンホールディングス	56,000	347.00	19,432,000
蛇の目マシン工業	10,600	716.00	7,589,600
マックス	14,000	1,470.00	20,580,000
グローリー	28,800	3,575.00	102,960,000
新晃工業	6,900	1,571.00	10,839,900
大和冷機工業	13,600	1,093.00	14,864,800
セガサミーホールディングス	89,300	1,454.00	129,842,200
日本ピストンリング	4,000	2,259.00	9,036,000
リケン	4,200	4,675.00	19,635,000
T P R	9,900	3,390.00	33,561,000
ツバキ・ナカシマ	10,100	1,853.00	18,715,300
ホシザキ	19,700	8,950.00	176,315,000
大豊工業	7,700	1,436.00	11,057,200
日本精工	183,800	1,460.00	268,348,000
N T N	208,000	515.00	107,120,000
ジェイテクト	94,900	1,677.00	159,147,300
不二越	91,000	565.00	51,415,000
日本トムソン	29,200	576.00	16,819,200
T H K	63,600	2,683.00	170,638,800
ユーシン精機	4,300	2,813.00	12,095,900
前澤給装工業	4,400	1,543.00	6,789,200
イーグル工業	9,400	1,402.00	13,178,800

日本ピラー工業	9,800	1,358.00	13,308,400
キット	42,500	736.00	31,280,000
日立工機	24,500	866.00	21,217,000
マキタ	116,800	3,825.00	446,760,000
日立造船	72,600	613.00	44,503,800
三菱重工業	1,508,000	431.50	650,702,000
I H I	692,000	352.00	243,584,000
スター精密	15,800	1,715.00	27,097,000
日清紡ホールディングス	50,400	1,079.00	54,381,600
イビデン	63,100	1,625.00	102,537,500
コニカミノルタ	209,300	944.00	197,579,200
ブラザー工業	116,100	2,182.00	253,330,200
ミネベアミツミ	164,000	1,440.00	236,160,000
日立製作所	2,159,000	574.30	1,239,913,700
東芝	1,833,000	210.10	385,113,300
三菱電機	959,200	1,498.00	1,436,881,600
富士電機	271,000	601.00	162,871,000
東洋電機製造	5,000	1,672.00	8,360,000
安川電機	103,800	2,031.00	210,817,800
シンフォニアテクノロジー	60,000	278.00	16,680,000
明電舎	84,000	368.00	30,912,000
オリジン電気	18,000	281.00	5,058,000
山洋電気	24,000	773.00	18,552,000
デンヨー	8,700	1,520.00	13,224,000
東芝テック	57,000	575.00	32,775,000
芝浦メカトロニクス	20,000	244.00	4,880,000
マブチモーター	25,300	6,030.00	152,559,000
日本電産	116,600	9,843.00	1,147,693,800
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	1,100	2,940.00	3,234,000
東光高岳	5,200	1,888.00	9,817,600
ダブル・スコープ	9,000	1,418.00	12,762,000
ダイヘン	50,000	669.00	33,450,000
田淵電機	15,800	314.00	4,961,200
ヤーマン	1,400	5,290.00	7,406,000
JVCケンウッド	67,000	263.00	17,621,000
ミマキエンジニアリング	9,700	600.00	5,820,000
第一精工	5,200	1,573.00	8,179,600
日新電機	18,500	1,226.00	22,681,000
大崎電気工業	18,000	902.00	16,236,000
オムロン	95,200	4,725.00	449,820,000
日東工業	12,900	1,516.00	19,556,400
I D E C	12,700	1,141.00	14,490,700

ジーエス・ユアサ コーポレーション	173,000	488.00	84,424,000
サクサホールディングス	30,000	199.00	5,970,000
メルコホールディングス	5,200	3,095.00	16,094,000
テクノメディカ	2,800	1,936.00	5,420,800
日本電気	1,236,000	259.00	320,124,000
富士通	868,000	658.90	571,925,200
沖電気工業	39,100	1,589.00	62,129,900
岩崎通信機	40,000	81.00	3,240,000
電気興業	27,000	531.00	14,337,000
サンケン電気	53,000	426.00	22,578,000
アイホン	5,700	1,718.00	9,792,600
ルネサスエレクトロニクス	46,200	1,042.00	48,140,400
セイコーエプソン	133,300	2,258.00	300,991,400
ワコム	71,900	386.00	27,753,400
アルバック	15,100	4,585.00	69,233,500
E I Z O	9,000	3,370.00	30,330,000
ジャパンディスプレイ	168,800	238.00	40,174,400
日本信号	25,100	972.00	24,397,200
京三製作所	28,000	404.00	11,312,000
能美防災	10,100	1,501.00	15,160,100
ホーチキ	7,500	1,327.00	9,952,500
エレコム	8,100	2,157.00	17,471,700
日本無線	6,200	1,365.00	8,463,000
パナソニック	1,032,000	1,228.50	1,267,812,000
アンリツ	66,500	768.00	51,072,000
富士通ゼネラル	30,000	2,199.00	65,970,000
日立国際電気	23,400	2,324.00	54,381,600
ソニー	634,800	3,446.00	2,187,520,800
T D K	50,500	6,530.00	329,765,000
タムラ製作所	35,000	460.00	16,100,000
アルプス電気	82,900	2,909.00	241,156,100
池上通信機	42,000	138.00	5,796,000
パイオニア	137,500	201.00	27,637,500
日本電波工業	12,100	759.00	9,183,900
日本トリム	2,500	3,600.00	9,000,000
ローランド ディー . ジー .	4,800	3,175.00	15,240,000
フォスター電機	10,800	1,732.00	18,705,600
クラリオン	48,000	404.00	19,392,000
S M K	27,000	368.00	9,936,000
ヨコオ	7,200	1,218.00	8,769,600
ホシデン	27,800	1,119.00	31,108,200
ヒロセ電機	14,500	14,610.00	211,845,000

日本航空電子工業	26,000	1,338.00	34,788,000
TOA	11,900	905.00	10,769,500
日立マクセル	13,400	1,912.00	25,620,800
古野電気	13,300	688.00	9,150,400
ユニデンホールディングス	38,000	157.00	5,966,000
アルパイン	21,900	1,470.00	32,193,000
スミダコーポレーション	8,200	1,274.00	10,446,800
アイコム	5,700	2,487.00	14,175,900
リオン	4,700	1,421.00	6,678,700
本多通信工業	3,700	1,284.00	4,750,800
船井電機	11,400	828.00	9,439,200
横河電機	97,400	1,697.00	165,287,800
新電元工業	35,000	449.00	15,715,000
アズビル	27,200	3,625.00	98,600,000
日本光電工業	37,800	2,413.00	91,211,400
チノー	5,500	1,187.00	6,528,500
共和電業	15,500	432.00	6,696,000
堀場製作所	17,900	6,090.00	109,011,000
アドバンテスト	61,300	1,909.00	117,021,700
エスペック	8,600	1,310.00	11,266,000
キーエンス	40,800	43,160.00	1,760,928,000
日置電機	5,600	2,078.00	11,636,800
シスメックス	69,700	6,760.00	471,172,000
日本マイクロニクス	17,600	863.00	15,188,800
メガチップス	8,600	2,557.00	21,990,200
OBARA GROUP	5,300	4,660.00	24,698,000
コーセル	12,600	1,392.00	17,539,200
イリソ電子工業	2,900	6,540.00	18,966,000
オブテックスグループ	7,000	2,855.00	19,985,000
千代田インテグレ	5,000	2,286.00	11,430,000
アイ・オー・データ機器	3,600	1,016.00	3,657,600
レーザーテック	19,800	1,296.00	25,660,800
スタンレー電気	63,900	3,020.00	192,978,000
岩崎電気	44,000	156.00	6,864,000
ウシオ電機	55,000	1,373.00	75,515,000
ヘリオス テクノ ホールディング	10,600	569.00	6,031,400
日本セラミック	7,600	2,236.00	16,993,600
遠藤照明	7,400	856.00	6,334,400
古河電池	8,000	712.00	5,696,000
山一電機	8,800	1,323.00	11,642,400
図研	7,300	1,304.00	9,519,200
日本電子	34,000	508.00	17,272,000

カシオ計算機	72,700	1,499.00	108,977,300	
ファナック	91,200	21,975.00	2,004,120,000	
日本シイエムケイ	21,800	660.00	14,388,000	
エンプラス	4,400	2,961.00	13,028,400	
大真空	3,900	1,292.00	5,038,800	
ローム	43,400	6,920.00	300,328,000	
浜松ホトニクス	70,100	3,080.00	215,908,000	
三井ハイテック	12,600	1,001.00	12,612,600	
新光電気工業	33,700	689.00	23,219,300	
京セラ	147,600	5,893.00	869,806,800	
太陽誘電	44,100	1,255.00	55,345,500	
村田製作所	94,300	14,370.00	1,355,091,000	
ユーシン	14,100	704.00	9,926,400	
双葉電子工業	14,700	1,877.00	27,591,900	
北陸電気工業	50,000	123.00	6,150,000	
ニチコン	28,200	960.00	27,072,000	
日本ケミコン	78,000	320.00	24,960,000	
K O A	12,900	1,387.00	17,892,300	
市光工業	20,000	506.00	10,120,000	
小糸製作所	53,500	5,360.00	286,760,000	
ミツバ	16,500	1,968.00	32,472,000	
S C R E E Nホールディングス	18,500	7,470.00	138,195,000	
キャノン電子	7,200	1,722.00	12,398,400	
キャノン	483,800	3,384.00	1,637,179,200	
リコー	269,400	916.00	246,770,400	
東京エレクトロン	60,000	11,760.00	705,600,000	
トヨタ紡織	31,100	2,394.00	74,453,400	
芦森工業	33,000	151.00	4,983,000	
ユニプレス	17,100	2,182.00	37,312,200	
豊田自動織機	81,800	5,120.00	418,816,000	
モリタホールディングス	15,600	1,586.00	24,741,600	
三櫻工業	14,800	752.00	11,129,600	
デンソー	221,400	4,650.00	1,029,510,000	
東海理化電機製作所	23,700	2,045.00	48,466,500	
三井造船	325,000	166.00	53,950,000	
川崎重工業	700,000	323.00	226,100,000	
名村造船所	26,900	699.00	18,803,100	
日本車輛製造	40,000	303.00	12,120,000	
ニチユ三菱フォークリフト	13,000	647.00	8,411,000	
日産自動車	1,060,300	1,010.50	1,071,433,150	
いすゞ自動車	261,700	1,387.00	362,977,900	
トヨタ自動車	1,093,300	5,731.00	6,265,702,300	代用有価証券 500,000株



日野自動車	127,800	1,252.00	160,005,600
三菱自動車工業	329,600	637.00	209,955,200
エフテック	6,600	1,251.00	8,256,600
武蔵精密工業	10,500	2,539.00	26,659,500
日産車体	39,400	976.00	38,454,400
新明和工業	36,000	1,006.00	36,216,000
極東開発工業	18,200	1,680.00	30,576,000
日信工業	19,700	1,850.00	36,445,000
トピー工業	7,500	2,770.00	20,775,000
ティラド	43,000	306.00	13,158,000
曙ブレーキ工業	42,100	311.00	13,093,100
タチエス	15,500	2,075.00	32,162,500
N O K	43,400	2,401.00	104,203,400
フタバ産業	27,600	735.00	20,286,000
K Y B	101,000	506.00	51,106,000
大同メタル工業	13,500	907.00	12,244,500
プレス工業	48,400	512.00	24,780,800
ミクニ	16,500	402.00	6,633,000
太平洋工業	18,300	1,390.00	25,437,000
ケーヒン	20,800	1,683.00	35,006,400
河西工業	12,400	1,288.00	15,971,200
アイシン精機	81,900	5,040.00	412,776,000
富士機工	12,100	511.00	6,183,100
マツダ	285,500	1,473.00	420,541,500
今仙電機製作所	10,800	934.00	10,087,200
本田技研工業	808,600	3,135.00	2,534,961,000
スズキ	178,600	4,472.00	798,699,200
S U B A R U	279,400	3,914.00	1,093,571,600
安永	3,700	1,329.00	4,917,300
ヤマハ発動機	126,500	2,494.00	315,491,000
ショーワ	23,300	906.00	21,109,800
T B K	14,900	456.00	6,794,400
エクセディ	11,800	2,940.00	34,692,000
豊田合成	29,000	2,653.00	76,937,000
愛三工業	15,900	872.00	13,864,800
ヨロズ	8,500	1,597.00	13,574,500
エフ・シー・シー	14,900	2,101.00	31,304,900
シマノ	36,200	16,370.00	592,594,000
テイ・エス テック	21,000	2,782.00	58,422,000
ジャムコ	5,800	2,309.00	13,392,200
テルモ	137,900	3,915.00	539,878,500
日機装	30,900	1,156.00	35,720,400

島津製作所	115,400	1,741.00	200,911,400
JMS	23,000	312.00	7,176,000
ブイ・テクノロジー	1,900	15,280.00	29,032,000
東京計器	39,000	255.00	9,945,000
愛知時計電機	1,900	3,555.00	6,754,500
東京精密	17,100	3,275.00	56,002,500
マニー	12,100	2,659.00	32,173,900
ニコン	156,800	1,544.00	242,099,200
トプコン	45,100	1,798.00	81,089,800
オリンパス	143,100	4,055.00	580,270,500
理研計器	8,600	1,553.00	13,355,800
タムロン	8,200	1,933.00	15,850,600
H O Y A	185,300	5,136.00	951,700,800
ノーリツ鋼機	10,600	798.00	8,458,800
シチズン時計	98,600	687.00	67,738,200
リズム時計工業	50,000	179.00	8,950,000
大研医器	9,800	771.00	7,555,800
メニコン	6,100	3,225.00	19,672,500
松風	6,500	1,274.00	8,281,000
セイコーホールディングス	62,000	440.00	27,280,000
ニプロ	62,400	1,633.00	101,899,200
スノーピーク	1,700	3,015.00	5,125,500
パラマウントベッドホールディングス	8,600	4,500.00	38,700,000
トランザクション	4,800	824.00	3,955,200
ニホンフラッシュ	5,200	1,299.00	6,754,800
前田工織	9,800	1,377.00	13,494,600
永大産業	15,000	498.00	7,470,000
アートネイチャー	12,800	705.00	9,024,000
ダンロップスポーツ	7,900	1,020.00	8,058,000
バンダイナムコホールディングス	99,000	3,270.00	323,730,000
S H O E I	4,500	2,729.00	12,280,500
フランスベッドホールディングス	13,900	896.00	12,454,400
パイロットコーポレーション	15,600	4,340.00	67,704,000
萩原工業	3,400	2,593.00	8,816,200
トッパン・フォームズ	15,100	1,079.00	16,292,900
フジシールインターナショナル	20,000	2,489.00	49,780,000
タカラトミー	35,000	1,074.00	37,590,000
アーク	47,100	94.00	4,427,400
プロネクサス	9,800	1,315.00	12,887,000
大建工業	7,300	2,030.00	14,819,000
凸版印刷	254,000	1,098.00	278,892,000
大日本印刷	257,000	1,191.00	306,087,000

図書印刷	14,000	484.00	6,776,000
共同印刷	32,000	352.00	11,264,000
日本写真印刷	14,900	2,422.00	36,087,800
宝印刷	5,900	1,601.00	9,445,900
アシックス	89,000	1,823.00	162,247,000
ツツミ	3,700	2,001.00	7,403,700
小松ウオール工業	4,000	1,798.00	7,192,000
ヤマハ	60,400	3,020.00	182,408,000
河合楽器製作所	4,200	2,180.00	9,156,000
クリナップ	12,400	785.00	9,734,000
ピジョン	54,300	3,470.00	188,421,000
キングジム	8,000	864.00	6,912,000
リンテック	21,500	2,317.00	49,815,500
T A S A K I	2,000	2,198.00	4,396,000
イトーキ	21,000	682.00	14,322,000
任天堂	55,400	25,240.00	1,398,296,000
三菱鉛筆	7,200	5,490.00	39,528,000
タカラスタANDARD	18,300	1,764.00	32,281,200
コクヨ	46,700	1,409.00	65,800,300
ナカバヤシ	18,000	259.00	4,662,000
グローブライド	5,300	1,852.00	9,815,600
岡村製作所	31,200	916.00	28,579,200
美津濃	47,000	542.00	25,474,000
東京電力ホールディングス	760,600	415.00	315,649,000
中部電力	297,000	1,472.00	437,184,000
関西電力	367,300	1,425.50	523,586,150
中国電力	123,200	1,234.00	152,028,800
北陸電力	88,100	1,026.00	90,390,600
東北電力	224,500	1,525.00	342,362,500
四国電力	81,200	1,232.00	100,038,400
九州電力	197,900	1,206.00	238,667,400
北海道電力	84,500	799.00	67,515,500
沖縄電力	13,000	2,545.00	33,085,000
電源開発	71,500	2,535.00	181,252,500
エフオン	4,500	887.00	3,991,500
イーレックス	12,100	1,253.00	15,161,300
東京瓦斯	965,000	507.50	489,737,500
大阪瓦斯	874,000	422.00	368,828,000
東邦瓦斯	224,000	788.00	176,512,000
北海道瓦斯	24,000	275.00	6,600,000
広島ガス	20,400	348.00	7,099,200
西部瓦斯	100,000	247.00	24,700,000

静岡ガス	26,800	753.00	20,180,400
メタウォーター	5,100	2,730.00	13,923,000
SBSホールディングス	9,900	789.00	7,811,100
東武鉄道	477,000	562.00	268,074,000
相鉄ホールディングス	144,000	517.00	74,448,000
東京急行電鉄	489,000	807.00	394,623,000
京浜急行電鉄	247,000	1,239.00	306,033,000
小田急電鉄	143,300	2,160.00	309,528,000
京王電鉄	249,000	894.00	222,606,000
京成電鉄	67,200	2,669.00	179,356,800
富士急行	25,000	970.00	24,250,000
新京成電鉄	14,000	410.00	5,740,000
東日本旅客鉄道	173,800	9,682.00	1,682,731,600
西日本旅客鉄道	86,700	7,490.00	649,383,000
東海旅客鉄道	74,700	18,375.00	1,372,612,500
西武ホールディングス	124,400	1,903.00	236,733,200
鴻池運輸	12,300	1,497.00	18,413,100
西日本鉄道	108,000	462.00	49,896,000
ハマキョウレックス	6,400	2,126.00	13,606,400
サカイ引越センター	3,400	3,330.00	11,322,000
近鉄グループホールディングス	905,000	402.00	363,810,000
阪急阪神ホールディングス	113,600	3,635.00	412,936,000
南海電気鉄道	190,000	547.00	103,930,000
京阪ホールディングス	201,000	683.00	137,283,000
神戸電鉄	25,000	381.00	9,525,000
名古屋鉄道	328,000	509.00	166,952,000
山陽電気鉄道	33,000	560.00	18,480,000
日本通運	346,000	576.00	199,296,000
ヤマトホールディングス	161,200	2,309.00	372,210,800
山九	119,000	669.00	79,611,000
丸全昭和運輸	33,000	427.00	14,091,000
センコーグループホールディングス	42,400	688.00	29,171,200
トナミホールディングス	23,000	365.00	8,395,000
ニッコンホールディングス	30,600	2,295.00	70,227,000
福山通運	54,000	667.00	36,018,000
セイノーホールディングス	63,600	1,260.00	80,136,000
神奈川中央交通	13,000	699.00	9,087,000
日立物流	18,000	2,295.00	41,310,000
丸和運輸機関	2,700	2,515.00	6,790,500
C&Fロジホールディングス	9,700	1,372.00	13,308,400
九州旅客鉄道	67,100	3,480.00	233,508,000
日本郵船	759,000	224.00	170,016,000

商船三井	471,000	326.00	153,546,000
川崎汽船	345,000	283.00	97,635,000
N S ユナイテッド海運	45,000	222.00	9,990,000
飯野海運	49,200	451.00	22,189,200
乾汽船	9,000	919.00	8,271,000
日本航空	162,000	3,366.00	545,292,000
A N A ホールディングス	1,668,000	326.20	544,101,600
パスコ	10,000	339.00	3,390,000
トランコム	2,800	5,590.00	15,652,000
日新	40,000	362.00	14,480,000
三菱倉庫	59,000	1,440.00	84,960,000
三井倉庫ホールディングス	56,000	319.00	17,864,000
住友倉庫	68,000	634.00	43,112,000
澁澤倉庫	31,000	335.00	10,385,000
東陽倉庫	21,200	291.00	6,169,200
日本トランスシティ	25,000	453.00	11,325,000
安田倉庫	10,400	720.00	7,488,000
東洋埠頭	38,000	169.00	6,422,000
上組	107,000	987.00	105,609,000
キューソー流通システム	3,100	2,506.00	7,768,600
郵船ロジスティクス	9,100	1,073.00	9,764,300
近鉄エクスプレス	16,200	1,612.00	26,114,400
エーアイティー	7,600	973.00	7,394,800
N E C ネットエスアイ	9,600	2,107.00	20,227,200
システナ	8,000	1,824.00	14,592,000
デジタルアーツ	4,300	2,772.00	11,919,600
新日鉄住金ソリューションズ	14,500	2,155.00	31,247,500
コア	4,900	1,212.00	5,938,800
ソフトクリエイイトホールディングス	6,200	1,295.00	8,029,000
T I S	29,600	2,798.00	82,820,800
電算システム	4,100	1,593.00	6,531,300
グリー	54,100	764.00	41,332,400
コーエーテクモホールディングス	20,900	2,161.00	45,164,900
三菱総合研究所	3,900	3,230.00	12,597,000
ファインデックス	8,000	945.00	7,560,000
ヒト・コミュニケーションズ	2,700	1,719.00	4,641,300
ブレインパッド	2,000	1,012.00	2,024,000
K L a b	18,000	715.00	12,870,000
ポルトウウィン・ピットクルーホールディングス	7,600	1,172.00	8,907,200
ネクソン	97,400	1,709.00	166,456,600
アイスタイル	15,300	844.00	12,913,200
エイチーム	5,200	2,707.00	14,076,400

テクノスジャパン	7,600	955.00	7,258,000
コロプラ	25,700	1,021.00	26,239,700
モバイルクリエイト	9,100	363.00	3,303,300
ブロードリーフ	22,000	677.00	14,894,000
ハーツユナイテッドグループ	5,100	1,390.00	7,089,000
メディアドゥ	2,200	2,606.00	5,733,200
ブイキューブ	3,700	530.00	1,961,000
ディー・エル・イー	4,200	518.00	2,175,600
フィックスターズ	1,600	2,771.00	4,433,600
VOYAGE GROUP	3,800	1,711.00	6,501,800
オブティム	2,200	2,708.00	5,957,600
ベリサーブ	1,300	2,560.00	3,328,000
ティーガイア	8,600	1,872.00	16,099,200
日本アジアグループ	14,400	362.00	5,212,800
豆蔵ホールディングス	8,100	812.00	6,577,200
テクマトリックス	6,700	1,354.00	9,071,800
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	185,400	253.00	46,906,200
GMOペイメントゲートウェイ	7,400	5,140.00	38,036,000
インターネットイニシアティブ	13,500	1,916.00	25,866,000
さくらインターネット	7,700	822.00	6,329,400
SRAホールディングス	5,100	2,857.00	14,570,700
フリービット	6,000	787.00	4,722,000
コムチュア	1,900	3,595.00	6,830,500
メディカル・データ・ビジョン	1,700	3,805.00	6,468,500
gumi	10,600	1,041.00	11,034,600
PCIホールディングス	1,300	2,427.00	3,155,100
LINE	14,800	4,025.00	59,570,000
AOI TYO Holdings	8,600	784.00	6,742,400
フェイス	4,600	1,114.00	5,124,400
野村総合研究所	66,200	3,965.00	262,483,000
サイバネットシステム	9,300	671.00	6,240,300
インテージホールディングス	6,200	1,935.00	11,997,000
ソースネクスト	7,000	516.00	3,612,000
クレスコ	2,700	2,590.00	6,993,000
フジ・メディア・ホールディングス	92,500	1,583.00	146,427,500
オービック	30,700	5,310.00	163,017,000
ジャストシステム	14,500	1,313.00	19,038,500
TDCソフトウェアエンジニアリング	5,000	1,205.00	6,025,000
ヤフー	635,800	506.00	321,714,800
トレンドマイクロ	47,100	4,710.00	221,841,000
日本オラクル	14,300	6,350.00	90,805,000
アルファシステムズ	4,200	1,842.00	7,736,400

フューチャー	14,200	843.00	11,970,600
CAC Holdings	9,300	1,017.00	9,458,100
ソフトバンク・テクノロジー	2,500	3,510.00	8,775,000
オービックビジネスコンサルタント	4,600	5,300.00	24,380,000
伊藤忠テクノソリューションズ	20,400	3,185.00	64,974,000
アイティフォー	14,900	561.00	8,358,900
大塚商会	23,800	5,990.00	142,562,000
サイボウズ	16,700	404.00	6,746,800
ソフトブレーン	13,300	483.00	6,423,900
電通国際情報サービス	5,900	2,427.00	14,319,300
デジタルガレージ	13,300	2,248.00	29,898,400
EMシステムズ	4,400	1,714.00	7,541,600
ウェザーニューズ	3,700	3,600.00	13,320,000
日本エンタープライズ	12,000	241.00	2,892,000
WOWOW	4,100	3,675.00	15,067,500
スカラ	6,800	766.00	5,208,800
イマジカ・ロボット ホールディングス	9,100	650.00	5,915,000
ネットワンシステムズ	39,200	884.00	34,652,800
システムソフト	19,000	128.00	2,432,000
アルゴグラフィックス	4,800	2,241.00	10,756,800
マーベラス	15,700	847.00	13,297,900
エイベックス・グループ・ホールディングス	16,600	1,561.00	25,912,600
日本ユニシス	24,400	1,475.00	35,990,000
兼松エレクトロニクス	5,500	2,722.00	14,971,000
東京放送ホールディングス	58,800	1,913.00	112,484,400
日本テレビホールディングス	80,900	1,869.00	151,202,100
朝日放送	11,600	741.00	8,595,600
テレビ朝日ホールディングス	24,700	2,042.00	50,437,400
スカパーJ S A Tホールディングス	57,600	475.00	27,360,000
テレビ東京ホールディングス	7,400	2,474.00	18,307,600
ワイヤレスゲート	4,000	1,354.00	5,416,000
コネクシオ	8,300	1,587.00	13,172,100
日本通信	42,800	175.00	7,490,000
日本電信電話	712,700	4,826.00	3,439,490,200
KDDI	878,300	2,873.00	2,523,355,900
光通信	10,600	10,450.00	110,770,000
NTTドコモ	663,500	2,593.50	1,720,787,250
エムティーアイ	15,600	620.00	9,672,000
GMOインターネット	32,500	1,200.00	39,000,000
カドカワ	25,700	1,494.00	38,395,800
学研ホールディングス	3,600	2,943.00	10,594,800
ゼンリン	12,100	2,060.00	24,926,000

アイネット	7,000	1,208.00	8,456,000
松竹	59,000	1,306.00	77,054,000
東宝	58,000	3,050.00	176,900,000
東映	33,000	924.00	30,492,000
エヌ・ティ・ティ・データ	54,500	5,120.00	279,040,000
D T S	9,100	2,688.00	24,460,800
スクウェア・エニックス・ホールディングス	34,300	3,140.00	107,702,000
シーイーシー	5,700	2,018.00	11,502,600
カブコン	21,100	2,150.00	45,365,000
ジャステック	8,100	1,178.00	9,541,800
S C S K	24,200	4,345.00	105,149,000
日本システムウエア	3,900	1,392.00	5,428,800
アイネス	13,000	1,016.00	13,208,000
T K C	8,300	3,020.00	25,066,000
富士ソフト	13,100	2,797.00	36,640,700
N S D	17,900	1,587.00	28,407,300
コナミホールディングス	40,200	4,580.00	184,116,000
福井コンピュータホールディングス	3,000	2,658.00	7,974,000
J B C Cホールディングス	11,000	755.00	8,305,000
ミロク情報サービス	7,200	2,120.00	15,264,000
ソフトバンクグループ	399,600	7,771.00	3,105,291,600
伊藤忠食品	2,500	4,520.00	11,300,000
エレマテック	4,400	1,859.00	8,179,600
J A L U X	3,500	2,346.00	8,211,000
あらた	4,100	2,987.00	12,246,700
東京エレクトロン デバイス	4,200	1,578.00	6,627,600
フィールズ	8,100	1,218.00	9,865,800
双日	525,500	266.00	139,783,000
アルフレッサ ホールディングス	104,700	1,955.00	204,688,500
横浜冷凍	23,300	1,077.00	25,094,100
アルコニックス	6,300	1,710.00	10,773,000
神戸物産	4,900	3,990.00	19,551,000
あい ホールディングス	12,700	2,616.00	33,223,200
ダイワボウホールディングス	76,000	305.00	23,180,000
マクニカ・富士エレホールディングス	16,100	1,489.00	23,972,900
バイタルケーエスケー・ホールディングス	17,100	981.00	16,775,100
U K Cホールディングス	6,200	1,869.00	11,587,800
T O K A Iホールディングス	40,600	825.00	33,495,000
三洋貿易	5,400	1,684.00	9,093,600
ウイン・パートナーズ	7,100	926.00	6,574,600
シップヘルスケアホールディングス	17,200	2,881.00	49,553,200
コメダホールディングス	12,900	1,899.00	24,497,100



小野建	8,900	1,460.00	12,994,000
佐島電機	9,200	784.00	7,212,800
伯東	8,400	978.00	8,215,200
コンドーテック	8,900	875.00	7,787,500
ナガイレーベン	13,100	2,311.00	30,274,100
三菱食品	9,400	3,480.00	32,712,000
松田産業	7,300	1,418.00	10,351,400
第一興商	14,900	4,510.00	67,199,000
メディパルホールディングス	88,800	1,802.00	160,017,600
萩原電気	4,200	2,118.00	8,895,600
アズワン	7,100	4,760.00	33,796,000
尾家産業	4,400	1,139.00	5,011,600
シモジマ	7,100	1,089.00	7,731,900
ドウシシャ	10,800	2,044.00	22,075,200
小津産業	2,400	2,198.00	5,275,200
高速	6,400	1,020.00	6,528,000
黒田電気	11,800	2,267.00	26,750,600
丸文	10,900	666.00	7,259,400
ハピネット	8,000	1,645.00	13,160,000
日本ライフライン	7,900	2,212.00	17,474,800
エクセル	5,100	1,416.00	7,221,600
マルカキカイ	3,800	1,694.00	6,437,200
I D O M	25,100	704.00	17,670,400
日本エム・ディ・エム	8,300	709.00	5,884,700
進和	6,100	1,772.00	10,809,200
シークス	6,400	4,105.00	26,272,000
オーハシテクニカ	6,600	1,294.00	8,540,400
伊藤忠商事	650,200	1,504.50	978,225,900
丸紅	877,000	659.50	578,381,500
長瀬産業	54,000	1,518.00	81,972,000
蝶理	6,500	1,890.00	12,285,000
豊田通商	98,900	3,230.00	319,447,000
三共生興	20,300	367.00	7,450,100
兼松	187,000	198.00	37,026,000
三井物産	803,500	1,534.00	1,232,569,000
日本紙パルプ商事	47,000	367.00	17,249,000
日立ハイテクノロジーズ	30,900	4,230.00	130,707,000
カメイ	11,900	1,119.00	13,316,100
スターゼン	4,000	4,325.00	17,300,000
山善	33,500	969.00	32,461,500
住友商事	560,200	1,420.00	795,484,000
内田洋行	5,300	2,423.00	12,841,900

三菱商事	666,200	2,337.00	1,556,909,400
第一実業	22,000	673.00	14,806,000
キヤノンマーケティングジャパン	25,700	2,194.00	56,385,800
西華産業	35,000	327.00	11,445,000
佐藤商事	9,300	802.00	7,458,600
菱洋エレクトロ	9,100	1,521.00	13,841,100
東京産業	12,500	420.00	5,250,000
ユアサ商事	8,300	2,971.00	24,659,300
阪和興業	90,000	739.00	66,510,000
カナデン	10,600	1,045.00	11,077,000
菱電商事	17,000	701.00	11,917,000
フルサト工業	6,200	1,600.00	9,920,000
岩谷産業	101,000	616.00	62,216,000
すてきナイスグループ	56,000	148.00	8,288,000
三愛石油	23,800	886.00	21,086,800
稲畑産業	20,800	1,295.00	26,936,000
G S I クレオス	34,000	124.00	4,216,000
ワキタ	19,900	1,222.00	24,317,800
東邦ホールディングス	28,900	2,269.00	65,574,100
サンゲツ	31,500	1,934.00	60,921,000
ミツウロコグループホールディングス	17,100	679.00	11,610,900
シナネンホールディングス	5,100	2,115.00	10,786,500
伊藤忠エネクス	19,000	878.00	16,682,000
サンリオ	27,800	1,947.00	54,126,600
サンワテクノス	6,900	1,050.00	7,245,000
リョーサン	13,800	3,350.00	46,230,000
新光商事	11,400	1,224.00	13,953,600
トーヨー	4,900	2,579.00	12,637,100
三信電気	11,300	1,245.00	14,068,500
東陽テクニカ	10,200	982.00	10,016,400
モスフードサービス	11,600	3,355.00	38,918,000
加賀電子	8,200	1,828.00	14,989,600
ソーダニッカ	12,800	481.00	6,156,800
立花エレテック	7,000	1,302.00	9,114,000
P A L T A C	13,900	3,105.00	43,159,500
三谷産業	15,900	359.00	5,708,100
太平洋興発	63,000	91.00	5,733,000
ヤマタネ	4,400	1,403.00	6,173,200
日鉄住金物産	7,500	4,255.00	31,912,500
トラスコ中山	19,900	2,422.00	48,197,800
オートバックスセブン	34,300	1,620.00	55,566,000
加藤産業	13,600	2,603.00	35,400,800

イノテック	11,100	575.00	6,382,500
イエローハット	8,600	2,436.00	20,949,600
J Kホールディングス	12,800	618.00	7,910,400
日伝	4,300	3,355.00	14,426,500
杉本商事	6,700	1,462.00	9,795,400
因幡電機産業	12,300	3,885.00	47,785,500
バイテックホールディングス	5,600	1,233.00	6,904,800
ミスミグループ本社	100,200	2,009.00	201,301,800
タキヒヨー	20,000	433.00	8,660,000
スズケン	40,400	3,570.00	144,228,000
ジェコス	7,900	1,058.00	8,358,200
ローソン	28,000	7,430.00	208,040,000
サンエー	6,500	4,705.00	30,582,500
カワチ薬品	7,100	2,941.00	20,881,100
エービーシー・マート	16,200	6,280.00	101,736,000
ハードオフコーポレーション	6,200	1,032.00	6,398,400
アスクル	9,300	3,095.00	28,783,500
ゲオホールディングス	15,200	1,153.00	17,525,600
アダストリア	13,900	2,613.00	36,320,700
くらコーポレーション	5,800	4,720.00	27,376,000
キャンドウ	6,200	1,705.00	10,571,000
パルグループホールディングス	5,000	2,492.00	12,460,000
エディオン	33,600	1,040.00	34,944,000
サーラコーポレーション	15,100	626.00	9,452,600
ハローズ	3,400	2,224.00	7,561,600
あみやき亭	2,200	4,265.00	9,383,000
ひらまつ	16,100	619.00	9,965,900
ゲンキー	3,800	2,994.00	11,377,200
大黒天物産	2,500	5,050.00	12,625,000
ハニーズホールディングス	9,500	1,058.00	10,051,000
アルペン	7,600	1,925.00	14,630,000
クオール	10,600	1,538.00	16,302,800
ジンズ	6,100	5,940.00	36,234,000
ビックカメラ	50,100	1,012.00	50,701,200
D C Mホールディングス	53,700	977.00	52,464,900
Monotaro	31,600	3,415.00	107,914,000
アーランドサービスホールディングス	3,100	3,135.00	9,718,500
J . フロント リテイリング	111,900	1,516.00	169,640,400
ドトール・日レスホールディングス	15,500	2,185.00	33,867,500
マツモトキヨシホールディングス	16,800	5,570.00	93,576,000
ブロンコビリー	4,900	2,726.00	13,357,400
スタートトゥデイ	81,600	2,351.00	191,841,600

物語コーポレーション	2,800	5,330.00	14,924,000
ココカラファイン	9,100	5,100.00	46,410,000
三越伊勢丹ホールディングス	176,300	1,185.00	208,915,500
ウエルシアホールディングス	17,100	3,430.00	58,653,000
クリエイトSDホールディングス	12,700	2,480.00	31,496,000
チムニー	3,200	2,708.00	8,665,600
シュッピン	3,800	1,513.00	5,749,400
ネクステージ	4,200	1,346.00	5,653,200
ジョイフル本田	14,400	3,580.00	51,552,000
鳥貴族	2,800	2,420.00	6,776,000
ホットランド	5,800	1,166.00	6,762,800
すかいらーく	37,700	1,648.00	62,129,600
綿半ホールディングス	4,600	1,686.00	7,755,600
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホール	28,200	1,065.00	30,033,000
ブックオフコーポレーション	8,300	754.00	6,258,200
ゴルフダイジェスト・オンライン	4,600	760.00	3,496,000
あさひ	8,000	1,429.00	11,432,000
日本調剤	3,400	3,535.00	12,019,000
コスモス薬品	4,500	22,950.00	103,275,000
セブン&アイ・ホールディングス	371,300	4,618.00	1,714,663,400
薬王堂	4,600	2,754.00	12,668,400
クリエイト・レストランツ・ホールディング	22,500	958.00	21,555,000
ツルハホールディングス	17,700	11,160.00	197,532,000
サンマルクホールディングス	5,700	3,230.00	18,411,000
トリドールホールディングス	11,200	2,584.00	28,940,800
パロックジャパンリミテッド	6,200	1,112.00	6,894,400
クスリのアオキホールディングス	7,000	4,810.00	33,670,000
メディカルシステムネットワーク	13,700	474.00	6,493,800
総合メディカル	4,400	4,140.00	18,216,000
ノジマ	10,600	1,422.00	15,073,200
カッパ・クリエイト	13,900	1,249.00	17,361,100
ライトオン	8,200	922.00	7,560,400
良品計画	11,700	25,040.00	292,968,000
三城ホールディングス	16,700	459.00	7,665,300
アドヴァン	10,200	1,127.00	11,495,400
アルビス	2,800	3,215.00	9,002,000
コナカ	15,000	573.00	8,595,000
G-7ホールディングス	3,000	2,232.00	6,696,000
コーナン商事	12,700	2,195.00	27,876,500
エコス	5,400	1,096.00	5,918,400
ワタミ	12,300	1,193.00	14,673,900
ドンキホーテホールディングス	57,400	3,970.00	227,878,000

西松屋チェーン	15,900	1,164.00	18,507,600
ゼンショーホールディングス	46,700	1,815.00	84,760,500
幸楽苑ホールディングス	5,800	1,673.00	9,703,400
サイゼリヤ	14,400	3,005.00	43,272,000
V Tホールディングス	30,500	534.00	16,287,000
魚力	3,600	1,260.00	4,536,000
ユナイテッドアローズ	12,000	3,335.00	40,020,000
ハイデイ日高	9,600	2,254.00	21,638,400
京都きもの友禅	6,300	926.00	5,833,800
コロナイド	29,200	1,755.00	51,246,000
ピーシーデポコーポレーション	13,900	518.00	7,200,200
壱番屋	6,100	3,545.00	21,624,500
スギホールディングス	19,600	5,450.00	106,820,000
スクロール	19,700	335.00	6,599,500
ヨンドシーホールディングス	6,800	2,591.00	17,618,800
ユニー・ファミリーマートホールディングス	38,800	6,370.00	247,156,000
木曽路	11,600	2,567.00	29,777,200
サトレストランシステムズ	13,800	833.00	11,495,400
千趣会	18,900	786.00	14,855,400
ケーヨー	16,800	613.00	10,298,400
上新電機	21,000	1,118.00	23,478,000
日本瓦斯	16,400	3,165.00	51,906,000
ベスト電器	37,700	153.00	5,768,100
ロイヤルホールディングス	14,300	2,124.00	30,373,200
いなげや	9,900	1,558.00	15,424,200
島忠	23,100	2,466.00	56,964,600
チヨダ	10,300	2,670.00	27,501,000
ライフコーポレーション	6,800	2,834.00	19,271,200
リンガーハット	10,700	2,248.00	24,053,600
Mr Max	16,200	390.00	6,318,000
A O K Iホールディングス	17,500	1,308.00	22,890,000
オークワ	14,000	1,173.00	16,422,000
コメリ	14,300	2,687.00	38,424,100
青山商事	18,600	3,835.00	71,331,000
しまむら	10,300	15,530.00	159,959,000
高島屋	149,000	994.00	148,106,000
松屋	20,300	1,012.00	20,543,600
エイチ・ツー・オー リテイリング	46,000	1,787.00	82,202,000
近鉄百貨店	39,000	334.00	13,026,000
パルコ	8,800	1,196.00	10,524,800
丸井グループ	93,700	1,465.00	137,270,500
アクシアル リテイリング	6,900	4,170.00	28,773,000

イオン	365,800	1,591.50	582,170,700
イズミ	17,600	5,460.00	96,096,000
平和堂	17,600	2,301.00	40,497,600
フジ	10,100	2,639.00	26,653,900
ヤオコー	9,700	4,110.00	39,867,000
ゼビオホールディングス	12,100	1,735.00	20,993,500
ケーズホールディングス	41,300	2,005.00	82,806,500
Olympicグループ	9,100	547.00	4,977,700
日産東京販売ホールディングス	17,200	410.00	7,052,000
アインホールディングス	11,500	7,550.00	86,825,000
元気寿司	2,700	2,121.00	5,726,700
ヤマダ電機	296,400	552.00	163,612,800
アークランドサカモト	15,500	1,343.00	20,816,500
ニトリホールディングス	38,300	14,860.00	569,138,000
グルメ杵屋	9,000	1,049.00	9,441,000
愛眼	12,800	191.00	2,444,800
吉野家ホールディングス	32,200	1,679.00	54,063,800
松屋フーズ	4,500	4,125.00	18,562,500
サガミチェーン	12,200	1,324.00	16,152,800
関西スーパーマーケット	8,100	1,465.00	11,866,500
王将フードサービス	6,400	4,130.00	26,432,000
プレナス	9,800	2,268.00	22,226,400
ミニストップ	7,000	2,087.00	14,609,000
アークス	16,300	2,561.00	41,744,300
パローホールディングス	19,700	2,541.00	50,057,700
ベルク	3,900	4,485.00	17,491,500
大庄	6,600	1,557.00	10,276,200
ファーストリテイリング	14,800	34,860.00	515,928,000
サンドラッグ	33,800	3,890.00	131,482,000
サックスパーホールディングス	9,600	1,173.00	11,260,800
ヤマザワ	2,300	1,717.00	3,949,100
やまや	2,900	1,582.00	4,587,800
ベルーナ	22,300	908.00	20,248,400
じもとホールディングス	62,600	185.00	11,581,000
めぶきフィナンシャルグループ	425,200	422.00	179,434,400
東京TYフィナンシャルグループ	12,800	2,990.00	38,272,000
九州フィナンシャルグループ	146,500	662.00	96,983,000
ゆうちょ銀行	250,100	1,346.00	336,634,600
富山第一銀行	24,000	516.00	12,384,000
コンコルディア・フィナンシャルグループ	581,100	500.10	290,608,110
西日本フィナンシャルホールディングス	60,800	1,045.00	63,536,000
新生銀行	843,000	191.00	161,013,000

あおぞら銀行	562,000	384.00	215,808,000	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	6,724,500	654.70	4,402,530,150	
りそなホールディングス	1,034,600	558.70	578,031,020	
三井住友トラスト・ホールディングス	184,700	3,670.00	677,849,000	
三井住友フィナンシャルグループ	710,800	3,828.00	2,720,942,400	
第四銀行	109,000	423.00	46,107,000	
北越銀行	9,800	2,590.00	25,382,000	
千葉銀行	341,000	700.00	238,700,000	
群馬銀行	198,700	557.00	110,675,900	
武蔵野銀行	14,100	3,120.00	43,992,000	
千葉興業銀行	24,800	587.00	14,557,600	
筑波銀行	37,500	303.00	11,362,500	
七十七銀行	139,000	460.00	63,940,000	
青森銀行	71,000	371.00	26,341,000	
秋田銀行	58,000	344.00	19,952,000	
山形銀行	50,000	479.00	23,950,000	
岩手銀行	5,800	4,425.00	25,665,000	
東邦銀行	78,000	397.00	30,966,000	
東北銀行	50,000	148.00	7,400,000	
みちのく銀行	50,000	182.00	9,100,000	
ふくおかフィナンシャルグループ	361,000	474.00	171,114,000	
静岡銀行	242,000	885.00	214,170,000	
十六銀行	120,000	345.00	41,400,000	
スルガ銀行	90,600	2,261.00	204,846,600	
八十二銀行	167,900	611.00	102,586,900	
山梨中央銀行	55,000	473.00	26,015,000	
大垣共立銀行	125,000	309.00	38,625,000	
福井銀行	78,000	257.00	20,046,000	
北國銀行	96,000	406.00	38,976,000	
清水銀行	3,000	3,210.00	9,630,000	
富山銀行	1,600	4,155.00	6,648,000	
滋賀銀行	84,000	565.00	47,460,000	
南都銀行	8,600	3,975.00	34,185,000	
百五銀行	80,000	432.00	34,560,000	
京都銀行	159,000	823.00	130,857,000	
紀陽銀行	33,900	1,664.00	56,409,600	
三重銀行	4,000	2,241.00	8,964,000	
ほくほくフィナンシャルグループ	58,700	1,661.00	97,500,700	
広島銀行	260,000	457.00	118,820,000	
山陰合同銀行	54,100	869.00	47,012,900	
中国銀行	62,100	1,573.00	97,683,300	
鳥取銀行	3,100	1,703.00	5,279,300	

伊予銀行	95,600	756.00	72,273,600
百十四銀行	99,000	353.00	34,947,000
四国銀行	70,000	280.00	19,600,000
阿波銀行	76,000	686.00	52,136,000
大分銀行	52,000	415.00	21,580,000
宮崎銀行	61,000	333.00	20,313,000
佐賀銀行	54,000	295.00	15,930,000
十八銀行	56,000	345.00	19,320,000
沖縄銀行	8,500	4,090.00	34,765,000
琉球銀行	18,900	1,464.00	27,669,600
セブン銀行	334,600	375.00	125,475,000
みずほフィナンシャルグループ	12,044,400	190.00	2,288,436,000
高知銀行	37,000	121.00	4,477,000
山口フィナンシャルグループ	83,000	1,177.00	97,691,000
長野銀行	3,000	1,924.00	5,772,000
名古屋銀行	7,300	3,880.00	28,324,000
北洋銀行	145,500	402.00	58,491,000
愛知銀行	3,000	5,920.00	17,760,000
第三銀行	5,300	1,615.00	8,559,500
中京銀行	3,600	2,275.00	8,190,000
大光銀行	32,000	221.00	7,072,000
愛媛銀行	10,600	1,330.00	14,098,000
トマト銀行	3,700	1,506.00	5,572,200
みなと銀行	7,900	2,001.00	15,807,900
京葉銀行	74,000	463.00	34,262,000
関西アーバン銀行	12,500	1,313.00	16,412,500
栃木銀行	50,700	500.00	25,350,000
北日本銀行	3,000	3,095.00	9,285,000
東和銀行	167,000	108.00	18,036,000
福島銀行	100,000	88.00	8,800,000
大東銀行	52,000	160.00	8,320,000
トモニホールディングス	73,400	553.00	40,590,200
フィデアホールディングス	90,600	200.00	18,120,000
池田泉州ホールディングス	94,600	452.00	42,759,200
F P G	33,000	901.00	29,733,000
S B Iホールディングス	100,900	1,481.00	149,432,900
ジャフコ	15,100	3,535.00	53,378,500
大和証券グループ本社	827,000	650.90	538,294,300
野村ホールディングス	1,814,500	641.70	1,164,364,650
岡三証券グループ	76,000	635.00	48,260,000
丸三証券	28,300	813.00	23,007,900
東洋証券	31,000	231.00	7,161,000



東海東京フィナンシャル・ホールディングス	103,400	544.00	56,249,600
光世証券	25,000	156.00	3,900,000
水戸証券	30,800	277.00	8,531,600
いちよし証券	20,600	831.00	17,118,600
松井証券	50,900	867.00	44,130,300
マネックスグループ	94,700	262.00	24,811,400
カブドットコム証券	67,100	352.00	23,619,200
極東証券	12,400	1,548.00	19,195,200
岩井コスモホールディングス	9,000	1,012.00	9,108,000
藍澤証券	16,500	664.00	10,956,000
マネーパートナーズグループ	12,000	435.00	5,220,000
かんぽ生命保険	33,700	2,434.00	82,025,800
S O M P Oホールディングス	185,200	3,904.00	723,020,800
アニコム ホールディングス	6,500	2,375.00	15,437,500
M S & A Dインシュアランスグループホールディングス	265,500	3,476.00	922,878,000
ソニーフィナンシャルホールディングス	85,500	1,720.00	147,060,000
第一生命ホールディングス	534,500	1,814.00	969,583,000
東京海上ホールディングス	359,500	4,550.00	1,635,725,000
T & Dホールディングス	322,800	1,531.50	494,368,200
アドバンスクリエイト	2,500	1,841.00	4,602,500
全国保証	25,100	4,025.00	101,027,500
クレディセゾン	67,300	1,948.00	131,100,400
アクリーティブ	8,300	326.00	2,705,800
芙蓉総合リース	10,100	4,830.00	48,783,000
興銀リース	16,700	2,227.00	37,190,900
東京センチュリー	17,500	3,695.00	64,662,500
日本証券金融	40,100	555.00	22,255,500
アイフル	149,700	307.00	45,957,900
ポケットカード	7,800	605.00	4,719,000
リコーリース	7,000	3,415.00	23,905,000
イオンフィナンシャルサービス	56,700	2,152.00	122,018,400
アコム	179,000	430.00	76,970,000
ジャックス	48,000	451.00	21,648,000
オリエントコーポレーション	193,000	191.00	36,863,000
日立キャピタル	21,000	2,618.00	54,978,000
アプラスフィナンシャル	48,900	101.00	4,938,900
オリックス	628,800	1,648.50	1,036,576,800
三菱UFJリース	223,700	548.00	122,587,600
日本取引所グループ	275,700	1,551.00	427,610,700
イー・ギャランティ	2,800	2,410.00	6,748,000
N E Cキャピタルソリューション	4,000	1,634.00	6,536,000
いちご	83,800	314.00	26,313,200

日本駐車場開発	118,000	137.00	16,166,000
ヒューリック	185,000	1,068.00	197,580,000
三栄建築設計	4,600	1,499.00	6,895,400
野村不動産ホールディングス	59,000	1,748.00	103,132,000
三重交通グループホールディングス	21,100	356.00	7,511,600
サムティ	8,400	1,033.00	8,677,200
日本商業開発	5,400	1,737.00	9,379,800
プレサンスコーポレーション	13,900	1,242.00	17,263,800
ユニゾホールディングス	7,900	2,747.00	21,701,300
日本管理センター	7,700	1,248.00	9,609,600
フージャースホールディングス	16,000	581.00	9,296,000
オープンハウス	12,900	2,636.00	34,004,400
東急不動産ホールディングス	214,500	603.00	129,343,500
飯田グループホールディングス	74,100	1,676.00	124,191,600
エコナックホールディングス	57,000	56.00	3,192,000
パーク24	45,600	2,873.00	131,008,800
パラカ	3,500	2,089.00	7,311,500
三井不動産	471,000	2,396.50	1,128,751,500
三菱地所	660,000	2,026.00	1,337,160,000
平和不動産	17,700	1,584.00	28,036,800
東京建物	103,100	1,482.00	152,794,200
ダイビル	23,900	938.00	22,418,200
京阪神ビルディング	17,100	599.00	10,242,900
住友不動産	213,000	2,905.00	618,765,000
大京	162,000	221.00	35,802,000
テーオーシー	35,300	939.00	33,146,700
東京楽天地	18,000	530.00	9,540,000
レオパレス21	113,900	574.00	65,378,600
スターツコーポレーション	8,800	2,312.00	20,345,600
フジ住宅	11,400	702.00	8,002,800
空港施設	15,400	547.00	8,423,800
住友不動産販売	8,100	3,595.00	29,119,500
ゴールドクレスト	8,500	1,895.00	16,107,500
日神不動産	14,500	533.00	7,728,500
日本エスコン	13,300	364.00	4,841,200
タカラレーベン	40,700	488.00	19,861,600
サンヨーハウジング名古屋	7,500	959.00	7,192,500
イオンモール	57,800	1,938.00	112,016,400
トーセイ	14,200	788.00	11,189,600
エヌ・ティ・ティ都市開発	56,000	942.00	52,752,000
サンフロンティア不動産	9,700	946.00	9,176,200
エフ・ジェー・ネクスト	8,500	896.00	7,616,000

日本空港ビルデング	28,600	3,800.00	108,680,000
日本工営	6,500	2,769.00	17,998,500
L i f u l l	23,400	715.00	16,731,000
ジェイエイシーリクルートメント	6,200	1,712.00	10,614,400
日本M&Aセンター	27,000	3,700.00	99,900,000
タケエイ	9,900	943.00	9,335,700
トラスト・テック	4,200	1,904.00	7,996,800
コシダカホールディングス	3,900	2,705.00	10,549,500
パソナグループ	8,800	844.00	7,427,200
リンクアンドモチベーション	23,400	618.00	14,461,200
G C A	10,100	872.00	8,807,200
エス・エム・エス	13,400	2,750.00	36,850,000
テンプホールディングス	72,300	2,031.00	146,841,300
リニカル	6,000	1,352.00	8,112,000
クックパッド	21,400	863.00	18,468,200
学情	4,800	1,246.00	5,980,800
スタジオアリス	4,700	2,242.00	10,537,400
シミックホールディングス	6,000	1,372.00	8,232,000
総合警備保障	34,100	4,790.00	163,339,000
カカクコム	67,400	1,564.00	105,413,600
アイロムグループ	2,300	1,135.00	2,610,500
ルネサンス	5,800	1,751.00	10,155,800
ディップ	12,100	2,320.00	28,072,000
オプトホールディング	8,200	984.00	8,068,800
ツクイ	23,100	621.00	14,345,100
エムスリー	81,700	2,793.00	228,188,100
ツカダ・グローバルホールディング	11,100	564.00	6,260,400
アウトソーシング	5,500	4,095.00	22,522,500
ウェルネット	8,100	1,370.00	11,097,000
ワールドホールディングス	2,200	1,960.00	4,312,000
ディー・エヌ・エー	42,500	2,232.00	94,860,000
博報堂D Yホールディングス	129,200	1,311.00	169,381,200
ぐるなび	13,700	2,135.00	29,249,500
エスアールジータカミヤ	12,400	553.00	6,857,200
ジャパンベストレスキューシステム	18,100	248.00	4,488,800
ファンコミュニケーションズ	23,300	777.00	18,104,100
ライク	2,200	2,465.00	5,423,000
W D Bホールディングス	4,100	1,454.00	5,961,400
インフォマート	40,200	615.00	24,723,000
J Pホールディングス	33,400	272.00	9,084,800
E P Sホールディングス	12,000	1,476.00	17,712,000
プレステージ・インターナショナル	15,200	945.00	14,364,000

アミューズ	5,500	2,374.00	13,057,000
ドリームインキュベータ	3,600	1,995.00	7,182,000
クイック	5,900	1,147.00	6,767,300
ケネディクス	119,200	481.00	57,335,200
電通	104,500	6,070.00	634,315,000
テイクアンドギヴ・ニーズ	6,000	891.00	5,346,000
ぴあ	3,400	2,868.00	9,751,200
イオンファンタジー	3,200	2,704.00	8,652,800
シーティーエス	6,800	660.00	4,488,000
ネクシィーズグループ	3,800	1,425.00	5,415,000
みらかホールディングス	24,200	5,070.00	122,694,000
アルプス技研	3,900	3,405.00	13,279,500
日本空調サービス	11,600	643.00	7,458,800
オリエンタルランド	101,700	6,500.00	661,050,000
ダスキン	24,400	2,394.00	58,413,600
明光ネットワークジャパン	12,400	1,219.00	15,115,600
ファルコホールディングス	5,800	1,454.00	8,433,200
ラウンドワン	30,500	938.00	28,609,000
リゾートトラスト	36,500	1,836.00	67,014,000
ビー・エム・エル	12,300	2,421.00	29,778,300
りらいあコミュニケーションズ	15,500	1,037.00	16,073,500
リソー教育	18,800	692.00	13,009,600
ユー・エス・エス	114,100	1,900.00	216,790,000
サイバーエージェント	49,700	3,400.00	168,980,000
楽天	481,400	1,180.50	568,292,700
クリーク・アンド・リバー社	4,300	897.00	3,857,100
テー・オー・ダブリュー	10,700	719.00	7,693,300
セントラルスポーツ	3,600	3,170.00	11,412,000
フルキャストホールディングス	10,200	1,078.00	10,995,600
テクノプロ・ホールディングス	15,500	4,145.00	64,247,500
インターワークス	3,200	1,042.00	3,334,400
イー・ガーディアン	3,600	1,647.00	5,929,200
リブセンス	10,000	469.00	4,690,000
ジャパンマテリアル	7,200	1,634.00	11,764,800
ベクトル	8,200	1,282.00	10,512,400
I B J	9,100	540.00	4,914,000
アサンテ	5,200	1,636.00	8,507,200
N・フィールド	5,600	1,262.00	7,067,200
M&Aキャピタルパートナーズ	1,300	5,040.00	6,552,000
アピスト	1,800	3,440.00	6,192,000
ウィルグループ	5,600	772.00	4,323,200
エスクロー・エージェント・ジャパン	2,200	1,805.00	3,971,000

リクルートホールディングス	204,900	5,540.00	1,135,146,000
日本郵政	245,400	1,359.00	333,498,600
ベルシステム24ホールディングス	15,100	941.00	14,209,100
ソラスト	5,300	1,416.00	7,504,800
リログループ	35,000	1,825.00	63,875,000
東祥	2,200	4,580.00	10,076,000
エイチ・アイ・エス	15,100	2,535.00	38,278,500
共立メンテナンス	15,200	3,120.00	47,424,000
イチネンホールディングス	11,000	1,101.00	12,111,000
建設技術研究所	7,900	1,043.00	8,239,700
スペース	5,800	1,324.00	7,679,200
東京テアトル	47,000	140.00	6,580,000
ナガワ	1,800	3,515.00	6,327,000
よみうりランド	25,000	412.00	10,300,000
東京都競馬	66,000	247.00	16,302,000
常磐興産	3,400	1,637.00	5,565,800
カナモト	13,100	2,755.00	36,090,500
東京ドーム	37,000	1,021.00	37,777,000
西尾レントオール	7,500	3,045.00	22,837,500
トランス・コスモス	10,700	2,505.00	26,803,500
乃村工藝社	19,600	1,943.00	38,082,800
藤田観光	37,000	336.00	12,432,000
KNT-CTホールディングス	64,000	132.00	8,448,000
日本管財	8,100	1,768.00	14,320,800
トーカイ	4,200	4,095.00	17,199,000
白洋舎	1,000	2,846.00	2,846,000
セコム	97,500	7,942.00	774,345,000
セントラル警備保障	5,200	1,542.00	8,018,400
丹青社	15,700	978.00	15,354,600
メイテック	11,400	4,480.00	51,072,000
アサツー ディ・ケイ	15,300	2,825.00	43,222,500
応用地質	10,000	1,315.00	13,150,000
船井総研ホールディングス	12,300	1,961.00	24,120,300
オオバ	11,200	490.00	5,488,000
ベネッセホールディングス	31,800	3,455.00	109,869,000
イオンディライト	10,100	3,380.00	34,138,000
ナック	8,600	920.00	7,912,000
ニチイ学館	18,000	801.00	14,418,000
ダイセキ	16,500	2,402.00	39,633,000
合計	135,276,375		192,397,438,150

(b) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

## デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

### 国内債券パッシブ・マザーファンド

#### 貸借対照表

	（単位：円）	
	（平成28年 4月13日現在）	（平成29年 4月13日現在）
資産の部		
流動資産		
金銭信託	1,087,298,169	-
コール・ローン	-	768,938,987
国債証券	187,852,950,690	162,458,114,390
地方債証券	19,705,368,838	17,624,303,937
特殊債券	26,958,862,667	27,348,154,557
社債券	14,582,429,000	9,912,712,000
未収入金	853,942,550	405,372,350
未収利息	560,459,266	454,630,526
前払費用	17,708,592	9,628,079
流動資産合計	251,619,019,772	218,981,854,826
資産合計	251,619,019,772	218,981,854,826
負債の部		
流動負債		
未払解約金	678,574,051	446,626,938
未払利息	-	1,242
その他未払費用	-	14,366
流動負債合計	678,574,051	446,642,546
負債合計	678,574,051	446,642,546
純資産の部		
元本等		
元本	197,030,769,648	174,107,403,486
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	53,909,676,073	44,427,808,794
元本等合計	250,940,445,721	218,535,212,280
純資産合計	250,940,445,721	218,535,212,280
負債純資産合計	251,619,019,772	218,981,854,826

#### 注記表

（重要な会計方針の注記）

項 目	自 平成28年 4月14日 至 平成29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28年 4月13日現在)	(平成29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	197,030,769,648口	174,107,403,486口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.2736円 (10,000口当たりの純資産額 12,736円)	1口当たり純資産額 1.2552円 (10,000口当たりの純資産額 12,552円)

## (金融商品に関する注記)

## . 金融商品の状況に関する事項

項目	自 平成28年 4月14日 至 平成29年 4月13日
1. 金融商品に対する取組方針	<p>当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。</p>
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいておりません。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク</p>

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

#### ・金融商品の時価等に関する事項

項目	(平成29年 4月13日現在)
1.貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	<p>(1) 有価証券（国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>



## （デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

## （関連当事者との取引に関する注記）

自 平成28年 4月14日 至 平成29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28年 4月13日現在）	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	249,296,427,435円
同期中における追加設定元本額	12,491,448,439円
同期中における一部解約元本額	64,757,106,226円
平成28年 4月13日現在における元本の内訳	
三井住友・DC年金バランス30（債券重点型）	2,239,138,488円
三井住友・DC年金バランス50（標準型）	4,078,591,494円
三井住友・DC年金バランス70（株式重点型）	898,514,497円
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）	335,784,395円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2020	48,681,261円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2025	82,366,502円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2030	159,789,344円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2035	68,089,290円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2040	34,119,985円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2045	62,891,892円
三井住友・DC年金バランスゼロ（債券型）	6,216,322円
アセットアロケーション・ファンド（安定型）	2,950,209,186円
アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）	1,038,718,638円
アセットアロケーション・ファンド（成長型）	790,427,719円
S M A M ・ 年金グローバル債券ファンド＜適格機関投資家限定＞	6,086,628,952円
S M A M ・ バランスファンドVA25＜適格機関投資家専用＞	30,018,527,129円
S M A M ・ バランスファンドVA37.5＜適格機関投資家専用＞	9,351,680,801円
S M A M ・ バランスファンドVA50＜適格機関投資家専用＞	22,548,239,869円
S M A M ・ バランスファンドVL30＜適格機関投資家限定＞	385,746,395円
S M A M ・ バランスファンドVL50＜適格機関投資家限定＞	714,264,941円
世界6資産バランスファンドVA＜適格機関投資家限定＞	66,006,960円

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 >	330,459,356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 >	133,253,321円
S M A M ・ インデックス・バランス V A 2 5 < 適格機関投資家専用 >	2,376,703,215円
S M A M ・ インデックス・バランス V A 5 0 < 適格機関投資家専用 >	2,697,590,770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 >	6,873,437,309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 >	14,472,854,467円
S M A M ・ バランス V A 株 4 0 T < 適格機関投資家限定 >	208,544,294円
三井住友・国内債券インデックスファンド・ V A S ( 適格機関投資家専用 )	7,581,275,181円
三井住友・ 5 資産バランスファンド・ V A S ( 適格機関投資家専用 )	33,554,495,091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 >	681,827,212円
S M A M ・ バランスファンド V A 2 0 < 適格機関投資家専用 >	1,196,087,768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 )	22,100,514,454円
S M A M ・ アセットバランスファンド V A 2 0 A < 適格機関投資家専用 >	1,133,636,491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 >	240,044,186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 >	53,970,912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 >	2,814,410,510円
S M A M ・ アセットバランスファンド V A 2 5 L < 適格機関投資家専用 >	3,237,414,419円
S M A M ・ アセットバランスファンド V A 2 0 T < 適格機関投資家専用 >	3,003,591,941円
S M A M ・ アセットバランスファンド V A 2 0 A 2 < 適格機関投資家専用 >	1,248,810,687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 >	261,712,641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 >	21,167,802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 >	488,152,676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 >	8,064,181,125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 >	382,692,836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 >	436,835円
S M A M ・ F G グローバルバランス 2 5 V A < 適格機関投資家限定 >	4,940,968円
S M A M ・ グローバル・マルチアセット・グロース・ファンド ( 安定成長型 ) < 適格機関投資家限定 >	7,619,291円
S M A M ・ 年金マルチ・インカム・ダイナミック・アロケーション ・ ファンド < 適格機関投資家限定 >	4,379,659円
S M A M ・ 年金 W リスクコントロールファンド < 適格機関投資家限定 >	3,164,472円
S M A M ・ マルチアセット戦略ファンド 2 0 1 6 - 0 1 < 適格機関投資家限定 >	1,888,765,699円
合計	197,030,769,648円

(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・ D C 年金バランス 3 0 ( 債券重点型 )	2,954,754,744円
三井住友・ D C 年金バランス 5 0 ( 標準型 )	5,151,261,045円
三井住友・ D C 年金バランス 7 0 ( 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

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 >	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

## 附属明細表

## 有価証券明細表

## (a) 株式

該当事項はありません。

## (b) 株式以外の有価証券

(単位：円)

種類	銘 柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	第 1 1 7 回 利 付 国 債 ( 5 年 )	15,000,000	15,127,500	
	第 1 2 1 回 利 付 国 債 ( 5 年 )	100,000,000	100,744,000	
	第 1 2 2 回 利 付 国 債 ( 5 年 )	50,000,000	50,403,500	
	第 1 2 3 回 利 付 国 債 ( 5 年 )	2,150,000,000	2,168,963,000	
	第 1 2 4 回 利 付 国 債 ( 5 年 )	2,340,000,000	2,362,042,800	
	第 1 2 5 回 利 付 国 債 ( 5 年 )	1,520,000,000	1,534,941,600	
	第 1 2 6 回 利 付 国 債 ( 5 年 )	910,000,000	919,600,500	
	第 1 2 7 回 利 付 国 債 ( 5 年 )	1,310,000,000	1,324,488,600	
	第 1 2 8 回 利 付 国 債 ( 5 年 )	2,605,000,000	2,635,113,800	
	第 1 2 9 回 利 付 国 債 ( 5 年 )	1,610,000,000	1,629,384,400	
	第 1 3 0 回 利 付 国 債 ( 5 年 )	1,800,000,000	1,822,896,000	
	第 1 3 1 回 利 付 国 債 ( 5 年 )	450,000,000	455,917,500	
	第 1 回 利 付 国 債 ( 4 0 年 )	40,000,000	57,505,200	
	第 2 回 利 付 国 債 ( 4 0 年 )	267,000,000	371,015,190	
	第 3 回 利 付 国 債 ( 4 0 年 )	330,000,000	460,597,500	
	第 4 回 利 付 国 債 ( 4 0 年 )	412,000,000	577,455,080	
	第 5 回 利 付 国 債 ( 4 0 年 )	415,000,000	558,560,950	
	第 6 回 利 付 国 債 ( 4 0 年 )	430,000,000	566,727,100	
	第 7 回 利 付 国 債 ( 4 0 年 )	445,000,000	559,952,400	
	第 8 回 利 付 国 債 ( 4 0 年 )	525,000,000	610,433,250	
	第 9 回 利 付 国 債 ( 4 0 年 )	751,000,000	626,506,730	
	第 2 9 7 回 利 付 国 債 ( 1 0 年 )	13,000,000	13,356,590	
	第 3 0 3 回 利 付 国 債 ( 1 0 年 )	195,000,000	202,634,250	
	第 3 0 5 回 利 付 国 債 ( 1 0 年 )	2,270,000,000	2,361,617,200	
	第 3 0 6 回 利 付 国 債 ( 1 0 年 )	1,670,000,000	1,748,306,300	
	第 3 0 7 回 利 付 国 債 ( 1 0 年 )	940,000,000	981,313,000	

第308回利付国債（10年）	670,000,000	701,885,300
第309回利付国債（10年）	550,000,000	572,665,500
第310回利付国債（10年）	3,080,000,000	3,205,879,600
第312回利付国債（10年）	2,145,000,000	2,254,545,150
第313回利付国債（10年）	2,105,000,000	2,227,637,300
第315回利付国債（10年）	1,800,000,000	1,903,698,000
第317回利付国債（10年）	1,005,000,000	1,061,692,050
第318回利付国債（10年）	895,000,000	941,495,250
第319回利付国債（10年）	980,000,000	1,037,937,600
第320回利付国債（10年）	960,000,000	1,012,233,600
第321回利付国債（10年）	960,000,000	1,014,748,800
第322回利付国債（10年）	1,065,000,000	1,120,454,550
第323回利付国債（10年）	510,000,000	537,789,900
第324回利付国債（10年）	860,000,000	902,372,200
第325回利付国債（10年）	1,290,000,000	1,356,306,000
第326回利付国債（10年）	602,000,000	630,751,520
第327回利付国債（10年）	375,000,000	395,055,000
第328回利付国債（10年）	790,000,000	824,420,300
第329回利付国債（10年）	2,675,000,000	2,828,973,000
第330回利付国債（10年）	1,335,000,000	1,414,552,650
第332回利付国債（10年）	838,000,000	878,307,800
第333回利付国債（10年）	1,855,000,000	1,946,878,150
第334回利付国債（10年）	1,440,000,000	1,512,302,400
第335回利付国債（10年）	1,365,000,000	1,424,145,450
第336回利付国債（10年）	1,240,000,000	1,294,547,600
第337回利付国債（10年）	910,000,000	935,980,500
第338回利付国債（10年）	1,470,000,000	1,523,831,400
第339回利付国債（10年）	1,860,000,000	1,928,708,400
第340回利付国債（10年）	1,810,000,000	1,877,332,000
第341回利付国債（10年）	2,052,000,000	2,110,892,400
第342回利付国債（10年）	1,825,000,000	1,844,564,000
第343回利付国債（10年）	1,925,000,000	1,944,442,500
第344回利付国債（10年）	2,386,000,000	2,408,476,120
第345回利付国債（10年）	2,118,000,000	2,136,426,600
第346回利付国債（10年）	150,000,000	151,188,000
第2回利付国債（30年）	510,000,000	654,625,800
第4回利付国債（30年）	300,000,000	408,279,000
第5回利付国債（30年）	290,000,000	368,978,600
第7回利付国債（30年）	474,000,000	613,962,720
第9回利付国債（30年）	100,000,000	116,208,000
第10回利付国債（30年）	585,000,000	652,649,400
第11回利付国債（30年）	570,000,000	689,380,800

第12回利付国債(30年)	590,000,000	750,969,700
第14回利付国債(30年)	822,000,000	1,088,615,700
第16回利付国債(30年)	465,000,000	625,104,150
第18回利付国債(30年)	500,000,000	656,680,000
第19回利付国債(30年)	490,000,000	644,467,600
第21回利付国債(30年)	345,000,000	454,568,550
第22回利付国債(30年)	335,000,000	453,569,900
第23回利付国債(30年)	329,000,000	446,084,520
第24回利付国債(30年)	310,000,000	420,527,400
第25回利付国債(30年)	300,000,000	396,381,000
第26回利付国債(30年)	353,000,000	473,658,930
第27回利付国債(30年)	395,000,000	539,419,900
第28回利付国債(30年)	436,000,000	597,773,440
第29回利付国債(30年)	227,000,000	307,791,570
第30回利付国債(30年)	557,000,000	746,970,420
第31回利付国債(30年)	425,000,000	562,755,250
第32回利付国債(30年)	705,000,000	951,305,850
第33回利付国債(30年)	743,000,000	957,637,840
第34回利付国債(30年)	737,000,000	984,720,440
第35回利付国債(30年)	730,000,000	945,715,000
第36回利付国債(30年)	365,000,000	474,244,500
第37回利付国債(30年)	655,000,000	837,306,150
第38回利付国債(30年)	710,000,000	892,129,200
第39回利付国債(30年)	375,000,000	480,393,750
第40回利付国債(30年)	475,000,000	597,521,500
第41回利付国債(30年)	475,000,000	586,387,500
第42回利付国債(30年)	480,000,000	592,766,400
第43回利付国債(30年)	465,000,000	575,107,350
第44回利付国債(30年)	500,000,000	618,605,000
第45回利付国債(30年)	625,000,000	742,643,750
第46回利付国債(30年)	540,000,000	641,649,600
第47回利付国債(30年)	715,000,000	867,459,450
第48回利付国債(30年)	615,000,000	715,368,000
第49回利付国債(30年)	575,000,000	668,730,750
第50回利付国債(30年)	565,000,000	569,005,850
第51回利付国債(30年)	560,000,000	490,285,600
第52回利付国債(30年)	633,000,000	586,366,890
第53回利付国債(30年)	507,000,000	482,101,230
第54回利付国債(30年)	95,000,000	95,229,900
第40回利付国債(20年)	10,000,000	10,361,500
第42回利付国債(20年)	480,000,000	506,188,800
第43回利付国債(20年)	1,120,000,000	1,204,974,400
第46回利付国債(20年)	775,000,000	834,403,750

第48回利付国債(20年)	955,000,000	1,049,602,300	
第50回利付国債(20年)	918,000,000	993,156,660	
第52回利付国債(20年)	720,000,000	792,597,600	
第54回利付国債(20年)	965,000,000	1,071,796,550	
第56回利付国債(20年)	818,000,000	909,256,080	
第59回利付国債(20年)	1,455,000,000	1,607,265,750	
第61回利付国債(20年)	1,215,000,000	1,296,562,950	
第64回利付国債(20年)	1,025,000,000	1,158,731,750	
第65回利付国債(20年)	1,020,000,000	1,158,281,400	
第69回利付国債(20年)	1,020,000,000	1,177,253,400	
第70回利付国債(20年)	780,000,000	920,259,600	
第72回利付国債(20年)	753,000,000	875,324,850	
第74回利付国債(20年)	664,000,000	775,206,720	
第75回利付国債(20年)	490,000,000	574,260,400	
第78回利付国債(20年)	590,000,000	684,441,300	
第82回利付国債(20年)	620,000,000	732,189,000	
第84回利付国債(20年)	850,000,000	1,000,101,500	
第85回利付国債(20年)	645,000,000	767,575,800	
第88回利付国債(20年)	742,000,000	899,823,400	
第89回利付国債(20年)	20,000,000	24,070,200	
第90回利付国債(20年)	580,000,000	700,292,000	
第92回利付国債(20年)	734,000,000	882,297,360	
第93回利付国債(20年)	632,000,000	755,928,880	
第95回利付国債(20年)	305,000,000	375,424,500	
第97回利付国債(20年)	677,000,000	828,844,330	
第99回利付国債(20年)	693,000,000	844,316,550	
第100回利付国債(20年)	247,000,000	304,360,810	
第101回利付国債(20年)	355,000,000	445,148,700	
第102回利付国債(20年)	382,000,000	480,426,120	
第105回利付国債(20年)	425,000,000	521,917,000	
第106回利付国債(20年)	370,000,000	458,563,200	
第107回利付国債(20年)	433,000,000	532,949,390	
第108回利付国債(20年)	640,000,000	772,960,000	
第109回利付国債(20年)	555,000,000	671,522,250	
第111回利付国債(20年)	586,000,000	731,826,100	
第113回利付国債(20年)	527,000,000	653,169,070	
第114回利付国債(20年)	818,000,000	1,015,800,580	
第116回利付国債(20年)	385,000,000	484,133,650	
第118回利付国債(20年)	460,000,000	568,113,800	
第119回利付国債(20年)	520,000,000	628,414,800	
第120回利付国債(20年)	540,000,000	638,685,000	
第121回利付国債(20年)	470,000,000	575,228,300	

第122回利付国債(20年)	565,000,000	684,102,000	
第123回利付国債(20年)	380,000,000	476,113,400	
第124回利付国債(20年)	365,000,000	452,461,300	
第125回利付国債(20年)	195,000,000	247,494,000	
第126回利付国債(20年)	280,000,000	347,799,200	
第127回利付国債(20年)	175,000,000	215,006,750	
第128回利付国債(20年)	445,000,000	547,390,050	
第129回利付国債(20年)	440,000,000	535,198,400	
第130回利付国債(20年)	535,000,000	651,378,550	
第131回利付国債(20年)	460,000,000	553,651,400	
第132回利付国債(20年)	470,000,000	566,481,600	
第133回利付国債(20年)	680,000,000	829,212,400	
第134回利付国債(20年)	210,000,000	256,273,500	
第135回利付国債(20年)	345,000,000	416,070,000	
第136回利付国債(20年)	320,000,000	381,324,800	
第137回利付国債(20年)	210,000,000	253,407,000	
第138回利付国債(20年)	45,000,000	52,952,850	
第139回利付国債(20年)	400,000,000	476,512,000	
第140回利付国債(20年)	895,000,000	1,080,542,450	
第141回利付国債(20年)	520,000,000	628,056,000	
第142回利付国債(20年)	450,000,000	550,651,500	
第143回利付国債(20年)	345,000,000	411,595,350	
第144回利付国債(20年)	180,000,000	212,020,200	
第145回利付国債(20年)	515,000,000	622,861,600	
第146回利付国債(20年)	380,000,000	459,689,800	
第147回利付国債(20年)	1,175,000,000	1,403,114,500	
第148回利付国債(20年)	664,000,000	782,245,120	
第149回利付国債(20年)	970,000,000	1,142,388,400	
第150回利付国債(20年)	861,000,000	998,828,880	
第151回利付国債(20年)	1,030,000,000	1,159,337,100	
第152回利付国債(20年)	835,000,000	938,865,650	
第153回利付国債(20年)	727,000,000	829,427,030	
第154回利付国債(20年)	1,070,000,000	1,200,422,300	
第155回利付国債(20年)	890,000,000	966,006,000	
第156回利付国債(20年)	920,000,000	897,110,400	
第157回利付国債(20年)	935,000,000	875,197,400	
第158回利付国債(20年)	895,000,000	884,036,250	
第159回利付国債(20年)	928,000,000	932,092,480	
第160回利付国債(20年)	45,000,000	45,964,350	
国債証券合計	145,746,000,000	162,458,114,390	
地方債証券			
第1回東京都公募公債(20年)	100,000,000	109,459,000	
第1回東京都公募公債(30年)	100,000,000	125,889,000	



第6回東京都公募公債(20年)	100,000,000	115,314,000	
第7回東京都公募公債(20年)	100,000,000	117,477,000	
第8回東京都公募公債(20年)	100,000,000	120,006,000	
第8回東京都公募公債(30年)	400,000,000	511,168,000	
第13回東京都公募公債(30年)	500,000,000	616,905,000	
第660回東京都公募公債	300,000,000	305,565,000	
第674回東京都公募公債	100,100,000	103,429,326	
平成20年度第4回北海道公募公債	100,000,000	102,344,000	
平成20年度第12回北海道公募公債	100,000,000	102,905,000	
平成21年度第14回北海道公募公債	100,000,000	104,335,000	
平成25年度第15回北海道公募公債	100,000,000	104,358,000	
第1回神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	118,028,000	
第3回神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	116,510,000	
第7回神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	119,850,000	
第57回神奈川県公募公債(5年)	200,000,000	200,854,000	
第157回神奈川県公募公債	115,600,000	118,671,492	
第167回神奈川県公募公債	100,000,000	103,668,000	
第97回大阪府公募公債(5年)	102,000,000	102,421,260	
第313回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	101,707,000	
第326回大阪府公募公債(10年)	200,000,000	206,984,000	
第332回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	104,104,000	
第342回大阪府公募公債(10年)	200,000,000	208,240,000	
第361回大阪府公募公債(10年)	200,000,000	209,474,000	
第373回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	105,478,000	
第377回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	104,602,000	
平成19年度第1回京都府公募公債	30,260,000	30,507,224	
平成20年度第3回京都府公募公債	100,000,000	102,620,000	
平成26年度第13回京都府公募公債	100,000,000	103,224,000	
平成27年度第4回京都府公募公債	100,000,000	103,803,000	
第5回兵庫県公募公債(15年)	300,000,000	333,480,000	
平成20年度第5回兵庫県公募公債	100,000,000	102,271,000	
平成21年度第3回兵庫県公募公債	200,000,000	206,760,000	
平成21年度第11回兵庫県公募公債	200,000,000	207,182,000	
第7回静岡県公募公債(30年)	100,000,000	125,064,000	
平成20年度第1回静岡県公募公債	200,000,000	234,994,000	
平成20年度第7回静岡県公募公債	100,000,000	102,754,000	
平成21年度第5回静岡県公募公債	300,000,000	310,065,000	
平成20年度第3回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	102,185,000	
平成20年度第6回愛知県公募公債(10年)	500,000,000	513,785,000	
平成21年度第1回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	103,264,000	
平成21年度第7回愛知県公募公債(10年)	200,000,000	207,224,000	
平成21年度第8回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	103,388,000	

平成21年度第10回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	103,474,000	
平成22年度第12回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	103,904,000	
平成23年度第18回愛知県公募公債(7年)	100,000,000	101,025,000	
平成21年度第1回広島県公募公債	100,000,000	103,301,000	
平成20年度第7回埼玉県公募公債	100,000,000	102,744,000	
平成21年度第1回埼玉県公募公債	100,000,000	103,071,000	
平成21年度第2回埼玉県公募公債	100,000,000	103,296,000	
平成21年度第4回埼玉県公募公債	200,000,000	206,624,000	
平成20年度第10回福岡県公募公債	100,000,000	102,782,000	
平成21年度第3回福岡県公募公債	100,000,000	103,640,000	
平成25年度第5回福岡県公募公債	600,000,000	602,046,000	
平成25年度第11回福岡県公募公債	100,000,000	104,626,000	
平成25年度第12回福岡県公募公債	100,000,000	100,282,000	
平成26年度第4回福岡県公募公債	100,000,000	100,293,000	
平成26年度第10回福岡県公募公債	100,000,000	102,958,000	
平成20年度第8回千葉県公募公債	100,000,000	102,741,000	
平成21年度第2回千葉県公募公債	345,000,000	356,329,800	
平成21年度第6回千葉県公募公債	100,000,000	103,418,000	
第9回群馬県公募公債(10年)	100,000,000	104,442,000	
平成21年度第1回岐阜県公募公債(10年)	200,000,000	206,782,000	
第51回共同発行市場公募地方債	500,000	501,835	
第62回共同発行市場公募地方債	200,000,000	203,846,000	
第64回共同発行市場公募地方債	300,000,000	306,786,000	
第65回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,189,000	
第73回共同発行市場公募地方債	400,000,000	412,800,000	
第75回共同発行市場公募地方債	900,000,000	932,166,000	
第76回共同発行市場公募地方債	300,000,000	309,480,000	
第77回共同発行市場公募地方債	200,000,000	207,198,000	
第79回共同発行市場公募地方債	200,000,000	206,710,000	
第81回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,522,000	
第82回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,913,000	
第91回共同発行市場公募地方債	300,000,000	309,420,000	
第111回共同発行市場公募地方債	300,000,000	313,713,000	
第115回共同発行市場公募地方債	600,000,000	626,220,000	
第137回共同発行市場公募地方債	200,000,000	207,568,000	
平成21年度第4回大阪市公募公債	300,000,000	311,325,000	
平成26年度第2回大阪市公募公債(5年)	200,000,000	200,842,000	
第1回名古屋市長公募公債(20年)	200,000,000	226,390,000	
第3回名古屋市長公募公債(20年)	100,000,000	115,859,000	
第467回名古屋市長公募公債(10年)	100,000,000	103,508,000	
第1回京都市公募公債(30年)	100,000,000	132,945,000	

	第7回京都市公募公債(20年)	100,000,000	123,691,000
	平成26年度第1回京都市公募公債	100,000,000	100,347,000
	平成26年度第17回神戸市公募公債	100,000,000	101,627,000
	第4回横浜市公募公債(20年)	100,000,000	115,460,000
	第9回横浜市公募公債(20年)	100,000,000	120,310,000
	第14回横浜市公募公債(20年)	100,000,000	122,339,000
	平成20年度第6回横浜市公募公債	200,000,000	205,512,000
	平成25年度第1回横浜市公債「ハマ債5」	100,000,000	100,216,000
	平成26年度第4回札幌市公募公債(10年)	100,000,000	103,619,000
	第2回川崎市15年公募公債	100,000,000	105,171,000
	第4回川崎市15年公募公債	100,000,000	109,840,000
	平成20年度第5回福岡市公募公債	100,000,000	102,381,000
	平成25年度第5回福岡市公募公債(5年)	100,000,000	100,384,000
	平成21年度第1回千葉市公募公債	200,000,000	206,410,000
地方債証券合計		16,593,460,000	17,624,303,937
特殊債券	第1回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	102,629,000
	第2回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	200,000,000	204,838,000
	第3回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	200,000,000	228,598,000
	第5回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	102,889,000
	第15回政府保証日本政策投資銀行債券	100,000,000	109,566,000
	第20回政府保証日本政策投資銀行債券	100,000,000	111,591,000
	第23回政府保証日本政策投資銀行債券	400,000,000	408,880,000
	第36回日本政策投資銀行債券	100,000,000	120,019,000
	第51回日本政策投資銀行債券	100,000,000	102,170,000
	第2回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	213,696,000
	第7回道路債券	100,000,000	113,649,000
	第8回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	120,483,000
	第9回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	107,677,000
	第9回道路債券	100,000,000	134,835,000
	第18回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	146,903,000
	第22回日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	425,520,000
	第36回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	53,000,000	53,191,330
	第41回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	400,000,000	403,204,000
	第42回道路債券	100,000,000	116,740,000
	第47回日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	248,954,000
	第49回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,235,000
	第52回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	202,882,000
	第56回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	202,934,000

第58回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	500,000,000	509,820,000	
第60回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,228,000	
第62回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	306,780,000	
第67回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	205,088,000	
第69回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,670,000	
第71回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	204,902,000	
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	243,706,000	
第88回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	130,972,000	
第89回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	600,000,000	619,830,000	
第90回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	366,378,000	
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	103,358,000	
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	123,580,000	
第103回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1,300,000,000	1,351,311,000	
第104回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	208,816,000	
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	103,358,000	
第340回政府保証道路債券	100,000,000	105,314,000	
第1回政府保証地方公営企業等金融機構債券	300,000,000	307,428,000	
第1回政府保証地方公共団体金融機構債券	300,000,000	310,032,000	
第2回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,237,000	
第2回地方公営企業等金融機構債券（20年）	100,000,000	123,048,000	
第3回政府保証地方公営企業等金融機構債券	100,000,000	102,408,000	
第3回公営企業債券（20年）	100,000,000	105,960,000	
第3回地方公共団体金融機構債券	300,000,000	311,133,000	
第4回政府保証地方公営企業等金融機構債券	100,000,000	102,384,000	
第4回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,243,000	
第5回政府保証地方公営企業等金融機構債券	100,000,000	102,483,000	
第5回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,120,000	
第5回公営企業債券（20年）	100,000,000	113,329,000	
第6回政府保証地方公営企業等金融機構債券	100,000,000	102,575,000	
第6回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	207,918,000	
第7回政府保証地方公営企業等金融機構債券	500,000,000	514,445,000	
第8回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,429,000	
第11回公営企業債券（20年）	100,000,000	115,889,000	

第11回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	104,424,000
第14回政府保証地方公共団体金融機構債券 (6年)	200,000,000	201,556,000
第16回公営企業債券(20年)	100,000,000	116,968,000
第17回公営企業債券(20年)	100,000,000	119,983,000
第18回公営企業債券(20年)	100,000,000	122,178,000
第22回公営企業債券(20年)	100,000,000	120,965,000
第24回公営企業債券(20年)	200,000,000	243,802,000
第30回公営企業債券	200,000,000	204,648,000
第42回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	104,155,000
第45回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	208,994,000
第61回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	104,521,000
第63回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,711,000
第65回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,372,000
F74回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,263,000
第883回政府保証公営企業債券	100,000,000	101,340,000
第884回政府保証公営企業債券	300,000,000	304,365,000
第885回政府保証公営企業債券	200,000,000	203,850,000
第886回政府保証公営企業債券	200,000,000	204,356,000
第34回株式会社日本政策金融公庫社債	200,000,000	200,608,000
第19回都市再生債券	100,000,000	101,896,000
第7回本州四国連絡橋債券	100,000,000	117,491,000
第332回東京交通債券	100,000,000	106,912,000
第342回東京交通債券	100,000,000	111,988,000
第13回関西国際空港株式会社社債	100,000,000	102,459,000
第16回関西国際空港株式会社社債	100,000,000	103,087,000
第51回政府保証関西国際空港債券	100,000,000	111,515,000
第14回独立行政法人福祉医療機構債券	200,000,000	200,740,000
第17回独立行政法人福祉医療機構債券	100,000,000	102,349,000
第199回政府保証預金保険機構債	300,000,000	300,633,000
第201回政府保証預金保険機構債	200,000,000	200,514,000
第203回政府保証預金保険機構債	600,000,000	602,334,000
第208回政府保証預金保険機構債	600,000,000	603,030,000
第209回政府保証預金保険機構債	600,000,000	603,186,000
第1回貸付債権担保住宅金融公庫債券	22,514,000	22,830,096
第3回貸付債権担保住宅金融公庫債券	11,303,000	11,479,665
第3回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	16,889,000	17,699,503
第4回貸付債権担保住宅金融公庫債券	11,947,000	12,188,329
第4回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	22,105,000	23,638,644
第5回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	17,171,000	17,976,148
第6回貸付債権担保住宅金融公庫債券	26,598,000	27,439,560
第7回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	22,077,000	23,559,691
第8回貸付債権担保住宅金融公庫債券	13,459,000	13,824,546

第 8 回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	100,756,000
第 9 回貸付債権担保 S 種住宅金融公庫債券	37,886,000	40,434,212
第 9 回貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券	22,409,000	23,957,685
第 1 0 回貸付債権担保 S 種住宅金融公庫債券	58,350,000	62,276,955
第 1 0 回貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券	22,001,000	23,247,356
第 1 1 回貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券	23,339,000	24,864,437
第 1 2 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	15,070,000	15,565,953
第 1 4 回貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券	25,500,000	26,449,620
第 1 4 回一般担保住宅金融支援機構債券	200,000,000	203,456,000
第 1 7 回貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券	57,166,000	59,584,121
第 1 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	30,406,000	32,715,335
第 2 1 回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	102,747,000
第 2 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	61,542,000	66,949,080
第 2 5 回一般担保住宅金融支援機構債券	200,000,000	205,602,000
第 2 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	92,103,000	99,537,554
第 2 7 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	33,511,000	36,123,852
第 2 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	37,282,000	40,104,620
第 2 9 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	19,083,000	19,923,224
第 2 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	39,351,000	42,289,339
第 3 0 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	39,383,000	42,298,917
第 3 2 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	22,070,000	23,062,929
第 3 2 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	79,046,000	84,462,231
第 3 5 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	22,060,000	23,153,073
第 3 5 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	43,654,000	46,605,446
第 3 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	45,080,000	48,006,142
第 3 9 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	20,288,000	21,288,198
第 4 1 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	22,025,000	23,391,871
第 4 3 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	41,508,000	44,437,219
第 4 3 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	57,720,000	61,296,331
第 4 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	50,087,000	53,643,177
第 4 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	95,634,000	102,638,234
第 4 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	46,986,000	50,127,014
第 5 1 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	19,461,000	20,723,240
第 5 1 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	102,394,000	108,866,324
第 5 2 回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	120,723,000
第 5 3 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	20,928,000	22,267,182
第 5 5 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	125,642,000	132,582,464
第 5 7 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	60,780,000	64,207,992
第 5 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	63,359,000	66,822,202
第 5 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	124,872,000	131,963,480

第60回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	192,885,000	202,793,502
第61回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	62,762,000	65,805,957
第67回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	69,650,000	72,426,945
第69回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	142,070,000	149,319,832
第70回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	127,568,000	133,929,816
第73回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	70,624,000	74,462,414
第95回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	105,093,000
第99回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	89,187,000	92,201,520
第130回一般担保住宅金融支援機構債券	200,000,000	236,744,000
第1回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	41,802,000	44,308,029
第2回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	43,850,000	46,701,565
第3回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	20,575,000	22,012,986
第6回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	21,203,000	22,528,823
第5回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	42,044,000	44,659,977
い第758号商工債	100,000,000	100,495,000
い第749号農林債	300,000,000	300,462,000
い第752号農林債	500,000,000	501,120,000
い第768号農林債	100,000,000	100,593,000
第281回信金中金債(5年)	100,000,000	100,243,000
第283回信金中金債(5年)	100,000,000	100,403,000
第291回信金中金債(5年)	100,000,000	100,440,000
第293回信金中金債(5年)	100,000,000	100,468,000
第297回信金中金債(5年)	200,000,000	200,850,000
第301回信金中金債(5年)	300,000,000	301,659,000
第171号商工債(3年)	300,000,000	300,018,000
第175号商工債(3年)	100,000,000	100,048,000
第177号商工債(3年)	300,000,000	300,219,000
第181号商工債(3年)	100,000,000	100,113,000
第183号商工債(3年)	500,000,000	500,695,000
第185号商工債(3年)	200,000,000	200,300,000
第197号商工債(3年)	200,000,000	199,998,000
第12回国際協力機構債券	100,000,000	104,348,000
第15回政府保証東日本高速道路債券	100,000,000	102,509,000
第5回中日本高速道路株式会社社債	200,000,000	205,322,000
第6回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	102,885,000
第19回政府保証中日本高速道路債券	124,000,000	125,489,240
第21回政府保証中日本高速道路債券	200,000,000	203,842,000
第25回政府保証中日本高速道路債券	200,000,000	206,688,000
第46回中日本高速道路株式会社社債	200,000,000	200,300,000
第8回政府保証西日本高速道路債券	33,000,000	33,056,430
第15回政府保証西日本高速道路債券	100,000,000	102,158,000
第19回政府保証西日本高速道路債券	100,000,000	102,894,000
第20回西日本高速道路株式会社社債	100,000,000	104,315,000

特殊債券合計		25,976,259,000	27,348,154,557
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	200,792,000
	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	200,758,000
	第21回コーペラティブ・セントラル・ライフアイゼン・ボエレンリーバンク・ピー・エー	200,000,000	200,942,000
	第18回コーペラティブ・セントラル・ライフアイゼン・ボエレンリーバンク・ピー・エー	300,000,000	300,891,000
	第18回 積水ハウス株式会社無担保社債	100,000,000	100,294,000
	第7回キリンホールディングス株式会社無担保社債	200,000,000	208,146,000
	第8回株式会社セブン&アイ・ホールディングス無担保社債	100,000,000	100,621,000
	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	102,474,000
	第8回株式会社三菱ケミカルホールディングス無担保社債	100,000,000	102,659,000
	第4回花王株式会社無担保社債	100,000,000	101,650,000
	第64回新日本製鐵株式会社無担保社債	100,000,000	104,167,000
	第62回株式会社神戸製鋼所無担保社債	100,000,000	99,758,000
	第13回株式会社クボタ無担保社債	100,000,000	101,149,000
	第16回株式会社日立製作所無担保社債	100,000,000	103,999,000
	第44回三菱電機株式会社無担保社債	100,000,000	100,464,000
	日本電産株式会社第1回無担保社債	100,000,000	100,105,000
	第36回富士通株式会社無担保社債	100,000,000	101,722,000
	第12回パナソニック株式会社無担保社債	200,000,000	201,624,000
	第13回パナソニック株式会社無担保社債	200,000,000	203,810,000
	第1回日本生命2011基金特定目的会社特定社債 第1回 - B	200,000,000	200,574,000
	第1回日本生命2012基金特定目的会社特定社債	100,000,000	100,776,000
	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	100,705,000
	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	100,464,000
	第1回ユニー・ファミリーマートホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	100,348,000
	第63回三井物産株式会社無担保社債	100,000,000	119,049,000
	第47回住友商事株式会社無担保社債	100,000,000	103,322,000
	第3回株式会社みずほコーポレート銀行無担保社債	100,000,000	101,824,000
	第8回株式会社みずほコーポレート銀行無担保社債	100,000,000	123,243,000
	株式会社三菱東京UFJ銀行第12回無担保社債	200,000,000	201,122,000
	第25回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	300,000,000	312,291,000



第110回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	100,000,000	103,673,000	
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	102,768,000	
第4回株式会社りそな銀行無担保社債	100,000,000	105,693,000	
第9回三菱UFJ信託銀行株式会社無担保社債	100,000,000	105,979,000	
第7回住友信託銀行株式会社無担保社債	100,000,000	100,135,000	
第8回住友信託銀行株式会社無担保社債	100,000,000	119,110,000	
第6回株式会社セブン銀行無担保社債	200,000,000	200,144,000	
第1回株式会社みずほフィナンシャルグループ無担保社債	100,000,000	103,311,000	
第20回株式会社三井住友銀行無担保社債	200,000,000	209,486,000	
第24回株式会社三井住友銀行無担保社債	100,000,000	105,810,000	
第8回株式会社みずほ銀行無担保社債	200,000,000	200,138,000	
第9回株式会社みずほ銀行無担保社債	100,000,000	119,218,000	
第17回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	106,156,000	
第53回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	100,302,000	
第54回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	101,344,000	
第113回オリックス株式会社無担保社債	100,000,000	100,042,000	
第162回オリックス株式会社無担保社債	100,000,000	100,110,000	
第165回オリックス株式会社無担保社債	100,000,000	100,236,000	
第48回三菱UFJリース株式会社無担保社債	100,000,000	99,961,000	
第21回野村ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	105,153,000	
第39回野村ホールディングス株式会社無担保社債	200,000,000	201,254,000	
第58回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	131,259,000	
第110回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	101,189,000	
第15回東日本旅客鉄道株式会社社債	100,000,000	108,832,000	
第34回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	117,380,000	
第110回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	118,334,000	
第41回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	121,610,000	
第42回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	200,000,000	247,152,000	
第45回阪急阪神ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	101,468,000	
第526回東京電力株式会社社債	300,000,000	300,588,000	
第528回東京電力株式会社社債	100,000,000	103,567,000	
第532回東京電力株式会社社債	100,000,000	100,646,000	
第537回東京電力株式会社社債	100,000,000	104,318,000	
第544回東京電力株式会社社債	100,000,000	102,101,000	
第547回東京電力株式会社社債	100,000,000	105,318,000	
第518回中部電力株式会社社債	100,000,000	100,143,000	

第467回関西電力株式会社社債	100,000,000	102,240,000	
第471回東北電力株式会社社債	100,000,000	106,155,000	
第472回東北電力株式会社社債	100,000,000	104,751,000	
第253回四国電力株式会社社債	100,000,000	105,055,000	
第400回九州電力株式会社社債	100,000,000	104,908,000	
第328回北海道電力株式会社社債	100,000,000	100,998,000	
第11回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	113,795,000	
第18回大阪瓦斯株式会社無担保社債	200,000,000	215,496,000	
第27回東邦瓦斯株式会社無担保社債	100,000,000	105,643,000	
社債券合計	9,500,000,000	9,912,712,000	
合計		217,343,284,884	

## デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## 外国株式インデックス・マザーファンド

## 貸借対照表

(単位：円)

	(平成28年 4月13日現在)	(平成29年 4月13日現在)
資産の部		
流動資産		
預金	3,297,537,450	2,185,463,083
金銭信託	233,094,782	-
コール・ローン	-	410,533,400
株式	143,907,141,807	188,918,250,224
投資証券	3,898,944,679	5,026,285,203
派生商品評価勘定	47,286,174	14,842,315
未収入金	1,592,186	1,904,428
未収配当金	271,057,094	316,599,965
差入委託証拠金	1,396,244,955	1,596,288,097
流動資産合計	153,052,899,127	198,470,166,715
資産合計	153,052,899,127	198,470,166,715
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	20,128,882	1,934,567
前受金	27,157,292	12,330,578
未払解約金	123,282,690	375,879,554
未払利息	-	663
その他未払費用	-	4,353
流動負債合計	170,568,864	390,149,715
負債合計	170,568,864	390,149,715
純資産の部		
元本等		
元本	60,593,406,071	68,241,612,029
剰余金		
剰余金又は欠損金( )	92,288,924,192	129,838,404,971
元本等合計	152,882,330,263	198,080,017,000
純資産合計	152,882,330,263	198,080,017,000
負債純資産合計	153,052,899,127	198,470,166,715

## 注記表

## （重要な会計方針の注記）

項目	自 平成28年 4月14日 至 平成29年 4月13日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	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。  (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。  (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。  (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。
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	(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。  (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。
3. 収益及び費用の計上基準	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。
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	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。

## （貸借対照表に関する注記）

項目	（平成28年 4月13日現在）	（平成29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	60,593,406,071口	68,241,612,029口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 2.5231円 (10,000口当たりの純資産額 25,231円)	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)

## （金融商品に関する注記）

## . 金融商品の状況に関する事項

項 目	自 平成28年 4月14日 至 平成29年 4月13日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、株式、投資証券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいておりません。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。当計算期間については、先物取引、為替予約取引を行っております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する委員会をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用グループに是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用グループは、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。その後、当該関連運用グループの対処の実施や対処方針の決定等に関し、必要に応じてリスク管理を行う部署が当該部署の担当役員、当該関連運用グループの担当役員およびリスク管理委員会へ報告を行う体制となっております。</p> <p>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する部会にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。</p>

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

・金融商品の時価等に関する事項

項目	(平成29年 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28年 4月13日現在）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

（単位：円）

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

（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	うち1年超	時 価	評 価 損 益
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	4,018,839,375	-	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	

## (注) 1. 時価の算定方法

## (1) 株価指数先物取引の時価の算定方法について

- 1) 原則として計算期間末日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場で評価しています。このような時価が発表されていない場合には、計算期間末日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しています。
- 2) 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

## (2) 為替予約取引の時価の算定方法について

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

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

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

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

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

2.ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

自 平成28年 4月14日 至 平成29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28年 4月13日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	69,552,562,996円
同期中における追加設定元本額	14,738,717,221円
同期中における一部解約元本額	23,697,874,146円
平成28年 4月13日現在における元本の内訳	
三井住友・DC外国株式インデックスファンドS	8,800,201,270円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	200,831,501円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	873,812,975円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	583,556,304円
S M A M・グローバルバランスファンド(機動的資産配分型)	30,773,907円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2020	3,083,623円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2025	7,205,082円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2030	29,623,573円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2035	26,788,007円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2040	16,067,043円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2045	36,039,216円
外国株式指数ファンド	437,913,349円
三井住友・DC全海外株式インデックスファンド	577,809,227円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	163,530,808円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	239,430,957円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	297,138,696円
S M A M・外国株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	7,705,954,401円
バランスファンドVA(安定運用型) <適格機関投資家限定>	45,693,152円
S M A M・バランスファンドVA安定成長型 <適格機関投資家限定>	5,296,983,372円
S M A M・バランスファンドVA25 <適格機関投資家専用>	3,693,008,705円
S M A M・バランスファンドVA37.5 <適格機関投資家専用>	2,722,128,231円
S M A M・バランスファンドVA50 <適格機関投資家専用>	11,262,781,335円
S M A M・バランスファンドVL30 <適格機関投資家限定>	30,694,337円
S M A M・バランスファンドVL50 <適格機関投資家限定>	179,966,870円
世界6資産バランスファンドVA <適格機関投資家限定>	13,782,411円
S M A M・バランスファンドVA75 <適格機関投資家専用>	1,343,045,993円

S M A M ・ バランスファンドV L 国際分散型 < 適格機関投資家限定 >	100,455,805円
S M A M ・ インデックス・バランスV A 2 5 < 適格機関投資家専用 >	295,414,154円
S M A M ・ インデックス・バランスV A 5 0 < 適格機関投資家専用 >	1,324,189,446円
S M A M ・ バランスファンドV A 4 0 < 適格機関投資家専用 >	2,309,545,149円
S M A M ・ バランスファンドV A 3 5 < 適格機関投資家専用 >	3,035,654,992円
S M A M ・ バランスV A 株 4 0 T < 適格機関投資家限定 >	100,751,800円
三井住友・外国株式インデックスファンド・V A S ( 適格機関投資家専用 )	1,244,794,128円
三井住友・5資産バランスファンド・V A S ( 適格機関投資家専用 )	2,728,718,926円
S M A M ・ グローバルバランス4 0 V A < 適格機関投資家限定 >	252,370,098円
S M A M ・ バランスファンドV A 2 0 < 適格機関投資家専用 >	148,942,135円
三井住友・7資産バランスファンド・V A S ( 適格機関投資家専用 )	2,424,066,062円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 2 0 A < 適格機関投資家専用 >	43,589,645円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 3 5 A < 適格機関投資家専用 >	23,914,178円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 5 0 A < 適格機関投資家専用 >	11,985,311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 >	94,837,863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 >	211,165,907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 >	205,483,522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 >	224,527円
S M A M ・ F G グローバルバランス2 5 V A < 適格機関投資家限定 >	2,389,563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 >	1,346,524,379円
S M A M ・ 年金Wリスクリスクコントロールファンド < 適格機関投資家限定 >	117,335円
S M A M ・ マルチアセットストラテジーファンド2 0 1 6 - 0 1 < 適格機関投資家限定 >	70,426,801円
合計	60,593,406,071円

(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・D C 外国株式インデックスファンドS	10,441,488,856円
三井住友・D C 年金バランス3 0 ( 債券重点型 )	227,458,140円
三井住友・D C 年金バランス5 0 ( 標準型 )	935,783,173円
三井住友・D C 年金バランス7 0 ( 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・D C ターゲットイヤーファンド2 0 2 0 ( 4資産タイプ )	3,182,251円
三井住友・D C ターゲットイヤーファンド2 0 2 5 ( 4資産タイプ )	8,789,280円
三井住友・D C ターゲットイヤーファンド2 0 3 0 ( 4資産タイプ )	26,099,614円
三井住友・D C ターゲットイヤーファンド2 0 3 5 ( 4資産タイプ )	32,539,661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 )	18,177,564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 )	48,001,285円
外国株式指数ファンド	413,768,587円
三井住友・D C 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・外国株式パッシブ・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
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＞	76,227,799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＞	36,503,645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＞	48,194,289円
合計	68,241,612,029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	30,772	62.54	1,924,480.88	
	ANTERO RESOURCES CORP	8,176	22.60	184,777.60	
	APACHE CORPORATION	20,891	53.81	1,124,144.71	
	BAKER HUGHES INC	21,577	60.34	1,301,956.18	
	CABOT OIL & GAS CORPORATION	26,164	24.45	639,709.80	
	CHENIERE ENERGY INC	11,680	48.01	560,756.80	
	CHEVRON CORPORATION	103,937	108.97	11,326,014.89	
	CIMAREX ENERGY CO	5,271	121.91	642,587.61	
	CONCHO RESOURCES INC	8,234	132.27	1,089,111.18	
	CONOCOPHILLIPS	68,219	49.44	3,372,747.36	
	CONTINENTAL RESOURCES, INC.	5,758	45.84	263,946.72	
	CORE LABORATORIES N.V.	2,680	116.80	313,024.00	
	DEVON ENERGY CORPORATION	25,946	41.87	1,086,359.02	
	DIAMONDBACK ENERGY INC	4,749	106.32	504,913.68	
	EOG RESOURCES INC	31,739	97.49	3,094,235.11	
	EQT CORPORATION	9,689	63.36	613,895.04	
	EXXON MOBIL CORPORATION	228,310	82.97	18,942,880.70	
	HALLIBURTON CO	47,595	49.33	2,347,861.35	
	HELMERICH & PAYNE INC	6,307	68.71	433,353.97	
	HESS CORPORATION	16,082	50.57	813,266.74	
	HOLLYFRONTIER CORP	8,311	27.82	231,212.02	
	KINDER MORGAN INC	104,474	21.66	2,262,906.84	
	MARATHON OIL CORP	48,323	16.41	792,980.43	
	MARATHON PETROLEUM CORPORATION	29,061	49.94	1,451,306.34	
	MURPHY OIL CORPORATION	9,993	28.10	280,803.30	
	NATIONAL-OILWELL VARCO INC.	22,038	37.78	832,595.64	
	NEWFIELD EXPLORATION CO	10,715	36.20	387,883.00	
	NOBLE ENERGY INC	24,229	35.24	853,829.96	
	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	42,075	65.06	2,737,399.50	
	ONEOK INC	12,008	55.33	664,402.64	
	PARSLEY ENERGY INC-CLASS A	11,937	31.46	375,538.02	
	PHILLIPS 66	25,809	77.38	1,997,100.42	
	PIONEER NATURAL RESOURCES CO	9,345	186.90	1,746,580.50	
PLAINS GP HOLDINGS LP-CL A	7,806	31.46	245,576.76		
RANGE RESOURCES CORPORATION	10,817	28.54	308,717.18		
SCHLUMBERGER LTD	76,150	79.57	6,059,255.50		
SOUTHWESTERN ENERGY COMPANY	29,453	7.87	231,795.11		

TARGA RESOURCES CORP	10,314	58.88	607,288.32
TECHNIPFMC PLC	24,396	33.33	813,118.68
TESORO CORPORATION	6,712	81.18	544,880.16
VALERO ENERGY CORP	24,923	65.13	1,623,234.99
WILLIAMS COS INC	44,930	30.38	1,364,973.40
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	11,471	135.51	1,554,435.21
ALBEMARLE CORPORATION	6,617	104.12	688,962.04
ARCONIC INC	25,812	25.85	667,240.20
ASHLAND GLOBAL HOLDINGS INC	3,401	123.96	421,587.96
AVERY DENNISON CORP	4,688	79.64	373,352.32
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	10,777	31.29	337,212.33
BALL CORPORATION	8,974	71.74	643,794.76
CELANESE CORPORATION	7,980	90.61	723,067.80
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	12,356	28.62	353,628.72
CROWN HOLDINGS INC	7,595	53.55	406,712.25
DOW CHEMICAL	61,175	61.92	3,787,956.00
DU PONT (E.I.) DE NEMOURS	47,416	78.43	3,718,836.88
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	8,696	78.69	684,288.24
ECOLAB INC	14,161	124.96	1,769,558.56
FMC CORPORATION	7,651	72.89	557,681.39
FREEMONT-MCMORAN INC	74,285	12.88	956,790.80
INTERNATIONAL PAPER CO	20,814	50.04	1,041,532.56
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	4,622	132.56	612,692.32
LYONDELLBASELL INDU-CL A	18,669	86.34	1,611,881.46
MARTIN MARIETTA MATERIALS	3,548	212.79	754,978.92
MONSANTO CO	23,812	116.27	2,768,621.24
MOSAIC CO/THE	19,208	28.15	540,705.20
NEWMONT MINING CORP	28,172	35.08	988,273.76
NUCOR CORP	16,963	57.88	981,818.44
PACKAGING CORP OF AMERICA	5,524	90.18	498,154.32
PPG INDUSTRIES INC	14,194	105.06	1,491,221.64
PRAXAIR INC	15,966	118.23	1,887,660.18
SEALED AIR CORP	11,115	42.69	474,499.35
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	4,430	312.96	1,386,412.80
VALSPAR CORP/THE	4,415	112.45	496,466.75
VULCAN MATERIALS CO	6,976	117.94	822,749.44
WESTROCK CO	14,346	49.83	714,861.18
WR GRACE & CO	3,500	67.90	237,650.00
3M COMPANY	33,116	189.70	6,282,105.20
ACUITY BRANDS INC	2,353	174.80	411,304.40
AERCAP HOLDINGS NV	7,913	43.41	343,503.33
AGCO CORP	3,447	58.87	202,924.89

AMETEK INC	13,323	53.52	713,046.96
BE AEROSPACE INC	5,983	64.47	385,724.01
BOEING CO	32,281	176.05	5,683,070.05
CATERPILLAR INC	31,829	94.86	3,019,298.94
CUMMINS INC	8,568	146.92	1,258,810.56
DANAHER CORP	34,276	85.75	2,939,167.00
DEERE & CO	14,902	109.35	1,629,533.70
DOVER CORP	8,642	79.33	685,569.86
EATON CORP PLC	25,253	74.24	1,874,782.72
EMERSON ELECTRIC CO	34,789	58.42	2,032,373.38
FASTENAL COMPANY	16,429	46.29	760,498.41
FLOWSERVE CORPORATION	7,675	47.72	366,251.00
FLUOR CORP	7,277	51.13	372,073.01
FORTIVE CORP	17,402	60.50	1,052,821.00
GENERAL DYNAMICS CORP	14,064	186.34	2,620,685.76
GENERAL ELECTRIC CO	486,743	29.77	14,490,339.11
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	39,863	123.15	4,909,128.45
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES	2,653	203.65	540,283.45
ILLINOIS TOOL WORKS	17,736	130.87	2,321,110.32
INGERSOLL-RAND PLC	13,777	82.29	1,133,709.33
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	7,005	53.11	372,035.55
JARDINE MATHESON HOLDINGS LIMITED	14,100	65.90	929,190.00
JARDINE STRATEGIC HOLDINGS LIMITED	12,600	42.00	529,200.00
L3 TECHNOLOGIES INC	4,316	166.45	718,398.20
LOCKHEED MARTIN CORPORATION	14,386	268.51	3,862,784.86
MASCO CORP	18,535	33.31	617,400.85
MIDDLEBY CORP	3,388	134.81	456,736.28
NORTHROP GRUMMAN CORP	9,072	239.36	2,171,473.92
PACCAR INC	18,774	65.65	1,232,513.10
PARKER HANNIFIN CORPORATION	7,528	155.42	1,170,001.76
PENTAIR PLC-REGISTERED	9,682	62.35	603,672.70
RAYTHEON COMPANY	15,937	151.35	2,412,064.95
ROCKWELL AUTOMATION INC	6,830	150.23	1,026,070.90
ROCKWELL COLLINS INC.	7,255	97.99	710,917.45
ROPER TECHNOLOGIES INC	5,414	205.47	1,112,414.58
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	10,115	40.28	407,432.20
SNAP-ON INC	3,266	162.63	531,149.58
STANLEY BLACK & DECKER INC	8,025	132.26	1,061,386.50
TEXTRON INC	14,631	47.46	694,387.26
TRANSDIGM GROUP INC	2,954	235.65	696,110.10
UNITED RENTALS INC	5,006	121.13	606,376.78
UNITED TECHNOLOGIES CORP	42,751	112.24	4,798,372.24

WABTEC CORP	4,279	79.67	340,907.93
WW GRAINGER INC	3,265	223.71	730,413.15
XYLEM INC	9,156	49.38	452,123.28
CINTAS CORP	4,708	122.38	576,165.04
DUN & BRADSTREET CORP	2,078	105.28	218,771.84
EQUIFAX INC	6,641	135.31	898,593.71
IHS MARKIT LTD	18,862	42.44	800,503.28
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	50,724	40.90	2,074,611.60
MANPOWERGROUP	4,034	98.49	397,308.66
NIELSEN HOLDINGS PLC	19,909	41.00	816,269.00
REPUBLIC SERVICES INC	13,657	62.51	853,699.07
ROBERT HALF INTL INC	7,661	44.84	343,519.24
STERICYCLE, INC.	4,902	81.27	398,385.54
VERISK ANALYTICS INC	9,152	79.24	725,204.48
WASTE CONNECTIONS INC	9,249	87.99	813,819.51
WASTE MANAGEMENT INC	24,706	72.30	1,786,243.80
AMERCO	390	361.40	140,946.00
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	6,589	43.96	289,652.44
C.H.ROBINSON WORLDWIDE, INC.	7,794	74.79	582,913.26
CSX CORPORATION	50,806	46.40	2,357,398.40
DELTA AIR LINES INC	10,570	45.05	476,178.50
EXPEDITORS INTL WASH INC	10,211	55.70	568,752.70
FEDEX CORP	13,719	186.31	2,555,986.89
J.B. HUNT TRANSPORT SERVICES INC	5,307	90.16	478,479.12
KANSAS CITY SOUTHERN	6,279	87.51	549,475.29
MACQUARIE INFRASTRUCTURE CORP	3,832	79.69	305,372.08
NORFOLK SOUTHERN CORP	16,345	111.79	1,827,207.55
SOUTHWEST AIRLINES	8,327	55.51	462,231.77
UNION PACIFIC CORP	45,033	105.57	4,754,133.81
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS INC	4,745	69.93	331,817.85
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	37,621	104.23	3,921,236.83
AUTOLIV INC	4,682	97.16	454,903.12
BORGWARNER INC	12,178	38.59	469,949.02
DELPHI AUTOMOTIVE PLC	15,341	74.28	1,139,529.48
FORD MOTOR COMPANY	201,121	11.23	2,258,588.83
GENERAL MOTORS CO	74,631	33.94	2,532,976.14
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	15,385	34.39	529,090.15
HARLEY-DAVIDSON INC	10,083	61.05	615,567.15
LEAR CORP	3,609	132.83	479,383.47
MOBILEYE NV	10,004	61.76	617,847.04
TESLA INC	6,947	296.84	2,062,147.48
WABCO HOLDINGS INC	2,658	113.29	301,124.82

COACH INC	15,728	40.14	631,321.92
D.R.HORTON INC	20,208	33.44	675,755.52
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY	9,004	61.71	555,636.84
GARMIN LTD	5,834	49.29	287,557.86
HANESBRANDS INC	21,525	21.11	454,392.75
HASBRO INC	6,377	96.46	615,125.42
LEGGETT & PLATT INC	7,789	51.10	398,017.90
LENNAR CORP-CL A	10,746	51.29	551,162.34
LULULEMON ATHLETICA INC	5,472	52.08	284,981.76
MATTEL INC	19,175	25.73	493,372.75
MICHAEL KORS HOLDINGS LIMITED	9,739	37.78	367,939.42
MOHAWK INDUSTRIES INC	3,598	230.46	829,195.08
NEWELL BRANDS INC	24,405	46.17	1,126,778.85
NIKE INC -CL B	72,909	55.57	4,051,553.13
POLARIS INDUSTRIES INC	3,113	80.61	250,938.93
PULTE GROUP INC	16,248	23.77	386,214.96
PVH CORP	4,758	101.21	481,557.18
RALPH LAUREN CORPORATION	2,646	80.18	212,156.28
SMITH(A.O.) CORP	8,542	49.85	425,818.70
TOLL BROTHERS INC	9,275	36.08	334,642.00
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	11,107	19.28	214,142.96
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	11,448	17.86	204,461.28
VF CORP	17,553	55.04	966,117.12
WHIRLPOOL CORP	4,289	168.27	721,710.03
ARAMARK	12,558	36.33	456,232.14
CARNIVAL CORP	19,931	57.73	1,150,616.63
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	1,668	458.35	764,527.80
DARDEN RESTAURANTS INC	6,806	82.49	561,426.94
DOMINO'S PIZZA INC	2,742	175.13	480,206.46
H&R BLOCK INC	13,015	23.63	307,544.45
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS INC	11,081	57.42	636,271.02
LAS VEGAS SANDS CORP	23,432	56.51	1,324,142.32
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	17,889	91.75	1,641,315.75
MCDONALD'S CORPORATION	45,447	131.26	5,965,373.22
MELCO RESORTS & ENTERTAINMENET-ADR	10,584	20.01	211,785.84
MGM MIRAGE	25,809	27.57	711,554.13
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDINGS	8,343	47.85	399,212.55
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	9,610	94.72	910,259.20
STARBUCKS CORP	79,496	57.58	4,577,379.68
WYNDHAM WORLDWIDE CORP	6,427	87.12	559,920.24
WYNN RESORTS LTD	4,682	115.39	540,255.98
YUM! BRANDS INC	19,326	64.03	1,237,443.78

CBS CORP-CL B	21,802	67.16	1,464,222.32
CHARTER COMMUNICATTIONS INC-A	11,811	334.57	3,951,606.27
COMCAST CORP-CLASS A	262,450	37.29	9,786,760.50
DISCOVERY COMMUNICATIONS INC-A	7,075	28.69	202,981.75
DISCOVERY COMMUNICATIONS INC-C	11,427	28.14	321,555.78
DISH NETWORK CORP.	12,925	63.99	827,070.75
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	22,642	24.50	554,729.00
LIBERTY BROADBAND-C	5,788	87.69	507,549.72
LIBERTY GLOBAL PLC-A	14,258	34.57	492,899.06
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	34,465	34.05	1,173,533.25
LIBERTY LILAC GROUP-C	5,259	23.54	123,796.86
LIBERTY SIRIUS GROUP-C	11,891	38.89	462,440.99
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-A	4,141	38.94	161,250.54
NEWS CORP-CLASS A	22,918	12.49	286,245.82
OMNICOM GROUP	12,567	84.67	1,064,047.89
SCRIPPS NETWORKS INTERACTIVE	4,484	75.43	338,228.12
SIRIUS XM HOLDINGS INC	100,341	5.09	510,735.69
TEGNA INC	10,189	25.43	259,106.27
THE WALT DISNEY CO.	82,925	113.04	9,373,842.00
TIME WARNER INC	42,090	98.75	4,156,387.50
TWENTY-FIRST CE CL-A	57,039	30.65	1,748,245.35
TWENTY-FIRST CE CL-B	25,050	30.14	755,007.00
VIACOM INC-CLASS B	19,259	44.34	853,944.06
ADVANCE AUTO PARTS	4,092	141.74	580,000.08
AMAZON.COM INC	22,196	896.23	19,892,721.08
AUTONATION INC	4,917	40.07	197,024.19
AUTOZONE INC	1,596	693.34	1,106,570.64
BED BATH & BEYOND INC	8,527	38.46	327,948.42
BEST BUY COMPANY INC	16,151	48.36	781,062.36
CARMAX INC	9,888	56.24	556,101.12
DICK'S SPORTING GOODS INC	4,201	50.23	211,016.23
DOLLAR GENERAL CORP	15,009	68.96	1,035,020.64
DOLLAR TREE INC	13,251	77.14	1,022,182.14
EXPEDIA INC	7,045	129.28	910,777.60
FOOT LOCKER INC	7,641	72.60	554,736.60
GAP INC/THE	11,623	24.30	282,438.90
GENUINE PARTS CO	8,452	89.42	755,777.84
HOME DEPOT INC	67,070	146.54	9,828,437.80
KOHL'S CORP	10,244	40.15	411,296.60
L BRANDS INC	12,641	47.81	604,366.21
LIBERTY INTERACTIVE CORP QVC GROUP-A	24,979	21.19	529,305.01
LKQ CORPORATION	16,373	28.14	460,736.22

LOWE'S COMPANIES INC	47,461	81.87	3,885,632.07
MACY'S INC	17,457	29.17	509,220.69
NETFLIX INC	23,379	143.83	3,362,601.57
NORDSTROM INC	6,499	46.43	301,748.57
O'REILLY AUTOMOTIVE INC NEW	5,249	253.03	1,328,154.47
PRICELINE GROUP INC/THE	2,697	1,750.01	4,719,776.97
ROSS STORES INC	21,299	63.73	1,357,385.27
SIGNET JEWELERS LTD	2,864	67.05	192,031.20
STAPLES INC	38,290	9.51	364,137.90
TARGET CORP	29,869	53.40	1,595,004.60
TIFFANY & CO	7,222	91.74	662,546.28
TJX COMPANIES INC	35,441	77.09	2,732,146.69
TRACTOR SUPPLY COMPANY	7,486	64.61	483,670.46
TRIPADVISOR INC-W/I	7,039	41.50	292,118.50
ULTA BEAUTY INC	3,353	283.78	951,514.34
COSTCO WHOLESALE CORP	23,855	170.17	4,059,405.35
CVS HEALTH CORPORATION	58,263	77.96	4,542,183.48
KROGER CO	49,385	29.86	1,474,636.10
RITE AID CORP	59,420	4.57	271,549.40
SYSCO CORP	28,607	52.21	1,493,571.47
WAL-MART STORES INC	85,155	73.44	6,253,783.20
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	50,269	82.57	4,150,711.33
WHOLE FOODS MARKET INC	17,976	34.12	613,341.12
ALTRIA GROUP INC	107,379	72.16	7,748,468.64
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	31,681	44.65	1,414,556.65
BROWN-FORMAN CORPORATION	12,263	45.95	563,484.85
BUNGE LIMITED	7,871	77.19	607,562.49
CAMPBELL SOUP CO	11,170	57.03	637,025.10
COCA-COLA CO/THE	225,374	42.94	9,677,559.56
CONAGRA BRANDS INC	22,020	40.62	894,452.40
CONSTELLATION BRANDS INC-A	9,785	169.96	1,663,058.60
DR.PEPPER SNAPPLE GROUP, INC	10,115	97.28	983,987.20
GENERAL MILLS INC	32,561	57.58	1,874,862.38
HORMEL FOODS CORPORATION	16,378	34.25	560,946.50
INGREDION INC	4,088	120.58	492,931.04
JM SMUCKER CO/THE-NEW COM	6,757	128.20	866,247.40
KELLOGG CO	14,766	72.33	1,068,024.78
KRAFT HEINZ COMPANY	33,125	91.93	3,045,181.25
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	6,460	99.84	644,966.40
MEAD JOHNSON NUTRITION COMPANY	10,257	88.69	909,693.33
MOLSON COORS BREWING COMPANY	10,377	95.56	991,626.12
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	84,225	44.39	3,738,747.75



MONSTER BEVERAGE CORPORATION	22,009	45.40	999,208.60
PEPSICO INC	78,964	113.61	8,971,100.04
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL INC.	85,415	113.78	9,718,518.70
REYNOLDS AMERICAN INC	47,101	64.20	3,023,884.20
THE HERSHEY COMPANY	8,215	109.05	895,845.75
TYSON FOODS INC-CL A	15,998	64.26	1,028,031.48
CHURCH & DWIGHT CO INC	14,360	50.02	718,287.20
CLOROX COMPANY	6,829	134.64	919,456.56
COLGATE-PALMOLIVE COMPANY	46,009	74.00	3,404,666.00
COTY INC-CL A	27,462	17.60	483,331.20
EDGEWELL PERSONAL CARE CO	2,963	70.40	208,595.20
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	12,238	84.92	1,039,250.96
KIMBERLY-CLARK CORP	19,719	133.10	2,624,598.90
PROCTER & GAMBLE CO	140,778	90.31	12,713,661.18
SPECTRUM BRANDS HOLDINGS INC	1,690	140.38	237,242.20
ABBOTT LABORATORIES	93,968	43.48	4,085,728.64
AETNA INC	19,320	129.08	2,493,825.60
ALIGN TECHNOLOGY INC	4,163	114.11	475,039.93
AMERISOURCEBERGEN CORP	9,013	86.82	782,508.66
ANTHEM INC	14,504	166.43	2,413,900.72
BARD(C.R.) INC	3,906	249.10	972,984.60
BAXTER INTERNATIONAL INC	26,521	53.53	1,419,669.13
BECTON DICKINSON & CO	11,690	183.22	2,141,841.80
BOSTON SCIENTIFIC CORP	76,162	24.53	1,868,253.86
CARDINAL HEALTH INC	17,622	81.71	1,439,893.62
CENTENE CORP	9,578	70.88	678,888.64
CERNER CORP	16,958	58.77	996,621.66
CIGNA CORP	14,136	150.59	2,128,740.24
COOPER COMPANIES INC (THE)	2,852	197.06	562,015.12
DAVITA INC	9,291	68.10	632,717.10
DENTSPLY SIRONA INC	13,264	61.99	822,235.36
DEXCOM INC	4,938	76.77	379,090.26
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	11,392	93.75	1,068,000.00
ENVISION HEALTHCARE CORP	6,386	60.30	385,075.80
EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO	34,651	66.54	2,305,677.54
HCA HOLDINGS, INC.	16,671	88.20	1,470,382.20
HENRY SCHEIN INC	4,543	168.73	766,540.39
HOLOGIC INC	14,057	42.50	597,422.50
HUMANA INC.	8,209	212.99	1,748,434.91
IDEXX LABORATORIES INC	4,934	154.20	760,822.80
INTUITIVE SURGICAL INC	2,133	764.26	1,630,166.58
LABORATORY CRP OF AMR HLDGS	5,705	142.57	813,361.85

MALLINCKRODT PLC	5,503	44.30	243,782.90
MCKESSON CORP	12,648	143.89	1,819,920.72
MEDNAX INC	4,959	67.94	336,914.46
MEDTRONIC PLC	76,725	80.10	6,145,672.50
PATTERSON COS INC	4,102	43.90	180,077.80
QUEST DIAGNOSTICS	7,908	98.12	775,932.96
QUINTILES IMS HOLDINGS INC	8,462	78.67	665,705.54
RESMED INC	7,656	68.41	523,746.96
STRYKER CORP	18,287	130.41	2,384,807.67
TELEFLEX INC	2,592	196.22	508,602.24
TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES-SP ADR	49,603	32.12	1,593,248.36
UNITEDHEALTH GROUP INC	52,405	165.56	8,676,171.80
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	4,903	123.06	603,363.18
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	5,497	89.44	491,651.68
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	10,735	119.17	1,279,289.95
ABBVIE INC	89,475	64.37	5,759,505.75
AGILENT TECHNOLOGIES INC	17,191	52.55	903,387.05
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	12,508	114.57	1,433,041.56
ALKERMES PLC	8,922	56.95	508,107.90
ALLERGAN PLC	20,499	237.83	4,875,277.17
AMGEN INC	40,959	163.05	6,678,364.95
BIOGEN INC	11,851	268.92	3,186,970.92
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	9,504	88.38	839,963.52
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	91,384	52.99	4,842,438.16
CELGENE CORP	42,393	125.15	5,305,483.95
ELI LILLY & CO	54,282	86.25	4,681,822.50
GILEAD SCIENCES INC	72,013	66.22	4,768,700.86
ILLUMINA INC	8,088	172.95	1,398,819.60
INCYTE CORP	9,335	138.27	1,290,750.45
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	3,564	152.21	542,476.44
JOHNSON & JOHNSON	149,506	125.40	18,748,052.40
MERCK & CO. INC.	151,803	63.05	9,571,179.15
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL INC	1,522	477.02	726,024.44
MYLAN NV	24,190	38.04	920,187.60
PERRIGO CO PLC	8,020	68.05	545,761.00
PFIZER INC	334,113	33.92	11,333,112.96
REGENERON PHARMACEUTICALS	4,276	366.33	1,566,427.08
SEATTLE GENETICS INC	5,832	64.30	374,997.60
TARO PHARMACEUTICAL INDUSTRIES	906	118.28	107,161.68
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	21,521	152.46	3,281,091.66
UNITED THERAPEUTICS CORP	2,169	121.95	264,509.55
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	13,656	114.86	1,568,528.16

WATERS CORP	4,625	155.11	717,383.75
ZOETIS INC	25,830	53.22	1,374,672.60
BANK OF AMERICA CORP	556,366	22.65	12,601,689.90
BB & T CORPORATION	43,869	43.23	1,896,456.87
CIT GROUP INC	11,525	43.41	500,300.25
CITIGROUP INC	156,286	58.51	9,144,293.86
CITIZENS FINANCIAL GROUP	29,170	33.73	983,904.10
COMERICA INC	9,983	66.12	660,075.96
FIFTH THIRD BANCORP	43,129	24.33	1,049,328.57
FIRST REPUBLIC BANK/CA	8,821	91.97	811,267.37
HUNTINGTON BANCSHARES INC	61,678	12.86	793,179.08
JPMORGAN CHASE & CO	196,607	85.40	16,790,237.80
KEYCORP	57,430	17.17	986,073.10
M & T BANK CORP	7,959	149.82	1,192,417.38
NEW YORK COMMUNITY BANCORP	28,674	13.72	393,407.28
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL INC	18,321	17.69	324,098.49
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	26,486	116.00	3,072,376.00
REGIONS FINANCIAL CORPORATION	70,213	13.96	980,173.48
SIGNATURE BANK	3,150	140.39	442,228.50
SUNTRUST BANKS INC	26,366	53.99	1,423,500.34
US BANCORP	92,906	50.70	4,710,334.20
WELLS FARGO & COMPANY	262,693	53.12	13,954,252.16
AFFILIATED MANAGERS GROUP	3,086	162.25	500,703.50
ALLY FINANCIAL INC	24,733	19.58	484,272.14
AMERICAN EXPRESS COMPANY	42,376	76.68	3,249,391.68
AMERIPRISE FINANCIAL INC	9,015	127.54	1,149,773.10
BANK OF NEW YORK MELLON CORP(THE)	57,445	46.89	2,693,596.05
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	67,424	165.11	11,132,376.64
BLACKROCK INC	6,598	381.44	2,516,741.12
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	27,115	82.42	2,234,818.30
CME GROUP INC.	18,386	116.62	2,144,175.32
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	21,190	65.47	1,387,309.30
E*TRADE FINANCIAL CORPORATION	16,112	33.73	543,457.76
EATON VANCE CORP	5,530	43.13	238,508.90
FIRST DATA CORP-CLASS A	20,440	14.96	305,782.40
FRANKLIN RESOURCES INC	21,228	40.81	866,314.68
GOLDMAN SACHS GROUP INC	19,551	225.75	4,413,638.25
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	32,208	59.83	1,927,004.64
INVESCO LIMITED	23,418	30.48	713,780.64
LEUCADIA NATIONAL CORPORATION	18,603	25.93	482,375.79
MOODY'S CORP	9,155	112.98	1,034,331.90
MORGAN STANLEY	76,494	41.07	3,141,608.58

MSCI INC-A	5,292	97.31	514,964.52
NASDAQ INC	6,596	68.68	453,013.28
NAVIENT CORPORATION	15,911	14.67	233,414.37
NORTHERN TRUST CORP	11,433	85.77	980,608.41
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	7,507	73.76	553,716.32
S&P GLOBAL INC	14,497	128.93	1,869,098.21
SCHWAB (CHARLES) CORP	64,805	38.40	2,488,512.00
SEI INVESTMENTS COMPANY	8,073	51.22	413,499.06
STATE STREET CORP	20,775	77.73	1,614,840.75
SYNCHRONY FINANCIAL	44,374	32.81	1,455,910.94
T ROWE PRICE GROUP INC	13,893	70.45	978,761.85
TD AMERITRADE HOLDING CORPORATION	15,062	37.22	560,607.64
AFLAC INC	21,973	73.35	1,611,719.55
ALLEGHANY CORPORATION	879	607.40	533,904.60
ALLSTATE CORP	19,838	80.97	1,606,282.86
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	55,972	60.17	3,367,835.24
AON PLC	14,184	118.67	1,683,215.28
ARCH CAPITAL GROUP LTD.	6,878	93.92	645,981.76
ARTHUR J GALLAGHER & CO	10,422	55.79	581,443.38
ASSURANT INC	3,023	93.63	283,043.49
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	5,338	65.95	352,041.10
CHUBB LTD	25,361	137.02	3,474,964.22
CINCINNATI FINANCIAL CORP	8,560	70.87	606,647.20
EVEREST RE GROUP LTD	2,331	233.35	543,938.85
FNF GROUP	13,005	38.53	501,082.65
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	21,634	47.82	1,034,537.88
LINCOLN NATIONAL CORP	13,187	63.97	843,572.39
LOEWS CORPORATION	16,336	46.72	763,217.92
MARKEL CORP	799	966.68	772,377.32
MARSH & MCLENNAN COS	27,910	72.72	2,029,615.20
METLIFE INC	50,752	51.97	2,637,581.44
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	15,265	61.93	945,361.45
PROGRESSIVE CORP	31,057	39.28	1,219,918.96
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	23,338	103.84	2,423,417.92
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	3,662	124.69	456,614.78
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	2,159	141.25	304,958.75
TORCHMARK CORPORATION	6,698	75.39	504,962.22
TRAVELERS COS INC(THE)	15,349	121.46	1,864,289.54
UNUM GROUP	13,176	45.21	595,686.96
VOYA FINANCIAL INC	11,788	36.29	427,786.52
W.R.BERKLEY CORPORATION	5,781	68.54	396,229.74
WILLIS TOWERS WATSON PLC	6,878	126.28	868,553.84

XL GROUP LTD	15,879	40.34	640,558.86
CBRE GROUP INC-A	17,067	33.36	569,355.12
CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP	20,222	96.45	1,950,411.90
EQUINIX INC	4,184	399.76	1,672,595.84
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	63,800	7.80	497,640.00
JONES LANG LASALLE INC	2,660	105.23	279,911.80
ACCENTURE PLC-CL A	33,872	115.58	3,914,925.76
ACTIVISION BLIZZARD INC	32,006	48.64	1,556,771.84
ADOBE SYSTEMS INC	27,095	129.38	3,505,551.10
AKAMAI TECHNOLOGIES	9,733	58.88	573,079.04
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	2,965	238.90	708,338.50
ALPHABET INC-CL A	16,260	841.46	13,682,139.60
ALPHABET INC-CL C	17,057	824.32	14,060,426.24
ANSYS INC	4,975	105.56	525,161.00
AUTODESK INC	11,299	85.62	967,420.38
AUTOMATIC DATA PROCESSING	24,498	101.95	2,497,571.10
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS	6,436	67.67	435,524.12
CA INC	17,874	31.71	566,784.54
CADENCE DESIGN SYS INC	17,210	31.27	538,156.70
CDK GLOBAL INC	7,248	64.69	468,873.12
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES	7,332	104.00	762,528.00
CITRIX SYSTEMS INC	8,155	83.00	676,865.00
COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS CORPORATION	32,806	58.66	1,924,399.96
COSTAR GROUP INC	1,621	204.62	331,689.02
EBAY INC	57,413	34.27	1,967,543.51
ELECTRONIC ARTS INC	16,214	89.95	1,458,449.30
FACEBOOK INC-A	128,627	139.58	17,953,756.66
FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES	16,723	80.52	1,346,535.96
FISERV INC	11,644	115.79	1,348,258.76
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	4,885	144.22	704,514.70
FORTINET INC	9,060	37.47	339,478.20
GARTNER INC	4,712	109.23	514,691.76
GLOBAL PAYMENTS INC	8,574	77.51	664,570.74
INTL BUSINESS MACHINES CORP	49,531	170.66	8,452,960.46
INTUIT INC	13,132	117.83	1,547,343.56
MASTERCARD INC-CL A	52,677	111.47	5,871,905.19
MERCADOLIBRE INC	2,340	216.31	506,165.40
MICROSOFT CORP	406,146	65.23	26,492,903.58
NUANCE COMMUNICATIONS INC	16,413	16.64	273,112.32
ORACLE CORPORATION	168,744	44.18	7,455,109.92
PAYCHEX INC	18,205	58.45	1,064,082.25
PAYPAL HOLDINGS INC	58,969	42.49	2,505,592.81

RED HAT INC	10,322	85.43	881,808.46
SABRE CORP	12,278	21.31	261,644.18
SALESFORCE.COM, INC.	35,086	83.37	2,925,119.82
SERVICENOW INC	8,722	84.49	736,921.78
SPLUNK INC	7,630	60.72	463,293.60
SYMANTEC CORPORATION	34,431	30.05	1,034,651.55
SYNOPSYS INC	8,909	70.97	632,271.73
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	9,740	52.26	509,012.40
TWITTER INC	31,928	14.42	460,401.76
VANTIV INC-CL A	9,060	63.56	575,853.60
VERISIGN INC	5,652	87.94	497,036.88
VISA INC	102,424	88.68	9,082,960.32
VMWARE INC	3,826	91.22	349,007.72
WESTERN UNION COMPANY	25,805	19.42	501,133.10
WORKDAY INC-CLASS A	6,281	83.45	524,149.45
XEROX CORP	50,705	7.03	356,456.15
YAHOO! INC	50,889	46.83	2,383,131.87
ZILLOW GROUP INC-C	5,320	34.47	183,380.40
AMPHENOL CORPORATION -CL A	17,380	68.84	1,196,439.20
APPLE INC	293,337	141.80	41,595,186.60
ARROW ELECTRONICS INC	5,286	69.97	369,861.42
AVNET INC	6,544	43.94	287,543.36
CDW CORP/DE	8,240	56.71	467,290.40
CISCO SYSTEMS INC	276,099	32.62	9,006,349.38
CORNING INC	52,919	26.48	1,401,295.12
DELL TECHNOLOGIES INC-CL V	12,719	63.90	812,744.10
DXC TECHNOLOGY CO	16,226	76.13	1,235,285.38
F5 NETWORKS INC	3,897	134.88	525,627.36
FLEX LTD	30,801	15.98	492,199.98
FLIR SYSTEMS INC	7,048	35.31	248,864.88
HARRIS CORP	7,099	110.29	782,948.71
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE C	93,531	18.05	1,688,234.55
HP INC	95,491	18.02	1,720,747.82
JUNIPER NETWORKS INC	20,290	27.63	560,612.70
MOTOROLA SOLUTIONS INC	8,355	82.84	692,128.20
NETAPP INC	16,097	39.65	638,246.05
PALO ALTO NETWORKS INC	5,121	113.38	580,618.98
QORVO INC	7,285	68.76	500,916.60
QUALCOMM INC	80,692	53.39	4,308,145.88
SEAGATE TECHNOLOGY	16,785	48.34	811,386.90
SKYWORKS SOLUTIONS INC	10,477	97.59	1,022,450.43
TE CONNECTIVITY LTD	19,087	72.42	1,382,280.54

TRIMBLE INC	14,277	30.84	440,302.68
WESTERN DIGITAL CORP	15,243	84.21	1,283,613.03
AT&T INC	338,113	40.56	13,713,863.28
CENTURYLINK INC	32,141	25.14	808,024.74
FRONTIER COMMUNICATIONS CORPORATION	55,620	2.03	112,908.60
LEVEL 3 COMMUNICATIONS INC	16,844	59.56	1,003,228.64
SBA COMMUNICATIONS CORP	6,527	123.07	803,277.89
SPRINT CORP	42,299	8.34	352,773.66
T-MOBILE US INC	16,265	63.92	1,039,658.80
VERIZON COMMUNICATIONS INC	223,737	48.92	10,945,214.04
ZAYO GROUP HOLDINGS INC	9,150	33.14	303,231.00
AES CORPORATION	34,931	11.37	397,165.47
ALLIANT ENERGY CORP	13,271	39.89	529,380.19
AMEREN CORPORATION	13,376	55.39	740,896.64
AMERICAN ELECTRIC POWER	27,073	67.79	1,835,278.67
AMERICAN WATER WORKS CO INC	9,814	78.82	773,539.48
ATMOS ENERGY CORP	5,637	80.49	453,722.13
CALPINE CORP	16,738	10.82	181,105.16
CENTERPOINT ENERGY INC	23,598	28.04	661,687.92
CMS ENERGY CORPORATION	16,033	45.55	730,303.15
CONSOLIDATED EDISON INC	16,778	78.58	1,318,415.24
DOMINION RESOURCES INC/VA	34,056	77.93	2,653,984.08
DTE ENERGY COMPANY	9,879	103.96	1,027,020.84
DUKE ENERGY CORP	37,935	82.78	3,140,259.30
EDISON INTERNATIONAL	17,595	80.80	1,421,676.00
ENERGY CORP	10,217	77.08	787,526.36
EVERSOURCE ENERGY	17,785	59.88	1,064,965.80
EXELON CORP	50,834	36.19	1,839,682.46
FIRSTENERGY CORP	23,453	31.61	741,349.33
NEXTERA ENERGY INC	25,459	130.51	3,322,654.09
NISOURCE INC	19,053	23.94	456,128.82
OGE ENERGY CORP	11,114	34.76	386,322.64
P G & E CORPORATION	27,841	67.52	1,879,824.32
PINNACLE WEST CAPITAL CORPORATION	5,985	85.37	510,939.45
PPL CORPORATION	37,419	37.78	1,413,689.82
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	27,854	45.61	1,270,420.94
SCANA CORP	7,744	66.22	512,807.68
SEMPRA ENERGY	12,762	111.46	1,422,452.52
SOUTHERN CO	54,001	49.66	2,681,689.66
UGI CORPORATION	9,182	49.90	458,181.80
WEC ENERGY GROUP INC	17,377	61.10	1,061,734.70
WESTAR ENERGY INC	8,114	54.15	439,373.10

	XCEL ENERGY INC	27,967	44.90	1,255,718.30
	ADVANCED MICRO DEVICES	44,937	12.76	573,396.12
	ANALOG DEVICES INC	20,522	76.87	1,577,526.14
	APPLIED MATERIALS INC	60,633	37.77	2,290,108.41
	BROADCOM LTD	21,988	209.20	4,599,889.60
	INTEL CORP	259,916	35.63	9,260,807.08
	KLA-TENCOR CORPORATION	8,674	95.21	825,851.54
	LAM RESEARCH CORP	8,980	126.16	1,132,916.80
	MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	24,825	14.81	367,658.25
	MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	15,825	43.69	691,394.25
	MICROCHIP TECHNOLOGY INC	12,238	72.15	882,971.70
	MICRON TECHNOLOGY INC	58,658	26.69	1,565,582.02
	NVIDIA CORP	29,348	97.31	2,855,853.88
	NXP SEMICONDUCTORS NV	16,193	103.69	1,679,052.17
	TEXAS INSTRUMENTS INC	54,589	78.48	4,284,144.72
	XILINX INC	14,382	55.10	792,448.20
	米ドル 小計	17,180,796		1,136,397,077.52 (123,674,093,946)
カナダドル	ALTAGAS LTD	6,948	31.06	215,804.88
	ARC RESOURCES LTD	20,661	18.62	384,707.82
	CAMECO CORP	24,102	15.05	362,735.10
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	59,764	44.72	2,672,646.08
	CENOVUS ENERGY INC	46,412	14.45	670,653.40
	CRESCENT POINT ENERGY CORP	29,608	14.61	432,572.88
	ENBRIDGE INC	89,689	56.41	5,059,356.49
	ENCANA CORP	59,142	15.66	926,163.72
	HUSKY ENERGY INC	21,322	15.47	329,851.34
	IMPERIAL OIL LTD	15,807	40.96	647,454.72
	INTER PIPELINE LTD	18,081	28.30	511,692.30
	KEYERA CORP	8,467	38.85	328,942.95
	PEMBINA PIPELINE CORP	20,978	44.34	930,164.52
	PEYTO EXPLORATION & DEV CORP	8,811	27.00	237,897.00
	PRAIRIESKY ROYALTY LTD	12,442	29.06	361,564.52
	SEVEN GENERATIONS ENERGY-A	14,441	25.07	362,035.87
	SUNCOR ENERGY INC	91,679	41.35	3,790,926.65
	TOURMALINE OIL CORP	12,887	29.13	375,398.31
	TRANSCANADA CORP	48,854	63.46	3,100,274.84
	VERESIN INC	20,344	15.36	312,483.84
	VERMILION ENERGY INC	5,586	50.50	282,093.00
	AGNICO EAGLE MINES LIMITED	12,763	62.51	797,815.13
	AGRIUM INC	7,862	123.86	973,787.32
	BARRICK GOLD CORP	65,680	26.84	1,762,851.20



CCL INDUSTRIES INC-CL B	1,387	294.85	408,956.95
ELDORADO GOLD CORPORATION	41,255	4.71	194,311.05
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	39,175	14.22	557,068.50
FRANCO-NEVADA CORPORATION	9,959	92.78	923,996.02
GOLDCORP INC	46,502	20.57	956,546.14
KINROSS GOLD CORP	75,698	5.09	385,302.82
METHANEX CORPORATION	5,484	62.65	343,572.60
POTASH CORP OF SASKATCHEWAN	44,140	22.19	979,466.60
SILVER WHEATON CORPORATION	23,656	29.02	686,497.12
TECK RESOURCES LIMITED-CL B	31,222	29.64	925,420.08
TURQUOISE HILL RESOURCES LTD	45,107	3.92	176,819.44
WEST FRASER TIMBER CO LTD	2,873	59.53	171,029.69
YAMANA GOLD INC	51,365	4.02	206,487.30
BOMBARDIER INC 'B'	115,394	2.22	256,174.68
CAE INC	13,932	20.42	284,491.44
FINNING INTERNATIONAL INC	7,972	24.35	194,118.20
SNC-LAVALIN GROUP INC	8,714	53.98	470,381.72
CANADIAN NATL RAILWAY CO	42,231	97.37	4,112,032.47
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	7,699	200.28	1,541,955.72
LINAMAR CORP	2,200	55.27	121,594.00
MAGNA INTERNATIONAL INC	20,332	53.05	1,078,612.60
GILDAN ACTIVEWEAR INC	12,997	35.80	465,292.60
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	12,023	74.85	899,921.55
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	23,050	28.77	663,148.50
THOMSON REUTERS CORP	17,386	57.05	991,871.30
CANADIAN TIRE CORP -CL A	3,990	162.56	648,614.40
DOLLARAMA INC	6,425	116.93	751,275.25
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC-B	23,176	60.65	1,405,624.40
EMPIRE CO LTD A	7,235	20.59	148,968.65
JEAN COUTU GROUP INC A	2,801	20.43	57,224.43
LOBLAW COMPANIES LTD	12,221	71.69	876,123.49
METRO INC	13,589	41.52	564,215.28
WESTON (GEORGE) LTD	3,180	116.34	369,961.20
SAPUTO INC	13,709	46.38	635,823.42
VALEANT PHARMACEUTICALS INTERN	20,194	12.76	257,675.44
BANK OF MONTREAL	36,494	98.25	3,585,535.50
BANK OF NOVA SCOTIA	65,888	76.78	5,058,880.64
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	21,452	113.39	2,432,442.28
NATIONAL BANK OF CANADA	18,686	55.12	1,029,972.32
ROYAL BANK OF CANADA	81,285	96.06	7,808,237.10
TORONTO-DOMINION BANK	101,543	65.57	6,658,174.51
CI FINANCIAL CORP	14,904	26.69	397,787.76

	ELEMENT FLEET MANAGEMENT CORP	19,611	12.19	239,058.09
	IGM FINANCIAL INC	5,296	39.76	210,568.96
	ONEX CORPORATION	4,217	95.59	403,103.03
	FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	1,327	612.73	813,092.71
	GREAT-WEST LIFECO INC	17,440	36.07	629,060.80
	INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANCE AND FINANC	4,851	55.83	270,831.33
	INTACT FINANCIAL CORPORATION	7,415	94.36	699,679.40
	MANULIFE FINANCIAL CORP	110,560	22.86	2,527,401.60
	POWER CORP OF CANADA	21,768	30.71	668,495.28
	POWER FINANCIAL CORP	14,523	33.88	492,039.24
	SUN LIFE FINANCIAL INC	33,966	46.89	1,592,665.74
	BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT INC	47,936	48.85	2,341,673.60
	FIRST CAPITAL REALTY INC	6,546	20.34	133,145.64
	CGI GROUP INC - CL A	11,985	62.36	747,384.60
	CONSTELLATION SOFTWARE	1,073	633.18	679,402.14
	OPEN TEXT CORPORATION	14,274	44.54	635,763.96
	BLACKBERRY LIMITED	23,701	11.85	280,856.85
	BCE INC	8,582	60.87	522,386.34
	ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	19,940	60.10	1,198,394.00
	TELUS CORPORATION	9,642	44.64	430,418.88
	ATCO LTD-CLASS I	4,985	50.84	253,437.40
	CANADIAN UTILITIES LIMITED	6,417	39.12	251,033.04
	EMERA INC	2,409	47.69	114,885.21
	FORTIS INC	21,944	44.65	979,799.60
	HYDRO ONE LTD	9,317	24.61	229,291.37
	カナダドル 小計	2,300,580		93,855,347.85 (7,712,093,932)
ユーロ	ENI SPA	140,064	15.24	2,134,575.36
	GALP ENERGIA SGPS S.A	29,714	14.65	435,310.10
	NESTE OYJ	7,547	37.31	281,578.57
	OMV AG	7,435	39.65	294,834.92
	REPSOL SA	61,595	14.83	913,761.82
	SAIPEM	393,610	0.41	161,458.82
	TENARIS S.A.	26,776	15.81	423,328.56
	TOTAL SA	125,291	48.64	6,094,154.24
	VOPAK	3,130	42.39	132,696.35
	AIR LIQUIDE	21,134	107.45	2,270,848.30
	AKZO NOBEL	14,000	78.54	1,099,560.00
	ARCELOR MITTAL	100,783	7.14	719,590.62
	ARKEMA	3,915	93.39	365,621.85
	BASF SE	50,570	91.45	4,624,626.50
	COVESTRO AG	4,691	74.25	348,306.75

CRH PLC	46,360	32.31	1,498,123.40
EVONIK INDUSTRIES AG	8,771	29.75	260,937.25
FUCHS PETROLUB SE-PREF	3,370	46.29	156,014.15
HEIDELBERGCEMENT AG	8,804	86.59	762,338.36
IMERYS SA	2,030	78.70	159,761.00
K+S AG	9,644	22.11	213,228.84
KONINKLIJKE DSM NV	9,456	65.56	619,935.36
LANXESS	5,325	63.60	338,670.00
LINDE AG	10,007	159.45	1,595,616.15
SOLVAY SA	4,081	114.20	466,050.20
STORA ENSO OYJ-R SHS	29,833	11.30	337,112.90
SYMRISE AG	7,266	63.06	458,193.96
THYSSENKRUPP AG	19,734	22.03	434,838.69
UMICORE	4,905	51.95	254,814.75
UPM-KYMMENE OYJ	29,614	22.41	663,649.74
VOESTALPINE AG	5,931	36.79	218,231.14
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	10,891	32.91	358,422.81
AIRBUS SE	31,436	71.93	2,261,191.48
ALSTOM RGPT	8,821	27.55	243,018.55
ANDRITZ AG	4,484	49.11	220,209.24
BOSKALIS WESTMINSTER NV	5,738	33.12	190,071.25
BOUYGUES SA	12,200	37.13	453,047.00
BRENTAG AG	8,154	53.02	432,325.08
CNH INDUSTRIAL NV	55,561	9.32	517,828.52
COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	28,491	46.62	1,328,250.42
DASSAULT AVIATION SA	117	1,180.00	138,060.00
EIFFAGE SA	3,580	72.64	260,051.20
FERROVIAL SA	27,801	19.21	534,057.21
GEA GROUP AG	9,966	41.91	417,675.06
HOCHTIEF AG	1,364	161.05	219,672.20
KONE OYJ-B	17,762	43.04	764,476.48
KONINKLIJKE PHILIPS NV	52,221	29.71	1,551,485.91
LEGRAND SA	14,095	56.74	799,750.30
LEONARDO SPA	22,528	13.10	295,116.80
MAN SE	2,092	96.70	202,296.40
METSO OYJ	5,502	28.58	157,247.16
OSRAM LICHT AG	4,588	59.45	272,756.60
PRYSMIAN SPA	9,379	25.32	237,476.28
REXEL SA	18,396	15.81	290,932.74
SAFRAN SA	17,840	73.07	1,303,568.80
SCHNEIDER ELECTRIC SE	30,486	68.74	2,095,607.64
SIEMENS AG-REG	42,120	127.30	5,361,876.00

THALES SA	5,961	91.97	548,233.17
VINCI S.A.	27,493	73.69	2,025,959.17
WARTSILA OYJ-B SHARES	8,572	52.40	449,172.80
ZARDOYA OTIS SA	8,459	8.34	70,548.06
ZODIAC AEROSPACE	10,335	23.56	243,544.27
BIC	1,337	118.30	158,167.10
BUREAU VERITAS SA	15,733	20.18	317,570.60
EDENRED	12,710	22.84	290,359.95
PADDY POWER BETFAIR PLC	4,592	100.25	460,348.00
RANDSTAD HOLDING NV	6,526	54.80	357,624.80
ABERTIS INFRASTRUCTURAS SA	34,535	15.23	526,140.72
AENA SA	3,899	151.65	591,283.35
AEROPORTS DE PARIS (ADP)	1,346	113.50	152,771.00
ATLANTIA SPA	23,300	24.24	564,792.00
BOLLORE	39,433	3.56	140,420.91
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	12,281	15.68	192,566.08
DEUTSCHE POST AG-REG	54,281	31.07	1,686,782.07
FRAPORT AG	1,856	71.10	131,961.60
GROUPE EUROTUNNEL SE	23,484	9.50	223,098.00
INTERNATIONAL CONSOLIDATED AIRLINES GROUP	44,863	6.31	283,354.70
RYANAIR HOLDINGS PLC	1,614	15.25	24,613.50
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	17,832	83.39	1,487,010.48
BAYERISCHE MOTOREN WERKE(BMW)AG-PFD	3,579	72.68	260,121.72
CONTINENTAL AG	5,886	200.20	1,178,377.20
DAIMLER AG	53,013	66.82	3,542,328.66
FERRARI NV	7,007	67.65	474,023.55
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	46,418	9.50	441,203.09
MICHELIN (CGDE)-B	10,441	111.90	1,168,347.90
NOKIAN RENKAAT OYJ	5,507	38.10	209,816.70
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE PREF	9,110	49.00	446,390.00
PSA PEUGEOT CITROEN	27,565	17.73	488,865.27
RENAULT SA	10,422	79.26	826,047.72
SCHAEFFLER AG	9,576	15.37	147,183.12
VALEO SA	12,609	60.95	768,518.55
VOLKSWAGEN AG	1,615	138.45	223,596.75
VOLKSWAGEN AG PFD	9,764	131.90	1,287,871.60
ADIDAS AG	10,183	177.45	1,806,973.35
CHRISTIAN DIOR SE	2,843	223.40	635,126.20
HERMES INTERNATIONAL	1,475	456.75	673,706.25
HUGO BOSS AG	3,891	69.96	272,214.36
KERING	4,322	249.45	1,078,122.90
LUXOTTICA GROUP SPA	9,452	51.75	489,141.00

LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	15,354	208.85	3,206,682.90
SEB SA	1,032	131.65	135,862.80
ACCOR SA	9,357	39.26	367,402.60
SODEXO	5,188	112.60	584,168.80
ALTICE NV -A W/I	20,146	21.27	428,505.42
ALTICE NV -B W/I	6,439	21.27	136,989.72
AXEL SPRINGER SE	2,952	51.76	152,795.52
EUTELSAT COMMUNICATIONS	8,726	21.71	189,485.09
JC DECAUX SA	2,828	32.28	91,287.84
LAGARDERE S.C.A.	6,108	27.86	170,199.42
PROSIEBEN SAT.1 MEDIA SE-REG	13,157	41.21	542,199.97
PUBLICIS GROUPE	10,644	65.06	692,498.64
RELX NV	56,723	17.75	1,007,116.86
RTL GROUP	2,567	75.80	194,578.60
SES	21,377	21.79	465,804.83
SFR GROUP SA	5,853	29.06	170,088.18
TELENET GROUP HOLDINGS NV	3,224	56.07	180,769.68
WOLTERS KLUWER-CVA	16,170	39.45	637,987.35
INDITEX	59,304	33.89	2,010,109.08
CARREFOUR SA	31,459	21.26	668,818.34
CASINO GUICHARD PERRACHON	2,725	52.61	143,362.25
COLRUYT NV	3,273	45.72	149,657.92
DISTRIBUIDORA INTERNACIONAL	29,663	5.45	161,752.33
JERONIMO MARTINS SGPS S.A.	12,194	16.76	204,371.44
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	73,083	19.16	1,400,270.28
METRO AG	9,739	29.44	286,764.85
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	42,054	103.55	4,354,691.70
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	11,503	34.98	402,374.94
DANONE	32,378	64.24	2,079,962.72
HEINEKEN HOLDING NV	5,455	76.54	417,525.70
HEINEKEN NV	13,142	81.50	1,071,073.00
KERRY GROUP PLC-A	9,177	77.10	707,546.70
PERNOD-RICARD SA	12,111	113.80	1,378,231.80
REMY COINTREAU	1,273	93.00	118,389.00
UNILEVER NV-CVA	88,982	48.29	4,296,940.78
BEIERSDORF AG	5,727	91.17	522,130.59
HENKEL AG & CO KGAA	5,401	107.15	578,717.15
HENKEL AG & CO KGAA	10,125	123.20	1,247,400.00
L'OREAL	13,869	181.95	2,523,464.55
ESSILOR INTERNATIONAL	11,408	115.75	1,320,476.00
FRESENIUS MEDICAL CARE AG AND CO.KGAA	11,752	78.98	928,172.96
FRESENIUS SE & CO KGAA	23,398	75.16	1,758,593.68

BAYER AG	45,217	106.25	4,804,306.25
EUROFINS SCIENTIFIC	646	421.00	271,966.00
GRIFOLS S.A.	17,560	23.39	410,816.20
MERCK KGAA	7,156	105.45	754,600.20
ORION OYJ	6,170	49.79	307,204.30
QIAGEN N.V.	12,422	26.29	326,636.49
SANOFI	63,894	85.24	5,446,324.56
UCB SA	6,820	73.62	502,088.40
ZALANDO SE	5,372	39.96	214,665.12
ABN AMRO GROUP NV-CVA	18,153	22.35	405,719.55
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	361,546	6.95	2,512,744.70
BANCO BILBAO VIZCAYA-RTS	361,546	0.12	46,277.88
BANCO DE SABADELL SA	293,755	1.60	472,358.04
BANCO ESPIRITO SANTO,S.A(BES)	187,906	0.01	1,879.06
BANCO POPULAR ESPANOL	155,616	0.63	98,660.54
BANCO SANTANDER SA	802,878	5.56	4,466,410.31
BANK OF IRELAND	1,626,681	0.24	393,656.80
BANKIA SA	276,240	1.02	283,146.00
BANKINTER,S.A.	34,025	7.88	268,185.05
BNP PARIBAS	58,334	59.10	3,447,539.40
CAIXABANK	189,114	3.74	708,610.15
COMMERZBANK AG	60,611	8.12	492,646.20
CREDIT AGRICOLE SA	61,121	12.11	740,175.31
ERSTE GROUP BANK AG	16,913	30.13	509,673.25
INTESA SANPAOLO	685,439	2.47	1,698,517.84
INTESA SANPAOLO-RSP	50,545	2.35	119,185.11
KBC GROUPE SA	13,707	61.34	840,787.38
NATIXIS	57,006	5.54	316,041.26
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG	6,210	20.50	127,305.00
SOCIETE GENERALE	41,541	44.65	1,854,805.65
UNICREDIT SPA	103,794	13.21	1,371,118.74
DEUTSCHE BANK AG -REG	112,857	15.28	1,725,019.24
DEUTSCHE BOERSE AG	10,594	86.15	912,673.10
EURAZEO	1,926	62.48	120,336.48
EXOR NV	6,517	48.38	315,292.46
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	4,260	86.48	368,404.80
ING GROEP NV-CVA	211,438	13.90	2,940,045.39
MEDIOBANCA SPA	34,833	7.85	273,439.05
WENDEL	1,532	121.50	186,138.00
AEGON NV	102,134	4.55	465,526.77
AGEAS	11,146	36.26	404,209.69
ALLIANZ SE-REG	25,162	171.40	4,312,766.80

ASSICURAZIONI GENERALI	65,527	14.18	929,172.86
AXA SA	106,443	23.58	2,509,925.94
CNP ASSURANCES	11,162	18.88	210,738.56
HANNOVER RUECKVERSICHERUNG SE	3,033	108.20	328,170.60
MAPFRE SA	68,075	3.17	216,410.42
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	8,867	182.85	1,621,330.95
NN GROUP NV	16,745	29.33	491,130.85
POSTE ITALIANE SPA	32,840	6.13	201,473.40
SAMPO OYJ-A SHS	24,972	45.03	1,124,489.16
SCOR SE	9,624	34.64	333,423.48
UNIPOLSAI SPA	49,963	2.02	101,125.11
DEUTSCHE WOHNEN AG-BR	18,909	32.27	610,193.43
VONOVIA SE	25,657	34.35	881,446.23
AMADEUS IT GROUP SA	24,840	46.70	1,160,152.20
ATOS SE	4,903	114.20	559,922.60
CAP GEMINI SA	9,296	87.47	813,121.12
DASSAULT SYSTEMES SA	6,868	81.80	561,802.40
GEMALTO	3,838	56.48	216,770.24
SAP SE	53,748	91.49	4,917,404.52
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	5,981	40.84	244,264.04
INGENICO S.A.	3,325	85.77	285,185.25
NOKIA OYJ	321,072	4.97	1,598,296.41
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	178,189	16.13	2,875,079.51
ELISA OYJ	8,373	31.88	266,931.24
ILIAD SA	1,546	208.50	322,341.00
KONINKLIJKE KPN NV	192,155	2.79	536,112.45
ORANGE S.A.	107,796	14.36	1,547,950.56
PROXIMUS SA	8,955	29.29	262,336.72
TELECOM ITALIA SPA	596,054	0.80	479,525.44
TELECOM ITALIA-RNC	365,506	0.65	239,589.18
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	48,244	4.55	219,703.17
TELEFONICA S.A.	246,482	10.32	2,544,926.65
VIVENDI SA	56,661	17.98	1,019,048.08
E.ON SE	112,982	7.37	832,903.30
EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	127,146	3.16	402,417.09
ELECTRICITE DE FRANCE(EDF)	16,922	7.96	134,732.96
ENAGAS	13,652	24.90	339,934.80
ENDESA S.A.	17,200	22.16	381,238.00
ENEL SPA	416,668	4.37	1,824,172.50
ENGIE	87,780	13.31	1,168,790.70
FORTUM OYJ	24,333	13.16	320,222.28
GAS NATURAL SDG SA	19,321	20.22	390,670.62

	IBERDROLA SA	304,359	6.72	2,045,596.83
	INNOGY SE	7,205	35.89	258,587.45
	RED ELECTRICA CORPORATION SA	24,948	18.65	465,280.20
	RWE AG	28,403	15.83	449,619.49
	SNAM SPA	127,541	4.09	522,407.93
	SUEZ	17,312	15.15	262,363.36
	TERNA SPA	87,158	4.68	408,596.70
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	28,101	17.15	481,932.15
	ASML HOLDING NV	20,554	121.80	2,503,477.20
	INFINEON TECHNOLOGIES AG	64,968	18.48	1,200,608.64
	STMICROELECTRONICS NV	33,781	13.93	470,569.33
	ユーロ 小計	13,389,479		206,405,277.80 (23,961,588,699)
英債券	BP PLC	1,041,823	4.72	4,922,613.67
	PETROFAC LIMITED	12,177	8.91	108,557.95
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	240,602	21.31	5,127,228.62
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	206,220	22.22	4,583,239.50
	ANGLO AMERICAN PLC	74,953	11.71	877,699.63
	ANTOFAGASTA PLC	19,439	8.24	160,274.55
	BHP BILLITON PLC	119,357	12.68	1,513,446.76
	CRODA INTERNATIONAL PLC	6,223	35.99	223,965.77
	FRESNILLO PLC	11,716	16.16	189,330.56
	GLENCORE PLC	673,667	3.10	2,088,367.70
	JOHNSON MATTHEY PLC	11,403	30.13	343,572.39
	MONDI PLC	20,772	19.59	406,923.48
	RANDGOLD RESOURCES LTD	5,368	74.25	398,574.00
	RIO TINTO PLC	67,387	31.45	2,119,321.15
	ASHTED GROUP PLC	26,961	16.78	452,405.58
	BAE SYSTEMS PLC	170,430	6.46	1,101,829.95
	BUNZL PLC	18,074	23.71	428,534.54
	COBHAM PLC	73,920	1.41	104,744.64
	DCC PLC	4,482	71.80	321,807.60
	IMI PLC	16,924	12.17	205,965.08
	MEGGITT PLC	52,383	4.60	241,223.71
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	102,142	8.30	848,289.31
	SMITHS GROUP PLC	22,759	16.25	369,833.75
	TRAVIS PERKINS PLC	12,496	15.50	193,688.00
	WEIR GROUP PLC/THE	12,829	20.08	257,606.32
	WOLSELEY PLC	13,830	49.17	680,021.10
	BABCOCK INTERNATIONAL GROUP PLC	11,442	8.83	101,090.07
	CAPITA PLC	41,602	5.56	231,515.13
	EXPERIAN PLC	53,872	16.29	877,574.88



G4S PLC	93,347	3.06	286,481.94
INTERTEK GROUP PLC	9,324	40.56	378,181.44
MERLIN ENTERTAINMENTS PLC	44,414	4.83	214,741.69
EASYJET PLC	7,630	10.60	80,878.00
ROYAL MAIL PLC	53,855	4.19	225,760.16
GKN PLC	93,825	3.54	332,703.45
BURBERRY GROUP PLC	23,827	17.64	420,308.28
PERSIMMON PLC	17,735	21.87	387,864.45
TAYLOR WIMPEY PLC	189,280	1.95	370,799.52
THE BERKELEY GROUP HOLDINGS	6,396	31.57	201,921.72
CARNIVAL PLC	10,738	45.27	486,109.26
COMPASS GROUP PLC	88,525	15.48	1,370,367.00
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	10,114	39.22	396,671.08
TUI AG-DI	28,865	10.97	316,649.05
WHITBREAD PLC	9,356	41.20	385,467.20
WILLIAM HILL PLC	41,877	2.98	124,960.96
ITV PLC	187,094	2.17	405,993.98
PEARSON PLC	46,957	6.35	298,411.73
RELX PLC	57,897	15.92	921,720.24
SKY PLC	58,830	9.76	574,180.80
WPP PLC	72,920	17.37	1,266,620.40
DIXONS CARPHONE PLC	49,868	3.15	157,183.93
KINGFISHER PLC	122,444	3.25	399,044.99
MARKS & SPENCER GROUP PLC	89,202	3.44	306,944.08
NEXT PLC	7,873	41.51	326,808.23
SAINSBURY (J) PLC	89,242	2.57	230,155.11
TESCO PLC	458,386	1.84	845,263.78
WILLIAM MORRISON SUPERMARKETS PLC	128,977	2.32	299,226.64
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	19,385	26.15	506,917.75
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	102,649	53.82	5,524,569.18
COCA-COLA HBC AG-CDI	8,704	20.95	182,348.80
DIAGEO PLC	138,536	23.05	3,193,254.80
IMPERIAL BRANDS PLC	52,785	39.18	2,068,380.22
TATE & LYLE PLC	24,535	7.76	190,514.27
UNILEVER PLC	70,665	40.65	2,872,885.57
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	59,885	5.63	337,451.97
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	34,704	74.92	2,600,023.68
MEDICLINIC INTERNATIONAL PLC	15,126	7.36	111,402.99
SMITH & NEPHEW PLC	50,414	12.59	634,712.26
ASTRAZENECA PLC	69,651	47.34	3,297,626.59
GLAXOSMITHKLINE PLC	268,472	16.45	4,417,706.76
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	7,449	19.22	143,169.78

	SHIRE PLC	49,745	45.35	2,255,935.75
	BARCLAYS PLC	920,279	2.13	1,966,636.22
	HSBC HOLDINGS PLC	1,085,592	6.55	7,113,884.37
	LLOYDS BANKING GROUP PLC	3,536,743	0.62	2,211,879.07
	ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	199,689	2.31	462,080.34
	STANDARD CHARTERED PLC	183,394	7.21	1,323,004.31
	3I GROUP PLC	52,448	7.66	401,751.68
	ABERDEEN ASSET MGMT PLC	60,380	2.81	170,150.84
	HARGREAVES LANSDOWN PLC	16,261	13.43	218,385.23
	INVESTEC PLC	33,008	5.41	178,573.28
	LONDON STOCK EXCHANGE GROUP PLC	17,642	32.20	568,072.40
	PROVIDENT FINANCIAL PLC	7,000	31.01	217,070.00
	SCHRODERS PLC	8,092	31.05	251,256.60
	ADMIRAL GROUP PLC	10,760	20.11	216,383.60
	AVIVA PLC	225,689	5.18	1,170,197.46
	DIRECT LINE INSURANCE GROUP	82,732	3.41	282,777.97
	LEGAL & GENERAL GROUP PLC	330,065	2.49	823,842.24
	OLD MUTUAL PLC	258,579	1.92	498,023.15
	PRUDENTIAL PLC	140,352	16.64	2,335,457.28
	RSA INSURANCE GROUP PLC	60,292	5.90	356,024.26
	ST JAMES'S PLACE PLC	26,198	10.58	277,174.84
	STANDARD LIFE PLC	124,704	3.77	470,882.30
	AUTO TRADER GROUP PLC	56,277	3.94	221,731.38
	SAGE GROUP PLC/THE	55,139	6.50	358,403.50
	WORLDPAY GROUP PLC	102,669	3.01	309,752.37
	BT GROUP PLC	473,911	3.15	1,496,137.02
	INMARSAT PLC	20,829	8.40	175,067.74
	VODAFONE GROUP PLC	1,465,395	2.04	2,993,801.98
	CENTRICA PLC	301,678	2.19	661,881.53
	NATIONAL GRID PLC	204,373	10.41	2,127,522.93
	SEVERN TRENT PLC	14,073	24.30	341,973.90
	SSE PLC	55,851	15.04	839,999.04
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	38,716	10.13	392,193.08
	英ポンド 小計	16,385,566		101,259,536.78 (13,836,103,105)
スイスフラン	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	421	594.50	250,284.50
	GIVAUDAN-REG	508	1,903.00	966,724.00
	LAFARGEHOLCIM LTD	25,963	58.60	1,521,431.80
	SIKA AG	117	6,370.00	745,290.00
	SYNGENTA AG	5,083	460.70	2,341,738.10
	ABB LTD	102,598	23.10	2,370,013.80
	GEBERIT AG-REG	1,958	429.30	840,569.40

	SCHINDLER HOLDING AG-REG	1,025	193.90	198,747.50	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	2,341	198.00	463,518.00	
	ADECCO GROUP AG-REG	9,116	72.65	662,277.40	
	SGS SA	312	2,179.00	679,848.00	
	KUEHNE&NAGEL INTL AG-REG	3,195	146.60	468,387.00	
	CIE FINANCIERE RICHEMONT SA-REGD A	28,341	80.75	2,288,535.75	
	THE SWATCH GROUP AG-B	1,730	371.50	642,695.00	
	THE SWATCH GROUP AG-REG	2,516	72.10	181,403.60	
	DUFREY AG-REG	2,687	152.90	410,842.30	
	ARYZTA AG	4,011	33.15	132,964.65	
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	109	1,338.00	145,842.00	
	LINDT & SPRUENGLI AG	60	5,615.00	336,900.00	
	LINDT & SPRUENGLI AG-REG	6	66,490.00	398,940.00	
	NESTLE SA-REGISTERED	170,893	76.65	13,098,948.45	
	SONOVA HOLDING AG	3,138	140.50	440,889.00	
	ACTELION LTD	5,340	284.40	1,518,696.00	
	GALENICA AG-REG	170	1,049.00	178,330.00	
	LONZA GROUP AG-REG	2,987	194.70	581,568.90	
	NOVARTIS AG-REG SHS	122,948	74.20	9,122,741.60	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	38,795	257.80	10,001,351.00	
	CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	112,407	14.53	1,633,273.71	
	JULIUS BAER GROUP LTD	12,563	49.70	624,381.10	
	PARGESA HOLDING SA-BR	1,867	72.10	134,610.70	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	944	563.50	531,944.00	
	UBS GROUP AG	201,398	15.54	3,129,724.92	
	BALOISE HOLDING AG	2,989	137.10	409,791.90	
	SWISS LIFE HOLDING AG	1,719	327.20	562,456.80	
	SWISS RE AG	17,504	89.60	1,568,358.40	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	8,288	267.50	2,217,040.00	
	SWISS PRIME SITE-REG	4,185	89.00	372,465.00	
	SWISSCOM AG-REG	1,349	437.20	589,782.80	
	スイスフラン 小計	901,581		62,763,307.08 (6,814,839,882)	
スウェーデンク ローナ	LUNDIN PETROLEUM AB	11,490	189.70	2,179,653.00	
	BOLIDEN AB	15,874	277.10	4,398,685.40	
	ALFA LAVAL AB	17,285	175.40	3,031,789.00	
	ASSA ABLOY AB-B	56,368	186.90	10,535,179.20	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	36,852	319.70	11,781,584.40	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	21,853	284.70	6,221,549.10	
	SANDVIK AB	58,705	135.30	7,942,786.50	
	SKANSKA AB-B SHS	19,178	209.20	4,012,037.60	
	SKF AB-B SHARES	22,855	177.70	4,061,333.50	

	VOLVO AB-B SHS	82,881	128.50	10,650,208.50	
	SECURITAS AB-B SHS	16,445	142.80	2,348,346.00	
	ELECTROLUX AB-SER B	13,837	256.70	3,551,957.90	
	HUSQVARNA AB-B SHS	18,593	80.95	1,505,103.35	
	HENNES & MAURITZ AB-B SHS	54,332	219.70	11,936,740.40	
	ICA GRUPPEN AB	3,550	296.50	1,052,575.00	
	SWEDISH MATCH AB	11,038	293.10	3,235,237.80	
	SVENSKA CELLULOSA AB-B SHS	32,681	278.20	9,091,854.20	
	GETINGE AB-B SHS	9,989	158.40	1,582,257.60	
	NORDEA BANK AB	173,353	101.70	17,630,000.10	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN AB-A	85,831	98.45	8,450,061.95	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	86,384	121.00	10,452,464.00	
	SWEDBANK AB - A SHARES	48,445	207.20	10,037,804.00	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	9,247	194.40	1,797,616.80	
	INVESTOR AB-B SHS	24,219	385.40	9,334,002.60	
	KINNEVIK AB-B SHS	11,257	239.70	2,698,302.90	
	LUNDBERGS AB-B SHS	1,567	605.50	948,818.50	
	ERICSSON LM-B SHS	167,176	58.25	9,738,002.00	
	HEXAGON AB-B SHS	14,555	365.60	5,321,308.00	
	MILLICOM INTL CELLULAR-SDR	3,357	470.60	1,579,804.20	
	TELE2 AB-B SHS	18,224	84.10	1,532,638.40	
	TELIA CO AB	142,080	35.98	5,112,038.40	
	スウェーデンクローナ 小計	1,289,501		183,751,740.30 (2,228,908,609)	
ノルウェーク ローネ	STATOIL ASA	60,728	149.40	9,072,763.20	
	NORSK HYDRO ASA	73,158	50.60	3,701,794.80	
	YARA INTERNATIONAL ASA	10,162	354.90	3,606,493.80	
	SCHIBSTED ASA	3,623	209.70	759,743.10	
	SCIBSTED ASA-B SHS	5,736	191.00	1,095,576.00	
	MARINE HARVEST ASA	21,924	133.10	2,918,084.40	
	ORKLA ASA	45,534	76.50	3,483,351.00	
	DNB ASA	52,931	136.70	7,235,667.70	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	9,626	128.00	1,232,128.00	
	TELENOR ASA	43,038	140.00	6,025,320.00	
	ノルウェークローネ 小計	326,460		39,130,922.00 (498,527,946)	
デンマークク ローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	5,510	438.00	2,413,380.00	
	NOVOZYMES A/S-B SHARES	13,280	287.50	3,818,000.00	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	11,823	574.50	6,792,313.50	
	ISS A/S	8,394	278.50	2,337,729.00	
	A P MOLLER-MAERSK A/S-A	226	11,500.00	2,599,000.00	
	A P MOLLER-MAERSK A/S-B	379	11,970.00	4,536,630.00	

	DSV A/S	10,662	364.10	3,882,034.20
	PANDORA A/S	6,148	755.00	4,641,740.00
	CARLSBERG AS-B	6,051	661.50	4,002,736.50
	COLOPLAST-B	6,296	553.50	3,484,836.00
	WILLIAM DEMANT HOLDING	4,455	150.90	672,259.50
	GENMAB A/S	3,295	1,255.00	4,135,225.00
	NOVO NORDISK A/S-B	105,268	253.50	26,685,438.00
	DANSKE BANK A/S	37,515	234.90	8,812,273.50
	TRYG A/S	5,005	127.90	640,139.50
	TDC A/S	48,014	35.78	1,717,940.92
	DONG ENERGY A/S	8,287	280.50	2,324,503.50
	デンマーククローネ 小計	280,608		83,496,179.12 (1,303,375,356)
オーストラリア ドル	CALTEX AUSTRALIA LIMITED	14,497	30.09	436,214.73
	OIL SEARCH LTD	78,703	7.59	597,355.77
	ORIGIN ENERGY LIMITED	100,424	7.52	755,188.48
	SANTOS LTD	91,834	3.84	352,642.56
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	41,745	33.85	1,413,068.25
	ALUMINA LTD	106,977	1.81	194,163.25
	AMCOR LIMITED	60,582	15.30	926,904.60
	BHP BILLITON LTD	176,830	25.32	4,477,335.60
	BORAL LIMITED	72,331	5.92	428,199.52
	FORTESCUE METALS GROUP LIMITED	84,994	5.90	501,464.60
	INCITEC PIVOT LTD	85,406	3.68	314,294.08
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	21,998	21.25	467,457.50
	NEWCREST MINING LIMITED	42,676	25.00	1,066,900.00
	ORICA LIMITED	22,325	18.07	403,412.75
	RIO TINTO LIMITED	24,195	61.89	1,497,428.55
	SOUTH32 LTD	297,652	2.96	881,049.92
	CIMIC GROUP LTD	4,062	36.40	147,856.80
	BRAMBLES LIMITED	90,587	9.61	870,541.07
	SEEK LIMITED	16,538	16.34	270,230.92
	AURIZON HOLDINGS LTD	111,161	5.41	601,381.01
	QANTAS AIRWAYS LIMITED	24,631	3.95	97,292.45
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	27,132	19.14	519,306.48
	CROWN RESORTS LTD	22,315	12.11	270,234.65
	DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES LIMITED	3,373	61.95	208,957.35
	FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD	2,650	31.00	82,150.00
	TABCORP HOLDINGS LIMITED	47,022	4.86	228,526.92
TATTS GROUP LTD	83,323	4.38	364,954.74	
REA GROUP LTD	2,708	60.15	162,886.20	
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	33,786	4.38	147,982.68	

	WESFARMERS LIMITED	61,198	44.98	2,752,686.04	
	WOOLWORTHS LIMITED	69,444	26.58	1,845,821.52	
	COCA-COLA AMATIL LIMITED	35,718	10.78	385,040.04	
	TREASURY WINE ESTATES LTD	40,165	12.01	482,381.65	
	COCHLEAR LIMITED	2,911	137.24	399,505.64	
	HEALTHSCOPE LTD	104,035	2.21	229,917.35	
	RAMSAY HEALTH CARE LTD	8,123	70.40	571,859.20	
	SONIC HEALTHCARE LTD	21,609	21.65	467,834.85	
	CSL LIMITED	25,104	127.71	3,206,031.84	
	AUST AND NZ BANKING GROUP LT	161,182	32.13	5,178,777.66	
	BANK OF QUEENSLAND LIMITED	17,851	12.19	217,603.69	
	BENDIGO AND ADELAIDE BANK	27,851	12.01	334,490.51	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	94,875	86.68	8,223,765.00	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	144,835	33.22	4,811,418.70	
	WESTPAC BANKING CORPORATION	184,234	34.93	6,435,293.62	
	ASX LTD	11,397	49.64	565,747.08	
	CHALLENGER FINANCIAL SERVICE	30,000	12.83	384,900.00	
	MACQUARIE GROUP LTD	17,198	88.63	1,524,258.74	
	AMP LIMITED	165,331	5.30	876,254.30	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP LT	132,301	6.10	807,036.10	
	MEDIBANK PRIVATE LTD	173,315	2.82	488,748.30	
	QBE INSURANCE GROUP LIMITED	76,262	12.86	980,729.32	
	SUNCORP GROUP LTD	67,456	13.45	907,283.20	
	COMPUTERSHARE LIMITED	27,209	13.90	378,205.10	
	VOCUS GROUP LIMITED	33,249	3.37	112,049.13	
	TELSTRA CORPORATION LIMITED	230,155	4.22	971,254.10	
	TPG TELECOM LTD	17,758	6.66	118,268.28	
	AGL ENERGY LIMITED	37,149	27.95	1,038,314.55	
	AUSNET SERVICES	85,220	1.69	144,447.90	
	オーストラリアドル 小計	3,895,592		63,525,304.84 (5,209,710,249)	
ニュージーランドドル	FLETCHER BUILDING LTD	44,092	7.97	351,413.24	
	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	47,051	6.63	311,948.13	
	RYMAN HEALTHCARE LIMITED	22,111	8.70	192,365.70	
	SPARK NEW ZEALAND LIMITED	98,640	3.60	355,104.00	
	CONTACT ENERGY LIMITED	35,357	5.18	183,149.26	
	MERCURY NZ LTD	46,516	3.18	148,153.46	
	MERIDIAN ENERGY LTD	58,158	2.84	165,168.72	
	ニュージーランドドル 小計	351,925		1,707,302.51 (129,908,647)	
香港ドル	NWS HOLDINGS LTD	91,500	14.42	1,319,430.00	
	CATHAY PACIFIC AIRWAYS	57,000	10.92	622,440.00	

	MTR CORPORATION	85,000	44.80	3,808,000.00	
	LI & FUNG LTD	395,200	3.29	1,300,208.00	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	83,000	32.70	2,714,100.00	
	YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	45,000	31.65	1,424,250.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LIMITED	125,000	43.50	5,437,500.00	
	MGM CHINA HOLDINGS LTD	44,000	17.80	783,200.00	
	SANDS CHINA LTD	136,400	37.35	5,094,540.00	
	SHANGRI-LA ASIA LTD.	64,000	11.48	734,720.00	
	SJM HOLDINGS LIMITED	80,000	7.44	595,200.00	
	WYNN MACAU LTD	78,000	17.68	1,379,040.00	
	WH GROUP LIMITED	442,500	6.81	3,013,425.00	
	BANK OF EAST ASIA	74,020	31.75	2,350,135.00	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	205,000	31.65	6,488,250.00	
	HANG SENG BANK LTD	40,600	158.20	6,422,920.00	
	CHEUNG KONG PROPERTY HOLDING	153,924	54.80	8,435,035.20	
	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	146,924	95.50	14,031,242.00	
	FIRST PACIFIC COMPANY	86,000	5.89	506,540.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEARING LIMITED	64,900	195.20	12,668,480.00	
	AIA GROUP LTD	658,200	49.85	32,811,270.00	
	HANG LUNG GROUP LTD	42,000	34.50	1,449,000.00	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	134,000	20.65	2,767,100.00	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	63,655	49.80	3,170,019.00	
	HYSAN DEVELOPMENT CO	29,000	36.45	1,057,050.00	
	KERRY PROPERTIES LTD	27,500	29.95	823,625.00	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	327,333	9.76	3,194,770.08	
	SINO LAND CO	160,200	13.42	2,149,884.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	82,000	117.70	9,651,400.00	
	SWIRE PACIFIC LTD 'A'	30,500	74.80	2,281,400.00	
	SWIRE PROPERTIES LIMITED	53,000	25.35	1,343,550.00	
	WHARF HOLDINGS LTD	77,000	67.25	5,178,250.00	
	WHEELOCK&COMPANY LTD	41,000	63.00	2,583,000.00	
	PCCW LIMITED	194,000	4.63	898,220.00	
	CHEUNG KONG INFRASTRUCTURE	37,000	63.00	2,331,000.00	
	CLP HOLDINGS LTD	87,600	82.25	7,205,100.00	
	HK ELECTRIC INVESTMENTS-SS	160,000	6.95	1,112,000.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	439,981	15.82	6,960,499.42	
	POWER ASSETS HOLDINGS LIMITED	77,000	68.70	5,289,900.00	
	ASM PACIFIC TECHNOLOGY	12,400	107.00	1,326,800.00	
	香港ドル 小計	5,231,337		172,712,492.70 (2,417,974,897)	
シンガポールド ル	KEPPEL CORP LTD	80,000	6.93	554,400.00	
	SEBFCORP INDUSTRIES LTD	63,020	3.15	198,513.00	

	SINGAPORE TECHNOLOGIES ENG	93,200	3.73	347,636.00	
	YANGZIJIANG SHIPBUILDING HOLDINGS LTD	90,000	1.15	103,950.00	
	COMFORTDELGRO CORP LTD	107,000	2.62	280,340.00	
	SATS LTD	26,800	4.89	131,052.00	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	33,466	10.26	343,361.16	
	GENTING SINGAPORE PLC	351,800	1.10	386,980.00	
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	100,750	3.52	354,640.00	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	4,700	46.03	216,341.00	
	GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	353,600	0.36	129,064.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	122,000	3.52	429,440.00	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	98,200	19.25	1,890,350.00	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	169,300	9.70	1,642,210.00	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	71,700	22.04	1,580,268.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	50,200	7.58	380,516.00	
	CAPITALAND LTD	151,000	3.68	555,680.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	21,000	10.48	220,080.00	
	GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES LIMITED	128,600	2.88	370,368.00	
	UOL GROUP LIMITED	19,200	7.03	134,976.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	438,615	3.82	1,675,509.30	
	STARHUB LIMITED	44,700	2.91	130,077.00	
	シンガポールドル 小計	2,618,851		12,055,751.46	(940,228,056)
イスラエルシュケル	FRUTAROM INDUSTRIES LTD	1,842	217.50	400,635.00	
	ISRAEL CHEMICALS LIMITED	32,527	15.85	515,552.95	
	ELBIT SYSTEMS LTD	1,581	423.00	668,763.00	
	BANK HAPOLIM BM	53,450	21.60	1,154,520.00	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	78,390	16.25	1,273,837.50	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	9,515	58.80	559,482.00	
	AZRIELI GROUP	1,762	195.60	344,647.20	
	NICE LTD	2,768	245.00	678,160.00	
	BEZEQ ISRAELI TELECOMMUNICATION CORP LTD	126,910	6.25	793,187.50	
	イスラエルシュケル 小計	308,745		6,388,785.15	(190,896,900)
	合 計	64,461,021		188,918,250,224	(188,918,250,224)

(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 599銘柄	62.4%	65.5%
カナダドル	株式 91銘柄	3.9%	4.1%
ユーロ	株式 236銘柄	12.1%	12.7%
英ポンド	株式 104銘柄	7.0%	7.3%



スイスフラン	株式	38銘柄	3.4%	3.6%
スウェーデンクローナ	株式	31銘柄	1.1%	1.2%
ノルウェークローネ	株式	10銘柄	0.3%	0.3%
デンマーククローネ	株式	17銘柄	0.7%	0.7%
オーストラリアドル	株式	58銘柄	2.6%	2.8%
ニュージーランドドル	株式	7銘柄	0.1%	0.1%
香港ドル	株式	40銘柄	1.2%	1.3%
シンガポールドル	株式	22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	19,807	397,922.63	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITIES, INC.	4,202	477,473.26	
		AMERICAN TOWER CORP	23,137	2,831,274.69	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	58,607	675,738.71	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	7,370	1,381,359.10	
		BOSTON PROPERTIES INC	8,255	1,127,550.45	
		BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	16,568	354,058.16	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	5,168	421,295.36	
		COLONY NORTHSTAR INC-CLASS A	30,148	384,989.96	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	8,411	924,537.12	
		DUKE REALTY CORP	19,835	550,619.60	
		EQUITY RESIDENTIAL	19,572	1,241,647.68	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	3,456	811,296.00	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	7,123	555,095.39	
		FEDERAL REALTY INVESTMENT TRUST	3,882	523,565.34	
		GGP INC	32,657	757,968.97	
		HCP, INC.	25,915	826,688.50	
		HOST HOTELS AND RESORTS INC	38,771	712,610.98	
		HUTCHISON PORT HOLDINGS TRUST	283,000	114,615.00	
		IRON MOUNTAIN INC	14,246	503,453.64	
		KIMCO REALTY CORPORATION	24,728	552,670.80	
		LIBERTY PROPERTY TRUST	8,638	350,184.52	
		MACERICH COMPANY/THE	6,717	438,955.95	
MID-AMERICA APARTMENT COMMUNITIES	6,365	648,147.95			
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	8,661	387,666.36			
PROLOGIS INC	29,822	1,638,122.46			
PUBLIC STORAGE	8,277	1,856,531.10			

	REALTY INCOME CORPORATION	14,528	891,728.64
	REGENCY CENTERS CORP	8,674	584,193.90
	SIMON PROPERTY GROUP INC	17,086	2,960,662.08
	SL GREEN REALTY CORP	5,628	612,945.48
	UDR INC	15,084	546,040.80
	VENTAS INC	18,928	1,242,433.92
	VEREIT INC	54,976	482,139.52
	VORNADO REALTY TRUST	9,519	974,650.41
	WELLTOWER INC	19,443	1,417,977.99
	WEYERHAEUSER CO	42,478	1,468,889.24
米ドル 小計		929,682	32,627,701.66 (3,550,872,771)
カナダドル	H&R REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	8,036	187,962.04
	RIOCAN REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	7,441	195,995.94
	SMART REAL ESTATE INVESTMENT	4,552	149,669.76
カナダドル 小計		20,029	533,627.74 (43,848,191)
ユーロ	FONCIERE DES REGIONS	1,550	124,930.00
	GECINA SA	2,342	303,289.00
	ICADE	1,873	131,784.28
	KLEPIERRE	12,954	484,414.83
	UNIBAIL-RODAMCO SE	5,470	1,229,109.00
ユーロ 小計		24,189	2,273,527.11 (263,933,762)
英ポンド	BRITISH LAND CO PLC	53,233	347,611.49
	HAMMERSON PLC	43,671	256,785.48
	INTU PROPERTIES PLC	52,522	151,368.40
	LAND SECURITIES GROUP PLC	44,622	498,873.96
	SEGRO PLC	57,341	273,917.95
英ポンド 小計		251,389	1,528,557.28 (208,862,066)
オーストラリアドル	APA GROUP	56,058	511,809.54
	DEXUS PROPERTY GROUP	53,132	546,196.96
	DUET GROUP	144,076	396,209.00
	GOODMAN GROUP	103,937	863,716.47
	GPT GROUP	98,809	525,663.88
	LENDLEASE GROUP	30,493	483,314.05
	MIRVAC GROUP	182,452	425,113.16
	SCENTRE GROUP	292,819	1,308,900.93
	STOCKLAND	137,366	670,346.08
	SYDNEY AIRPORT	65,814	448,851.48

	TRANSURBAN GROUP	116,522	1,393,603.12
	VICINITY CENTRES	183,407	542,884.72
	WESTFIELD CORP	109,178	991,336.24
	オーストラリアドル 小計	1,574,063	9,107,945.63 (746,942,621)
香港ドル	HKT TRUST AND HKT LTD	216,000	2,190,240.00
	LINK REIT	123,000	6,949,500.00
	香港ドル 小計	339,000	9,139,740.00 (127,956,360)
シンガポールドル	ASCENDAS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	146,600	370,898.00
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	132,400	210,516.00
	CAPITALAND MALL TRUST	146,900	295,269.00
	SUNTEC REIT	112,900	198,704.00
	シンガポールドル 小計	538,800	1,075,387.00 (83,869,432)
	合計		5,026,285,203 (5,026,285,203)

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

通貨	銘柄数	組入投資証券 時価比率	合計金額に対する比率
米ドル	投資証券 37銘柄	1.8%	70.6%
カナダドル	投資証券 3銘柄	0.0%	0.9%
ユーロ	投資証券 5銘柄	0.1%	5.3%
英ポンド	投資証券 5銘柄	0.1%	4.2%
オーストラリアドル	投資証券 13銘柄	0.4%	14.9%
香港ドル	投資証券 2銘柄	0.1%	2.5%
シンガポールドル	投資証券 4銘柄	0.0%	1.7%

#### デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。

#### 外国債券パッシブ・マザーファンド

#### 貸借対照表

(単位:円)

(平成28年 4月13日現在)

(平成29年 4月13日現在)

資産の部		
流動資産		
預金	364,120,525	591,078,577
金銭信託	221,166,178	-
コール・ローン	-	701,419,762

	(平成28年 4月13日現在)	(平成29年 4月13日現在)
国債証券	174,826,593,847	201,489,716,795
未収利息	1,675,906,330	1,593,045,139
前払費用	37,008,522	183,784,741
流動資産合計	177,124,795,402	204,559,045,014
資産合計	177,124,795,402	204,559,045,014
負債の部		
流動負債		
未払解約金	24,126,508	146,279,306
未払利息	-	1,133
その他未払費用	-	11,874
流動負債合計	24,126,508	146,292,313
負債合計	24,126,508	146,292,313
純資産の部		
元本等		
元本	105,056,343,629	125,951,607,749
剰余金		
剰余金又は欠損金( )	72,044,325,265	78,461,144,952
元本等合計	177,100,668,894	204,412,752,701
純資産合計	177,100,668,894	204,412,752,701
負債純資産合計	177,124,795,402	204,559,045,014

## 注記表

(重要な会計方針の注記)

項目	自平成28年 4月14日 至平成29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28年 4月13日現在)	(平成29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	105,056,343,629口	125,951,607,749口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.6858円 (10,000口当たりの純資産額 16,858円)	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)

## (金融商品に関する注記)

## . 金融商品の状況に関する事項

項目	自平成28年 4月14日 至平成29年 4月13日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、国債証券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。当計算期間については、為替予約取引を行っております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>

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

#### ・金融商品の時価等に関する事項

項目	(平成29年 4月13日現在)
1.貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	<p>(1) 有価証券（国債証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

#### （デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

## （関連当事者との取引に関する注記）

自 平成28年 4月14日 至 平成29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28年 4月13日現在）	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	125,043,526,611円
同期中における追加設定元本額	6,823,302,530円
同期中における一部解約元本額	26,810,485,512円
平成28年 4月13日現在における元本の内訳	
三井住友・DC外国債券インデックスファンドS	7,346,160,970円
三井住友・DC年金バランス30（債券重点型）	288,409,692円
三井住友・DC年金バランス50（標準型）	857,455,684円
三井住友・DC年金バランス70（株式重点型）	442,434,229円
SMAM・グローバルバランスファンド（機動的資産配分型）	51,016,068円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2020	8,544,101円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2025	21,533,883円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2030	58,678,871円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2035	36,813,376円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2040	20,804,114円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2045	43,801,378円
三井住友・DC年金バランスゼロ（債券型）	1,199,855円
アセットアロケーション・ファンド（安定型）	109,412,792円
アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）	186,889,135円
アセットアロケーション・ファンド（成長型）	251,038,011円
SMAM・年金外国債券パッシブ・ファンド＜適格機関投資家限定＞	1,494,949,025円
SMAM・バランスファンドVA安定成長型＜適格機関投資家限定＞	3,821,555,609円
SMAM・バランスファンドVA25＜適格機関投資家専用＞	19,243,724,359円
SMAM・バランスファンドVA37.5＜適格機関投資家専用＞	7,379,971,636円
SMAM・バランスファンドVA50＜適格機関投資家専用＞	16,312,945,354円
SMAM・バランスファンドVL30＜適格機関投資家限定＞	45,968,708円
SMAM・バランスファンドVL50＜適格機関投資家限定＞	130,038,973円
世界6資産バランスファンドVA＜適格機関投資家限定＞	13,644,843円
SMAM・バランスファンドVA75＜適格機関投資家専用＞	939,503,001円
SMAM・バランスファンドVL国際分散型＜適格機関投資家限定＞	142,165,035円
SMAM・インデックス・バランスVA25＜適格機関投資家専用＞	1,513,583,466円

S M A M ・ インデックス ・ バランス V A 5 0 < 適格機関投資家専用 >	1,924,991,258円
S M A M ・ バランスファンド V A 4 0 < 適格機関投資家専用 >	4,909,027,048円
S M A M ・ バランスファンド V A 3 5 < 適格機関投資家専用 >	9,047,341,588円
S M A M ・ バランス V A 株 4 0 T < 適格機関投資家限定 >	150,974,873円
S M A M ・ 外国債券パッシブファンド V A < 適格機関投資家限定 >	14,447,331,155円
三井住友 ・ 外国債券インデックスファンド ・ V A S ( 適格機関投資家専用 )	1,248,309,934円
三井住友 ・ 5資産バランスファンド ・ V A S ( 適格機関投資家専用 )	4,140,231,510円
S M A M ・ グローバルバランス 4 0 V A < 適格機関投資家限定 >	244,324,035円
S M A M ・ バランスファンド V A 2 0 < 適格機関投資家専用 >	861,343,324円
三井住友 ・ 7資産バランスファンド ・ V A S ( 適格機関投資家専用 )	3,639,387,901円
S M A M ・ アセットバランスファンド V A 2 0 A < 適格機関投資家専用 >	185,069,203円
S M A M ・ アセットバランスファンド V A 3 5 A < 適格機関投資家専用 >	52,811,680円
S M A M ・ アセットバランスファンド V A 5 0 A < 適格機関投資家専用 >	16,896,401円
S M A M ・ アセットバランスファンド V A 2 0 L < 適格機関投資家専用 >	209,180,765円
S M A M ・ アセットバランスファンド V A 2 5 L < 適格機関投資家専用 >	717,216,112円
S M A M ・ アセットバランスファンド V A 2 0 T < 適格機関投資家専用 >	226,773,526円
S M A M ・ アセットバランスファンド V A 2 0 A 2 < 適格機関投資家専用 >	203,301,882円
S M A M ・ アセットバランスファンド V A 3 5 A 2 < 適格機関投資家専用 >	57,130,687円
S M A M ・ アセットバランスファンド V A 5 0 A 2 < 適格機関投資家専用 >	6,475,605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 >	1,767,576,019円
S M A M ・ アセットバランスファンド V A 2 0 T 2 < 適格機関投資家専用 >	27,895,415円
S M A M ・ F G 新興国重視型バランス 2 0 V A < 適格機関投資家限定 >	2,078,450円
S M A M ・ F G グローバルバランス 2 5 V A < 適格機関投資家限定 >	14,227,327円
S M A M ・ 年金Wリスクコントロールファンド < 適格機関投資家限定 >	395,826円
S M A M ・ マルチアセットストラテジーファンド 2 0 1 6 - 0 1 < 適格機関投資家限定 >	193,809,937円
合計	105,056,343,629円

(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 ・ D C 外国債券インデックスファンド S	8,558,030,650円
三井住友 ・ D C 年金バランス 3 0 ( 債券重点型 )	408,028,815円
三井住友 ・ D C 年金バランス 5 0 ( 標準型 )	1,116,063,124円
三井住友 ・ D C 年金バランス 7 0 ( 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 ・ D C ターゲットイヤーファンド 2 0 2 0 ( 4資産タイプ )	10,088,242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 )	30,849,302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 )	71,866,545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 )	58,275,556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 )	28,913,333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 )	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
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>	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

## 附属明細表

## 有価証券明細表

## (a) 株式

該当事項はありません。

## (b) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘 柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	米ドル	US TREASURY N/B 0.625	3,000,000.00	2,984,531.25	
		US TREASURY N/B 0.625	2,000,000.00	1,987,812.50	
		US TREASURY N/B 0.75	4,000,000.00	3,985,937.52	
		US TREASURY N/B 0.75	2,000,000.00	1,992,343.76	
		US TREASURY N/B 0.75	3,000,000.00	2,984,296.89	
		US TREASURY N/B 0.75	3,500,000.00	3,479,765.62	
		US TREASURY N/B 0.75	3,000,000.00	2,981,250.00	
		US TREASURY N/B 0.75	2,000,000.00	1,986,093.76	
		US TREASURY N/B 0.75	2,000,000.00	1,982,343.76	
		US TREASURY N/B 0.75	2,000,000.00	1,974,531.26	
		US TREASURY N/B 0.75	3,000,000.00	2,959,921.89	
		US TREASURY N/B 0.875	3,000,000.00	2,991,328.14	
		US TREASURY N/B 0.875	3,000,000.00	2,989,687.50	
		US TREASURY N/B 0.875	2,000,000.00	1,990,468.76	
		US TREASURY N/B 0.875	4,000,000.00	3,969,375.00	
		US TREASURY N/B 0.875	3,000,000.00	2,974,687.50	
		US TREASURY N/B 0.875	3,000,000.00	2,972,343.75	
		US TREASURY N/B 0.875	2,000,000.00	1,980,000.00	
		US TREASURY N/B 0.875	3,000,000.00	2,965,546.89	
		US TREASURY N/B 1	3,000,000.00	2,995,781.25	
		US TREASURY N/B 1	5,000,000.00	4,992,187.50	
		US TREASURY N/B 1	3,000,000.00	2,993,437.50	
		US TREASURY N/B 1	3,000,000.00	2,992,265.64	
		US TREASURY N/B 1	3,000,000.00	2,989,687.50	
		US TREASURY N/B 1	4,000,000.00	3,981,250.00	
		US TREASURY N/B 1	3,000,000.00	2,980,078.14	
		US TREASURY N/B 1	4,000,000.00	3,968,437.52	

US TREASURY N/B 1	2,000,000.00	1,982,656.26	
US TREASURY N/B 1	2,000,000.00	1,981,875.00	
US TREASURY N/B 1	2,000,000.00	1,980,312.50	
US TREASURY N/B 1	3,000,000.00	2,970,234.39	
US TREASURY N/B 1.125	2,000,000.00	1,999,687.50	
US TREASURY N/B 1.125	3,000,000.00	2,994,140.64	
US TREASURY N/B 1.125	3,000,000.00	2,994,140.64	
US TREASURY N/B 1.125	3,000,000.00	2,993,671.89	
US TREASURY N/B 1.125	2,000,000.00	1,993,593.76	
US TREASURY N/B 1.125	4,000,000.00	3,970,625.00	
US TREASURY N/B 1.125	2,800,000.00	2,772,875.00	
US TREASURY N/B 1.125	3,000,000.00	2,967,890.64	
US TREASURY N/B 1.125	3,800,000.00	3,721,328.14	
US TREASURY N/B 1.125	3,000,000.00	2,925,000.00	
US TREASURY N/B 1.125	3,000,000.00	2,922,187.50	
US TREASURY N/B 1.125	5,000,000.00	4,865,234.40	
US TREASURY N/B 1.125	5,000,000.00	4,858,984.40	
US TREASURY N/B 1.25	3,000,000.00	3,002,109.39	
US TREASURY N/B 1.25	3,000,000.00	3,001,875.00	
US TREASURY N/B 1.25	3,000,000.00	3,001,875.00	
US TREASURY N/B 1.25	3,000,000.00	3,001,406.25	
US TREASURY N/B 1.25	3,000,000.00	3,001,406.25	
US TREASURY N/B 1.25	4,000,000.00	4,001,250.00	
US TREASURY N/B 1.25	3,000,000.00	3,000,234.39	
US TREASURY N/B 1.25	2,000,000.00	1,999,062.50	
US TREASURY N/B 1.25	2,000,000.00	1,994,062.50	
US TREASURY N/B 1.25	3,000,000.00	2,985,234.39	
US TREASURY N/B 1.25	3,000,000.00	2,982,890.64	
US TREASURY N/B 1.25	4,000,000.00	3,932,500.00	
US TREASURY N/B 1.25	5,000,000.00	4,881,640.65	
US TREASURY N/B 1.25	3,000,000.00	2,858,203.14	
US TREASURY N/B 1.375	3,000,000.00	3,008,437.50	
US TREASURY N/B 1.375	3,000,000.00	3,007,734.39	
US TREASURY N/B 1.375	4,500,000.00	4,511,250.00	
US TREASURY N/B 1.375	3,000,000.00	3,008,437.50	
US TREASURY N/B 1.375	2,000,000.00	2,005,156.26	
US TREASURY N/B 1.375	5,000,000.00	5,013,281.25	
US TREASURY N/B 1.375	3,000,000.00	2,997,656.25	
US TREASURY N/B 1.375	3,000,000.00	2,996,718.75	
US TREASURY N/B 1.375	4,000,000.00	3,995,000.00	
US TREASURY N/B 1.375	3,000,000.00	2,995,312.50	
US TREASURY N/B 1.375	5,000,000.00	4,990,625.00	

US TREASURY N/B 1.375	4,000,000.00	3,989,687.52
US TREASURY N/B 1.375	4,000,000.00	3,986,562.52
US TREASURY N/B 1.375	3,000,000.00	2,987,343.75
US TREASURY N/B 1.375	4,000,000.00	3,974,375.00
US TREASURY N/B 1.375	3,000,000.00	2,978,203.14
US TREASURY N/B 1.375	5,000,000.00	4,959,765.65
US TREASURY N/B 1.375	3,000,000.00	2,968,593.75
US TREASURY N/B 1.375	4,000,000.00	3,947,812.52
US TREASURY N/B 1.375	4,000,000.00	3,944,062.52
US TREASURY N/B 1.375	3,000,000.00	2,883,750.00
US TREASURY N/B 1.375	4,000,000.00	3,835,625.00
US TREASURY N/B 1.375	3,000,000.00	2,873,906.25
US TREASURY N/B 1.5	5,000,000.00	5,021,484.40
US TREASURY N/B 1.5	4,700,000.00	4,721,296.87
US TREASURY N/B 1.5	2,000,000.00	2,009,062.50
US TREASURY N/B 1.5	4,000,000.00	4,018,125.00
US TREASURY N/B 1.5	3,000,000.00	3,013,359.39
US TREASURY N/B 1.5	3,000,000.00	3,008,906.25
US TREASURY N/B 1.5	5,000,000.00	5,014,062.50
US TREASURY N/B 1.5	3,000,000.00	2,999,062.50
US TREASURY N/B 1.5	3,000,000.00	2,954,296.89
US TREASURY N/B 1.5	4,000,000.00	3,889,062.52
US TREASURY N/B 1.5	3,000,000.00	2,913,750.00
US TREASURY N/B 1.5	8,000,000.00	7,468,125.04
US TREASURY N/B 1.625	5,000,000.00	5,035,937.50
US TREASURY N/B 1.625	4,000,000.00	4,027,812.52
US TREASURY N/B 1.625	3,000,000.00	3,020,390.64
US TREASURY N/B 1.625	2,000,000.00	2,013,281.26
US TREASURY N/B 1.625	3,000,000.00	3,020,390.64
US TREASURY N/B 1.625	5,000,000.00	5,028,906.25
US TREASURY N/B 1.625	3,500,000.00	3,510,664.08
US TREASURY N/B 1.625	3,000,000.00	3,007,031.25
US TREASURY N/B 1.625	5,000,000.00	5,000,000.00
US TREASURY N/B 1.625	3,000,000.00	2,955,000.00
US TREASURY N/B 1.625	3,500,000.00	3,439,296.87
US TREASURY N/B 1.625	3,000,000.00	2,932,265.64
US TREASURY N/B 1.625	3,000,000.00	2,929,453.14
US TREASURY N/B 1.625	3,000,000.00	2,917,968.75
US TREASURY N/B 1.625	8,000,000.00	7,586,250.00
US TREASURY N/B 1.625	7,000,000.00	6,623,203.16
US TREASURY N/B 1.75	1,000,000.00	1,008,984.38
US TREASURY N/B 1.75	4,000,000.00	4,038,125.00
US TREASURY N/B 1.75	4,300,000.00	4,321,500.00

US TREASURY N/B 1.75	5,000,000.00	5,020,312.50	
US TREASURY N/B 1.75	3,000,000.00	2,993,906.25	
US TREASURY N/B 1.75	3,000,000.00	2,987,343.75	
US TREASURY N/B 1.75	4,500,000.00	4,477,851.58	
US TREASURY N/B 1.75	3,000,000.00	2,984,531.25	
US TREASURY N/B 1.75	3,000,000.00	2,984,296.89	
US TREASURY N/B 1.75	3,000,000.00	2,971,171.89	
US TREASURY N/B 1.75	3,000,000.00	2,960,625.00	
US TREASURY N/B 1.75	7,000,000.00	6,888,437.50	
US TREASURY N/B 1.875	3,000,000.00	3,033,750.00	
US TREASURY N/B 1.875	3,000,000.00	3,010,078.14	
US TREASURY N/B 1.875	4,000,000.00	4,008,437.52	
US TREASURY N/B 1.875	4,000,000.00	4,009,375.00	
US TREASURY N/B 1.875	3,000,000.00	3,001,171.89	
US TREASURY N/B 1.875	4,000,000.00	3,993,437.52	
US TREASURY N/B 1.875	3,000,000.00	2,988,046.89	
US TREASURY N/B 2	3,000,000.00	3,043,125.00	
US TREASURY N/B 2	2,300,000.00	2,332,164.07	
US TREASURY N/B 2	3,000,000.00	3,038,906.25	
US TREASURY N/B 2	3,000,000.00	3,038,203.14	
US TREASURY N/B 2	4,000,000.00	4,044,375.00	
US TREASURY N/B 2	3,000,000.00	3,029,296.89	
US TREASURY N/B 2	3,000,000.00	3,026,250.00	
US TREASURY N/B 2	6,000,000.00	6,053,437.50	
US TREASURY N/B 2	5,000,000.00	5,040,625.00	
US TREASURY N/B 2	3,100,000.00	3,126,882.82	
US TREASURY N/B 2	3,000,000.00	3,015,234.39	
US TREASURY N/B 2	3,000,000.00	3,006,093.75	
US TREASURY N/B 2	7,500,000.00	7,502,343.75	
US TREASURY N/B 2	8,000,000.00	7,878,750.00	
US TREASURY N/B 2	8,000,000.00	7,851,875.04	
US TREASURY N/B 2	8,000,000.00	7,795,000.00	
US TREASURY N/B 2.125	3,500,000.00	3,563,437.50	
US TREASURY N/B 2.125	4,000,000.00	4,067,187.52	
US TREASURY N/B 2.125	4,000,000.00	4,063,125.00	
US TREASURY N/B 2.125	5,000,000.00	5,077,343.75	
US TREASURY N/B 2.125	3,000,000.00	3,043,359.39	
US TREASURY N/B 2.125	4,000,000.00	4,055,000.00	
US TREASURY N/B 2.125	3,000,000.00	3,035,859.39	
US TREASURY N/B 2.125	4,000,000.00	4,031,562.52	
US TREASURY N/B 2.125	4,000,000.00	4,011,875.00	
US TREASURY N/B 2.125	2,000,000.00	2,002,187.50	

US TREASURY N/B 2.125	7,000,000.00	6,947,500.00
US TREASURY N/B 2.25	2,000,000.00	2,028,437.50
US TREASURY N/B 2.25	4,000,000.00	4,085,625.00
US TREASURY N/B 2.25	2,000,000.00	2,041,875.00
US TREASURY N/B 2.25	4,000,000.00	4,082,812.52
US TREASURY N/B 2.25	4,000,000.00	4,039,062.52
US TREASURY N/B 2.25	2,000,000.00	2,018,906.26
US TREASURY N/B 2.25	8,000,000.00	8,035,000.00
US TREASURY N/B 2.25	7,500,000.00	7,494,140.62
US TREASURY N/B 2.25	5,000,000.00	4,978,125.00
US TREASURY N/B 2.25	5,000,000.00	4,311,328.15
US TREASURY N/B 2.375	2,000,000.00	2,029,531.26
US TREASURY N/B 2.375	2,000,000.00	2,053,593.76
US TREASURY N/B 2.375	8,000,000.00	8,120,000.00
US TREASURY N/B 2.5	6,000,000.00	6,159,375.00
US TREASURY N/B 2.5	8,000,000.00	8,197,500.00
US TREASURY N/B 2.5	5,500,000.00	5,029,062.50
US TREASURY N/B 2.5	5,300,000.00	4,837,492.21
US TREASURY N/B 2.5	5,000,000.00	4,559,765.65
US TREASURY N/B 2.625	2,000,000.00	2,031,250.00
US TREASURY N/B 2.625	4,000,000.00	4,139,687.52
US TREASURY N/B 2.625	5,500,000.00	5,695,507.84
US TREASURY N/B 2.75	3,000,000.00	3,082,968.75
US TREASURY N/B 2.75	6,200,000.00	6,459,140.65
US TREASURY N/B 2.75	7,000,000.00	7,290,937.50
US TREASURY N/B 2.75	2,000,000.00	1,938,125.00
US TREASURY N/B 2.75	8,000,000.00	7,747,500.00
US TREASURY N/B 2.875	3,000,000.00	2,970,468.75
US TREASURY N/B 2.875	4,000,000.00	3,947,500.00
US TREASURY N/B 2.875	4,500,000.00	4,445,156.25
US TREASURY N/B 3	2,800,000.00	2,844,406.26
US TREASURY N/B 3	4,000,000.00	4,048,750.00
US TREASURY N/B 3	4,000,000.00	4,047,187.52
US TREASURY N/B 3	6,000,000.00	6,067,968.78
US TREASURY N/B 3	1,000,000.00	1,013,671.88
US TREASURY N/B 3.125	2,000,000.00	2,075,781.26
US TREASURY N/B 3.125	3,000,000.00	3,165,937.50
US TREASURY N/B 3.125	2,000,000.00	2,079,218.76
US TREASURY N/B 3.125	2,500,000.00	2,598,632.82
US TREASURY N/B 3.125	6,000,000.00	6,227,812.50
US TREASURY N/B 3.375	5,000,000.00	5,253,125.00
US TREASURY N/B 3.375	4,000,000.00	4,338,750.00
US TREASURY N/B 3.5	4,500,000.00	4,774,570.33

US TREASURY N/B 3.5	2,000,000.00	2,233,593.76	
US TREASURY N/B 3.625	5,000,000.00	5,264,843.75	
US TREASURY N/B 3.625	6,000,000.00	6,367,500.00	
US TREASURY N/B 3.625	5,000,000.00	5,368,359.40	
US TREASURY N/B 3.625	6,000,000.00	6,789,375.00	
US TREASURY N/B 3.625	5,000,000.00	5,661,718.75	
US TREASURY N/B 3.75	3,000,000.00	3,119,531.25	
US TREASURY N/B 3.75	2,000,000.00	2,302,500.00	
US TREASURY N/B 3.75	4,000,000.00	4,625,000.00	
US TREASURY N/B 3.875	6,000,000.00	6,178,125.00	
US TREASURY N/B 3.875	2,000,000.00	2,348,437.50	
US TREASURY N/B 4	2,500,000.00	2,595,117.20	
US TREASURY N/B 4.25	2,000,000.00	2,479,687.50	
US TREASURY N/B 4.25	2,000,000.00	2,477,343.76	
US TREASURY N/B 4.375	1,200,000.00	1,519,687.50	
US TREASURY N/B 4.375	1,500,000.00	1,888,593.75	
US TREASURY N/B 4.375	2,500,000.00	3,152,734.37	
US TREASURY N/B 4.375	2,000,000.00	2,529,062.50	
US TREASURY N/B 4.5	1,500,000.00	1,925,976.57	
US TREASURY N/B 4.5	1,000,000.00	1,285,546.88	
US TREASURY N/B 4.5	1,000,000.00	1,281,718.75	
US TREASURY N/B 4.625	4,000,000.00	5,210,000.00	
US TREASURY N/B 4.75	1,500,000.00	1,992,773.44	
US TREASURY N/B 5	1,000,000.00	1,362,343.75	
US TREASURY N/B 5.25	1,000,000.00	1,289,531.25	
US TREASURY N/B 5.25	500,000.00	647,265.62	
US TREASURY N/B 5.375	1,320,000.00	1,780,968.75	
US TREASURY N/B 5.5	1,000,000.00	1,310,625.00	
US TREASURY N/B 6	1,000,000.00	1,301,406.25	
US TREASURY N/B 6.125	1,000,000.00	1,356,562.50	
US TREASURY N/B 6.25	800,000.00	1,001,937.50	
US TREASURY N/B 6.25	1,000,000.00	1,430,703.13	
US TREASURY N/B 6.5	500,000.00	681,445.31	
US TREASURY N/B 8	1,300,000.00	1,655,671.87	
US TREASURY N/B 8.75	1,000,000.00	1,233,906.25	
US TREASURY N/B 8.875	1,100,000.00	1,254,773.44	
米ドル 小計	817,020,000.00	828,193,759.33 (90,132,326,827)	
カナダドル			
CANADA-GOV'T 0.5	2,000,000.00	1,994,560.00	
CANADA-GOV'T 0.5	2,000,000.00	1,993,000.00	
CANADA-GOV'T 0.5	2,000,000.00	1,991,200.00	
CANADA-GOV'T 0.5	2,000,000.00	1,944,800.00	

	CANADA-GOV'T 0.75	2,000,000.00	1,998,980.00
	CANADA-GOV'T 0.75	1,000,000.00	995,000.00
	CANADA-GOV'T 0.75	2,000,000.00	1,983,698.00
	CANADA-GOV'T 0.75	2,000,000.00	1,976,700.00
	CANADA-GOV'T 1	1,000,000.00	939,750.00
	CANADA-GOV'T 1.25	2,000,000.00	2,010,140.00
	CANADA-GOV'T 1.25	1,000,000.00	1,007,300.00
	CANADA-GOV'T 1.5	2,000,000.00	2,036,900.00
	CANADA-GOV'T 1.5	2,000,000.00	2,029,080.00
	CANADA-GOV'T 1.5	2,000,000.00	1,992,200.00
	CANADA-GOV'T 1.75	1,000,000.00	1,019,010.00
	CANADA-GOV'T 1.75	1,000,000.00	1,022,570.00
	CANADA-GOV'T 2.25	1,000,000.00	1,061,720.00
	CANADA-GOV'T 2.5	2,000,000.00	2,156,100.00
	CANADA-GOV'T 2.75	1,000,000.00	1,081,200.00
	CANADA-GOV'T 2.75	2,000,000.00	2,242,600.00
	CANADA-GOV'T 3.25	1,000,000.00	1,090,590.00
	CANADA-GOV'T 3.5	2,000,000.00	2,160,780.00
	CANADA-GOV'T 3.5	1,500,000.00	1,893,540.00
	CANADA-GOV'T 3.75	2,500,000.00	2,658,500.00
	CANADA-GOV'T 4	2,000,000.00	2,653,860.00
	CANADA-GOV'T 4.25	1,500,000.00	1,559,850.00
	CANADA-GOV'T 5	1,500,000.00	2,189,550.00
	CANADA-GOV'T 5.75	1,500,000.00	2,136,615.00
	CANADA-GOV'T 5.75	1,500,000.00	2,263,755.00
	CANADA-GOV'T 8	500,000.00	795,810.00
	カナダドル 小計	48,500,000.00	52,879,358.00 (4,345,096,846)
メキシコペソ	MEXICAN BONOS 10	40,000,000.00	46,872,000.00
	MEXICAN BONOS 5.75	20,000,000.00	18,240,000.00
	MEXICAN BONOS 6.5	30,000,000.00	29,331,000.00
	MEXICAN BONOS 7.75	20,000,000.00	20,146,000.00
	MEXICAN BONOS 8	50,000,000.00	51,490,000.00
	MEXICAN BONOS 8	20,000,000.00	21,012,000.00
	MEXICAN BONOS 8.5	20,000,000.00	20,550,000.00
	MEXICAN BONOS 8.5	50,000,000.00	54,850,000.00
	MEXICAN BONOS 8.5	40,000,000.00	44,044,000.00
	メキシコペソ 小計	290,000,000.00	306,535,000.00 (1,799,360,450)
ユーロ	BELGIAN 0326 4	1,000,000.00	1,406,310.00
	BELGIAN 0.2	1,000,000.00	1,011,330.00
	BELGIAN 0.8	2,000,000.00	2,062,980.00
	BELGIAN 0.8	1,000,000.00	1,004,820.00



BELGIAN 0291 5.5	2,000,000.00	3,014,960.00
BELGIAN 0304 5	2,500,000.00	4,051,550.00
BELGIAN 0308 4	1,500,000.00	1,820,865.00
BELGIAN 0315 4	1,500,000.00	1,635,840.00
BELGIAN 0318 3.75	2,000,000.00	2,296,300.00
BELGIAN 0320 4.25	2,500,000.00	3,906,800.00
BELGIAN 0321 4.25	1,700,000.00	2,052,937.00
BELGIAN 0324 4.5	1,000,000.00	1,355,370.00
BELGIAN 0325 4.25	2,000,000.00	2,486,440.00
BELGIAN 0327 3	2,000,000.00	2,176,620.00
BELGIAN 0328 2.25	2,000,000.00	2,286,280.00
BELGIAN 0329 1.25	2,000,000.00	2,044,280.00
BELGIAN 0332 2.6	2,000,000.00	2,342,940.00
BELGIAN 0333 3	500,000.00	641,855.00
BELGIAN 1	2,000,000.00	2,077,460.00
BELGIAN 1	1,000,000.00	988,930.00
BELGIAN 1.9	1,000,000.00	1,090,000.00
BELGIAN 2.15	500,000.00	517,195.00
BELGIAN 3.75	1,000,000.00	1,480,560.00
BTPS 0.05	1,000,000.00	992,730.00
BTPS 0.1	1,000,000.00	999,760.00
BTPS 0.25	2,000,000.00	2,009,040.00
BTPS 0.3	1,000,000.00	1,004,960.00
BTPS 0.35	2,000,000.00	1,957,560.00
BTPS 0.45	2,000,000.00	1,982,840.00
BTPS 0.65	2,000,000.00	2,011,800.00
BTPS 0.65	2,000,000.00	1,899,820.00
BTPS 0.7	2,000,000.00	2,015,800.00
BTPS 0.95	2,000,000.00	1,961,880.00
BTPS 1.05	2,000,000.00	2,036,400.00
BTPS 1.2	1,000,000.00	1,005,680.00
BTPS 1.25	3,000,000.00	2,778,240.00
BTPS 1.35	2,000,000.00	2,028,640.00
BTPS 1.45	2,000,000.00	2,031,880.00
BTPS 1.5	2,000,000.00	2,055,460.00
BTPS 1.5	2,000,000.00	1,939,800.00
BTPS 1.6	2,000,000.00	1,919,060.00
BTPS 1.65	2,000,000.00	1,779,600.00
BTPS 2	2,000,000.00	1,997,180.00
BTPS 2.15	2,000,000.00	2,114,340.00
BTPS 2.2	1,000,000.00	993,060.00
BTPS 2.25	1,000,000.00	910,960.00
BTPS 2.5	3,000,000.00	3,141,210.00

BTPS 2.5	2,000,000.00	2,092,960.00	
BTPS 2.7	2,000,000.00	1,785,360.00	
BTPS 2.8	1,000,000.00	833,740.00	
BTPS 3.25	1,500,000.00	1,497,945.00	
BTPS 3.5	2,400,000.00	2,497,296.00	
BTPS 3.5	2,000,000.00	2,112,200.00	
BTPS 3.5	3,000,000.00	3,310,740.00	
BTPS 3.75	3,000,000.00	3,364,110.00	
BTPS 3.75	2,000,000.00	2,245,220.00	
BTPS 3.75	3,300,000.00	3,711,708.00	
BTPS 3.75	2,000,000.00	2,268,680.00	
BTPS 4	2,500,000.00	2,791,975.00	
BTPS 4	3,000,000.00	3,455,370.00	
BTPS 4.25	2,400,000.00	2,577,984.00	
BTPS 4.25	3,500,000.00	3,824,345.00	
BTPS 4.25	3,300,000.00	3,660,855.00	
BTPS 4.5	3,000,000.00	3,177,750.00	
BTPS 4.5	2,700,000.00	2,921,049.00	
BTPS 4.5	2,700,000.00	3,008,259.00	
BTPS 4.5	2,800,000.00	3,302,432.00	
BTPS 4.5	3,000,000.00	3,547,800.00	
BTPS 4.5	3,000,000.00	3,579,120.00	
BTPS 4.75	2,600,000.00	3,037,008.00	
BTPS 4.75	2,500,000.00	2,999,175.00	
BTPS 4.75	3,000,000.00	3,681,570.00	
BTPS 4.75	2,000,000.00	2,518,440.00	
BTPS 5	3,000,000.00	3,562,050.00	
BTPS 5	3,000,000.00	3,678,960.00	
BTPS 5	2,470,000.00	3,182,767.90	
BTPS 5	2,000,000.00	2,594,320.00	
BTPS 5	2,500,000.00	3,215,925.00	
BTPS 5.25	3,700,000.00	4,781,880.00	
BTPS 5.5	2,500,000.00	3,059,825.00	
BTPS 5.5	2,500,000.00	3,067,100.00	
BTPS 5.75	2,200,000.00	3,040,092.00	
BTPS 6	4,100,000.00	5,713,227.00	
BTPS 6.5	2,960,000.00	4,117,478.40	
BTPS 7.25	1,000,000.00	1,440,270.00	
BTPS 9	1,000,000.00	1,465,100.00	
BUNDESUBL-166 0.25	2,000,000.00	2,022,100.00	
BUNDESUBL-167 1	2,000,000.00	2,056,300.00	
BUNDESUBL-168 1	1,000,000.00	1,034,980.00	

BUNDESUBL-169 0.5	2,000,000.00	2,054,640.00
BUNDESUBL-170 0.25	1,000,000.00	1,027,260.00
BUNDESUBL-171 0	2,000,000.00	2,047,740.00
BUNDESUBL-172 0.25	2,000,000.00	2,069,020.00
BUNDESUBL-173 0	3,000,000.00	3,080,730.00
BUNDESUBL-174 0	3,000,000.00	3,082,200.00
BUNDESSCHATZANW 0	2,000,000.00	2,020,080.00
BUNDESSCHATZANW 0	1,000,000.00	1,012,130.00
BUNDESSCHATZANW 0	2,000,000.00	2,028,740.00
DEUTSCHLAND REP 0	3,000,000.00	2,966,070.00
DEUTSCHLAND REP 0.25	2,000,000.00	2,010,560.00
DEUTSCHLAND REP 0.5	3,000,000.00	3,147,210.00
DEUTSCHLAND REP 0.5	3,000,000.00	3,124,980.00
DEUTSCHLAND REP 1	2,000,000.00	2,178,340.00
DEUTSCHLAND REP 1	3,000,000.00	3,264,000.00
DEUTSCHLAND REP 1.5	2,500,000.00	2,768,925.00
DEUTSCHLAND REP 1.5	2,500,000.00	2,782,250.00
DEUTSCHLAND REP 1.5	2,000,000.00	2,232,120.00
DEUTSCHLAND REP 1.5	2,000,000.00	2,248,700.00
DEUTSCHLAND REP 1.75	2,500,000.00	2,796,725.00
DEUTSCHLAND REP 1.75	2,000,000.00	2,280,700.00
DEUTSCHLAND REP 2	2,000,000.00	2,247,120.00
DEUTSCHLAND REP 2	2,500,000.00	2,877,100.00
DEUTSCHLAND REP 2.25	1,500,000.00	1,654,275.00
DEUTSCHLAND REP 2.25	2,000,000.00	2,255,520.00
DEUTSCHLAND REP 2.5	2,000,000.00	2,242,100.00
DEUTSCHLAND REP 2.5	2,200,000.00	3,043,876.00
DEUTSCHLAND REP 2.5	2,000,000.00	2,799,360.00
DEUTSCHLAND REP 3	3,000,000.00	3,369,090.00
DEUTSCHLAND REP 3.25	3,000,000.00	3,337,080.00
DEUTSCHLAND REP 3.25	2,000,000.00	2,333,760.00
DEUTSCHLAND REP 3.25	1,500,000.00	2,319,150.00
DEUTSCHLAND REP 3.5	3,000,000.00	3,292,560.00
DEUTSCHLAND REP 3.75	3,500,000.00	3,780,840.00
DEUTSCHLAND REP 4	3,200,000.00	5,166,240.00
DEUTSCHLAND REP 4.25	2,200,000.00	2,337,104.00
DEUTSCHLAND REP 4.25	1,500,000.00	2,578,710.00
DEUTSCHLAND REP 4.75	1,300,000.00	1,945,229.00
DEUTSCHLAND REP 4.75	2,600,000.00	4,391,322.00
DEUTSCHLAND REP 4.75	2,400,000.00	4,436,208.00
DEUTSCHLAND REP 5.5	1,800,000.00	3,026,682.00
DEUTSCHLAND REP 5.625	1,580,000.00	2,485,087.20
DEUTSCHLAND REP 6.25	1,200,000.00	1,732,224.00

DEUTSCHLAND REP 6.25	1,000,000.00	1,737,720.00	
DEUTSCHLAND REP 6.5	2,000,000.00	3,279,860.00	
FINNISH GOV'T 0.75	1,000,000.00	1,005,420.00	
FINNISH GOV'T 1.5	1,000,000.00	1,099,320.00	
FINNISH GOV'T 1.625	1,000,000.00	1,101,500.00	
FINNISH GOV'T 2	1,000,000.00	1,139,150.00	
FINNISH GOV'T 2.625	500,000.00	685,780.00	
FINNISH GOV'T 2.75	600,000.00	748,068.00	
FINNISH GOV'T 3.375	1,200,000.00	1,344,432.00	
FINNISH GOV'T 3.5	1,000,000.00	1,160,210.00	
FINNISH GOV'T 4	1,000,000.00	1,316,040.00	
FINNISH GOV'T 4.375	1,000,000.00	1,113,020.00	
FRANCE O.A.T. 0	2,000,000.00	2,018,300.00	
FRANCE O.A.T. 0	3,000,000.00	3,030,570.00	
FRANCE O.A.T. 0	3,000,000.00	3,019,440.00	
FRANCE O.A.T. 0	1,000,000.00	997,010.00	
FRANCE O.A.T. 0.25	3,000,000.00	3,053,220.00	
FRANCE O.A.T. 0.25	2,000,000.00	1,876,460.00	
FRANCE O.A.T. 0.5	3,000,000.00	3,070,650.00	
FRANCE O.A.T. 0.5	4,000,000.00	3,951,680.00	
FRANCE O.A.T. 0.5	3,000,000.00	2,910,570.00	
FRANCE O.A.T. 1	3,000,000.00	3,049,770.00	
FRANCE O.A.T. 1	3,000,000.00	3,071,940.00	
FRANCE O.A.T. 1	2,000,000.00	2,061,800.00	
FRANCE O.A.T. 1	3,000,000.00	3,063,000.00	
FRANCE O.A.T. 1.25	2,000,000.00	1,886,120.00	
FRANCE O.A.T. 1.5	3,000,000.00	3,072,840.00	
FRANCE O.A.T. 1.75	4,000,000.00	4,366,600.00	
FRANCE O.A.T. 1.75	4,000,000.00	4,358,360.00	
FRANCE O.A.T. 1.75	1,000,000.00	880,220.00	
FRANCE O.A.T. 2.25	3,800,000.00	4,244,904.00	
FRANCE O.A.T. 2.25	4,000,000.00	4,507,800.00	
FRANCE O.A.T. 2.5	4,500,000.00	4,940,370.00	
FRANCE O.A.T. 2.5	4,000,000.00	4,617,760.00	
FRANCE O.A.T. 2.75	4,000,000.00	4,681,600.00	
FRANCE O.A.T. 3	5,000,000.00	5,746,650.00	
FRANCE O.A.T. 3.25	4,800,000.00	5,527,488.00	
FRANCE O.A.T. 3.25	3,200,000.00	4,129,536.00	
FRANCE O.A.T. 3.5	4,000,000.00	4,464,840.00	
FRANCE O.A.T. 3.5	4,000,000.00	4,936,480.00	
FRANCE O.A.T. 3.75	5,000,000.00	5,529,650.00	
FRANCE O.A.T. 3.75	4,700,000.00	5,445,091.00	

FRANCE O.A.T. 4	3,000,000.00	3,138,030.00
FRANCE O.A.T. 4	3,700,000.00	5,278,642.00
FRANCE O.A.T. 4	1,370,000.00	2,071,467.40
FRANCE O.A.T. 4	1,500,000.00	2,303,655.00
FRANCE O.A.T. 4.25	4,000,000.00	4,290,360.00
FRANCE O.A.T. 4.25	4,400,000.00	4,823,676.00
FRANCE O.A.T. 4.25	5,000,000.00	6,269,200.00
FRANCE O.A.T. 4.5	4,200,000.00	6,459,684.00
FRANCE O.A.T. 4.75	3,100,000.00	4,699,321.00
FRANCE O.A.T. 5.5	3,500,000.00	5,224,240.00
FRANCE O.A.T. 5.75	4,200,000.00	6,795,306.00
FRANCE O.A.T. 6	3,500,000.00	5,045,565.00
FRANCE O.A.T. 8.5	850,000.00	1,042,423.00
FRANCE O.A.T. 8.5	1,700,000.00	2,543,795.00
IRISH GOVT 0.8	1,000,000.00	1,039,310.00
IRISH GOVT 1	1,000,000.00	1,006,900.00
IRISH GOVT 2	1,000,000.00	1,003,070.00
IRISH GOVT 2.4	1,000,000.00	1,126,640.00
IRISH GOVT 3.4	1,000,000.00	1,200,470.00
IRISH GOVT 3.9	500,000.00	609,210.00
IRISH GOVT 4.4	1,000,000.00	1,104,970.00
IRISH GOVT 4.5	1,000,000.00	1,074,260.00
IRISH GOVT 4.5	1,490,000.00	1,704,515.30
IRISH GOVT 5	1,000,000.00	1,184,820.00
IRISH GOVT 5.4	1,500,000.00	2,043,645.00
IRISH GOVT 5.9	800,000.00	926,048.00
NETHERLANDS GOVT 0	2,000,000.00	2,015,180.00
NETHERLANDS GOVT 0	2,000,000.00	2,041,080.00
NETHERLANDS GOVT 0.25	2,000,000.00	2,056,000.00
NETHERLANDS GOVT 0.25	2,000,000.00	2,017,700.00
NETHERLANDS GOVT 0.5	1,500,000.00	1,528,980.00
NETHERLANDS GOVT 1.25	2,000,000.00	2,072,220.00
NETHERLANDS GOVT 1.75	2,200,000.00	2,472,800.00
NETHERLANDS GOVT 2	2,000,000.00	2,296,400.00
NETHERLANDS GOVT 2.25	2,000,000.00	2,280,700.00
NETHERLANDS GOVT 2.5	1,100,000.00	1,402,346.00
NETHERLANDS GOVT 2.75	2,000,000.00	2,888,040.00
NETHERLANDS GOVT 3.25	1,500,000.00	1,746,660.00
NETHERLANDS GOVT 3.5	2,000,000.00	2,276,300.00
NETHERLANDS GOVT 3.75	1,000,000.00	1,237,030.00
NETHERLANDS GOVT 3.75	1,500,000.00	2,448,930.00
NETHERLANDS GOVT 4	1,500,000.00	1,589,925.00
NETHERLANDS GOVT 4	1,500,000.00	1,662,735.00

NETHERLANDS GOVT 4	2,200,000.00	3,502,356.00	
NETHERLANDS GOVT 5.5	1,500,000.00	2,305,500.00	
REP OF AUSTRIA 0.25	1,000,000.00	1,023,550.00	
REP OF AUSTRIA 0.75	1,900,000.00	1,955,708.00	
REP OF AUSTRIA 1.15	1,000,000.00	1,028,220.00	
REP OF AUSTRIA 1.2	1,500,000.00	1,621,425.00	
REP OF AUSTRIA 1.5	1,000,000.00	1,044,950.00	
REP OF AUSTRIA 1.65	1,000,000.00	1,116,820.00	
REP OF AUSTRIA 1.75	1,000,000.00	1,122,840.00	
REP OF AUSTRIA 1.95	1,000,000.00	1,057,350.00	
REP OF AUSTRIA 2.4	1,000,000.00	1,236,680.00	
REP OF AUSTRIA 3.15	500,000.00	722,665.00	
REP OF AUSTRIA 3.4	1,000,000.00	1,207,640.00	
REP OF AUSTRIA 3.5	2,000,000.00	2,353,560.00	
REP OF AUSTRIA 3.65	1,000,000.00	1,203,220.00	
REP OF AUSTRIA 3.8	500,000.00	883,295.00	
REP OF AUSTRIA 3.9	1,500,000.00	1,721,325.00	
REP OF AUSTRIA 4.15	1,300,000.00	2,033,057.00	
REP OF AUSTRIA 4.35	1,200,000.00	1,316,316.00	
REP OF AUSTRIA 4.85	1,000,000.00	1,407,330.00	
REP OF AUSTRIA 6.25	1,000,000.00	1,589,230.00	
SPANISH GOV'T 0.25	2,000,000.00	2,010,740.00	
SPANISH GOV'T 0.25	3,000,000.00	3,022,080.00	
SPANISH GOV'T 0.4	1,000,000.00	998,020.00	
SPANISH GOV'T 0.75	2,000,000.00	2,047,560.00	
SPANISH GOV'T 1.15	2,000,000.00	2,075,120.00	
SPANISH GOV'T 1.3	2,000,000.00	1,956,660.00	
SPANISH GOV'T 1.4	2,000,000.00	2,082,720.00	
SPANISH GOV'T 1.5	1,500,000.00	1,478,505.00	
SPANISH GOV'T 1.6	2,000,000.00	2,048,460.00	
SPANISH GOV'T 1.95	2,500,000.00	2,596,225.00	
SPANISH GOV'T 1.95	2,000,000.00	1,973,940.00	
SPANISH GOV'T 2.15	2,000,000.00	2,116,720.00	
SPANISH GOV'T 2.35	1,000,000.00	1,002,350.00	
SPANISH GOV'T 2.75	3,000,000.00	3,179,970.00	
SPANISH GOV'T 2.75	3,000,000.00	3,338,250.00	
SPANISH GOV'T 2.9	1,000,000.00	994,770.00	
SPANISH GOV'T 3.45	500,000.00	523,590.00	
SPANISH GOV'T 3.75	2,200,000.00	2,337,654.00	
SPANISH GOV'T 3.8	2,000,000.00	2,374,960.00	
SPANISH GOV'T 4	3,000,000.00	3,363,750.00	
SPANISH GOV'T 4.1	2,000,000.00	2,111,480.00	

	SPANISH GOV'T 4.2	2,050,000.00	2,581,770.00
	SPANISH GOV'T 4.3	3,000,000.00	3,334,560.00
	SPANISH GOV'T 4.4	3,000,000.00	3,674,010.00
	SPANISH GOV'T 4.6	2,500,000.00	2,771,600.00
	SPANISH GOV'T 4.65	3,000,000.00	3,772,290.00
	SPANISH GOV'T 4.7	1,500,000.00	2,021,745.00
	SPANISH GOV'T 4.8	2,000,000.00	2,508,100.00
	SPANISH GOV'T 4.85	2,000,000.00	2,339,620.00
	SPANISH GOV'T 4.9	2,000,000.00	2,758,920.00
	SPANISH GOV'T 5.15	1,500,000.00	2,017,215.00
	SPANISH GOV'T 5.15	2,000,000.00	2,864,000.00
	SPANISH GOV'T 5.4	3,000,000.00	3,811,590.00
	SPANISH GOV'T 5.5	3,000,000.00	3,651,000.00
	SPANISH GOV'T 5.75	2,200,000.00	3,219,678.00
	SPANISH GOV'T 5.85	2,500,000.00	3,152,700.00
	SPANISH GOV'T 5.9	2,500,000.00	3,445,700.00
	SPANISH GOV'T 6	2,900,000.00	4,170,780.00
	ユーロ 小計	585,170,000.00	682,494,872.20 (79,230,829,713)
英債券	UK TSY GILT 0.5	1,000,000.00	999,850.00
	UK TSY GILT 1.25	3,500,000.00	3,552,325.00
	UK TSY GILT 1.5	3,000,000.00	3,138,750.00
	UK TSY GILT 1.5	2,500,000.00	2,613,775.00
	UK TSY GILT 1.5	1,000,000.00	963,600.00
	UK TSY GILT 1.75	3,000,000.00	3,113,250.00
	UK TSY GILT 1.75	3,000,000.00	3,206,220.00
	UK TSY GILT 1.75	1,000,000.00	1,013,800.00
	UK TSY GILT 2	3,000,000.00	3,178,050.00
	UK TSY GILT 2	2,500,000.00	2,733,250.00
	UK TSY GILT 2.25	2,700,000.00	2,982,150.00
	UK TSY GILT 2.5	1,500,000.00	2,008,350.00
	UK TSY GILT 2.75	2,000,000.00	2,292,140.00
	UK TSY GILT 3.25	3,000,000.00	3,987,300.00
	UK TSY GILT 3.5	2,500,000.00	3,490,000.00
	UK TSY GILT 3.5	2,000,000.00	3,420,600.00
	UK TSY GILT 3.75	2,000,000.00	2,176,560.00
	UK TSY GILT 3.75	2,800,000.00	3,143,056.00
	UK TSY GILT 3.75	1,400,000.00	1,612,338.00
	UK TSY GILT 3.75	2,300,000.00	3,643,200.00
	UK TSY GILT 4	1,500,000.00	1,767,525.00
	UK TSY GILT 4	2,000,000.00	3,566,260.00
	UK TSY GILT 4.25	1,300,000.00	1,718,366.00
	UK TSY GILT 4.25	2,000,000.00	2,771,300.00

	UK TSY GILT 4.25	3,000,000.00	4,300,200.00	
	UK TSY GILT 4.25	1,500,000.00	2,221,050.00	
	UK TSY GILT 4.25	2,500,000.00	3,750,750.00	
	UK TSY GILT 4.25	1,900,000.00	3,038,290.00	
	UK TSY GILT 4.25	1,900,000.00	3,157,230.00	
	UK TSY GILT 4.25	2,100,000.00	3,749,970.00	
	UK TSY GILT 4.5	2,000,000.00	2,165,612.00	
	UK TSY GILT 4.5	2,500,000.00	3,632,500.00	
	UK TSY GILT 4.5	2,000,000.00	3,171,580.00	
	UK TSY GILT 4.75	2,700,000.00	3,064,392.00	
	UK TSY GILT 4.75	1,800,000.00	2,579,220.00	
	UK TSY GILT 4.75	1,500,000.00	2,349,750.00	
	UK TSY GILT 5	2,000,000.00	2,650,280.00	
	UK TSY GILT 6	1,200,000.00	1,836,876.00	
	UK TSY GILT 8	1,620,000.00	2,141,575.20	
	英債券 小計	82,720,000.00	106,901,290.20 (14,606,992,292)	
スイスフラン	SWISS (GOVT) 2.25	900,000.00	990,180.00	
	SWISS (GOVT) 3	1,000,000.00	1,082,400.00	
	SWISS (GOVT) 4	500,000.00	634,800.00	
	SWISS (GOVT) 4	700,000.00	1,020,530.00	
	スイスフラン 小計	3,100,000.00	3,727,910.00 (404,776,467)	
スウェーデンクローナ	SWEDISH GOVRNMNT 1	8,000,000.00	8,328,480.00	
	SWEDISH GOVRNMNT 1.5	12,000,000.00	13,068,120.00	
	SWEDISH GOVRNMNT 2.5	8,000,000.00	9,367,760.00	
	SWEDISH GOVRNMNT 3.5	11,000,000.00	13,033,570.00	
	SWEDISH GOVRNMNT 3.5	6,000,000.00	8,213,880.00	
	SWEDISH GOVRNMNT 4.25	12,000,000.00	13,130,640.00	
	SWEDISH GOVRNMNT 5	11,000,000.00	13,150,500.00	
	スウェーデンクローナ 小計	68,000,000.00	78,292,950.00 (949,693,483)	
ノルウェークローネ	NORWEGIAN GOV'T 1.5	5,000,000.00	5,004,000.00	
	NORWEGIAN GOV'T 1.75	5,000,000.00	5,136,500.00	
	NORWEGIAN GOV'T 2	10,000,000.00	10,482,000.00	
	NORWEGIAN GOV'T 3	4,000,000.00	4,461,600.00	
	NORWEGIAN GOV'T 3.75	11,000,000.00	12,239,700.00	
	NORWEGIAN GOV'T 4.5	6,000,000.00	6,482,400.00	
	ノルウェークローネ 小計	41,000,000.00	43,806,200.00 (558,090,988)	
デンマーククローネ	DENMARK - BULLET 0.25	10,000,000.00	10,141,000.00	
	DENMARK - BULLET 1.5	5,000,000.00	5,523,500.00	



	DENMARK - BULLET 1.75	10,000,000.00	11,320,000.00
	DENMARK - BULLET 3	10,000,000.00	11,548,000.00
	DENMARK - BULLET 4	8,000,000.00	8,955,200.00
	DENMARK - BULLET 4.5	17,000,000.00	29,326,700.00
	DENMARK - BULLET 7	3,080,000.00	4,713,016.00
	デンマーククローネ 小計	63,080,000.00	81,527,416.00 (1,272,642,963)
ポーランドズロチ	POLAND GOVT BOND 1.5	3,000,000.00	2,919,900.00
	POLAND GOVT BOND 1.75	3,000,000.00	2,885,400.00
	POLAND GOVT BOND 2	3,000,000.00	2,913,000.00
	POLAND GOVT BOND 2.5	5,000,000.00	5,035,000.00
	POLAND GOVT BOND 2.5	4,000,000.00	3,740,400.00
	POLAND GOVT BOND 3.25	5,000,000.00	4,985,500.00
	POLAND GOVT BOND 4	2,000,000.00	2,107,000.00
	POLAND GOVT BOND 5.25	5,000,000.00	5,097,500.00
	POLAND GOVT BOND 5.25	2,000,000.00	2,180,000.00
	POLAND GOVT BOND 5.5	4,000,000.00	4,316,000.00
	POLAND GOVT BOND 5.75	4,000,000.00	4,492,000.00
	POLAND GOVT BOND 5.75	4,200,000.00	4,786,446.00
	POLAND GOVT BOND 5.75	2,000,000.00	2,449,260.00
	ポーランドズロチ 小計	46,200,000.00	47,907,406.00 (1,309,309,405)
オーストラリアドル	AUSTRALIAN GOVT. 1.75	3,000,000.00	2,986,350.00
	AUSTRALIAN GOVT. 2	1,000,000.00	999,100.00
	AUSTRALIAN GOVT. 2.25	2,000,000.00	1,929,200.00
	AUSTRALIAN GOVT. 2.75	3,000,000.00	3,076,650.00
	AUSTRALIAN GOVT. 2.75	3,000,000.00	3,089,070.00
	AUSTRALIAN GOVT. 2.75	2,000,000.00	2,031,600.00
	AUSTRALIAN GOVT. 2.75	1,000,000.00	1,011,922.00
	AUSTRALIAN GOVT. 2.75	1,000,000.00	952,100.00
	AUSTRALIAN GOVT. 3	1,000,000.00	912,894.00
	AUSTRALIAN GOVT. 3.25	2,000,000.00	2,048,240.00
	AUSTRALIAN GOVT. 3.25	4,000,000.00	4,251,600.00
	AUSTRALIAN GOVT. 3.25	1,500,000.00	1,587,150.00
	AUSTRALIAN GOVT. 3.25	1,000,000.00	994,600.00
	AUSTRALIAN GOVT. 3.75	1,000,000.00	1,081,600.00
	AUSTRALIAN GOVT. 4.25	4,000,000.00	4,572,800.00
	AUSTRALIAN GOVT. 4.5	3,000,000.00	3,237,969.00
	AUSTRALIAN GOVT. 4.5	1,500,000.00	1,797,750.00
	AUSTRALIAN GOVT. 4.75	3,200,000.00	3,826,560.00
	AUSTRALIAN GOVT. 5.25	3,000,000.00	3,202,794.00
	AUSTRALIAN GOVT. 5.5	2,500,000.00	2,965,500.00
	AUSTRALIAN GOVT. 5.75	3,000,000.00	3,446,100.00

	AUSTRALIAN GOVT. 5.75	3,000,000.00	3,544,800.00	
オーストラリアドル 小計		49,700,000.00	53,546,349.00 (4,391,336,081)	
シンガポールドル	SINGAPORE GOV'T 2.25	500,000.00	513,100.00	
	SINGAPORE GOV'T 2.75	1,000,000.00	1,051,800.00	
	SINGAPORE GOV'T 2.75	400,000.00	427,600.00	
	SINGAPORE GOV'T 2.875	400,000.00	426,600.00	
	SINGAPORE GOV'T 3	1,000,000.00	1,067,000.00	
	SINGAPORE GOV'T 3.125	1,000,000.00	1,071,800.00	
	SINGAPORE GOV'T 3.25	1,000,000.00	1,061,000.00	
	SINGAPORE GOV'T 3.375	500,000.00	569,250.00	
	SINGAPORE GOV'T 3.5	1,500,000.00	1,678,710.00	
	SINGAPORE GOV'T 4	2,100,000.00	2,185,260.00	
シンガポールドル 小計		9,400,000.00	10,052,120.00 (783,964,838)	
マレーシアリングgit	MALAYSIA GOVT 3.418	8,000,000.00	7,777,608.00	
	MALAYSIA GOVT 3.502	9,000,000.00	8,433,999.00	
	MALAYSIA GOVT 4.24	5,000,000.00	5,037,500.00	
	MALAYSIA GOVT 4.378	5,000,000.00	5,089,500.00	
マレーシアリングgit 小計		27,000,000.00	26,338,607.00 (647,929,732)	
南アフリカランド	REP SOUTH AFRICA 6.5	60,000,000.00	42,240,000.00	
	REP SOUTH AFRICA 6.75	30,000,000.00	28,861,500.00	
	REP SOUTH AFRICA 7	60,000,000.00	49,368,000.00	
	REP SOUTH AFRICA 8	10,000,000.00	10,069,600.00	
南アフリカランド 小計		160,000,000.00	130,539,100.00 (1,057,366,710)	
合計			201,489,716,795 (201,489,716,795)	

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

通貨	銘柄数	組入債券時価比率	合計金額に対する比率
米ドル	国債証券 233銘柄	44.1%	44.7%
カナダドル	国債証券 30銘柄	2.1%	2.2%
メキシコペソ	国債証券 9銘柄	0.9%	0.9%
ユーロ	国債証券 276銘柄	38.8%	39.3%
英ポンド	国債証券 39銘柄	7.1%	7.2%
スイスフラン	国債証券 4銘柄	0.2%	0.2%
スウェーデンクローナ	国債証券 7銘柄	0.5%	0.5%
ノルウェークローネ	国債証券 6銘柄	0.3%	0.3%
デンマーククローネ	国債証券 7銘柄	0.6%	0.6%
ポーランドズロチ	国債証券 13銘柄	0.6%	0.6%

オーストラリアドル	国債証券	22銘柄	2.1%	2.2%
シンガポールドル	国債証券	10銘柄	0.4%	0.4%
マレーシアリングット	国債証券	4銘柄	0.3%	0.3%
南アフリカランド	国債証券	4銘柄	0.5%	0.5%

## デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## マネーインカム・マザーファンド

## 貸借対照表

	(単位：円)	
	(平成28年 4月13日現在)	(平成29年 4月13日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	473,493,536	-
コール・ローン	-	316,255,179
国債証券	432,382,400	-
特殊債券	405,524,000	1,005,837,000
未収利息	2,563,481	1,448,041
前払費用	-	213,697
流動資産合計	1,313,963,417	1,323,753,917
資産合計	1,313,963,417	1,323,753,917
負債の部		
流動負債		
未払解約金	7,000,713	-
未払利息	-	511
その他未払費用	-	3,177
流動負債合計	7,000,713	3,688
負債合計	7,000,713	3,688
純資産の部		
元本等		
元本	1,290,985,957	1,308,650,457
剰余金		
剰余金又は欠損金( )	15,976,747	15,099,772
元本等合計	1,306,962,704	1,323,750,229
純資産合計	1,306,962,704	1,323,750,229
負債純資産合計	1,313,963,417	1,323,753,917

## 注記表

(重要な会計方針の注記)

項 目	自 平成28年 4月14日 至 平成29年 4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28年 4月13日現在）	（平成29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	1,290,985,957口	1,308,650,457口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.0124円 (10,000口当たりの純資産額 10,124円)	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)

## (金融商品に関する注記)

## . 金融商品の状況に関する事項

項 目	自 平成28年 4月14日 至 平成29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、特殊債券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク</p>

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

#### ・金融商品の時価等に関する事項

項目	(平成29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28年 4月14日 至 平成29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28年 4月13日現在）	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	1,480,579,600円
同期中における追加設定元本額	716,376,125円
同期中における一部解約元本額	905,969,768円
平成28年 4月13日現在における元本の内訳	
S M A M・グローバルバランスファンド（機動的資産配分型）	33,626,531円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2020	28,312,486円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2025	8,934,284円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2030	9,209,457円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2035	5,723,760円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2040	3,286,242円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2045	6,937,555円
米国小型ハイクオリティファンド（毎月決算型）	99,128円
米国小型ハイクオリティファンド（資産成長型）	297,384円
S M A M・マネーインカムファンド＜適格機関投資家限定＞	432,140,183円
S M A M・バランス先物ファンドV A 2 0＜適格機関投資家限定＞	485,731,667円
S M A M・F GマネーファンドV A＜適格機関投資家限定＞	276,687,280円
合計	1,290,985,957円

（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

## 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21回政府保証日本政策投資銀行債券	100,000,000	101,401,000	
	第40回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	201,488,000	
	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	101,467,000	
	第1回政府保証地方公共団体金融機構債券（6年）	100,000,000	100,202,000	
	第875回政府保証公営企業債券	100,000,000	100,185,000	
	第876回政府保証公営企業債券	200,000,000	200,722,000	
	第195回政府保証預金保険機構債	200,000,000	200,372,000	
合計		1,000,000,000	1,005,837,000	

### デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## 2【ファンドの現況】

## 【純資産額計算書】

三井住友・DCターゲットイヤーファンド2040（4資産タイプ）

平成29年 4月28日現在

資産総額	247,548,670円
負債総額	45,244円
純資産総額（ - ）	247,503,426円
発行済口数	171,692,749口
1口当たり純資産額（ / ）	1.4415円
（1万口当たり純資産額）	（14,415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。

## 第二部【委託会社等の情報】

### 第1【委託会社等の概況】

#### 1【委託会社等の概況】

##### イ 資本金の額および株式数

	平成29年 4月28日現在
資本金の額	2,000百万円
会社が発行する株式の総数	60,000株
発行済株式総数	17,640株

##### ロ 最近5年間における資本金の額の増減 該当ありません。

#### 八 会社の機構

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

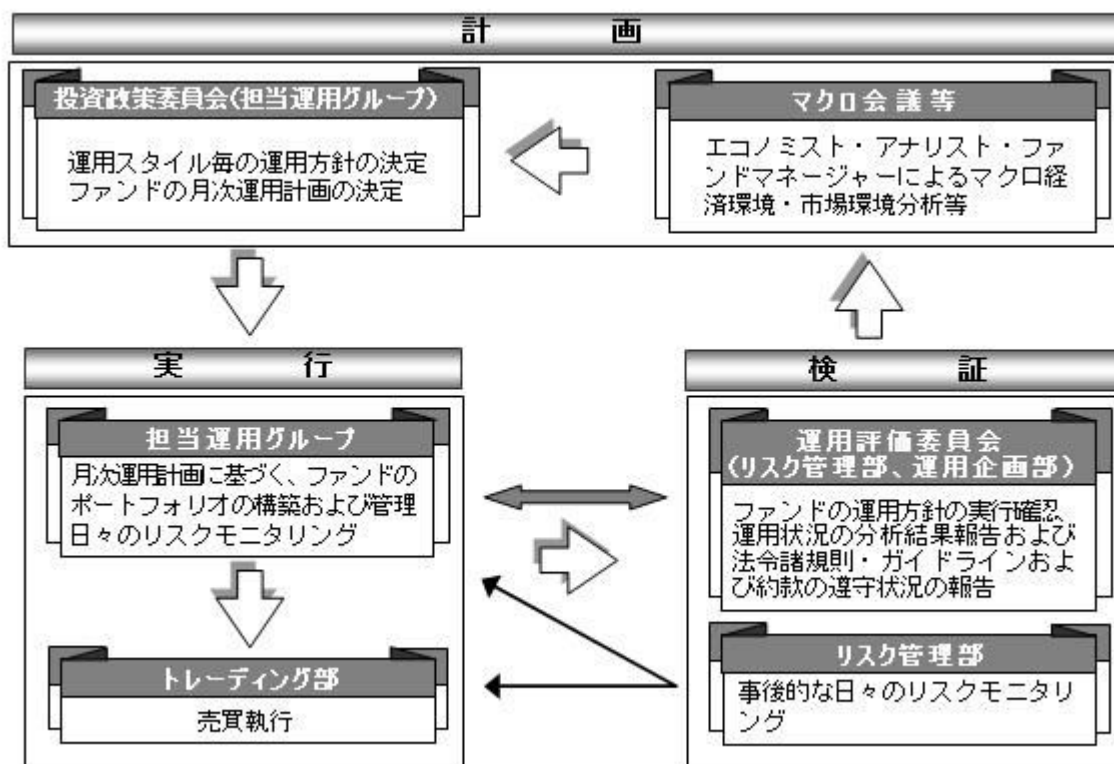
取締役の任期は、選任後1年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会の終結の時までとし、補欠または増員によって選任された取締役の任期は、他の現任取締役の任期の満了する時までとします。

委託会社の業務上重要な事項は、取締役会の決議により決定します。

取締役会は、取締役会の決議によって、代表取締役若干名を選定します。

また、取締役会の決議によって、取締役社長を1名選定します。

#### 二 投資信託の運用の流れ



## 2【事業の内容及び営業の概況】

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

平成29年4月28日現在、委託会社が運用を行っている投資信託（親投資信託は除きます）は、以下の通りです。

（平成29年 4月28日現在）

		本 数(本)	純資産総額(百万円)
株式投資信託	単位型	70 ( 22 )	191,026 ( 84,033 )
	追加型	453 ( 193 )	5,152,670 ( 2,810,575 )
	計	523 ( 215 )	5,343,697 ( 2,894,608 )
公社債投資信託	単位型	96 ( 96 )	401,710 ( 401,710 )
	追加型	1 ( 0 )	28,628 ( 0 )
	計	97 ( 96 )	430,338 ( 401,710 )
合 計		620 ( 311 )	5,774,035 ( 3,296,317 )

( )内は、私募投資信託分であり、内書き表記しております。

## 3【委託会社等の経理状況】

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

2 当社は、当事業年度（平成28年4月1日から平成29年3月31日まで）の財務諸表については、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、有限責任 あずさ監査法人の監査を受けております。

## (1)【貸借対照表】

(単位：千円)

		前事業年度 (平成28年3月31日)	当事業年度 (平成29年3月31日)
資産の部			
流動資産			
現金及び預金	2	10,857,507	13,279,384
顧客分別金信託		20,006	20,008
前払費用		324,934	351,526
未収入金		81,347	40,544
未収委託者報酬		5,418,116	5,511,715
未収運用受託報酬		1,635,461	1,297,104
未収投資助言報酬		382,911	343,523
未収収益		28,813	20,789

繰延税金資産		494,032	482,535
その他の流動資産		6,226	5,560
流動資産合計		19,249,357	21,352,691
固定資産			
有形固定資産	1		
建物		154,246	198,767
器具備品		240,748	261,096
有形固定資産合計		394,995	459,864
無形固定資産			
ソフトウェア		449,034	493,806
ソフトウェア仮勘定		146,452	141,025
電話加入権		79	68
商標権		60	3
無形固定資産合計		595,627	634,903
投資その他の資産			
投資有価証券		13,115,106	12,098,372
関係会社株式		10,412,523	10,412,523
長期差入保証金		603,625	677,681
長期前払費用		32,533	61,282
会員権		17,299	7,819
繰延税金資産		750,481	871,577
投資その他の資産合計		24,931,569	24,129,257
固定資産合計		25,922,192	25,224,025
資産合計		45,171,549	46,576,717

(単位：千円)

	前事業年度 (平成28年3月31日)	当事業年度 (平成29年3月31日)
負債の部		
流動負債		
顧客からの預り金	0	304
その他の預り金	73,103	80,380
未払金		
未払収益分配金	154	655
未払償還金	141,808	140,124
未払手数料	2,479,778	2,424,318
その他未払金	58,453	52,903
未払費用	2,092,669	2,564,625
未払消費税等	317,444	160,571
未払法人税等	992,491	661,467
賞与引当金	982,654	1,001,068
その他の流動負債	-	445
流動負債合計	7,138,557	7,086,864
固定負債		
退職給付引当金	3,028,212	3,177,131
賞与引当金	51,310	40,167
その他の固定負債	693	2,174
固定負債合計	3,080,216	3,219,473
負債合計	10,218,774	10,306,337

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	21,984,811	23,493,074
利益剰余金合計	23,806,015	25,314,279
株主資本計	34,434,999	35,943,263
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	517,775	327,116
評価・換算差額等合計	517,775	327,116
純資産合計	34,952,774	36,270,379
負債・純資産合計	45,171,549	46,576,717

## (2) 【損益計算書】

(単位：千円)

	前事業年度 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)	当事業年度 (自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	32,339,255	31,628,014
運用受託報酬	7,401,835	5,649,190
投資助言報酬	1,909,892	1,726,511
その他営業収益		
情報提供コンサルタント 業務報酬	5,000	5,000
投資法人運用受託報酬	8,546	-
サービス支援手数料	74,038	61,268
その他	55,319	54,261
営業収益計	41,793,887	39,124,246
営業費用		
支払手数料	16,006,652	14,908,517
広告宣伝費	615,596	366,227
公告費	4,507	1,140
調査費		
調査費	1,624,477	1,325,978
委託調査費	4,106,366	4,343,104
営業雑経費		
通信費	43,662	46,030
印刷費	399,236	338,254
協会費	23,328	21,669
諸会費	22,650	20,054
情報機器関連費	2,557,200	2,516,497
販売促進費	31,271	24,896
その他	161,974	149,177
営業費用合計	25,596,925	24,061,549

一般管理費			
給料			
役員報酬		181,739	225,885
給料・手当		5,824,767	6,121,741
賞与		609,597	610,533
賞与引当金繰入額		1,033,964	989,925
交際費		26,912	23,136
寄付金		23	-
事務委託費		540,251	317,928
旅費交通費		277,212	229,248
租税公課		161,628	268,527
不動産賃借料		595,051	622,662
退職給付費用		701,070	423,954
固定資産減価償却費		334,024	384,068
諸経費		354,884	335,840
一般管理費合計		10,641,129	10,553,451
営業利益		5,555,832	4,509,246
営業外収益			
受取配当金	1	36,102	106,651
受取利息	1	3,728	745
時効成立分配金・償還金		1,394	1,721
原稿・講演料		1,766	1,474
雑収入		19,472	12,592
営業外収益合計		62,465	123,184
営業外費用			
為替差損		51,385	9,737
雑損失		-	1,084
営業外費用合計		51,385	10,821
経常利益		5,566,912	4,621,608
特別利益			
投資有価証券償還益		13,036	353,462
投資有価証券売却益		38,823	2,579
投資有価証券清算益		29,214	-
特別利益合計		81,075	356,041
特別損失			
固定資産除却損	2	5,300	8,157
投資有価証券償還損		2,313	43,644
投資有価証券売却損		8,184	15,012
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		15,798	91,884
税引前当期純利益		5,632,188	4,885,765
法人税、住民税及び事業税		1,598,176	1,391,996
法人税等調整額		41,999	25,454
法人税等合計		1,556,177	1,366,541
当期純利益		4,076,011	3,519,223

## (3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

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

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

当事業年度（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		利益準備金	利益剰余金			利益剰余金 合計	株主資本 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	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	634,478	634,478	31,946,027
当期変動額			
剰余金の配当		-	952,560
当期純利益		-	4,076,011
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	116,703	116,703	116,703
当期変動額合計	116,703	116,703	3,006,747
当期末残高	517,775	517,775	34,952,774

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

## [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あります。

## (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あります。

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あります。



#### 数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法

過去勤務費用については、その発生時において一時に費用処理しております。

数理計算上の差異については、その発生時において一時に費用処理しております。

#### 4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

##### 消費税等の会計処理

消費税等の会計処理は税抜方式によっております。

##### (会計方針の変更)

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

この結果、当事業年度の営業利益、経常利益及び税引前当期純利益はそれぞれ2,218千円増加しております。

##### (追加情報)

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

##### (貸借対照表関係)

##### 1 有形固定資産の減価償却累計額

	前事業年度 (平成28年3月31日)	当事業年度 (平成29年3月31日)
建物	281,421千円	291,976千円
器具備品	758,541千円	651,918千円

##### 2 関係会社に対する資産及び負債

	前事業年度 (平成28年3月31日)	当事業年度 (平成29年3月31日)
現金及び預金	4,716,352千円	-千円

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

	前事業年度 (平成28年3月31日)	当事業年度 (平成29年3月31日)
当座借越極度額の総額	10,000,000千円	10,000,000千円
借入実行残高	-千円	-千円
差引額	10,000,000千円	10,000,000千円

##### 4 保証債務

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

	前事業年度 (平成28年3月31日)	当事業年度 (平成29年3月31日)
Sumitomo Mitsui Asset Management (New York) Inc.	296,815千円	256,031千円

## (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27年 4月 1日 至 平成28年 3月31日)	当事業年度 (自 平成28年 4月 1日 至 平成29年 3月31日)
受取配当金	-	106,640千円
受取利息	1,423千円	18千円

## 2 固定資産除却損

	前事業年度 (自 平成27年 4月 1日 至 平成28年 3月31日)	当事業年度 (自 平成28年 4月 1日 至 平成29年 3月31日)
建物	-	6,952千円
器具備品	5,300千円	1,204千円

## (株主資本等変動計算書関係)

前事業年度(自 平成27年 4月 1日 至 平成28年 3月31日)

## 1. 発行済株式数に関する事項

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

## 2. 剰余金の配当に関する事項

## (1) 配当金支払額等

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

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

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

当事業年度(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

(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28年3月31日)	当事業年度 (平成29年3月31日)
1年以内	579,592	626,698
1年超	756,470	191,491
合計	1,336,063	818,190

(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、定期的に取り締役会において報告し、投資家の資金性格、金額、および投資家数等の状況から検討した結果、目的が達成されたと判断した場合には速やかに処分することとしています。

#### (4)金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

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

## 2.金融商品の時価等に関する事項

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

前事業年度（平成28年3月31日）

（単位：千円）

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

当事業年度（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	-

（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28年3月31日)	当事業年度 (平成29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28年3月31日)

(単位：千円)

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

当事業年度(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	-	-

## (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28年3月31日)

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

当事業年度(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、記載していません。

## 2. その他有価証券

前事業年度(平成28年3月31日)

(単位:千円)

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

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

当事業年度(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、記載していません。

## 3. 当事業年度中に売却したその他有価証券

前事業年度(自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)

(単位:千円)

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

当事業年度(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

(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27年4月1日 至 平成28年3月31日)	当事業年度 (自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)
退職給付債務の期首残高	2,633,080	3,028,212
勤務費用	225,881	280,524
利息費用	19,247	-
数理計算上の差異の発生額	285,510	15,494
退職給付の支払額	135,507	116,111
退職給付債務の期末残高	3,028,212	3,177,131

## (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28年3月31日)	当事業年度 (平成29年3月31日)
非積立型制度の退職給付債務	3,028,212	3,177,131
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	3,028,212	3,177,131

## (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27年4月1日 至 平成28年3月31日)	当事業年度 (自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)
勤務費用	225,881	280,524
利息費用	19,247	-
数理計算上の差異の費用処理額	285,510	15,494
その他	170,430	158,924
確定給付制度に係る退職給付費用	701,070	423,954

(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27年 4月 1日 至 平成28年 3月31日)	当事業年度 (自 平成28年 4月 1日 至 平成29年 3月31日)
割引率	0.000%	0.092%

### 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125,210千円、当事業年度137,310千円であります。

(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的主要原因別の内訳

(単位:千円)

	前事業年度 (平成28年 3月31日)	当事業年度 (平成29年 3月31日)
<b>流動の部</b>		
<b>繰延税金資産</b>		
賞与引当金	303,247	308,929
調査費	74,734	79,381
未払金	44,028	45,745
未払事業税	67,598	46,406
その他	7,369	2,071
繰延税金資産小計	496,977	482,535
評価性引当額	2,945	-
繰延税金資産合計	494,032	482,535
<b>固定の部</b>		
<b>繰延税金資産</b>		
退職給付引当金	927,238	972,837
特定外国子会社留保金額	205,413	-
ソフトウェア償却	35,707	18,718
賞与引当金	15,834	12,299
投資有価証券評価損	95	95
その他	5,971	14,592
繰延税金資産小計	1,190,261	1,018,544
評価性引当額	211,267	2,597
繰延税金資産合計	978,994	1,015,946
<b>繰延税金負債</b>		
その他有価証券評価差額金	228,513	144,368
繰延税金負債合計	228,513	144,368
繰延税金資産の純額	1,244,513	1,354,113



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28年3月31日)	当事業年度 (平成29年3月31日)
法定実効税率	33.0%	30.8%
(調整)		
評価性引当額の増減	5.5	0.1
交際費等永久に損金に算入されない項目	0.1	0.2
受取配当等永久に益金に算入されない項目	0.0	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	1.5	2.2
その他	1.3	0.0
税効果会計適用後の法人税等の負担率	27.6	27.9

(注)前事業年度において、独立掲記しておりました「税率変更による期末繰延税金資産の減額修正」は、重要性が乏しくなったため、当事業年度より「その他」に含めて表示しております。この表示方法の変更を反映させるため、前事業年度の内訳の組替えを行っております。この結果、前事業年度の「税率変更による期末繰延税金資産の減額修正」として表示していた1.3%は「その他」として組み替えております。

(セグメント情報等)

前事業年度(自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)

1. セグメント情報

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

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

2. 関連情報

(1) 製品及びサービスごとの情報

(単位：千円)

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

(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。

##### (関連当事者情報)

前事業年度(自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)

##### 1. 関連当事者との取引

(1) 親会社及び主要株主（会社等の場合に限る。）等

(単位:千円)

種類	会社等の名称 又は氏名	所在地	資本金、出資金 又は基金	事業の内容 又は職業	議決権等の 所有(被所有) 割合	関連当事者 との 関係	取引の内容	取引金額	科目	期末残高
その他の 関係会社	(株)三井 住友 銀行	東京都 千代田区	1,770,986,505	銀行業	%  (被所有)  直接 40	投信の販売  委託  役員の兼任	委託販売  手数料	2,740,552	未払手数料	471,118

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

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

投信の販売委託については、一般取引条件を基に、協議の上決定しております。

(2)兄弟会社等

(単位:千円)

種類	会社等の名称 又は氏名	所在地	資本金、出資 金 又は基金	事業の内容 又は職業	議決権等の 所有(被所 有) 割合	関連当事者 との 関係	取引の内容	取引金額	科目	期末残高
その他の 関係会社の 子会社	SMB日興 証券(株)	東京都 千代田 区	10,000,000	証券業	%  -	投信の販売  委託  役員の兼任	子会社株式  の 取得  委託販売  手数料	9,877,717  5,483,224	-  未払手数料	-  912,899

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

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

該当事項はありません。

当事業年度(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	Sumitomo Mitsui Asset Management (Hong Kong) 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	(株)三井住 友 銀行	東京都 千代田区	1,770,986,505	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(株)	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. (株)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(株)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)

(1株当たり情報)

	前事業年度 (自平成27年4月1日 至平成28年3月31日)	当事業年度 (自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)
1株当たり純資産額	1,981,449.82円	2,056,143.98円
1株当たり当期純利益金額	231,066.40円	199,502.47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27年4月1日 至平成28年3月31日)	当事業年度 (自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)
1株当たり当期純利益金額		
当期純利益(千円)	4,076,011	3,519,223
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)	4,076,011	3,519,223
期中平均株式数(株)	17,640	17,640

(重要な後発事象)

該当事項はありません。

4【利害関係人との取引制限】

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

- イ 自己またはその取締役もしくは執行役との間における取引を行うことを内容とした運用を行うこと(投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。)
- ロ 運用財産相互間において取引を行うことを内容とした運用を行うこと(投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。)
- ハ 通常の取引の条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託会社の親法人等(委託会社の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。)または子法人等(委託会社が総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。)と有価証券の売買その他の取引または店頭デリバティブ取引を行うこと。
- ニ 委託会社の親法人等または子法人等の利益を図るため、その行う投資運用業に関して運用の方針、運用財産の額もしくは市場の状況に照らして不必要な取引を行うことを内容とした運用を行うこと。
- ホ 上記ハ、ニに掲げるもののほか、委託会社の親法人等または子法人等が関与する行為であって、投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのあるものとして内閣府令で定める行為。

## 5【その他】

### イ 定款の変更、その他の重要事項

平成29年6月27日付で、定款について以下の変更を行いました。

- (イ) 監査体制の見直しにより監査役の員数を1名減員し5名以内とする定款の変更
- (ロ) 公告の方法を日本経済新聞に掲載する方法から、電子公告(ただし、事故その他やむを得ない事由が生じた場合は、日本経済新聞に掲載)とする平成30年2月1日付効力発生 of 定款の変更
- ロ 訴訟事件その他会社に重要な影響を与えることが予想される事実  
該当ありません。

## 第2【その他の関係法人の概況】

### 1【名称、資本金の額及び事業の内容】

#### イ 受託会社

- (イ) 名称 三井住友信託銀行株式会社
- (ロ) 資本金の額 342,037百万円(平成29年3月末現在)
- (ハ) 事業の内容 銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

#### [参考情報：再信託受託会社の概要]

- ・ 名称 日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社
- ・ 資本金の額 51,000百万円(平成29年3月末現在)
- ・ 事業の内容 銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

#### ロ 販売会社

- (イ) 名称 住友生命保険相互会社

- (ロ) 資本金の額 639,000百万円(平成29年3月末現在の基金および基金償却積立金の合計額を記載しております。)
- (ハ) 事業の内容 保険業法に基づき、生命保険業を営んでいます。

## 2【関係業務の概要】

### イ 受託会社

信託契約の受託会社であり、信託財産の保管・管理・計算等を行います。

### ロ 販売会社

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

## 3【資本関係】

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

## 第3【参考情報】

ファンドについては、当計算期間において以下の書類が提出されております。

提出年月日	提出書類
平成28年 7月 7日	有価証券届出書
平成28年 7月 7日	有価証券報告書
平成29年 1月13日	有価証券届出書の訂正届出書
平成29年 1月13日	半期報告書

**独立監査人の監査報告書**

平成29年 6月16日

三井住友アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

## 有限責任 あずさ監査法人

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている三井住友アセットマネジメント株式会社の平成28年4月1日から平成29年3月31日までの第32期事業年度の財務諸表、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29年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

## 利害関係

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

以 上

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

**独立監査人の監査報告書**

平成29年5月23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）（旧名称：スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2040）の平成28年4月14日から平成29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）（旧名称：スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2040）の平成29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. X B R L データは監査の対象には含まれていません。