

【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	平成29年11月16日提出
【発行者名】	三井住友アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 松下 隆史
【本店の所在の場所】	東京都港区愛宕二丁目5番1号
【事務連絡者氏名】	土田 雅央
【電話番号】	03-5405-0740
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券に係るファンドの名称】	三井住友・DC年金バランスゼロ（債券型）
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券の金額】	継続募集額(平成29年11月17日から平成30年5月16日まで) 2兆5,000億円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【証券情報】

(1)【ファンドの名称】

三井住友・DC年金バランスゼロ（債券型）
（愛称として「マイパッケージZERO」という名称を用いることがあります。）
以下「当ファンド」といいます。

(2)【内国投資信託受益証券の形態等】

追加型証券投資信託の受益権です。

* ファンドの受益権は、社債、株式等の振替に関する法律（以下「社振法」といいます。）の規定の適用を受け、受益権の帰属は、後述の「(11)振替機関に関する事項」に記載の振替機関および当該振替機関の下位の口座管理機関（社振法第2条に規定する「口座管理機関」をいい、振替機関を含め、以下「振替機関等」といいます。）の振替口座簿に記載または記録されることにより定まります（以下、振替口座簿に記載または記録されることにより定まる受益権を「振替受益権」といいます。）。委託会社である三井住友アセットマネジメント株式会社は、やむを得ない事情等がある場合を除き、当該振替受益権を表示する受益証券を発行しません。

当初元本は1口当たり1円です。委託会社の依頼により、信用格付業者から提供され、もしくは閲覧に供された信用格付または信用格付業者から提供され、もしくは閲覧に供される予定の信用格付はありません。

(3)【発行（売出）価額の総額】

2兆5,000億円を上限とします。

(4)【発行（売出）価格】

取得申込受付日の翌営業日の基準価額となります。

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

「基準価額」とは、信託財産の純資産総額を計算日における受益権口数で除した価額をいいます（基準価額は、便宜上1万口単位で表示される場合があります。）。

基準価額は、組入有価証券の値動き等により日々変動します。

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

委託会社に対する照会は下記においてできます。

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

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

(5)【申込手数料】

無手数料です。

(6) 【申込単位】

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

(7) 【申込期間】

2017年11月17日から2018年5月16日まで

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

(8) 【申込取扱場所】

販売会社において申込みを取り扱います。

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

(9) 【払込期日】

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

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

(10) 【払込取扱場所】

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

(11) 【振替機関に関する事項】

当ファンドの振替機関は下記の通りです。

株式会社証券保管振替機構

(12) 【その他】

イ 申込証拠金
ありません。

ロ 日本以外の地域における募集
ありません。

ハ クーリング・オフ制度(金融商品取引法第37条の6)の適用
ありません。

ニ 振替受益権について

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

（参考：投資信託振替制度）

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

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

（1）【ファンドの目的及び基本的性格】

- イ 当ファンドは、「国内債券パッシブ・マザーファンド」および「外国債券パッシブ・マザーファンド」（以下「マザーファンド」といいます。）の受益証券の組入れを通じて、日本を含む世界各国の公社債に分散投資することにより、信託財産の着実な成長を目指した運用を行います。
- ロ 当ファンドの運用にあたっては、債券、短期金融資産を基本資産配分の比率により独自に作成した合成指数をベンチマークとして、中長期的にベンチマークに連動する投資成果を目指します。詳細については、後述の「2 投資方針」をご参照ください。
- ハ 委託会社は、受託会社と合意の上、金5,000億円を限度として信託金を追加することができます。この限度額は、委託会社、受託会社の合意により変更できます。
- ニ 当ファンドが該当する商品分類、属性区分は次の通りです。

（イ）当ファンドが該当する商品分類

項目	該当する商品分類	内容
単位型・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）	債券	目論見書または信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に債券を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
補足分類	インデックス型	目論見書または信託約款において、各種指数に連動する運用成果を目指す旨の記載があるものをいいます。

（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（債券、短期金融資産））	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す。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債券であり、ファンドの収益は債券市場の動向に左右されるものであるため、商品分類上の投資対象資産（収益の源泉）は「債券」となります。
決算頻度	年1回	目論見書または信託約款において、年1回決算する旨の記載があるものをいいます。
投資対象地域	グローバル（日本を含む）	目論見書または信託約款において、組入資産による投資収益が日本を含む世界の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
投資形態	ファミリーファンド	目論見書または信託約款において、親投資信託（ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除く。）を投資対象として投資するものをいいます。

為替ヘッジ	為替ヘッジなし	目論見書または信託約款において、対円での為替のヘッジを行わない旨の記載があるものまたは対円での為替のヘッジを行う旨の記載がないものをいいます。
対象インデックス	その他の指数 (合成指数)	目論見書または信託約款において、委託会社が定める合成指数に連動する運用成果を目指す旨の記載があるものをいいます。

商品分類表

単位型・追加型	投資対象地域	投資対象資産 (収益の源泉)	補足分類
単位型	国内	株式	インデックス型
追加型	海外	債券	
		不動産投信	
		その他資産 ()	特殊型
	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	対象インデックス
株式	年1回	グローバル (日本を含む)			
一般	年2回	日本			日経225
大型株	年4回	北米			
中小型株	年6回(隔月)	欧州	ファミリーファンド	あり	
債券	年12回(毎月)	アジア			
一般	日々	オセアニア			TOPIX
公債	その他	中南米			
社債	()	アフリカ	ファンド・オブ・ファンズ	なし	
その他債券					
クレジット属性					
()					
不動産投信					
その他資産					
(投資信託証券		中近東(中東)			その他
(債券、短期		エマージング			(合成指数)
金融資産))					
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、対円ででの為替変動リスクに対するヘッジの有無を記載しています。商品分類、属性区分は、一般社団法人投資信託協会「商品分類に関する指針」に基づき記載しています。商品分類、属性区分の全体的な定義等は一般社団法人投資信託協会のホームページ（<http://www.toushin.or.jp/>）をご覧ください。

（２）【ファンドの沿革】

2014年12月15日 信託契約締結、設定、運用開始。

（３）【ファンドの仕組み】

イ 当ファンドの関係法人とその役割

（イ）委託会社 「三井住友アセットマネジメント株式会社」

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

（ロ）受託会社 「三井住友信託銀行株式会社」

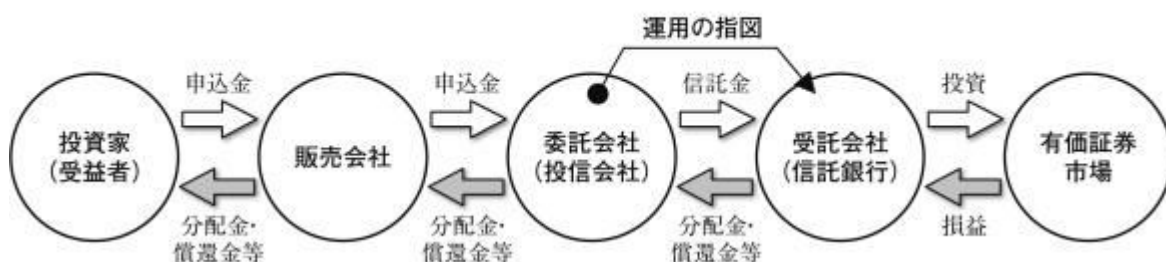
証券投資信託契約に基づき、信託財産の保管・管理・計算等を行います。なお、信託事務の一部につき、日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社に委託することがあります。また、外国における資産の保管は、その業務を行うに十分な能力を有すると認められる外国の金融機関が行う場合があります。

（ハ）販売会社

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

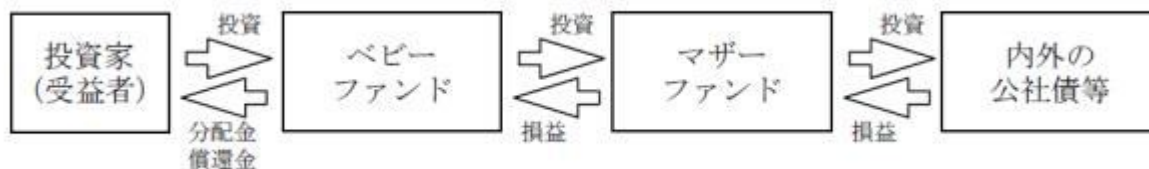
委託会社は販売会社としての役割も有します。

運営の仕組み



当ファンドの運用は、「ファミリーファンド方式」で行われます。

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



□ 委託会社の概況

(イ) 資本金の額

2,000百万円（2017年 9月29日現在）

(ロ) 会社の沿革

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

(ハ) 大株主の状況

（2017年 9月29日現在）

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

2【投資方針】

(1)【投資方針】

イ 基本方針

内外の公社債に投資する2つのマザーファンドの組入れを通じて、日本を含む世界各国の公社債に分散投資することにより、信託財産の着実な成長を目指した運用を行います。

国内債券	国内債券パッシブ・マザーファンド
外国債券	外国債券パッシブ・マザーファンド

ロ 投資態度

(イ) マザーファンド受益証券への投資を通じて行う各資産への実質的な基本資産配分は下記の通りとします。

ただし、それぞれの資産の時価変動等に伴う各資産比率の変化については、一定の範囲（±3%）を設けて調整を行います。

債券	95%
国内債券	75%
外国債券	20%

短期金融資産	5%
--------	----

- (ロ) 当ファンドの運用は、以下の比率により委託会社が独自に作成した合成指数をベンチマークとし、中長期的にベンチマークに連動する投資成果を目指します。

NOMURA - B P I (総合)	75%
シティ世界国債インデックス(除く日本、円ベース)	20%
有担保コール翌日物	5%

- (ハ) 実質外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行わないことを基本とします。
(ニ) 資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

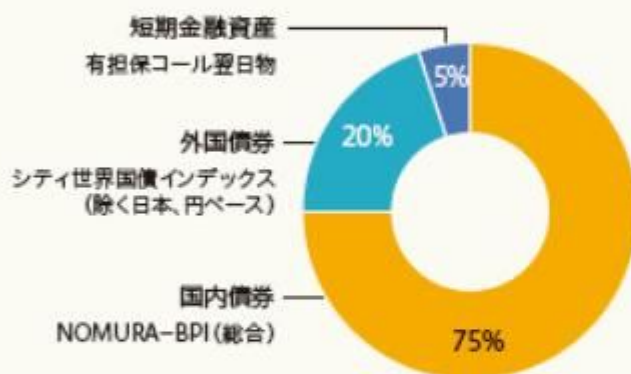
ファンドの特色

1 内外の公社債に投資する2つのマザーファンドの組入れを通じて、日本を含む世界各国の公社債に分散投資することにより、信託財産の着実な成長を目指した運用を行います。

2 国内債券、外国債券および短期金融資産への実質的な基本資産配分は下記の通りとします。

- それぞれの資産の時価変動等に伴う各資産比率の変化については、一定の範囲（±3%）を設けて調整を行います。

[基本資産配分イメージ]



NOMURA-BPI(総合)、シティ世界国債インデックスは、それぞれ野村證券株式会社、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。

*「有担保コール翌日物」、「シティ世界国債インデックス(除く日本、円ベース)」、「NOMURA-BPI(総合)」は、各資産の代表的な指数等であり、当ファンドの合成指数を構成するものです。

※上図はイメージであり、実際とは異なる場合があります。

3 運用にあたっては、委託会社が独自に作成した合成指数をベンチマークとし、中長期的にベンチマークに連動する投資成果を目指します。

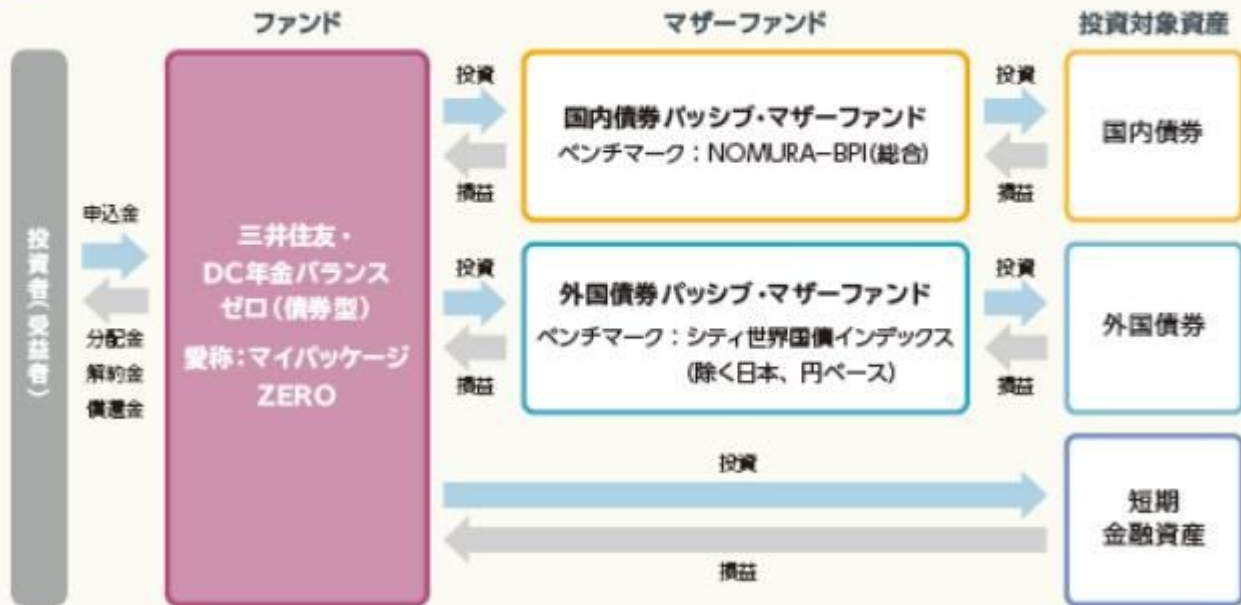
- ベンチマークの資産別合成比率は、**NOMURA-BPI(総合)** 75%、**シティ世界国債インデックス(除く日本、円ベース)** 20%、**有担保コール翌日物** 5%となります。

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

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

ファンドのしくみ

- ファミリーファンド方式で運用を行います。
- 各マザーファンドは、それぞれのベンチマークに連動する投資成果を目指して運用を行います。



各マザーファンドの投資方針等

国内債券パッシブ・マザーファンド

[投資方針]

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

[運用プロセス]



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、銘柄入替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。

トラッキングエラーとは

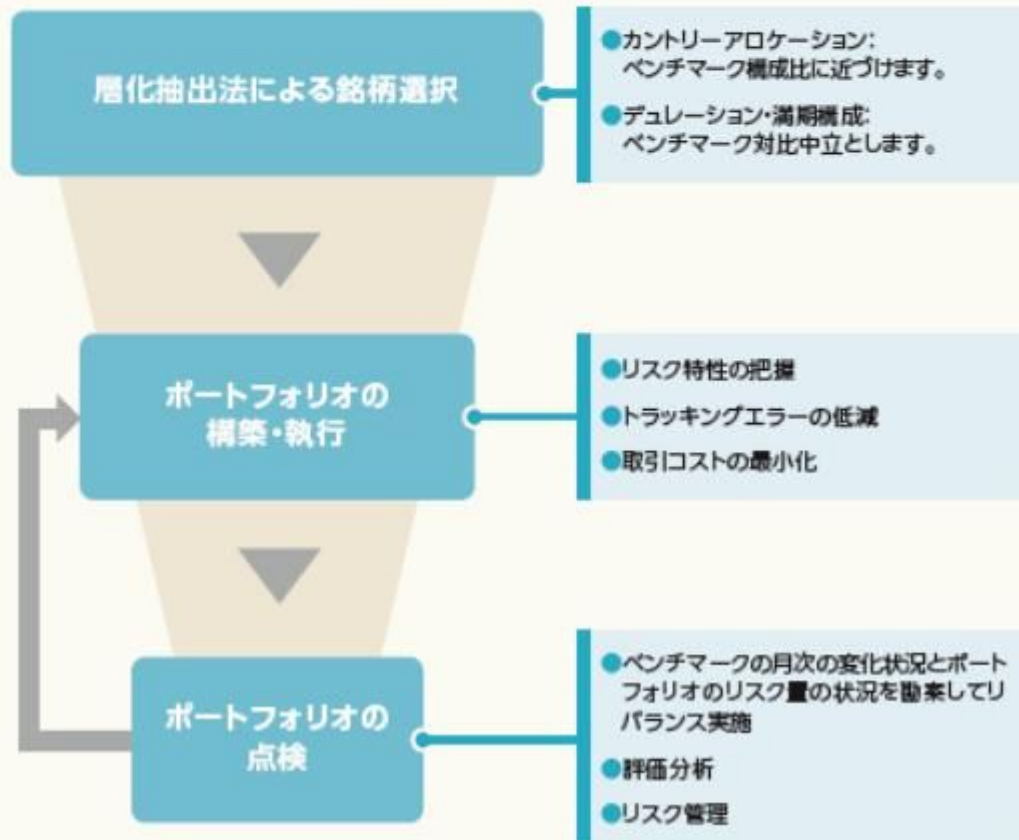
ポートフォリオとベンチマークのリターンの乖離のことをいいます。

▶ 外国債券パッシブ・マザーファンド

[投資方針]

- 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)の動きに連動する投資成果を目指した運用を行います。
- ポートフォリオの作成にあたっては、マルチファクターモデルおよび委託会社独自のリスクモデルを併用して、層化抽出法により、通貨配分、国別配分、デュレーション、満期構成等を可能な限り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。

[運用プロセス]



ベンチマークの推移

- ・以下のグラフは、ファンドのベンチマーク(合成指数)の推移です。
- ・ファンドの値動きのイメージをつかんでいただくため、ベンチマークの推移と国内外の主要な出来事を含わせて記載したものであり、ファンドの運用実績ではありません。
- ・ファンドの実際の運用実績は、後掲「基準価額・純資産の推移」をご覧ください。
- ・ファンドの将来の運用成果等を示唆あるいは保証するものではありません。



※データは1997年9月末～2017年9月末、1997年9月末を100として指数化。

※有価証券売買時のコストや信託報酬等の費用負担、組入る有価証券の売買のタイミング等の影響から、当ファンドの値動きは上記推移とは異なります。

※ベンチマークである合成指数のデータは、当ファンドの基本資産配分で組み合わせたデータを用いて、委託会社が独自に計算したものであり、ベンチマークを構成する各指数の著作権、知的所有権、その他一切の権利は発行者、許諾者が有しています。これら発行者、許諾者は当ファンドの運営に何ら関与するものではなく、当ファンドの運用成果に対して一切の責任を負うものではありません。

ベンチマークの詳細は、前掲「ファンドの特色 3」をご覧ください。

(出所) FactSetのデータを基に三井住友アセットマネジメント作成

(2) 【投資対象】

イ 投資対象とする資産の種類

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

1. 有価証券
2. デリバティブ取引にかかる権利

3. 金銭債権

4. 約束手形

(口) 特定資産以外の資産で、以下に掲げる資産

1. 為替手形

口 投資対象とする有価証券

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

1. 株券または新株引受権証書

2. 国債証券

3. 地方債証券

4. 特別の法律により法人の発行する債券

5. 社債券（新株引受権証書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. 受益証券発行信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定めるものをいいます。）

20. 外国の者に対する権利で、貸付債権信託受益権であって前号の有価証券に表示されるべき権利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、上記口の有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用する

ことを指図することができます。

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

（3）【運用体制】

イ 運用体制

当ファンドの運用は、次のプロセスに基づいて行われます。

（イ）計画（Plan）

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

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

（ロ）実行（Do）

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

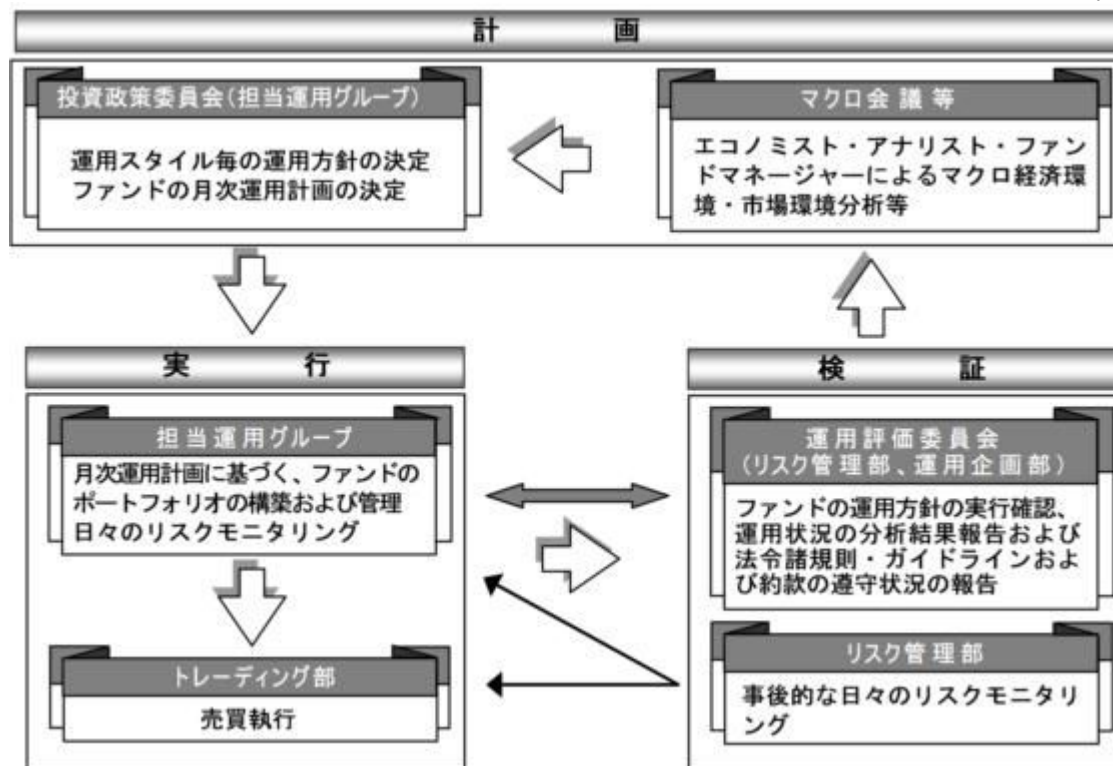
売買執行については、組織的に分離されたトレーディング部が、最良と思われる手法をもって売買を執行します。

（ハ）検証（Check）

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

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

【ファンドの運用体制】



リスク管理部は11名程度、運用企画部は9名程度で構成されています。

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

□ 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】

年1回（原則として毎年2月18日、ただし休業日の場合は翌営業日）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 分配対象額の範囲は、繰越分を含めた利子、配当収益と売買益（評価損益を含みます。）等の全額とします。
- ロ 収益分配金額は、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象収益が少額の場合等には委託会社の判断により収益分配を行わない場合もあるため、将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。
- ハ 留保益の運用については特に制限を定めず、委託会社の判断に基づき、前記「（１）投資方針」と同一の運用を行います。

ファンドは複利効果による信託財産の成長を優先するため、分配を極力抑制します。

（基準価額水準、市況動向等によっては変更する場合があります。）

（５）【投資制限】

ファンドの信託約款に基づく主要な投資制限

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

- 投資信託証券(マザーファンド受益証券および上場投資信託証券を除きます。)への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- 八 外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の50%以下とします。
- 二 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

ファンドの信託約款に基づくその他の投資制限

イ 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。

□ 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、取引所に上場され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され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。

八 信用取引の指図

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

二 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、日本の取引所における有価証券先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。)、有価証券指数等先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。)および有価証券オプション取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。)ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めて取り扱うものとします(以下同じ。)
- (ロ) 委託会社は、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、日本の取引所における通貨にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うこと

の指図をすることができます。

- (ハ) 委託会社は、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、日本の取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。

ホ 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総額とマザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額（「スワップ取引の想定元本の合計額」といいます。）が、信託財産の純資産総額を超えないものとしします。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、委託者は、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します。
- (ニ) 上記（ハ）においてマザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の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信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
- (ホ) 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します。
- (ヘ) 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します。

ヘ 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総額とマザーファンドの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総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額（「金利先渡取引および為替先渡取引の想定元本の合計額」といいます。）が、信託財産の純資産総額を超えないものとしします。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します。
- (ニ) 上記（ハ）においてマザーファンドの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総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの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信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
- (ホ) 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。

- (ヘ) 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。
- (ト) 「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。
- (チ) 「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。

ト 有価証券の貸付けの指図

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

チ 有価証券の空売りの指図

- (イ) 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産において有しない有価証券または借り入れた有価証券を売り付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、売り付けた有価証券の引渡しまたは買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。
- (ロ) 上記（イ）の売付けの指図は、当該売付けにかかる有価証券の時価総額が信託財産の純資産総額を超えない範囲で行うものとします。
- (ハ) 信託財産の一部解約等の事由により、上記（ロ）の売付けにかかる有価証券の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する売付けの一部を決済するための指図をするものとします。

リ 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)の借入れの指図は、当該借入れにかかる有価証券の時価総額が信託財産の純資産総額を超えない範囲で行うものとします。
- (ハ) 信託財産の一部解約等の事由により、上記(ロ)の借入れにかかる有価証券の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する借り入れた有価証券の一部を返還するための指図をするものとします。
- (二) 借入れにかかる品借料は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。

ヌ 特別の場合の外貨建有価証券への投資制限

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

ル 外国為替予約取引の指図

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

ヲ 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、資金の借入れ（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、有価証券等の売却代金、解約代金または償還金の入金日までに限るものとし、資金借入額は、次の各号に掲げる要件を満たす範囲内の額とします。
 1. 一部解約金の支払資金の手当てのために行った有価証券等の売却等による受取りの確定している資金の額の範囲内
 2. 一部解約金支払日の前営業日において確定した当該支払日における支払資金の不足額の範囲内
 3. 借入れ指図を行う日における信託財産の純資産総額の10%以内
- (ハ) 収益分配金の再投資にかかる借入期間は信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。
- (二) 借入金の利息は受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。

法令に基づく投資制限

イ 同一法人の発行する株式への投資制限（投資信託及び投資法人に関する法律第9条）

委託会社は、同一の法人の発行する株式を、その運用の指図を行うすべての委託者指図型投資信託につき、信託財産として有する当該株式にかかる議決権の総数（株主総会において決議をすることができる事項の全部につき議決権を行使することができない株式についての議決権を除き、会社法第879条第3項の規定により議決権を有するものとみなされる株式についての議決権を含みます。）が、当該株式にかかる議決権の総数に100分の50を乗じて得た数を超えることとなる

場合においては、信託財産をもって当該株式を取得することを受託会社に指図することが禁じられています。

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

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

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

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

(参考情報:マザーファンドの投資方針等)

(国内債券パッシブ・マザーファンド)

(1)投資方針等

イ 基本方針

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

□ 投資態度

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

(□) 公社債の組入比率は原則として高位を保ちます。

(八) 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。

□ 投資対象とする有価証券

前記「2 投資方針 (2)投資対象 □ 投資対象とする有価証券」において記載したベビーファンドが投資対象とする有価証券の各号(第1号から第20号まで)に掲げるものに投資します。

八 投資対象とする金融商品

前記「2 投資方針 (2)投資対象 八 投資対象とする金融商品」において記載したベビーファンドが投資対象とする金融商品に同じです。

(3)投資制限

イ ファンドの信託約款に基づく主要な投資制限

(イ) 株式(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。

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

(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20号まで)に掲げるものに投資します(ただし、投資法人債券を除きます。)

ハ 投資対象とする金融商品

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

(3) 投資制限

イ ファンドの信託約款に基づく主要な投資制限

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

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

3【投資リスク】

イ ファンドのもつリスクの特性

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

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

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

(イ) 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。

(ロ) 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。

(ハ) 為替変動リスク

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

(ニ) 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。

特に投資先が新興国の場合、その証券市場は先進国の証券市場に比べ、より運用上の制約が大きいことが想定されます。また、先進国に比べ、一般に市場規模が小さいため、有価証券の需給変動の影響を受けやすく、価格形成が偏ったり、変動性が大きくなる傾向が考えられます。

(ホ) 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。

(ヘ) 指数と連動しない要因

ファンドは、委託会社が独自に作成した合成指数に連動する投資成果を目指して運用を行います。

す。ただし、有価証券売買時のコストおよび信託報酬その他のファンド運営にかかる費用、追加設定・解約に伴う組入有価証券の売買のタイミング差、インデックス構成銘柄と組入有価証券との誤差の影響等から、上記合成指数に連動しないことがあります。

(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。

年間騰落率：
2012年10月～2017年9月
(2015年11月以前はベンチマークの騰落率)

分配金再投資基準価額：
2014年12月～2017年9月



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

「ファンドと他の代表的な 資産クラスとの騰落率の比較」

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

ファンド：
2012年10月～2017年9月
(2015年11月以前はベンチマークの騰落率)

他の資産クラス：
2012年10月～2017年9月



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

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

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

無手数料です。

(2) 【換金（解約）手数料】

解約手数料はありません。

(3) 【信託報酬等】

純資産総額に年0.2376%（税抜き0.22%）の率を乗じて得た金額が信託報酬として計算され、信託財産の費用として計上されます。

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

信託報酬 = 運用期間中の基準価額 × 信託報酬率

信託報酬の実質的配分は以下の通りです。

< 信託報酬の配分（税抜き） >

支払先	料率	役務の内容
委託会社	年0.09%	ファンド運用の指図等の対価
販売会社	年0.1%	交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
受託会社	年0.03%	ファンド財産の保管および管理、委託会社からの指図の実行等の対価

上記の各支払先の料率には別途消費税等相当額がかかります。

委託会社が販売会社として募集の取扱い等をした部分については、販売会社配分相当額も委託会社が収受します。

(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、各計算期間の最初の6ヵ月終了日と各計算期末または信託終了のときに、信託財産中から支弁するものとします。監査費用は、将来、監査法人との契約等により変更となることがあります。
- ロ 信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用および受託会社の立て替えた立替金の利息は、信託財産中から支弁します。
- ハ 有価証券の売買時の手数料、デリバティブ取引等に要する費用、および外国における資産の保管等に要する費用等（それらにかかる消費税等相当額を含みます。）は、信託財産中から支弁するものとします。

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

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

(5) 【課税上の取扱い】

イ 個別元本について

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

ロ 一部解約時および償還時の課税について

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

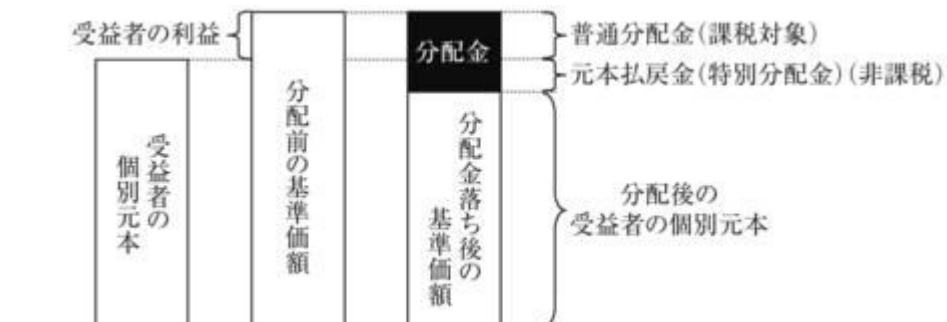
ハ 収益分配金の課税について

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

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



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



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

二 個人、法人別の課税の取扱いについて

（イ）個人の受益者に対する課税

・ 収益分配時

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

・ 一部解約時および償還時

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

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

（ロ）法人の受益者に対する課税

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

当ファンドは、課税上は株式投資信託として取り扱われます。

公募株式投資信託は税法上、少額投資非課税制度「NISA（ニーサ）」、未成年者少額投資非課税制度「ジュニアNISA（ニーサ）」の適用対象です。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。

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50%以下とします。

非株式割合に関する制限はありません（約款規定なし）。

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、2017年9月末現在の情報をもとに作成しています。税法の改正等により、変更されることがあります。

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

5【運用状況】

（1）【投資状況】

三井住友・DC年金バランスゼロ（債券型）

2017年 9月29日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)

親投資信託受益証券	日本	84,132,587	94.97
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		4,453,436	5.03
合計(純資産総額)		88,586,023	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年金バランスゼロ(債券型)

イ 主要投資銘柄

2017年 9月29日現在

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価(円)	帳簿価額(円)	評価額単価(円)	評価額(円)	投資比率(%)
日本	親投資信託受益証券	国内債券パッシブ・マザーファンド	52,939,977	1.2460	65,966,746	1.2531	66,339,085	74.89
日本	親投資信託受益証券	外国債券パッシブ・マザーファンド	10,025,638	1.6707	16,750,444	1.7748	17,793,502	20.09

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

2017年 9月29日現在

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	94.97
合計	94.97

【投資不動産物件】

三井住友・DC年金バランスゼロ(債券型)

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

三井住友・DC年金バランスゼロ(債券型)

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

三井住友・DC年金バランスゼロ（債券型）

年月日	純資産総額 （円）		1万口当たりの 純資産額（円）	
	（分配落）	（分配付）	（分配落）	（分配付）
第1期 (2016年 2月18日)	8,827,175	8,827,175	10,118	10,118
第2期 (2017年 2月20日)	71,065,592	71,065,592	10,036	10,036
2016年 9月末日	52,154,851		10,136	
10月末日	53,158,910		10,116	
11月末日	54,182,019		10,147	
12月末日	71,699,190		10,165	
2017年 1月末日	73,635,288		10,070	
2月末日	71,601,922		10,082	
3月末日	74,245,052		10,070	
4月末日	75,731,858		10,120	
5月末日	83,985,494		10,134	
6月末日	85,479,855		10,148	
7月末日	86,973,931		10,147	
8月末日	88,643,174		10,215	
9月末日	88,586,023		10,208	

【分配の推移】

三井住友・DC年金バランスゼロ（債券型）

	計算期間	1万口当たり分配金（円）
第1期	2014年12月15日～2016年 2月18日	0
第2期	2016年 2月19日～2017年 2月20日	0

【収益率の推移】

三井住友・DC年金バランスゼロ（債券型）

	収益率（％）
第1期	1.2
第2期	0.8
第3期（中間期）	1.2

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

（４）【設定及び解約の実績】

三井住友・DC年金バランスゼロ（債券型）

	設定口数（口）	解約口数（口）
第1期	10,149,579	1,424,968
第2期	73,536,464	11,450,065
第3期（中間期）	19,707,798	4,482,084

（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

国内債券パッシブ・マザーファンド

2017年 9月29日現在

資産の種類	国／地域	時価合計 （円）	投資比率 （％）
国債証券	日本	164,662,808,370	74.11
地方債証券	日本	19,562,026,414	8.80
特殊債券	日本	28,016,217,901	12.61
社債券	日本	8,054,962,000	3.63
	オランダ	500,972,000	0.23
	アメリカ	200,592,000	0.09
	オーストラリア	200,558,000	0.09
	小計	8,957,084,000	4.03
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		991,170,389	0.45
合計（純資産総額）		222,189,307,074	100.00

外国債券パッシブ・マザーファンド

2017年 9月29日現在

資産の種類	国／地域	時価合計 （円）	投資比率 （％）
国債証券	アメリカ	85,027,873,034	42.57
	フランス	20,325,295,812	10.18
	イタリア	19,289,702,520	9.66
	ドイツ	14,237,713,475	7.13
	イギリス	13,831,709,425	6.93
	スペイン	11,442,179,726	5.73

	ベルギー	4,935,194,830	2.47
	オーストラリア	4,335,800,617	2.17
	カナダ	4,245,827,018	2.13
	オランダ	4,187,389,621	2.10
	オーストリア	3,156,893,028	1.58
	メキシコ	1,739,305,183	0.87
	アイルランド	1,682,849,251	0.84
	デンマーク	1,266,418,408	0.63
	フィンランド	1,254,447,818	0.63
	ポーランド	1,170,092,466	0.59
	南アフリカ	1,093,559,068	0.55
	スウェーデン	959,534,812	0.48
	マレーシア	896,539,809	0.45
	シンガポール	827,235,927	0.41
	ノルウェー	617,637,236	0.31
	スイス	424,153,732	0.21
	小計	196,947,352,816	98.61
	現金・預金・その他の資産(負債控除後)	2,780,614,186	1.39
	合計(純資産総額)	199,727,967,002	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		1,449,618	0.00
	売建		1,066,990,956	0.53

(2) 投資資産

投資有価証券の主要銘柄

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)

2017年 9月29日現在

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
日本	国債証券	第310回利付国債(10年)	3,080,000,000	103.77	3,196,300,800	103.30	3,181,670,800	1.000	2020/9/20	1.43
日本	国債証券	第329回利付国債(10年)	2,800,000,000	105.39	2,950,920,000	104.95	2,938,852,000	0.800	2023/6/20	1.32
日本	国債証券	第131回利付国債(5年)	2,650,000,000	101.06	2,678,090,000	100.82	2,671,942,000	0.100	2022/3/20	1.20
日本	国債証券	第128回利付国債(5年)	2,605,000,000	100.93	2,629,434,900	100.74	2,624,407,250	0.100	2021/6/20	1.18

日本	国債証券	第344回利付国債(10年)	2,351,000,000	100.65	2,366,281,500	100.62	2,365,693,750	0.100	2026/9/20	1.06
日本	国債証券	第346回利付国債(10年)	2,300,000,000	100.55	2,312,685,900	100.56	2,312,995,000	0.100	2027/3/20	1.04
日本	国債証券	第312回利付国債(10年)	2,145,000,000	104.75	2,247,080,550	104.20	2,235,261,600	1.200	2020/12/20	1.01
日本	国債証券	第313回利付国債(10年)	2,105,000,000	105.45	2,219,764,600	104.86	2,207,324,050	1.300	2021/3/20	0.99
日本	国債証券	第124回利付国債(5年)	2,140,000,000	100.73	2,155,622,000	100.57	2,152,219,400	0.100	2020/6/20	0.97
日本	国債証券	第345回利付国債(10年)	2,118,000,000	100.57	2,130,093,780	100.64	2,131,618,740	0.100	2026/12/20	0.96
日本	国債証券	第340回利付国債(10年)	1,960,000,000	103.38	2,026,281,000	103.22	2,023,229,600	0.400	2025/9/20	0.91
日本	国債証券	第342回利付国債(10年)	1,980,000,000	100.74	1,994,673,000	100.76	1,995,048,000	0.100	2026/3/20	0.90
日本	国債証券	第343回利付国債(10年)	1,980,000,000	100.72	1,994,366,550	100.69	1,993,761,000	0.100	2026/6/20	0.90
日本	国債証券	第341回利付国債(10年)	1,877,000,000	102.53	1,924,612,400	102.46	1,923,249,280	0.300	2025/12/20	0.87
日本	国債証券	第339回利付国債(10年)	1,835,000,000	103.34	1,896,289,000	103.20	1,893,793,400	0.400	2025/6/20	0.85
日本	国債証券	第315回利付国債(10年)	1,800,000,000	105.38	1,896,930,000	104.82	1,886,832,000	1.200	2021/6/20	0.85
日本	国債証券	第130回利付国債(5年)	1,800,000,000	101.07	1,819,404,000	100.80	1,814,454,000	0.100	2021/12/20	0.82
日本	国債証券	第333回利付国債(10年)	1,705,000,000	104.61	1,783,609,500	104.21	1,776,814,600	0.600	2024/3/20	0.80
日本	国債証券	第129回利付国債(5年)	1,610,000,000	100.97	1,625,697,500	100.77	1,622,477,500	0.100	2021/9/20	0.73
日本	国債証券	第335回利付国債(10年)	1,550,000,000	103.97	1,611,618,000	103.73	1,607,892,500	0.500	2024/9/20	0.72
日本	国債証券	第59回利付国債(20年)	1,455,000,000	110.03	1,601,023,800	109.26	1,589,762,100	1.700	2022/12/20	0.72
日本	特殊債券	第103回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1,500,000,000	103.73	1,556,010,000	103.31	1,549,650,000	1.300	2020/3/19	0.70
日本	国債証券	第125回利付国債(5年)	1,520,000,000	100.79	1,532,129,600	100.60	1,529,256,800	0.100	2020/9/20	0.69
日本	国債証券	第338回利付国債(10年)	1,455,000,000	103.32	1,503,314,000	103.17	1,501,210,800	0.400	2025/3/20	0.68
日本	国債証券	第347回利付国債(10年)	1,430,000,000	100.72	1,440,304,350	100.48	1,436,906,900	0.100	2027/6/20	0.65
日本	国債証券	第325回利付国債(10年)	1,365,000,000	104.79	1,430,443,650	104.36	1,424,514,000	0.800	2022/9/20	0.64
日本	国債証券	第330回利付国債(10年)	1,335,000,000	105.58	1,409,533,050	105.14	1,403,712,450	0.800	2023/9/20	0.63
日本	国債証券	第147回利付国債(20年)	1,135,000,000	119.19	1,352,806,500	119.27	1,353,714,500	1.600	2033/12/20	0.61
日本	国債証券	第154回利付国債(20年)	1,180,000,000	112.21	1,324,125,200	112.55	1,328,196,200	1.200	2035/9/20	0.60
日本	国債証券	第334回利付国債(10年)	1,265,000,000	104.71	1,324,598,100	104.30	1,319,483,550	0.600	2024/6/20	0.59

□ 種類別の投資比率

2017年 9月29日現在

種類	投資比率(%)
国債証券	74.11

地方債証券	8.80
特殊債券	12.61
社債券	4.03
合計	99.55

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）

2017年 9月29日現在

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.375	8,000,000	11,203.69	896,295,590	11,451.78	916,142,623	2.375	2024/8/15	0.46
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.25	7,500,000	11,025.65	826,924,151	11,287.09	846,531,844	2.250	2025/11/15	0.42
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2	7,500,000	10,795.02	809,626,860	11,095.97	832,198,405	2.000	2025/8/15	0.42
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.5	7,000,000	11,333.34	793,333,993	11,547.77	808,344,556	2.500	2024/5/15	0.40
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.25	7,000,000	11,109.54	777,667,905	11,347.85	794,350,188	2.250	2024/11/15	0.40
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.25	7,000,000	11,174.82	782,237,979	11,220.15	785,411,047	2.250	2027/2/15	0.39
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2	7,000,000	10,850.26	759,518,375	11,140.01	779,800,972	2.000	2025/2/15	0.39
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 3.625	6,000,000	12,232.96	733,977,984	12,909.34	774,560,784	3.625	2043/8/15	0.39
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 3	5,000,000	15,485.20	774,260,428	15,250.91	762,545,715	3.000	2022/4/25	0.38
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 4.25	4,500,000	17,020.56	765,925,419	16,678.78	750,545,375	4.250	2023/10/25	0.38
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 1.625	7,000,000	10,381.64	726,715,217	10,708.46	749,592,855	1.625	2026/5/15	0.38
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 1.5	7,000,000	10,265.19	718,563,566	10,567.55	739,728,980	1.500	2026/8/15	0.37
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 4.5	3,500,000	20,927.86	732,475,117	20,840.31	729,410,932	4.500	2041/4/25	0.37
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.75	6,200,000	11,514.31	713,887,385	11,735.36	727,592,890	2.750	2023/11/15	0.36
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 3.75	5,000,000	14,935.66	746,783,063	14,485.56	724,278,273	3.750	2019/10/25	0.36
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 3.75	4,700,000	15,631.25	734,669,003	15,259.68	717,205,073	3.750	2021/4/25	0.36
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 3.625	6,000,000	11,959.94	717,596,906	11,832.24	709,934,792	3.625	2020/2/15	0.36
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2	6,200,000	10,795.02	669,291,538	10,998.22	681,889,679	2.000	2026/11/15	0.34
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.375	6,000,000	11,387.64	683,258,786	11,335.52	680,131,799	2.375	2027/5/15	0.34
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.125	6,000,000	10,958.48	657,508,998	11,220.15	673,209,469	2.125	2025/5/15	0.34
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 5.75	3,100,000	21,967.73	680,999,728	21,649.36	671,130,435	5.750	2032/10/25	0.34
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 3.5	4,000,000	16,680.47	667,219,197	16,596.95	663,878,020	3.500	2026/4/25	0.33
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 3.25	4,300,000	15,523.73	667,520,767	15,220.62	654,486,854	3.250	2021/10/25	0.33
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 3.625	5,000,000	12,416.67	620,833,701	12,926.96	646,348,023	3.625	2044/2/15	0.32
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 1.625	6,000,000	10,427.52	625,651,500	10,731.36	643,882,058	1.625	2026/2/15	0.32
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 3.125	5,400,000	11,260.59	608,072,384	11,870.99	641,033,864	3.125	2044/8/15	0.32
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.625	5,500,000	11,591.81	637,549,798	11,616.47	638,906,081	2.625	2020/11/15	0.32

アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 1.75	5,700,000	10,896.48	621,099,462	11,124.16	634,077,189	1.750	2023/5/15	0.32
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 4.75	3,100,000	20,803.51	644,908,900	20,394.20	632,220,264	4.750	2035/4/25	0.32
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 2.75	4,000,000	15,890.65	635,626,138	15,795.06	631,802,716	2.750	2027/10/25	0.32

□ 種類別の投資比率

2017年 9月29日現在

種類	投資比率(%)
国債証券	98.61
合計	98.61

投資不動産物件

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。

外国債券パッシブ・マザーファンド

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

国内債券パッシブ・マザーファンド

該当事項はありません。

外国債券パッシブ・マザーファンド

2017年 9月29日現在

種類	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	米ドル	買建	2,826.74	318,518	318,601	0.00
	メキシコペソ	買建	4,873.79	30,433	30,217	0.00
	ユーロ	買建	4,739.97	627,916	629,705	0.00
	英ポンド	買建	3,028.57	457,051	458,404	0.00
	デンマーククローネ	買建	458.37	8,162	8,181	0.00
	オーストラリアドル	買建	51.00	4,512	4,510	0.00
	米ドル	売建	4,082,633.00	458,747,914	460,153,565	0.23
	メキシコペソ	売建	5,781,047.00	36,174,259	35,842,491	0.01

ユーロ	売建	3,002,221.00	397,785,576	398,845,059	0.19
英ポンド	売建	832,645.00	125,824,649	126,029,147	0.06
デンマーククローネ	売建	1,012,667.00	18,034,282	18,076,105	0.00
オーストラリアドル	売建	317,103.00	28,084,671	28,044,589	0.01

(注) 日本における対顧客先物相場の仲値で評価しております。

参考情報

基準日:2017年9月29日

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

基準価額・純資産の推移



※基準価額は、1万口当たり、信託報酬控除後です。

分配の推移

決算期	分配金
2017年2月	0円
2016年2月	0円
設定来累計	0円

※分配金は1万口当たり、税引前です。

年間収益率の推移(暦年ベース)



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

※2014年の収益率は、ファンドの設定日(2014年12月15日)から年末までの騰落率を表示しています。

※2017年の収益率は、年初から2017年9月29日までの騰落率を表示しています。

※ベンチマークの情報はあくまで参考情報として記載しており、ファンドの運用実績ではありません。

第2【管理及び運営】

1【申込(販売)手続等】

イ 申込方法

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

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

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

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

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

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

ファンドのお買付けに関しましては、クーリング・オフ制度の適用はありません。

ロ 申込価額

取得申込受付日の翌営業日の基準価額となります。

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

ハ 申込手数料

無手数料です。

ニ 申込単位

お申込単位の詳細は、取扱いの販売会社または委託会社にお問い合わせください。

ホ 照会先

手続き等のご不明な点についての委託会社に対する照会は下記においてできます。

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

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

ヘ 申込取扱場所・払込取扱場所

販売会社において申込み・払込みを取り扱います。

ト 払込期日

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

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

2【換金（解約）手続等】

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

お買付けの販売会社にお申し出ください。

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

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

一部解約金は、解約請求受付日から起算して5営業日目からお支払いします。

一部解約価額は、解約請求受付日の翌営業日の基準価額となります。

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

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

3【資産管理等の概要】

(1)【資産の評価】

イ 基準価額の算出方法

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

ロ 基準価額の算出頻度・照会方法

基準価額は、委託会社の営業日において日々算出されます。

基準価額は、販売会社または委託会社にお問い合わせいただけるほか、原則として翌日付の日本経済新聞朝刊の証券欄「オープン基準価格」の紙面に、「DCマゼロ」として掲載されます。委託会社に対する照会は下記においてできます。

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

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

(2)【保管】

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

(3)【信託期間】

2014年12月15日から下記「(5)その他 イ 信託の終了」に記載された各事由が生じた場合における信託終了の日までとなります。

(4)【計算期間】

毎年2月19日から翌年2月18日までとすることを原則としますが、各計算期間終了日に該当する日(以下「該当日」といいます。)が休業日のとき、各計算期間終了日は、該当日の翌営業日とし、

その翌日より次の計算期間が開始するものとします。なお、最終計算期間の終了日は、信託期間の終了日とします。

(5)【その他】

イ 信託の終了

(イ) 信託契約の解約

- a. 委託会社は、当ファンドの信託契約を解約することが受益者にとって有利であると認めるとき、その他やむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意の上、当ファンドの信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。
- b. 委託会社は、上記aの事項について、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。

(ニ) 受託会社の辞任および解任に伴う取扱い

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

八 信託約款の変更等

(イ) 委託会社は、当ファンドの信託約款を変更することが受益者の利益のため必要と認めるとき、監督官庁より変更の命令を受けたとき、その他やむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意の上、当ファンドの信託約款を変更すること、または当ファンドと他のファンドとの併合（投資信託及び投資法人に関する法律第16条第2号に規定する「委託者指図型投資信託の併合」をいいます。）を行うことができるものとし、あらかじめ、変更または併合しようとする旨および内容を監督官庁に届け出ます。

(ロ) 委託会社は、上記(イ)の事項（変更についてはその内容が重大なものに該当する場合に限り、併合にあつては、その併合が受益者の利益に及ぼす影響が軽微なものに該当する場合を除きます。以下、合わせて「重大な信託約款の変更等」といいます。）について、書面決議を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに重大な信託約款の変更等の内容およびその理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、当ファンドの知っている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。

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

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

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

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

二 反対受益者の受益権買取請求の不適用

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

ホ 販売会社との契約の更改等

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

会社と販売会社との合意により変更されることがあります。

- へ 委託会社の事業の譲渡および承継に伴う取扱い
委託会社の事業の全部または一部の譲渡、もしくは分割承継により、当ファンドに関する事業が譲渡・承継されることがあります。
- ト 公告
委託会社が受益者に対してする公告は、日本経済新聞に掲載します。ただし、2018年2月1日以降は、以下の通り変更される予定です。
委託会社が受益者に対してする公告は、電子公告の方法により行い、次のアドレスに掲載します。
<http://www.smam-jp.com>
なお、電子公告による公告をすることができない事故その他やむを得ない事由が生じた場合の公告は、日本経済新聞に掲載します。
- チ 運用にかかる報告書の開示方法
委託会社は毎決算後、投資信託及び投資法人に関する法律の規定に従い、期中の運用経過のほか、信託財産の内容、有価証券売買状況などを記載した運用報告書（全体版）および運用報告書（全体版）の記載事項のうち重要なものを記載した交付運用報告書を作成します。
交付運用報告書は、原則として、あらかじめ受益者が申し出た住所に販売会社から届けられます。なお、運用報告書（全体版）は、委託会社のホームページで閲覧できます。

4【受益者の権利等】

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

- イ 分配金請求権
受益者は、委託会社の決定した収益分配金を持分に応じて請求する権利を有します。
収益分配金は、原則として、税金を差し引いた後、毎計算期間終了日後1ヵ月以内の委託会社の指定する日（原則として決算日から起算して5営業日目まで）から、販売会社において、決算日の振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（当該収益分配金にかかる決算日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該収益分配金にかかる決算日以前に設定された受益権で取得申込代金支払い前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者としします。）に支払われます。
ただし、分配金自動再投資コースをお申込みの場合の収益分配金は、原則として、税金を差し引いた後、累積投資契約に基づき、毎計算期間終了日の翌営業日に再投資され、再投資により増加した受益権は、振替口座簿に記載または記録されます。
収益分配金は、受益者が、その支払開始日から5年間その支払いを請求しないときは、受益者はその権利を失い、当該金銭は、委託会社に帰属します。
 - ロ 償還金請求権
受益者は、持分に応じて償還金を請求する権利を有します。
償還金は、信託終了後1ヵ月以内の委託会社の指定する日（原則として償還日から起算して5営業日目まで）から、販売会社において、原則として、償還日の振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（償還日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該償還日以前に設定された受益権で取得申込代金支払い前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者としします。）に支払われます。
償還金は、受益者がその支払開始日から10年間その支払いを請求しないときは、受益者はその権利を失い、当該金銭は、委託会社に帰属します。
- ハ 一部解約実行請求権

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

二 書面決議における議決権

委託会社が、当ファンドの解約（監督官庁の命令による解約等の場合を除きます。）または、重大な信託約款の変更等を行おうとする場合において、受益者は、それぞれの書面決議手続きにおいて、受益権の口数に応じて議決権を有しこれを行行使することができます。

ホ 帳簿閲覧・謄写請求権

受益者は委託会社に対し、当該受益者にかかる信託財産に関する書類の閲覧または謄写を請求することができます。

第3【ファンドの経理状況】

1. 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）ならびに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づいて作成しております。
なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
2. 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第2期（平成28年 2月19日から平成29年 2月20日まで）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

1【財務諸表】

【三井住友・DC年金バランスゼロ（債券型）】

（１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第1期 （平成28年 2月18日現在）	第2期 （平成29年 2月20日現在）
資産の部		
流動資産		
金銭信託	659,077	-
コール・ローン	-	3,261,464
親投資信託受益証券	8,189,833	67,890,909
未収入金	50,000	-
流動資産合計	8,898,910	71,152,373
資産合計	8,898,910	71,152,373
負債の部		
流動負債		
未払解約金	66,119	14,773
未払受託者報酬	761	9,614
未払委託者報酬	4,796	60,845
未払利息	-	8
その他未払費用	59	1,541
流動負債合計	71,735	86,781
負債合計	71,735	86,781
純資産の部		
元本等		
元本	8,724,611	70,811,010
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	102,564	254,582
元本等合計	8,827,175	71,065,592
純資産合計	8,827,175	71,065,592
負債純資産合計	8,898,910	71,152,373

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第1期		第2期	
	自	平成26年12月15日 至 平成28年 2月18日	自	平成28年 2月19日 至 平成29年 2月20日
営業収益				
有価証券売買等損益		84,833		948,924
営業収益合計		84,833		948,924
営業費用				
支払利息		-		1,210
受託者報酬		763		12,402
委託者報酬		4,828		78,446
その他費用		59		2,165
営業費用合計		5,650		94,223
営業利益又は営業損失（ ）		79,183		1,043,147
経常利益又は経常損失（ ）		79,183		1,043,147
当期純利益又は当期純損失（ ）		79,183		1,043,147
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（ ）		7,575		21,410
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		-		102,564
剰余金増加額又は欠損金減少額		33,849		1,383,962
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		33,849		1,383,962
剰余金減少額又は欠損金増加額		2,893		210,207
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		2,893		210,207
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（ ）		102,564		254,582

（ 3 ）【注記表】

（ 重要な会計方針の注記 ）

項 目	第2期	
	自 平成28年 2月19日 至 平成29年 2月20日	
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>	
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>計算期間の取扱い</p> <p>当計算期間は当期末が休日のため、平成28年 2月19日から平成29年 2月20日までとなっております。</p>	

（ 貸借対照表に関する注記 ）

項 目	第1期		第2期	
	（平成28年 2月18日現在）		（平成29年 2月20日現在）	
1. 当計算期間の末日における受益権の総数		8,724,611口		70,811,010口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額	1.0118円	1口当たり純資産額	1.0036円
	(10,000口当たりの純資産額)	10,118円)	(10,000口当たりの純資産額)	10,036円)

（ 損益及び剰余金計算書に関する注記 ）

項目	第1期	第2期
	自 平成26年12月15日 至 平成28年 2月18日	自 平成28年 2月19日 至 平成29年 2月20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（39,389円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（32,219円）、収益調整金（30,956円）、および分配準備積立金（0円）より、分配対象収益は102,564円（1万口当たり117.54円）であります。分配を行っておりません。	計算期間末における費用控除後の配当等収益（468,020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（680,475円）、および分配準備積立金（43,064円）より、分配対象収益は1,191,559円（1万口当たり168.25円）であります。分配を行っておりません。

（金融商品に関する注記）

. 金融商品の状況に関する事項

項目	第2期
	自 平成28年 2月19日 至 平成29年 2月20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>

項目	第2期 自 平成28年 2月19日 至 平成29年 2月20日
3.金融商品に係るリスク管理体制	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する委員会をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用グループに是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用グループは、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。その後、当該関連運用グループの対処の実施や対処方針の決定等に関し、必要に応じてリスク管理を行う部署が当該部署の担当役員、当該関連運用グループの担当役員およびリスク管理委員会へ報告を行う体制となっております。</p> <p>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する部会にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。</p>
4.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって認める評価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。</p>

・金融商品の時価等に関する事項

項目	第2期 (平成29年 2月20日現在)
1.貸借対照表計上額、時価及び差額	<p>金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p>
2.時価の算定方法	<p>(1) 有価証券（親投資信託受益証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

第1期（自 平成26年12月15日 至 平成28年 2月18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	81,113円
合計	81,113円

第2期（自 平成28年 2月19日 至 平成29年 2月20日）

種 類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	902,650円
合計	902,650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2期 自 平成28年 2月19日 至 平成29年 2月20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1期 （平成28年 2月18日現在）	第2期 （平成29年 2月20日現在）
期首元本額	100,000円	8,724,611円
期中追加設定元本額	10,049,579円	73,536,464円
期中一部解約元本額	1,424,968円	11,450,065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	外国債券パッシブ・マザーファンド	8,677,298	14,419,933	
	国内債券パッシブ・マザーファンド	42,965,831	53,470,976	
合計		51,643,129	67,890,909	

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

(参考)

三井住友・DC年金バランスゼロ（債券型）は、「国内債券パッシブ・マザーファンド」および「外国債券パッシブ・マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同マザーファンドの受益証券です。

なお、以下に記載した状況は、監査の対象外です。

国内債券パッシブ・マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

	(平成28年 2月18日現在)	(平成29年 2月20日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	3,955,557,059	-
コール・ローン	-	789,494,703
国債証券	183,256,681,550	163,526,437,680
地方債証券	19,028,775,276	17,280,211,396
特殊債券	27,839,025,052	27,407,081,968
社債券	16,720,556,000	10,096,415,000
未収入金	4,035,431,400	100,974,000
未収利息	948,886,580	727,362,319
前払費用	14,892,621	20,618,923
流動資産合計	255,799,805,538	219,948,595,989
資産合計	255,799,805,538	219,948,595,989
負債の部		
流動負債		
未払金	-	199,592,000
未払解約金	7,095,653,575	8,852,786
未払利息	-	1,946
その他未払費用	-	2,524
流動負債合計	7,095,653,575	208,449,256
負債合計	7,095,653,575	208,449,256
純資産の部		
元本等		

	（平成28年 2月18日現在）	（平成29年 2月20日現在）
元本	200,347,049,687	176,575,927,018
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	48,357,102,276	43,164,219,715
元本等合計	248,704,151,963	219,740,146,733
純資産合計	248,704,151,963	219,740,146,733
負債純資産合計	255,799,805,538	219,948,595,989

注記表

（重要な会計方針の注記）

項目	自 平成28年 2月19日 至 平成29年 2月20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 2月18日現在）	（平成29年 2月20日現在）
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	200,347,049,687口	176,575,927,018口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.2414円 (10,000口当たりの純資産額 12,414円)	1口当たり純資産額 1.2445円 (10,000口当たりの純資産額 12,445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 2月19日 至 平成29年 2月20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。

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

・金融商品の時価等に関する事項

項 目	(平成29年 2月20日現在)
-----	-----------------

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

(デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

自 平成28年 2月19日 至 平成29年 2月20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 2月18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	257,155,832,329円
同期中における追加設定元本額	11,865,641,694円
同期中における一部解約元本額	68,674,424,336円
平成28年 2月18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)	2,165,516,380円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	3,813,680,427円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	817,165,991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)	300,550,045円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2020	47,921,173円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2025	77,810,997円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2030	151,876,114円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2035	63,113,487円

スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2040	32,352,193円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2045	57,633,698円
三井住友・DC年金バランスゼロ(債券型)	5,294,440円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	921,178,055円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	504,257,110円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	251,867,131円
SMAM・年金グローバル債券ファンド<適格機関投資家限定>	6,104,083,623円
SMAM・バランスファンドVA25<適格機関投資家専用>	31,642,677,939円
SMAM・バランスファンドVA37.5<適格機関投資家専用>	9,374,298,014円
SMAM・バランスファンドVA50<適格機関投資家専用>	22,725,074,360円
SMAM・バランスファンドVL30<適格機関投資家限定>	385,746,395円
SMAM・バランスファンドVL50<適格機関投資家限定>	710,279,607円
世界6資産バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	66,453,100円
SMAM・バランスファンドVA75<適格機関投資家専用>	330,459,356円
SMAM・バランスファンドVL国際分散型<適格機関投資家限定>	133,253,321円
SMAM・インデックス・バランスVA25<適格機関投資家専用>	2,449,351,412円
SMAM・インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用>	2,767,730,960円
SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用>	6,913,724,152円
SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>	14,892,295,388円
SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定>	209,261,015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)	7,584,993,038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)	35,504,244,175円
SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	686,174,762円
SMAM・バランスファンドVA20<適格機関投資家専用>	1,210,961,907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)	23,957,257,289円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>	1,143,922,160円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>	255,000,027円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用>	53,970,912円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>	2,850,978,211円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	3,280,304,460円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T<適格機関投資家専用>	3,047,527,271円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A2<適格機関投資家専用>	1,216,622,709円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A2<適格機関投資家専用>	267,247,997円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A2<適格機関投資家専用>	21,167,802円
SMAM・アセットバランスファンドVA30L2<適格機関投資家専用>	490,120,804円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L2<適格機関投資家専用>	8,236,891,255円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T2<適格機関投資家専用>	382,692,836円
SMAM・FG新興国重視型バランス20VA<適格機関投資家限定>	570,934円
SMAM・FGグローバルバランス25VA<適格機関投資家限定>	8,180,420円
SMAM・グローバル・マルチアセット・グロース・ファンド(安定成長型)<適格機関投資家限定>	6,547,163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>	3,333,119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>	4,325,792円
SMAM・マルチアセットストラテジーファンド2016-01<適格機関投資家限定>	2,219,108,761円
合計	200,347,049,687円

（平成29年 2月20日現在）	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	200,347,049,687円
同期中における追加設定元本額	22,841,533,818円
同期中における一部解約元本額	46,612,656,487円
平成29年 2月20日現在における元本の内訳	
三井住友・DC年金バランス30（債券重点型）	2,863,630,622円
三井住友・DC年金バランス50（標準型）	4,976,613,428円
三井住友・DC年金バランス70（株式重点型）	1,089,371,225円
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）	384,565,306円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2020（4資産タイプ）	55,791,630円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2025（4資産タイプ）	118,592,981円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2030（4資産タイプ）	197,602,898円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2035（4資産タイプ）	109,131,079円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2040（4資産タイプ）	46,099,493円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2045（4資産タイプ）	93,999,728円
三井住友・DC年金バランスゼロ（債券型）	42,965,831円
アセットアロケーション・ファンド（安定型）	2,762,566,161円
アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）	468,392,446円
アセットアロケーション・ファンド（成長型）	19,246,606円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2050	3,627,980円
S M A M ・ 年金グローバル債券ファンド＜適格機関投資家限定＞	5,947,959,996円
S M A M ・ バランスファンドVA25＜適格機関投資家専用＞	26,518,547,564円
S M A M ・ バランスファンドVA37.5＜適格機関投資家専用＞	9,024,962,955円
S M A M ・ バランスファンドVA50＜適格機関投資家専用＞	22,153,432,312円
S M A M ・ バランスファンドVL30＜適格機関投資家限定＞	366,992,815円
S M A M ・ バランスファンドVL50＜適格機関投資家限定＞	726,765,314円
世界6資産バランスファンドVA＜適格機関投資家限定＞	39,780,411円
S M A M ・ バランスファンドVA75＜適格機関投資家専用＞	337,186,477円
S M A M ・ バランスファンドVL国際分散型＜適格機関投資家限定＞	138,667,534円
S M A M ・ インデックス・バランスVA25＜適格機関投資家専用＞	2,318,302,247円
S M A M ・ インデックス・バランスVA50＜適格機関投資家専用＞	2,648,512,195円
S M A M ・ バランスファンドVA40＜適格機関投資家専用＞	6,705,288,357円
S M A M ・ バランスファンドVA35＜適格機関投資家専用＞	13,609,804,456円
S M A M ・ バランスVA株40T＜適格機関投資家限定＞	196,730,814円
三井住友・国内債券インデックスファンド・VAS（適格機関投資家専用）	7,215,523,917円
三井住友・5資産バランスファンド・VAS（適格機関投資家専用）	22,262,433,589円
S M A M ・ グローバルバランス40VA＜適格機関投資家限定＞	663,412,031円
S M A M ・ バランスファンドVA20＜適格機関投資家専用＞	1,078,987,149円
三井住友・7資産バランスファンド・VAS（適格機関投資家専用）	18,580,545,586円
S M A M ・ アセットバランスファンドVA20A＜適格機関投資家専用＞	1,072,236,500円
S M A M ・ アセットバランスファンドVA35A＜適格機関投資家専用＞	231,556,718円
S M A M ・ アセットバランスファンドVA50A＜適格機関投資家専用＞	55,827,020円
S M A M ・ アセットバランスファンドVA20L＜適格機関投資家専用＞	2,577,142,492円
S M A M ・ アセットバランスファンドVA25L＜適格機関投資家専用＞	2,973,007,979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 >	2,892,799,761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 >	1,187,033,452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 >	260,266,079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 >	22,401,538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 >	411,209,300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 >	7,685,581,694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 >	335,011,843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 >	34,418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 >	1,517,353円
S M A M ・ 年金マルチ・インカム・ダイナミック・アロケーション ・ ファンド < 適格機関投資家限定 >	2,243,863円
S M A M ・ 年金Wリスクコントロールファンド < 適格機関投資家限定 >	2,850,704円
S M A M ・ マルチアセットストラテジーファンド 2 0 1 6 - 0 4 < 適格機関投資家限定 >	1,467,582,962円
S M A M ・ マルチアセットストラテジーファンド 2 0 1 6 - 0 5 < 適格機関投資家限定 >	703,296,109円
S M A M ・ マルチアセットストラテジー・オープン < 適格機関投資家限定 >	928,294,100円
合計	176,575,927,018円

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 2 1 回利付国債（5年）	100,000,000	100,737,000	
	第 1 2 2 回利付国債（5年）	1,550,000,000	1,561,873,000	
	第 1 2 3 回利付国債（5年）	2,220,000,000	2,237,804,400	
	第 1 2 4 回利付国債（5年）	2,340,000,000	2,359,141,200	
	第 1 2 5 回利付国債（5年）	1,520,000,000	1,533,102,400	
	第 1 2 6 回利付国債（5年）	910,000,000	918,044,400	
	第 1 2 7 回利付国債（5年）	1,310,000,000	1,322,052,000	
	第 1 2 8 回利付国債（5年）	2,605,000,000	2,629,330,700	

第129回利付国債(5年)	1,270,000,000	1,281,963,400	
第130回利付国債(5年)	100,000,000	100,969,000	
第1回利付国債(40年)	40,000,000	56,136,000	
第2回利付国債(40年)	237,000,000	321,272,460	
第3回利付国債(40年)	330,000,000	449,644,800	
第4回利付国債(40年)	440,000,000	602,505,200	
第5回利付国債(40年)	415,000,000	546,152,450	
第6回利付国債(40年)	415,000,000	535,296,050	
第7回利付国債(40年)	445,000,000	547,763,850	
第8回利付国債(40年)	525,000,000	597,733,500	
第9回利付国債(40年)	630,000,000	512,990,100	
第297回利付国債(10年)	13,000,000	13,391,950	
第298回利付国債(10年)	195,000,000	200,520,450	
第299回利付国債(10年)	345,000,000	355,908,900	
第300回利付国債(10年)	1,100,000,000	1,139,358,000	
第301回利付国債(10年)	2,285,000,000	2,375,668,800	
第303回利付国債(10年)	195,000,000	203,022,300	
第305回利付国債(10年)	2,970,000,000	3,093,908,400	
第306回利付国債(10年)	1,670,000,000	1,750,393,800	
第307回利付国債(10年)	940,000,000	982,356,400	
第308回利付国債(10年)	670,000,000	702,206,900	
第309回利付国債(10年)	550,000,000	572,770,000	
第310回利付国債(10年)	3,080,000,000	3,205,017,200	
第312回利付国債(10年)	2,145,000,000	2,254,223,400	
第313回利付国債(10年)	2,105,000,000	2,226,816,350	
第315回利付国債(10年)	1,800,000,000	1,902,420,000	
第317回利付国債(10年)	1,005,000,000	1,060,425,750	
第318回利付国債(10年)	895,000,000	940,251,200	
第319回利付国債(10年)	980,000,000	1,036,506,800	
第320回利付国債(10年)	960,000,000	1,010,697,600	
第321回利付国債(10年)	930,000,000	981,140,700	
第322回利付国債(10年)	1,065,000,000	1,118,143,500	
第323回利付国債(10年)	510,000,000	536,428,200	
第324回利付国債(10年)	1,035,000,000	1,083,106,800	
第325回利付国債(10年)	1,440,000,000	1,509,696,000	
第326回利付国債(10年)	830,000,000	866,611,300	

第327回利付国債(10年)	375,000,000	393,735,000	
第328回利付国債(10年)	790,000,000	821,268,200	
第329回利付国債(10年)	2,675,000,000	2,818,326,500	
第330回利付国債(10年)	1,300,000,000	1,371,981,000	
第332回利付国債(10年)	978,000,000	1,020,132,240	
第333回利付国債(10年)	1,855,000,000	1,935,061,800	
第334回利付国債(10年)	1,330,000,000	1,387,416,100	
第335回利付国債(10年)	1,345,000,000	1,393,823,500	
第336回利付国債(10年)	940,000,000	974,479,200	
第337回利付国債(10年)	1,090,000,000	1,112,966,300	
第338回利付国債(10年)	1,260,000,000	1,296,489,600	
第339回利付国債(10年)	1,880,000,000	1,934,538,800	
第340回利付国債(10年)	1,900,000,000	1,955,936,000	
第341回利付国債(10年)	2,245,000,000	2,291,269,450	
第342回利付国債(10年)	2,165,000,000	2,170,845,500	
第343回利付国債(10年)	2,025,000,000	2,029,677,750	
第344回利付国債(10年)	2,490,000,000	2,494,731,000	
第345回利付国債(10年)	795,000,000	795,771,150	
第2回利付国債(30年)	510,000,000	648,816,900	
第4回利付国債(30年)	300,000,000	404,280,000	
第5回利付国債(30年)	290,000,000	364,738,800	
第7回利付国債(30年)	474,000,000	605,525,520	
第9回利付国債(30年)	100,000,000	114,541,000	
第10回利付国債(30年)	585,000,000	641,984,850	
第11回利付国債(30年)	570,000,000	678,339,900	
第12回利付国債(30年)	590,000,000	739,016,300	
第14回利付国債(30年)	860,000,000	1,122,300,000	
第16回利付国債(30年)	465,000,000	615,246,150	
第18回利付国債(30年)	510,000,000	658,869,000	
第19回利付国債(30年)	490,000,000	633,261,300	
第21回利付国債(30年)	345,000,000	445,708,950	
第22回利付国債(30年)	335,000,000	445,064,250	
第23回利付国債(30年)	329,000,000	437,619,350	
第24回利付国債(30年)	310,000,000	412,455,000	
第25回利付国債(30年)	300,000,000	388,635,000	
第26回利付国債(30年)	353,000,000	463,916,130	

第27回利付国債(30年)	395,000,000	528,577,150	
第28回利付国債(30年)	436,000,000	585,482,600	
第29回利付国債(30年)	287,000,000	380,952,320	
第30回利付国債(30年)	602,000,000	789,914,300	
第31回利付国債(30年)	505,000,000	654,586,050	
第32回利付国債(30年)	705,000,000	930,903,150	
第33回利付国債(30年)	743,000,000	935,615,320	
第34回利付国債(30年)	770,000,000	1,005,858,700	
第35回利付国債(30年)	730,000,000	924,143,500	
第36回利付国債(30年)	480,000,000	609,187,200	
第37回利付国債(30年)	640,000,000	799,654,400	
第38回利付国債(30年)	560,000,000	688,223,200	
第39回利付国債(30年)	455,000,000	570,024,000	
第40回利付国債(30年)	475,000,000	584,221,500	
第41回利付国債(30年)	475,000,000	573,211,000	
第42回利付国債(30年)	480,000,000	579,350,400	
第43回利付国債(30年)	415,000,000	500,992,150	
第44回利付国債(30年)	500,000,000	603,705,000	
第45回利付国債(30年)	625,000,000	723,743,750	
第46回利付国債(30年)	540,000,000	625,212,000	
第47回利付国債(30年)	730,000,000	863,852,800	
第48回利付国債(30年)	615,000,000	697,576,050	
第49回利付国債(30年)	575,000,000	651,986,750	
第50回利付国債(30年)	565,000,000	554,536,200	
第51回利付国債(30年)	560,000,000	477,064,000	
第52回利付国債(30年)	655,000,000	591,039,250	
第53回利付国債(30年)	195,000,000	180,607,050	
第40回利付国債(20年)	10,000,000	10,402,400	
第42回利付国債(20年)	480,000,000	508,056,000	
第43回利付国債(20年)	1,120,000,000	1,209,398,400	
第46回利付国債(20年)	775,000,000	835,643,750	
第48回利付国債(20年)	955,000,000	1,051,206,700	
第50回利付国債(20年)	918,000,000	993,560,580	
第52回利付国債(20年)	720,000,000	792,482,400	
第54回利付国債(20年)	965,000,000	1,072,076,400	
第56回利付国債(20年)	818,000,000	908,470,800	

第59回利付国債(20年)	1,455,000,000	1,604,675,850	
第61回利付国債(20年)	1,215,000,000	1,293,075,900	
第64回利付国債(20年)	1,025,000,000	1,155,328,750	
第65回利付国債(20年)	1,020,000,000	1,154,221,800	
第69回利付国債(20年)	1,020,000,000	1,172,286,000	
第70回利付国債(20年)	780,000,000	916,414,200	
第72回利付国債(20年)	753,000,000	871,461,960	
第74回利付国債(20年)	664,000,000	771,295,760	
第75回利付国債(20年)	490,000,000	571,207,700	
第78回利付国債(20年)	590,000,000	680,753,800	
第82回利付国債(20年)	620,000,000	728,214,800	
第84回利付国債(20年)	850,000,000	994,313,000	
第85回利付国債(20年)	645,000,000	763,022,100	
第88回利付国債(20年)	742,000,000	895,267,520	
第89回利付国債(20年)	20,000,000	23,945,800	
第90回利付国債(20年)	580,000,000	697,171,600	
第92回利付国債(20年)	734,000,000	878,098,880	
第93回利付国債(20年)	632,000,000	752,098,960	
第95回利付国債(20年)	305,000,000	373,179,700	
第97回利付国債(20年)	677,000,000	824,051,170	
第99回利付国債(20年)	673,000,000	814,087,720	
第100回利付国債(20年)	282,000,000	345,142,620	
第101回利付国債(20年)	355,000,000	442,227,050	
第102回利付国債(20年)	382,000,000	477,163,840	
第105回利付国債(20年)	425,000,000	517,820,000	
第106回利付国債(20年)	370,000,000	455,003,800	
第107回利付国債(20年)	433,000,000	528,948,470	
第108回利付国債(20年)	340,000,000	407,473,000	
第109回利付国債(20年)	555,000,000	666,599,400	
第111回利付国債(20年)	526,000,000	652,129,540	
第113回利付国債(20年)	527,000,000	648,236,350	
第114回利付国債(20年)	813,000,000	1,002,380,220	
第116回利付国債(20年)	375,000,000	467,853,750	
第118回利付国債(20年)	460,000,000	563,067,600	
第119回利付国債(20年)	520,000,000	622,715,600	
第120回利付国債(20年)	540,000,000	632,772,000	

第121回利付国債(20年)	470,000,000	569,574,200	
第122回利付国債(20年)	565,000,000	677,310,700	
第123回利付国債(20年)	380,000,000	471,420,400	
第124回利付国債(20年)	365,000,000	447,957,200	
第125回利付国債(20年)	195,000,000	244,855,650	
第126回利付国債(20年)	280,000,000	344,033,200	
第127回利付国債(20年)	175,000,000	212,660,000	
第128回利付国債(20年)	500,000,000	608,190,000	
第129回利付国債(20年)	515,000,000	618,963,050	
第130回利付国債(20年)	535,000,000	643,471,250	
第131回利付国債(20年)	460,000,000	546,875,600	
第132回利付国債(20年)	490,000,000	582,815,800	
第133回利付国債(20年)	680,000,000	818,380,000	
第134回利付国債(20年)	210,000,000	252,867,300	
第135回利付国債(20年)	345,000,000	410,501,700	
第136回利付国債(20年)	320,000,000	375,916,800	
第137回利付国債(20年)	210,000,000	249,956,700	
第138回利付国債(20年)	45,000,000	52,222,050	
第139回利付国債(20年)	400,000,000	470,320,000	
第140回利付国債(20年)	895,000,000	1,065,587,000	
第141回利付国債(20年)	520,000,000	619,684,000	
第142回利付国債(20年)	450,000,000	542,952,000	
第143回利付国債(20年)	345,000,000	405,675,150	
第144回利付国債(20年)	180,000,000	208,951,200	
第145回利付国債(20年)	515,000,000	613,354,700	
第146回利付国債(20年)	380,000,000	452,568,600	
第147回利付国債(20年)	1,275,000,000	1,497,296,250	
第148回利付国債(20年)	795,000,000	920,761,050	
第149回利付国債(20年)	960,000,000	1,111,267,200	
第150回利付国債(20年)	825,000,000	940,392,750	
第151回利付国債(20年)	860,000,000	949,964,600	
第152回利付国債(20年)	835,000,000	921,180,350	
第153回利付国債(20年)	897,000,000	1,003,967,250	
第154回利付国債(20年)	1,070,000,000	1,177,288,900	
第155回利付国債(20年)	890,000,000	946,212,400	
第156回利付国債(20年)	920,000,000	877,247,600	

	第157回利付国債(20年)	935,000,000	854,692,850	
	第158回利付国債(20年)	895,000,000	864,176,200	
	第159回利付国債(20年)	250,000,000	245,432,500	
国債証券合計		147,968,000,000	163,526,437,680	
地方債証券	第1回東京都公募公債(20年)	100,000,000	109,303,000	
	第1回東京都公募公債(30年)	100,000,000	124,035,000	
	第6回東京都公募公債(20年)	100,000,000	114,801,000	
	第7回東京都公募公債(20年)	100,000,000	116,923,000	
	第8回東京都公募公債(20年)	100,000,000	119,516,000	
	第8回東京都公募公債(30年)	400,000,000	500,172,000	
	第13回東京都公募公債(30年)	500,000,000	601,660,000	
	第660回東京都公募公債	300,000,000	306,261,000	
	第674回東京都公募公債	100,100,000	103,638,535	
	平成20年度第4回北海道公募公債	100,000,000	102,628,000	
	平成20年度第12回北海道公募公債	100,000,000	103,158,000	
	平成21年度第14回北海道公募公債	100,000,000	104,541,000	
	平成25年度第15回北海道公募公債	100,000,000	103,829,000	
	第1回神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	117,565,000	
	第3回神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	115,979,000	
	第7回神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	119,240,000	
	第57回神奈川県公募公債(5年)	200,000,000	200,954,000	
	第157回神奈川県公募公債	115,600,000	118,941,996	
	第167回神奈川県公募公債	100,000,000	103,896,000	
	第97回大阪府公募公債(5年)	102,000,000	102,473,280	
	第313回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	101,949,000	
	第326回大阪府公募公債(10年)	200,000,000	207,478,000	
	第332回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	104,343,000	
	第342回大阪府公募公債(10年)	200,000,000	208,542,000	
	第361回大阪府公募公債(10年)	200,000,000	209,122,000	
	第373回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	105,179,000	
	第377回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	104,179,000	
	平成19年度第1回京都府公募公債	30,260,000	30,585,295	
	平成20年度第3回京都府公募公債	100,000,000	102,850,000	
	平成26年度第13回京都府公募公債	100,000,000	102,582,000	
	平成27年度第4回京都府公募公債	100,000,000	103,102,000	
	第5回兵庫県公募公債(15年)	300,000,000	330,705,000	

平成20年度第5回兵庫県公募公債	100,000,000	102,552,000	
平成21年度第3回兵庫県公募公債	200,000,000	207,244,000	
平成21年度第11回兵庫県公募公債	200,000,000	207,678,000	
第7回静岡県公募公債(30年)	100,000,000	122,116,000	
平成20年度第1回静岡県公募公債	200,000,000	233,988,000	
平成20年度第7回静岡県公募公債	100,000,000	103,005,000	
平成21年度第5回静岡県公募公債	300,000,000	310,680,000	
平成20年度第3回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	102,437,000	
平成20年度第6回愛知県公募公債(10年)	500,000,000	515,040,000	
平成21年度第1回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	103,503,000	
平成21年度第7回愛知県公募公債(10年)	200,000,000	207,688,000	
平成21年度第8回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	103,599,000	
平成21年度第10回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	103,686,000	
平成22年度第12回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	104,038,000	
平成23年度第18回愛知県公募公債(7年)	100,000,000	101,114,000	
平成21年度第1回広島県公募公債	100,000,000	103,534,000	
平成20年度第7回埼玉県公募公債	100,000,000	102,964,000	
平成21年度第1回埼玉県公募公債	100,000,000	103,298,000	
平成21年度第2回埼玉県公募公債	100,000,000	103,531,000	
平成21年度第4回埼玉県公募公債	200,000,000	207,064,000	
平成20年度第10回福岡県公募公債	100,000,000	103,005,000	
平成21年度第3回福岡県公募公債	100,000,000	103,873,000	
平成25年度第5回福岡県公募公債	600,000,000	602,298,000	
平成25年度第11回福岡県公募公債	100,000,000	104,065,000	
平成25年度第12回福岡県公募公債	100,000,000	100,314,000	
平成26年度第4回福岡県公募公債	100,000,000	100,324,000	
平成26年度第10回福岡県公募公債	100,000,000	102,318,000	
平成20年度第8回千葉県公募公債	100,000,000	102,960,000	
平成21年度第2回千葉県公募公債	345,000,000	357,137,100	
平成21年度第6回千葉県公募公債	100,000,000	103,632,000	
第9回群馬県公募公債(10年)	100,000,000	104,232,000	
平成21年度第1回岐阜県公募公債(10年)	200,000,000	207,194,000	
第51回共同発行市場公募地方債	500,000	503,190	
第62回共同発行市場公募地方債	200,000,000	204,350,000	
第64回共同発行市場公募地方債	300,000,000	307,566,000	

第65回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,427,000	
第73回共同発行市場公募地方債	400,000,000	413,748,000	
第75回共同発行市場公募地方債	900,000,000	934,371,000	
第76回共同発行市場公募地方債	300,000,000	310,113,000	
第77回共同発行市場公募地方債	200,000,000	207,660,000	
第79回共同発行市場公募地方債	200,000,000	207,120,000	
第81回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,723,000	
第82回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,118,000	
第91回共同発行市場公募地方債	300,000,000	309,741,000	
第115回共同発行市場公募地方債	600,000,000	625,224,000	
第137回共同発行市場公募地方債	200,000,000	206,248,000	
平成21年度第4回大阪市公募公債	300,000,000	312,054,000	
平成26年度第2回大阪市公募公債(5年)	200,000,000	200,924,000	
第1回名古屋市公募公債(20年)	200,000,000	225,792,000	
第3回名古屋市公募公債(20年)	100,000,000	115,322,000	
第467回名古屋市公募公債(10年)	100,000,000	103,749,000	
第1回京都市公募公債(30年)	100,000,000	130,350,000	
第7回京都市公募公債(20年)	100,000,000	122,727,000	
平成26年度第1回京都市公募公債	100,000,000	100,382,000	
平成26年度第17回神戸市公募公債	100,000,000	100,940,000	
第4回横浜市公募公債(20年)	100,000,000	114,994,000	
第9回横浜市公募公債(20年)	100,000,000	119,848,000	
第14回横浜市公募公債(20年)	100,000,000	121,509,000	
平成20年度第6回横浜市公募公債	200,000,000	205,960,000	
平成25年度第1回横浜市公債「ハマ債5」	100,000,000	100,290,000	
平成26年度第4回札幌市公募公債(10年)	100,000,000	102,938,000	
第2回川崎市15年公募公債	100,000,000	105,382,000	
第4回川崎市15年公募公債	100,000,000	109,977,000	
平成20年度第5回福岡市公募公債	100,000,000	102,612,000	
平成25年度第5回福岡市公募公債(5年)	100,000,000	100,425,000	
平成21年度第1回千葉市公募公債	200,000,000	206,882,000	
地方債証券合計	16,293,460,000	17,280,211,396	
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	102,808,000
	第2回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	200,000,000	205,136,000
	第3回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	200,000,000	228,114,000
	第5回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	103,028,000

第15回政府保証日本政策投資銀行債券	100,000,000	109,696,000	
第20回政府保証日本政策投資銀行債券	100,000,000	111,622,000	
第23回政府保証日本政策投資銀行債券	400,000,000	409,628,000	
第36回日本政策投資銀行債券	100,000,000	119,298,000	
第51回日本政策投資銀行債券	100,000,000	102,441,000	
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	213,896,000	
第7回道路債券	100,000,000	114,023,000	
第8回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	119,892,000	
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	107,799,000	
第9回道路債券	100,000,000	133,248,000	
第18回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	142,343,000	
第22回日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	412,122,000	
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	53,332,840	
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	404,120,000	
第42回道路債券	100,000,000	116,196,000	
第47回日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	247,204,000	
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	101,423,000	
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	203,286,000	
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	203,274,000	
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	510,865,000	
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	102,449,000	
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	307,389,000	
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	205,450,000	
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	102,848,000	
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	205,198,000	
第81回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	241,910,000	
	100,000,000	128,140,000	

第88回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券			
第89回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	600,000,000	620,502,000	
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	363,603,000	
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	103,446,000	
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	122,536,000	
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	1,352,104,000	
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	208,960,000	
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	103,339,000	
第340回政府保証道路債券	100,000,000	105,427,000	
第1回政府保証地方公営企業等金融機構債券	300,000,000	307,974,000	
第1回政府保証地方公共団体金融機構債券	300,000,000	310,479,000	
第2回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,370,000	
第2回地方公営企業等金融機構債券(20年)	100,000,000	122,170,000	
第3回政府保証地方公営企業等金融機構債券	100,000,000	102,557,000	
第3回公営企業債券(20年)	100,000,000	105,718,000	
第3回地方公共団体金融機構債券	300,000,000	311,847,000	
第4回政府保証地方公営企業等金融機構債券	100,000,000	102,515,000	
第4回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,355,000	
第5回政府保証地方公営企業等金融機構債券	100,000,000	102,612,000	
第5回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,216,000	
第5回公営企業債券(20年)	100,000,000	113,176,000	
第6回政府保証地方公営企業等金融機構債券	100,000,000	102,702,000	
第6回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	208,384,000	
第7回政府保証地方公営企業等金融機構債券	500,000,000	515,140,000	
第8回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,405,000	
第11回公営企業債券(20年)	100,000,000	115,334,000	
第11回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	104,613,000	
第14回政府保証地方公共団体金融機構債券(6年)	200,000,000	201,354,000	
第16回公営企業債券(20年)	100,000,000	116,329,000	
第17回公営企業債券(20年)	100,000,000	119,387,000	

第18回公営企業債券(20年)	100,000,000	121,622,000	
第22回公営企業債券(20年)	100,000,000	120,292,000	
第24回公営企業債券(20年)	200,000,000	242,068,000	
第30回公営企業債券	200,000,000	205,230,000	
第42回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	104,267,000	
第45回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	208,458,000	
第61回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,925,000	
第63回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,974,000	
第65回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,651,000	
F74回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,366,000	
第883回政府保証公営企業債券	100,000,000	101,514,000	
第884回政府保証公営企業債券	300,000,000	304,878,000	
第885回政府保証公営企業債券	200,000,000	204,270,000	
第886回政府保証公営企業債券	200,000,000	204,798,000	
第34回株式会社日本政策金融公庫社債	200,000,000	200,702,000	
第27回国際協力銀行債券	100,000,000	100,120,000	
第19回都市再生債券	100,000,000	102,192,000	
第7回本州四国連絡橋債券	100,000,000	116,876,000	
第332回東京交通債券	100,000,000	107,184,000	
第342回東京交通債券	100,000,000	111,871,000	
第13回関西国際空港株式会社社債	100,000,000	102,713,000	
第16回関西国際空港株式会社社債	100,000,000	103,358,000	
第51回政府保証関西国際空港債券	100,000,000	111,657,000	
第14回独立行政法人福祉医療機構債券	200,000,000	201,306,000	
第17回独立行政法人福祉医療機構債券	100,000,000	102,639,000	
第199回政府保証預金保険機構債	300,000,000	300,543,000	
第201回政府保証預金保険機構債	200,000,000	200,434,000	
第203回政府保証預金保険機構債	600,000,000	601,884,000	
第208回政府保証預金保険機構債	600,000,000	602,280,000	
第209回政府保証預金保険機構債	600,000,000	602,394,000	
第1回貸付債権担保住宅金融公庫債券	23,150,000	23,549,106	
第3回貸付債権担保住宅金融公庫債券	11,544,000	11,756,525	
第3回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	17,320,000	18,147,376	
第4回貸付債権担保住宅金融公庫債券	12,411,000	12,707,126	
第4回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	22,804,000	24,383,861	
第5回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	17,592,000	18,410,028	

第 6 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	27,180,000	28,077,483	
第 7 回貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券	22,731,000	24,218,289	
第 8 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	13,753,000	14,140,009	
第 8 回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	101,005,000	
第 9 回貸付債権担保 S 種住宅金融公庫債券	38,650,000	41,211,722	
第 9 回貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券	22,985,000	24,544,072	
第 1 0 回貸付債権担保 S 種住宅金融公庫債券	59,718,000	63,675,511	
第 1 0 回貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券	22,555,000	23,817,177	
第 1 1 回貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券	23,907,000	25,433,461	
第 1 2 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	15,427,000	15,940,873	
第 1 4 回貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券	26,575,000	27,557,743	
第 1 4 回一般担保住宅金融支援機構債券	200,000,000	204,000,000	
第 1 7 回貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券	59,412,000	61,878,786	
第 1 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	31,136,000	33,424,184	
第 2 1 回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	103,028,000	
第 2 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	63,596,000	69,025,190	
第 2 5 回一般担保住宅金融支援機構債券	200,000,000	206,096,000	
第 2 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	95,718,000	103,202,190	
第 2 7 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	34,431,000	37,008,504	
第 2 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	38,265,000	41,040,743	
第 2 9 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	19,527,000	20,385,211	
第 2 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	40,294,000	43,170,185	
第 3 0 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	40,505,000	43,380,855	
第 3 2 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	23,077,000	24,114,311	
第 3 2 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	80,950,000	86,244,939	
第 3 5 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	22,800,000	23,919,708	
第 3 5 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	45,147,000	48,103,677	
第 3 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	46,691,000	49,621,794	
第 3 9 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	21,048,000	22,089,665	
第 4 1 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	22,726,000	24,126,830	
第 4 3 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	42,838,000	45,851,224	
第 4 3 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	59,708,000	63,214,053	
第 4 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	52,369,000	55,973,558	

第48回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	99,724,000	106,812,381	
第49回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	49,102,000	52,271,043	
第51回貸付債権担保住宅金融公庫債券	20,208,000	21,533,442	
第51回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	107,138,000	113,630,562	
第52回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	119,566,000	
第53回貸付債権担保住宅金融公庫債券	21,811,000	23,206,031	
第55回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	130,156,000	136,855,129	
第57回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	63,294,000	66,640,353	
第58回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	65,473,000	68,798,373	
第59回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	129,914,000	136,785,151	
第60回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	198,684,000	208,125,463	
第61回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	65,027,000	67,927,854	
第67回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	71,485,000	74,016,283	
第69回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	145,682,000	152,491,176	
第70回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	132,588,000	138,698,980	
第73回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	72,664,000	76,302,286	
第95回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	105,133,000	
第99回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	90,209,000	92,664,488	
第130回一般担保住宅金融支援機構債券	200,000,000	233,458,000	
第1回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	43,482,000	46,107,877	
第2回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	45,844,000	48,840,363	
第3回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	21,102,000	22,546,642	
第6回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	21,988,000	23,363,349	
第5回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	43,182,000	45,807,033	
い第758号商工債	100,000,000	100,558,000	
い第749号農林債	300,000,000	300,588,000	
い第752号農林債	500,000,000	501,335,000	
い第768号農林債	100,000,000	100,645,000	
第281回信金中金債（5年）	100,000,000	100,284,000	
第283回信金中金債（5年）	100,000,000	100,458,000	
第291回信金中金債（5年）	100,000,000	100,474,000	
第293回信金中金債（5年）	100,000,000	100,512,000	
第297回信金中金債（5年）	200,000,000	200,904,000	
第301回信金中金債（5年）	300,000,000	301,746,000	
第171号商工債（3年）	300,000,000	300,096,000	
第175号商工債（3年）	100,000,000	100,071,000	

	第177号商工債(3年)	300,000,000	300,282,000	
	第181号商工債(3年)	100,000,000	100,142,000	
	第183号商工債(3年)	500,000,000	500,825,000	
	第185号商工債(3年)	200,000,000	200,350,000	
	第197号商工債(3年)	200,000,000	200,024,000	
	第15回政府保証東日本高速道路債券	100,000,000	102,638,000	
	第5回中日本高速道路株式会社社債	200,000,000	205,870,000	
	第6回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	103,138,000	
	第19回政府保証中日本高速道路債券	124,000,000	125,723,600	
	第21回政府保証中日本高速道路債券	200,000,000	204,260,000	
	第25回政府保証中日本高速道路債券	200,000,000	206,986,000	
	第46回中日本高速道路株式会社社債	200,000,000	200,402,000	
	第8回政府保証西日本高速道路債券	33,000,000	33,135,300	
	第15回政府保証西日本高速道路債券	100,000,000	102,380,000	
	第19回政府保証西日本高速道路債券	100,000,000	103,032,000	
	第20回西日本高速道路株式会社社債	100,000,000	103,968,000	
特殊債券合計		26,067,297,000	27,407,081,968	
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	200,870,000	
	第11回ウエストパック・バンキング・コーポレーション円貨社債	200,000,000	200,506,000	
	第21回コーペラティブ・セントラル・ライフアイゼン・ボエレンリーバンク・ピー・エー	200,000,000	201,048,000	
	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	301,143,000	
	第18回 積水ハウス株式会社無担保社債	100,000,000	100,029,000	
	第7回麒麟ホールディングス株式会社無担保社債	200,000,000	208,376,000	
	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	100,615,000	
	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	102,008,000	
	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	102,616,000	
	第4回花王株式会社無担保社債	100,000,000	101,560,000	
	第64回新日本製鐵株式会社無担保社債	100,000,000	104,229,000	
	第62回株式会社神戸製鋼所無担保社債	100,000,000	99,344,000	

第13回株式会社クボタ無担保社債	100,000,000	101,076,000	
第16回株式会社日立製作所無担保社債	100,000,000	103,458,000	
第44回三菱電機株式会社無担保社債	100,000,000	100,450,000	
日本電産株式会社第1回無担保社債	100,000,000	100,166,000	
第36回富士通株式会社無担保社債	100,000,000	101,523,000	
第12回パナソニック株式会社無担保社債	200,000,000	201,432,000	
第13回パナソニック株式会社無担保社債	200,000,000	203,298,000	
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	200,816,000	
第1回日本生命2012基金特定目的会社特定社債	100,000,000	100,802,000	
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	100,708,000	
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	100,395,000	
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	99,956,000	
第63回三井物産株式会社無担保社債	100,000,000	118,191,000	
第47回住友商事株式会社無担保社債	100,000,000	102,088,000	
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	102,186,000	
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	122,720,000	
株式会社三菱東京UFJ銀行第12回無担保社債	200,000,000	201,766,000	
第25回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	300,000,000	312,084,000	
第110回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	100,000,000	103,883,000	
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	101,882,000	
第4回株式会社りそな銀行無担保社債	100,000,000	106,014,000	
第9回三菱UFJ信託銀行株式会社無担保社債	100,000,000	105,954,000	
第7回住友信託銀行株式会社無担保社債	100,000,000	100,399,000	
第8回住友信託銀行株式会社無担保社債	100,000,000	118,140,000	
第6回株式会社セブン銀行無担保社債	200,000,000	200,288,000	
第1回株式会社みずほフィナンシャルグループ無担保社債	100,000,000	102,379,000	
第20回株式会社三井住友銀行無担保社債	200,000,000	209,952,000	
第24回株式会社三井住友銀行無担保社債	100,000,000	105,791,000	

第8回株式会社みずほ銀行無担保社債	200,000,000	200,674,000	
第9回株式会社みずほ銀行無担保社債	100,000,000	118,312,000	
第17回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	106,108,000	
第53回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	100,386,000	
第54回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	101,151,000	
第113回オリックス株式会社無担保社債	100,000,000	100,334,000	
第162回オリックス株式会社無担保社債	100,000,000	100,244,000	
第165回オリックス株式会社無担保社債	100,000,000	100,386,000	
第48回三菱UFJリース株式会社無担保社債	100,000,000	99,786,000	
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	105,262,000	
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	201,520,000	
第58回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	128,433,000	
第110回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	101,028,000	
第15回東日本旅客鉄道株式会社社債	100,000,000	108,975,000	
第34回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	116,826,000	
第110回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	115,546,000	
第41回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	120,748,000	
第42回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	200,000,000	245,394,000	
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	101,404,000	
第524回東京電力株式会社社債	100,000,000	100,099,000	
第526回東京電力株式会社社債	300,000,000	301,287,000	
第528回東京電力株式会社社債	100,000,000	103,741,000	
第532回東京電力株式会社社債	100,000,000	100,918,000	
第537回東京電力株式会社社債	100,000,000	104,380,000	
第544回東京電力株式会社社債	100,000,000	102,371,000	
第547回東京電力株式会社社債	100,000,000	105,350,000	
第518回中部電力株式会社社債	100,000,000	99,736,000	
第440回関西電力株式会社社債	100,000,000	100,001,000	
第467回関西電力株式会社社債	100,000,000	102,502,000	
第471回東北電力株式会社社債	100,000,000	105,643,000	

第472回東北電力株式会社社債	100,000,000	104,131,000	
第253回四国電力株式会社社債	100,000,000	104,653,000	
第400回九州電力株式会社社債	100,000,000	104,970,000	
第328回北海道電力株式会社社債	100,000,000	100,581,000	
第11回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	113,178,000	
第18回大阪瓦斯株式会社無担保社債	200,000,000	214,946,000	
第27回東邦瓦斯株式会社無担保社債	100,000,000	105,270,000	
社債券合計	9,700,000,000	10,096,415,000	
合計		218,310,146,044	

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 2月18日現在）	（平成29年 2月20日現在）
資産の部		
流動資産		
預金	825,340,017	1,630,095,689
金銭信託	352,441,486	-
コール・ローン	-	420,483,961
国債証券	180,251,698,471	212,934,137,705
派生商品評価勘定	10,541,643	3,366,000
未収入金	1,347,086,025	-
未収利息	1,569,916,558	1,456,904,963
前払費用	19,303,386	248,360,400
流動資産合計	184,376,327,586	216,693,348,718
資産合計	184,376,327,586	216,693,348,718
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	2,122,019	-
未払解約金	1,312,070,060	184,808,571
未払利息	-	1,036
その他未払費用	-	2,223
流動負債合計	1,314,192,079	184,811,830
負債合計	1,314,192,079	184,811,830
純資産の部		
元本等		
元本	105,835,628,786	130,285,580,252
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	77,226,506,721	86,222,956,636
元本等合計	183,062,135,507	216,508,536,888

(平成28年 2月18日現在) (平成29年 2月20日現在)

純資産合計	183,062,135,507	216,508,536,888
負債純資産合計	184,376,327,586	216,693,348,718

注記表

(重要な会計方針の注記)

項目	自平成28年 2月19日 至平成29年 2月20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 2月18日現在)	(平成29年 2月20日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	105,835,628,786口	130,285,580,252口
2. 1単位当たり純資産の額	<p>1口当たり純資産額 1.7297円</p> <p>(10,000口当たりの純資産額 17,297円)</p>	<p>1口当たり純資産額 1.6618円</p> <p>(10,000口当たりの純資産額 16,618円)</p>

(金融商品に関する注記)

. 金融商品の状況に関する事項

項目	自平成28年 2月19日 至平成29年 2月20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おります。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。

項目	(平成29年 2月20日現在)
1.貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1) 有価証券（国債証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(デリバティブ取引に関する注記)

(平成28年 2月18日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位：円)

区分	種類	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	4,399,713	-	4,406,270	6,557
	米ドル	832,762	-	829,619	3,143
	メキシコペソ	1,603,836	-	1,632,701	28,865
	ユーロ	1,439,205	-	1,429,660	9,545
	英ポンド	523,910	-	514,290	9,620
	売建	2,483,293,934	-	2,474,880,867	8,413,067
	米ドル	1,080,137,579	-	1,076,484,584	3,652,995
	メキシコペソ	129,149,091	-	131,128,391	1,979,300
	ユーロ	960,195,362	-	955,596,566	4,598,796
	英ポンド	225,895,777	-	223,910,213	1,985,564
	オーストラリアドル	87,916,125	-	87,761,113	155,012
	合計	2,487,693,647	-	2,479,287,137	8,419,624

(平成29年 2月20日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位：円)

区 分	種 類	契 約 額 等	うち1年超	時 価	評 価 損 益
市場取引以外の 取引	為替予約取引				
	売建	362,796,000	-	359,430,000	3,366,000
	ユーロ	362,796,000	-	359,430,000	3,366,000
合計		362,796,000	-	359,430,000	3,366,000

(注) 1. 時価の算定方法

(1) 為替予約取引の時価の算定方法について

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

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

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

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

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

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

自 平成28年 2月19日

至 平成29年 2月20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 2月18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	126,886,417,223円
同期中における追加設定元本額	6,661,708,692円
同期中における一部解約元本額	27,712,497,129円
平成28年 2月18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	7,156,914,733円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	283,155,221円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	816,152,669円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	391,479,609円

SMAM・グローバルバランスファンド(機動的資産配分型)	65,678,327円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2020	8,084,483円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2025	20,053,483円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2030	57,177,288円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2035	33,537,747円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2040	18,899,407円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2045	40,348,826円
三井住友・DC年金バランスゼロ(債券型)	935,027円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	126,172,805円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	209,579,902円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	271,019,067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>	1,486,334,046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>	4,116,106,420円
SMAM・バランスファンドVA25<適格機関投資家専用>	19,590,844,346円
SMAM・バランスファンドVA37.5<適格機関投資家専用>	7,388,321,434円
SMAM・バランスファンドVA50<適格機関投資家専用>	16,136,785,635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>	13,725,292円
SMAM・バランスファンドVA75<適格機関投資家専用>	936,651,340円
SMAM・バランスファンドVL国際分散型<適格機関投資家限定>	142,165,035円
SMAM・インデックス・バランスVA25<適格機関投資家専用>	1,513,583,466円
SMAM・インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用>	1,924,991,258円
SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用>	4,995,407,835円
SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>	9,191,592,746円
SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定>	150,974,873円
SMAM・外国債券パッシブファンドVA<適格機関投資家限定>	14,447,331,155円
三井住友・外国債券インデックスファンド・VAS(適格機関投資家専用)	1,306,786,613円
三井住友・5資産バランスファンド・VAS(適格機関投資家専用)	4,226,873,483円
SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	244,324,035円
SMAM・バランスファンドVA20<適格機関投資家専用>	861,343,324円
三井住友・7資産バランスファンド・VAS(適格機関投資家専用)	3,749,286,729円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>	185,069,203円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>	54,495,867円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用>	16,602,801円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>	209,180,765円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	716,753,636円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T<適格機関投資家専用>	226,773,526円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A2<適格機関投資家専用>	203,301,882円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A2<適格機関投資家専用>	57,130,687円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A2<適格機関投資家専用>	6,416,885円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L2<適格機関投資家専用>	1,772,298,242円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T2<適格機関投資家専用>	27,895,415円
SMAM・FG新興国重視型バランス20VA<適格機関投資家限定>	2,420,864円
SMAM・FGグローバルバランス25VA<適格機関投資家限定>	21,046,912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>	323,735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>	45,796,792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>	232,242円
S M A M ・ マルチアセットストラテジーファンド2016-01<適格機関投資家限定>	191,263,992円
合計	105,835,628,786円

(平成29年 2月20日現在)

開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	105,835,628,786円
同期中における追加設定元本額	34,882,825,852円
同期中における一部解約元本額	10,432,874,386円
平成29年 2月20日現在における元本の内訳	
三井住友・DC外国債券インデックスファンドS	8,358,315,433円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	389,830,570円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	1,052,407,898円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	538,770,076円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2020(4資産タイプ)	9,769,176円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2025(4資産タイプ)	28,929,706円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2030(4資産タイプ)	69,434,880円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2035(4資産タイプ)	54,726,029円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2040(4資産タイプ)	27,486,608円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2045(4資産タイプ)	65,848,707円
三井住友・DC年金バランスゼロ(債券型)	8,677,298円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	922,153,129円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	1,004,280,447円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	943,312,291円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2050	1,684,478円
S M A M ・ 年金外国債券パッシブ・ファンド<適格機関投資家限定>	1,858,733,714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>	3,077,480,090円
S M A M ・ バランスファンドVA25<適格機関投資家専用>	17,376,105,571円
S M A M ・ バランスファンドVA37.5<適格機関投資家専用>	7,352,945,318円
S M A M ・ バランスファンドVA50<適格機関投資家専用>	16,474,464,883円
S M A M ・ バランスファンドVL30<適格機関投資家限定>	44,556,535円
S M A M ・ バランスファンドVL50<適格機関投資家限定>	132,257,986円
世界6資産バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	8,183,393円
S M A M ・ バランスファンドVA75<適格機関投資家専用>	1,004,398,480円
S M A M ・ バランスファンドVL国際分散型<適格機関投資家限定>	152,420,385円
S M A M ・ インデックス・バランスVA25<適格機関投資家専用>	1,522,471,675円
S M A M ・ インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用>	1,968,892,164円
S M A M ・ バランスファンドVA40<適格機関投資家専用>	5,027,493,405円
S M A M ・ バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>	8,722,624,976円
S M A M ・ バランスVA株40T<適格機関投資家限定>	147,363,511円
S M A M ・ 外国債券パッシブファンドVA<適格機関投資家限定>	14,054,439,171円

三井住友・外国債券インデックスファンド・V A S (適格機関投資家専用)	1,253,064,467円
三井住友・5資産バランスファンド・V A S (適格機関投資家専用)	2,773,090,197円
S M A M ・ グローバルバランス40VA <適格機関投資家限定>	248,946,684円
S M A M ・ バランスファンドVA20 <適格機関投資家専用>	809,563,317円
三井住友・7資産バランスファンド・V A S (適格機関投資家専用)	3,091,050,370円
S M A M ・ アセットバランスファンドVA20A <適格機関投資家専用>	183,025,865円
S M A M ・ アセットバランスファンドVA35A <適格機関投資家専用>	51,000,429円
S M A M ・ アセットバランスファンドVA50A <適格機関投資家専用>	17,370,270円
S M A M ・ アセットバランスファンドVA20L <適格機関投資家専用>	193,870,007円
S M A M ・ アセットバランスファンドVA25L <適格機関投資家専用>	668,513,101円
S M A M ・ アセットバランスファンドVA20T <適格機関投資家専用>	220,923,296円
S M A M ・ アセットバランスファンドVA20A2 <適格機関投資家専用>	201,813,759円
S M A M ・ アセットバランスファンドVA35A2 <適格機関投資家専用>	57,866,612円
S M A M ・ アセットバランスファンドVA50A2 <適格機関投資家専用>	7,027,104円
S M A M ・ アセットバランスファンドVA25L2 <適格機関投資家専用>	1,734,420,431円
S M A M ・ アセットバランスファンドVA20T2 <適格機関投資家専用>	25,670,897円
S M A M ・ グローバルバランスファンド(標準型)VA <適格機関投資家限定>	5,405,578,472円
S M A M ・ グローバルバランスファンド(債券重視型)VA <適格機関投資家限定>	2,894,723,008円
S M A M ・ 世界バランスファンドVA <適格機関投資家限定>	8,664,062,208円
S M A M ・ 世界バランスファンドVA2 <適格機関投資家限定>	8,849,409,963円
S M A M ・ F G新興国重視型バランス20VA <適格機関投資家限定>	171,310円
S M A M ・ F Gグローバルバランス25VA <適格機関投資家限定>	4,611,078円
S M A M ・ 年金マルチ・インカム・ダイナミック・アロケーション ・ファンド<適格機関投資家限定>	133,552円
S M A M ・ 年金マルチ・インカム・ダイナミック・アロケーション ・ファンド<適格機関投資家限定>	49,010,896円
S M A M ・ 年金Wリスクコントロールファンド<適格機関投資家限定>	358,269円
S M A M ・ マルチアセットストラテジーファンド2016-04 <適格機関投資家限定>	227,318,078円
S M A M ・ マルチアセットストラテジーファンド2016-05 <適格機関投資家限定>	108,891,749円
S M A M ・ マルチアセットストラテジー・オープン <適格機関投資家限定>	143,636,880円
合計	130,285,580,252円

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	2,987,109.39	
		US TREASURY N/B 0.625	2,000,000.00	1,989,218.76	

US TREASURY N/B 0.75	7,000,000.00	6,986,328.16	
US TREASURY N/B 0.75	3,000,000.00	2,993,203.14	
US TREASURY N/B 0.75	4,000,000.00	3,989,375.00	
US TREASURY N/B 0.75	2,000,000.00	1,994,062.50	
US TREASURY N/B 0.75	3,000,000.00	2,986,640.64	
US TREASURY N/B 0.75	3,500,000.00	3,482,500.00	
US TREASURY N/B 0.75	3,000,000.00	2,982,656.25	
US TREASURY N/B 0.75	2,000,000.00	1,986,718.76	
US TREASURY N/B 0.75	2,000,000.00	1,981,406.26	
US TREASURY N/B 0.75	2,000,000.00	1,971,875.00	
US TREASURY N/B 0.75	3,000,000.00	2,955,468.75	
US TREASURY N/B 0.875	2,000,000.00	1,999,531.26	
US TREASURY N/B 0.875	4,000,000.00	3,995,625.00	
US TREASURY N/B 0.875	3,000,000.00	2,995,078.14	
US TREASURY N/B 0.875	3,000,000.00	2,993,203.14	
US TREASURY N/B 0.875	2,000,000.00	1,991,875.00	
US TREASURY N/B 0.875	4,000,000.00	3,965,937.52	
US TREASURY N/B 0.875	3,000,000.00	2,971,875.00	
US TREASURY N/B 0.875	3,000,000.00	2,969,296.89	
US TREASURY N/B 0.875	3,000,000.00	2,961,796.89	
US TREASURY N/B 1	4,000,000.00	4,002,812.52	
US TREASURY N/B 1	2,000,000.00	2,000,781.26	
US TREASURY N/B 1	3,000,000.00	3,000,000.00	
US TREASURY N/B 1	5,000,000.00	4,998,828.15	
US TREASURY N/B 1	3,000,000.00	2,997,421.89	
US TREASURY N/B 1	3,000,000.00	2,995,312.50	
US TREASURY N/B 1	3,000,000.00	2,991,093.75	
US TREASURY N/B 1	4,000,000.00	3,979,375.00	
US TREASURY N/B 1	3,000,000.00	2,977,265.64	
US TREASURY N/B 1	4,000,000.00	3,963,437.52	
US TREASURY N/B 1	2,000,000.00	1,979,375.00	
US TREASURY N/B 1	2,000,000.00	1,979,062.50	
US TREASURY N/B 1	2,000,000.00	1,976,718.76	
US TREASURY N/B 1	3,000,000.00	2,965,078.14	
US TREASURY N/B 1.125	2,000,000.00	2,002,812.50	
US TREASURY N/B 1.125	3,000,000.00	2,995,312.50	
US TREASURY N/B 1.125	3,000,000.00	2,995,312.50	
US TREASURY N/B 1.125	2,000,000.00	1,991,718.76	
US TREASURY N/B 1.125	4,000,000.00	3,963,750.00	
US TREASURY N/B 1.125	2,800,000.00	2,766,750.00	
US TREASURY N/B 1.125	3,000,000.00	2,960,859.39	
US TREASURY N/B 1.125	3,800,000.00	3,704,703.14	

US TREASURY N/B 1.125	3,000,000.00	2,909,765.64
US TREASURY N/B 1.125	3,000,000.00	2,906,015.64
US TREASURY N/B 1.125	5,000,000.00	4,839,843.75
US TREASURY N/B 1.125	5,000,000.00	4,832,812.50
US TREASURY N/B 1.25	3,000,000.00	3,004,921.89
US TREASURY N/B 1.25	3,000,000.00	3,004,921.89
US TREASURY N/B 1.25	3,000,000.00	3,003,515.64
US TREASURY N/B 1.25	3,000,000.00	3,003,515.64
US TREASURY N/B 1.25	3,000,000.00	3,002,812.50
US TREASURY N/B 1.25	4,000,000.00	4,002,968.76
US TREASURY N/B 1.25	2,000,000.00	1,997,968.76
US TREASURY N/B 1.25	2,000,000.00	1,991,093.76
US TREASURY N/B 1.25	3,000,000.00	2,979,843.75
US TREASURY N/B 1.25	3,000,000.00	2,977,968.75
US TREASURY N/B 1.25	4,000,000.00	3,913,750.00
US TREASURY N/B 1.25	5,000,000.00	4,855,468.75
US TREASURY N/B 1.25	3,000,000.00	2,831,953.14
US TREASURY N/B 1.375	3,000,000.00	3,014,296.89
US TREASURY N/B 1.375	3,000,000.00	3,013,828.14
US TREASURY N/B 1.375	4,500,000.00	4,518,281.25
US TREASURY N/B 1.375	5,000,000.00	5,018,359.40
US TREASURY N/B 1.375	2,000,000.00	2,006,718.76
US TREASURY N/B 1.375	5,000,000.00	5,014,062.50
US TREASURY N/B 1.375	3,000,000.00	2,993,671.89
US TREASURY N/B 1.375	3,000,000.00	2,992,031.25
US TREASURY N/B 1.375	4,000,000.00	3,988,750.00
US TREASURY N/B 1.375	5,000,000.00	4,980,078.15
US TREASURY N/B 1.375	4,000,000.00	3,981,562.52
US TREASURY N/B 1.375	4,000,000.00	3,977,187.52
US TREASURY N/B 1.375	3,000,000.00	2,980,546.89
US TREASURY N/B 1.375	5,000,000.00	4,953,125.00
US TREASURY N/B 1.375	3,000,000.00	2,968,125.00
US TREASURY N/B 1.375	5,000,000.00	4,942,968.75
US TREASURY N/B 1.375	3,000,000.00	2,956,406.25
US TREASURY N/B 1.375	4,000,000.00	3,930,000.00
US TREASURY N/B 1.375	4,000,000.00	3,925,312.52
US TREASURY N/B 1.375	3,000,000.00	2,858,437.50
US TREASURY N/B 1.375	4,000,000.00	3,801,250.00
US TREASURY N/B 1.375	3,000,000.00	2,847,421.89
US TREASURY N/B 1.5	5,000,000.00	5,031,250.00
US TREASURY N/B 1.5	4,700,000.00	4,726,070.33
US TREASURY N/B 1.5	2,000,000.00	2,010,937.50
US TREASURY N/B 1.5	4,000,000.00	4,021,250.00

US TREASURY N/B 1.5	3,000,000.00	3,012,421.89
US TREASURY N/B 1.5	3,000,000.00	3,005,859.39
US TREASURY N/B 1.5	5,000,000.00	5,007,812.50
US TREASURY N/B 1.5	3,000,000.00	2,992,031.25
US TREASURY N/B 1.5	3,000,000.00	2,939,062.50
US TREASURY N/B 1.5	4,000,000.00	3,858,125.00
US TREASURY N/B 1.5	3,000,000.00	2,890,312.50
US TREASURY N/B 1.5	8,000,000.00	7,364,375.04
US TREASURY N/B 1.625	5,000,000.00	5,036,328.15
US TREASURY N/B 1.625	4,000,000.00	4,028,125.00
US TREASURY N/B 1.625	3,000,000.00	3,019,921.89
US TREASURY N/B 1.625	2,000,000.00	2,012,500.00
US TREASURY N/B 1.625	3,000,000.00	3,018,281.25
US TREASURY N/B 1.625	5,000,000.00	5,022,656.25
US TREASURY N/B 1.625	3,500,000.00	3,502,187.50
US TREASURY N/B 1.625	3,000,000.00	2,999,296.89
US TREASURY N/B 1.625	5,000,000.00	4,983,593.75
US TREASURY N/B 1.625	3,000,000.00	2,938,593.75
US TREASURY N/B 1.625	3,500,000.00	3,414,414.08
US TREASURY N/B 1.625	3,000,000.00	2,908,593.75
US TREASURY N/B 1.625	3,000,000.00	2,905,312.50
US TREASURY N/B 1.625	3,000,000.00	2,892,187.50
US TREASURY N/B 1.625	8,000,000.00	7,484,375.04
US TREASURY N/B 1.625	7,000,000.00	6,532,968.75
US TREASURY N/B 1.75	1,000,000.00	1,010,000.00
US TREASURY N/B 1.75	4,000,000.00	4,034,687.52
US TREASURY N/B 1.75	4,300,000.00	4,310,750.00
US TREASURY N/B 1.75	5,000,000.00	5,002,734.40
US TREASURY N/B 1.75	3,000,000.00	2,980,312.50
US TREASURY N/B 1.75	3,000,000.00	2,972,812.50
US TREASURY N/B 1.75	4,500,000.00	4,453,242.21
US TREASURY N/B 1.75	3,000,000.00	2,965,312.50
US TREASURY N/B 1.75	3,000,000.00	2,964,140.64
US TREASURY N/B 1.75	3,000,000.00	2,951,484.39
US TREASURY N/B 1.75	3,000,000.00	2,939,765.64
US TREASURY N/B 1.75	7,000,000.00	6,832,656.25
US TREASURY N/B 1.875	3,000,000.00	3,027,421.89
US TREASURY N/B 1.875	3,000,000.00	2,995,781.25
US TREASURY N/B 1.875	3,000,000.00	2,983,125.00
US TREASURY N/B 1.875	4,000,000.00	3,963,750.00
US TREASURY N/B 1.875	3,000,000.00	2,968,593.75
US TREASURY N/B 2	3,000,000.00	3,037,734.39

US TREASURY N/B 2	2,300,000.00	2,327,312.50
US TREASURY N/B 2	4,000,000.00	4,042,187.52
US TREASURY N/B 2	3,000,000.00	3,028,593.75
US TREASURY N/B 2	4,000,000.00	4,030,625.00
US TREASURY N/B 2	3,000,000.00	3,015,703.14
US TREASURY N/B 2	3,000,000.00	3,013,828.14
US TREASURY N/B 2	6,000,000.00	6,025,781.28
US TREASURY N/B 2	5,000,000.00	5,021,093.75
US TREASURY N/B 2	5,100,000.00	5,116,335.96
US TREASURY N/B 2	3,000,000.00	2,995,546.89
US TREASURY N/B 2	5,000,000.00	4,976,562.50
US TREASURY N/B 2	7,500,000.00	7,450,195.35
US TREASURY N/B 2	8,000,000.00	7,798,125.04
US TREASURY N/B 2	8,000,000.00	7,758,750.00
US TREASURY N/B 2	8,000,000.00	7,692,500.00
US TREASURY N/B 2.125	3,500,000.00	3,556,601.58
US TREASURY N/B 2.125	4,000,000.00	4,057,187.52
US TREASURY N/B 2.125	4,000,000.00	4,050,000.00
US TREASURY N/B 2.125	5,000,000.00	5,053,906.25
US TREASURY N/B 2.125	3,000,000.00	3,031,171.89
US TREASURY N/B 2.125	4,000,000.00	4,038,437.52
US TREASURY N/B 2.125	3,000,000.00	3,017,578.14
US TREASURY N/B 2.125	4,000,000.00	4,005,937.52
US TREASURY N/B 2.125	4,000,000.00	3,978,437.52
US TREASURY N/B 2.125	9,000,000.00	8,834,062.50
US TREASURY N/B 2.25	2,000,000.00	2,034,375.00
US TREASURY N/B 2.25	4,000,000.00	4,073,437.52
US TREASURY N/B 2.25	2,000,000.00	2,036,562.50
US TREASURY N/B 2.25	4,000,000.00	4,066,875.00
US TREASURY N/B 2.25	4,000,000.00	4,006,875.00
US TREASURY N/B 2.25	8,000,000.00	7,959,375.04
US TREASURY N/B 2.25	8,500,000.00	8,393,750.00
US TREASURY N/B 2.25	5,000,000.00	4,218,359.40
US TREASURY N/B 2.375	2,000,000.00	2,036,562.50
US TREASURY N/B 2.375	2,000,000.00	2,048,750.00
US TREASURY N/B 2.375	8,000,000.00	8,050,625.04
US TREASURY N/B 2.5	6,000,000.00	6,112,031.28
US TREASURY N/B 2.5	8,000,000.00	8,129,375.04
US TREASURY N/B 2.5	5,500,000.00	4,923,789.09
US TREASURY N/B 2.5	5,300,000.00	4,734,804.71
US TREASURY N/B 2.5	5,000,000.00	4,464,453.15
US TREASURY N/B 2.625	4,000,000.00	4,064,375.00
US TREASURY N/B 2.625	2,000,000.00	2,038,906.26

US TREASURY N/B 2.625	4,000,000.00	4,132,500.00	
US TREASURY N/B 2.625	5,500,000.00	5,685,195.34	
US TREASURY N/B 2.75	3,000,000.00	3,055,078.14	
US TREASURY N/B 2.75	3,000,000.00	3,090,000.00	
US TREASURY N/B 2.75	6,200,000.00	6,408,765.65	
US TREASURY N/B 2.75	7,000,000.00	7,235,703.16	
US TREASURY N/B 2.75	2,000,000.00	1,899,062.50	
US TREASURY N/B 2.75	11,000,000.00	10,431,953.18	
US TREASURY N/B 2.875	3,000,000.00	3,062,812.50	
US TREASURY N/B 2.875	3,000,000.00	2,911,875.00	
US TREASURY N/B 2.875	4,000,000.00	3,867,187.52	
US TREASURY N/B 2.875	4,500,000.00	4,356,210.96	
US TREASURY N/B 3	2,800,000.00	2,790,156.26	
US TREASURY N/B 3	4,000,000.00	3,967,187.52	
US TREASURY N/B 3	4,000,000.00	3,963,750.00	
US TREASURY N/B 3	6,000,000.00	5,943,281.28	
US TREASURY N/B 3.125	2,000,000.00	2,079,531.26	
US TREASURY N/B 3.125	5,000,000.00	5,264,453.15	
US TREASURY N/B 3.125	2,000,000.00	2,038,437.50	
US TREASURY N/B 3.125	2,500,000.00	2,547,070.32	
US TREASURY N/B 3.125	6,000,000.00	6,095,156.28	
US TREASURY N/B 3.375	5,000,000.00	5,264,062.50	
US TREASURY N/B 3.375	4,000,000.00	4,255,625.00	
US TREASURY N/B 3.5	2,500,000.00	2,562,500.00	
US TREASURY N/B 3.5	4,500,000.00	4,774,218.75	
US TREASURY N/B 3.5	2,000,000.00	2,192,187.50	
US TREASURY N/B 3.625	5,000,000.00	5,274,609.40	
US TREASURY N/B 3.625	6,000,000.00	6,373,593.78	
US TREASURY N/B 3.625	5,000,000.00	5,359,375.00	
US TREASURY N/B 3.625	6,000,000.00	6,669,375.00	
US TREASURY N/B 3.625	5,000,000.00	5,555,859.40	
US TREASURY N/B 3.75	3,000,000.00	3,134,531.25	
US TREASURY N/B 3.75	2,000,000.00	2,260,937.50	
US TREASURY N/B 3.75	4,000,000.00	4,543,437.52	
US TREASURY N/B 3.875	6,000,000.00	6,215,156.28	
US TREASURY N/B 3.875	2,000,000.00	2,304,687.50	
US TREASURY N/B 4	2,500,000.00	2,609,765.62	
US TREASURY N/B 4.25	2,000,000.00	2,434,062.50	
US TREASURY N/B 4.25	2,000,000.00	2,434,531.26	
US TREASURY N/B 4.375	1,200,000.00	1,493,718.75	
US TREASURY N/B 4.375	1,500,000.00	1,857,187.50	
US TREASURY N/B 4.375	2,500,000.00	3,095,703.12	

	US TREASURY N/B 4.375	2,000,000.00	2,482,500.00
	US TREASURY N/B 4.5	1,500,000.00	1,899,375.00
	US TREASURY N/B 4.5	1,000,000.00	1,266,093.75
	US TREASURY N/B 4.5	1,000,000.00	1,258,359.38
	US TREASURY N/B 4.625	4,000,000.00	5,123,750.00
	US TREASURY N/B 4.75	1,500,000.00	1,959,492.19
	US TREASURY N/B 5	1,000,000.00	1,342,734.38
	US TREASURY N/B 5.25	1,000,000.00	1,275,312.50
	US TREASURY N/B 5.25	500,000.00	640,312.50
	US TREASURY N/B 5.375	1,320,000.00	1,760,343.75
	US TREASURY N/B 5.5	1,000,000.00	1,295,937.50
	US TREASURY N/B 6	1,000,000.00	1,292,421.88
	US TREASURY N/B 6.125	1,000,000.00	1,342,890.63
	US TREASURY N/B 6.25	800,000.00	999,187.50
	US TREASURY N/B 6.25	1,000,000.00	1,415,937.50
	US TREASURY N/B 6.5	500,000.00	676,328.12
	US TREASURY N/B 8	1,300,000.00	1,659,023.44
	US TREASURY N/B 8.75	1,000,000.00	1,241,328.13
	US TREASURY N/B 8.875	1,100,000.00	1,267,750.00
	米ドル 小計	838,520,000.00	844,992,588.07 (95,382,763,341)
カナダドル	CANADA-GOV'T 0.25	1,000,000.00	997,700.00
	CANADA-GOV'T 0.5	2,000,000.00	1,993,920.00
	CANADA-GOV'T 0.5	2,000,000.00	1,991,720.00
	CANADA-GOV'T 0.5	2,000,000.00	1,989,300.00
	CANADA-GOV'T 0.5	2,000,000.00	1,935,200.00
	CANADA-GOV'T 0.75	1,000,000.00	990,650.00
	CANADA-GOV'T 0.75	2,000,000.00	1,974,300.00
	CANADA-GOV'T 0.75	2,000,000.00	1,967,000.00
	CANADA-GOV'T 1	1,000,000.00	922,900.00
	CANADA-GOV'T 1.25	1,000,000.00	1,003,160.00
	CANADA-GOV'T 1.25	1,000,000.00	1,005,960.00
	CANADA-GOV'T 1.25	2,000,000.00	2,012,520.00
	CANADA-GOV'T 1.25	1,000,000.00	1,007,900.00
	CANADA-GOV'T 1.5	1,000,000.00	1,004,890.00
	CANADA-GOV'T 1.5	2,000,000.00	2,033,700.00
	CANADA-GOV'T 1.5	2,000,000.00	2,015,100.00
	CANADA-GOV'T 1.5	2,000,000.00	1,964,800.00
	CANADA-GOV'T 1.75	1,000,000.00	1,019,540.00
	CANADA-GOV'T 1.75	1,000,000.00	1,022,740.00
	CANADA-GOV'T 2.25	1,000,000.00	1,049,690.00
	CANADA-GOV'T 2.5	2,000,000.00	2,139,260.00
	CANADA-GOV'T 2.75	1,000,000.00	1,076,800.00

	CANADA-GOV'T 2.75	2,000,000.00	2,150,000.00	
	CANADA-GOV'T 3.25	1,000,000.00	1,089,380.00	
	CANADA-GOV'T 3.5	2,000,000.00	2,162,480.00	
	CANADA-GOV'T 3.5	1,500,000.00	1,824,585.00	
	CANADA-GOV'T 3.75	2,500,000.00	2,664,250.00	
	CANADA-GOV'T 4	3,000,000.00	3,851,520.00	
	CANADA-GOV'T 4.25	1,500,000.00	1,567,350.00	
	CANADA-GOV'T 5	1,500,000.00	2,129,385.00	
	CANADA-GOV'T 5.75	1,500,000.00	2,107,515.00	
	CANADA-GOV'T 5.75	1,500,000.00	2,213,790.00	
	CANADA-GOV'T 8	500,000.00	789,035.00	
	カナダドル 小計	51,500,000.00	55,668,040.00	(4,797,471,687)
メキシコペソ	MEXICAN BONOS 10	40,000,000.00	46,399,680.00	
	MEXICAN BONOS 5.75	20,000,000.00	17,824,740.00	
	MEXICAN BONOS 6.5	30,000,000.00	29,105,460.00	
	MEXICAN BONOS 7.75	20,000,000.00	20,204,340.00	
	MEXICAN BONOS 8	50,000,000.00	51,468,750.00	
	MEXICAN BONOS 8	20,000,000.00	20,770,620.00	
	MEXICAN BONOS 8.5	20,000,000.00	20,564,500.00	
	MEXICAN BONOS 8.5	50,000,000.00	53,465,400.00	
	MEXICAN BONOS 8.5	40,000,000.00	42,369,760.00	
	メキシコペソ 小計	290,000,000.00	302,173,250.00	(1,667,996,340)
ユーロ	BELGIAN 0326 4	1,000,000.00	1,387,640.00	
	BELGIAN 0.2	1,000,000.00	1,005,150.00	
	BELGIAN 0.8	2,000,000.00	2,048,220.00	
	BELGIAN 0.8	1,000,000.00	996,850.00	
	BELGIAN 0291 5.5	2,000,000.00	2,997,780.00	
	BELGIAN 0304 5	2,500,000.00	3,990,825.00	
	BELGIAN 0308 4	1,500,000.00	1,826,940.00	
	BELGIAN 0312 4	1,000,000.00	1,051,330.00	
	BELGIAN 0315 4	1,500,000.00	1,644,810.00	
	BELGIAN 0318 3.75	2,000,000.00	2,305,040.00	
	BELGIAN 0320 4.25	2,500,000.00	3,825,025.00	
	BELGIAN 0321 4.25	1,700,000.00	2,061,012.00	
	BELGIAN 0324 4.5	1,000,000.00	1,349,830.00	
	BELGIAN 0325 4.25	2,000,000.00	2,492,520.00	
	BELGIAN 0327 3	2,000,000.00	2,185,580.00	
	BELGIAN 0328 2.25	2,000,000.00	2,284,060.00	
	BELGIAN 0329 1.25	2,000,000.00	2,050,400.00	
	BELGIAN 0332 2.6	2,000,000.00	2,336,960.00	

BELGIAN 0333 3	500,000.00	630,390.00
BELGIAN 1	2,000,000.00	2,060,220.00
BELGIAN 1	1,000,000.00	971,890.00
BELGIAN 1.9	1,000,000.00	1,065,090.00
BELGIAN 2.15	500,000.00	499,255.00
BELGIAN 3.75	1,000,000.00	1,442,950.00
BTPS 0.05	1,000,000.00	993,900.00
BTPS 0.1	1,000,000.00	999,620.00
BTPS 0.25	2,000,000.00	2,010,340.00
BTPS 0.3	1,000,000.00	1,005,520.00
BTPS 0.35	2,000,000.00	1,949,700.00
BTPS 0.45	2,000,000.00	1,978,100.00
BTPS 0.65	2,000,000.00	2,012,100.00
BTPS 0.65	2,000,000.00	1,888,140.00
BTPS 0.7	2,000,000.00	2,018,460.00
BTPS 0.95	2,000,000.00	1,952,600.00
BTPS 1.05	2,000,000.00	2,041,860.00
BTPS 1.25	3,000,000.00	2,758,260.00
BTPS 1.35	2,000,000.00	2,024,960.00
BTPS 1.45	2,000,000.00	2,026,080.00
BTPS 1.5	3,000,000.00	3,089,730.00
BTPS 1.5	2,000,000.00	1,933,020.00
BTPS 1.6	2,000,000.00	1,911,380.00
BTPS 1.65	2,000,000.00	1,789,880.00
BTPS 2	2,000,000.00	1,985,720.00
BTPS 2.15	2,000,000.00	2,112,660.00
BTPS 2.25	1,000,000.00	917,860.00
BTPS 2.5	3,000,000.00	3,152,100.00
BTPS 2.5	3,000,000.00	3,132,840.00
BTPS 2.7	2,000,000.00	1,781,520.00
BTPS 2.8	1,000,000.00	827,230.00
BTPS 3.25	1,500,000.00	1,494,660.00
BTPS 3.5	3,400,000.00	3,556,978.00
BTPS 3.5	2,000,000.00	2,123,460.00
BTPS 3.5	3,000,000.00	3,311,430.00
BTPS 3.75	3,000,000.00	3,373,470.00
BTPS 3.75	2,000,000.00	2,250,200.00
BTPS 3.75	3,300,000.00	3,726,228.00
BTPS 3.75	2,000,000.00	2,266,900.00
BTPS 4	3,500,000.00	3,929,100.00
BTPS 4	3,000,000.00	3,462,540.00
BTPS 4.25	2,400,000.00	2,594,904.00
BTPS 4.25	3,500,000.00	3,848,985.00

BTPS 4.25	3,300,000.00	3,683,724.00	
BTPS 4.5	2,000,000.00	2,089,500.00	
BTPS 4.5	3,000,000.00	3,198,270.00	
BTPS 4.5	2,700,000.00	2,939,571.00	
BTPS 4.5	2,700,000.00	3,027,591.00	
BTPS 4.5	2,800,000.00	3,302,152.00	
BTPS 4.5	3,000,000.00	3,551,010.00	
BTPS 4.5	3,000,000.00	3,569,790.00	
BTPS 4.75	2,600,000.00	3,048,994.00	
BTPS 4.75	3,500,000.00	4,202,380.00	
BTPS 4.75	3,000,000.00	3,673,050.00	
BTPS 4.75	2,000,000.00	2,510,700.00	
BTPS 5	3,000,000.00	3,575,610.00	
BTPS 5	3,000,000.00	3,677,790.00	
BTPS 5	2,470,000.00	3,198,477.10	
BTPS 5	2,000,000.00	2,590,680.00	
BTPS 5	2,500,000.00	3,223,675.00	
BTPS 5.25	3,700,000.00	4,774,147.00	
BTPS 5.5	2,500,000.00	3,069,525.00	
BTPS 5.5	2,500,000.00	3,075,100.00	
BTPS 5.75	2,200,000.00	3,044,624.00	
BTPS 6	4,100,000.00	5,729,463.00	
BTPS 6.5	2,960,000.00	4,108,420.80	
BTPS 7.25	1,000,000.00	1,436,670.00	
BTPS 9	1,000,000.00	1,469,970.00	
BUNDESOBL-165 0.5	1,000,000.00	1,013,900.00	
BUNDESOBL-166 0.25	2,000,000.00	2,026,020.00	
BUNDESOBL-167 1	2,000,000.00	2,060,820.00	
BUNDESOBL-168 1	1,000,000.00	1,037,370.00	
BUNDESOBL-169 0.5	2,000,000.00	2,058,020.00	
BUNDESOBL-170 0.25	1,000,000.00	1,028,690.00	
BUNDESOBL-171 0	3,000,000.00	3,071,370.00	
BUNDESOBL-172 0.25	2,000,000.00	2,069,180.00	
BUNDESOBL-173 0	3,000,000.00	3,077,760.00	
BUNDESOBL-174 0	3,000,000.00	3,078,570.00	
BUNDESSCHATZANW 0	2,000,000.00	2,018,520.00	
BUNDESSCHATZANW 0	2,000,000.00	2,022,780.00	
BUNDESSCHATZANW 0	1,000,000.00	1,013,360.00	
BUNDESSCHATZANW 0	2,000,000.00	2,030,120.00	
DEUTSCHLAND REP 0	3,000,000.00	2,935,350.00	
DEUTSCHLAND REP 0.5	3,000,000.00	3,129,540.00	
DEUTSCHLAND REP 0.5	3,000,000.00	3,100,650.00	

DEUTSCHLAND REP 1	2,000,000.00	2,167,820.00
DEUTSCHLAND REP 1	3,000,000.00	3,244,410.00
DEUTSCHLAND REP 1.5	2,500,000.00	2,770,050.00
DEUTSCHLAND REP 1.5	2,500,000.00	2,779,775.00
DEUTSCHLAND REP 1.5	2,000,000.00	2,228,820.00
DEUTSCHLAND REP 1.5	2,000,000.00	2,240,660.00
DEUTSCHLAND REP 1.75	2,500,000.00	2,798,025.00
DEUTSCHLAND REP 1.75	2,000,000.00	2,274,180.00
DEUTSCHLAND REP 2	2,000,000.00	2,248,280.00
DEUTSCHLAND REP 2	2,500,000.00	2,874,525.00
DEUTSCHLAND REP 2.25	2,500,000.00	2,765,275.00
DEUTSCHLAND REP 2.25	2,000,000.00	2,259,840.00
DEUTSCHLAND REP 2.5	2,000,000.00	2,248,140.00
DEUTSCHLAND REP 2.5	2,200,000.00	2,953,786.00
DEUTSCHLAND REP 2.5	2,000,000.00	2,712,960.00
DEUTSCHLAND REP 3	3,000,000.00	3,383,100.00
DEUTSCHLAND REP 3.25	3,000,000.00	3,353,220.00
DEUTSCHLAND REP 3.25	2,000,000.00	2,342,280.00
DEUTSCHLAND REP 3.25	1,500,000.00	2,251,710.00
DEUTSCHLAND REP 3.5	4,000,000.00	4,414,800.00
DEUTSCHLAND REP 3.75	3,500,000.00	3,804,045.00
DEUTSCHLAND REP 4	3,200,000.00	5,065,312.00
DEUTSCHLAND REP 4.25	3,200,000.00	3,425,344.00
DEUTSCHLAND REP 4.25	1,500,000.00	2,516,460.00
DEUTSCHLAND REP 4.75	1,300,000.00	1,935,700.00
DEUTSCHLAND REP 4.75	3,100,000.00	5,157,098.00
DEUTSCHLAND REP 4.75	2,400,000.00	4,327,632.00
DEUTSCHLAND REP 5.5	1,800,000.00	2,996,442.00
DEUTSCHLAND REP 5.625	1,580,000.00	2,478,862.00
DEUTSCHLAND REP 6.25	1,200,000.00	1,737,504.00
DEUTSCHLAND REP 6.25	1,000,000.00	1,723,690.00
DEUTSCHLAND REP 6.5	2,000,000.00	3,276,020.00
FINNISH GOV'T 0.75	1,000,000.00	980,210.00
FINNISH GOV'T 1.5	1,000,000.00	1,095,180.00
FINNISH GOV'T 1.625	1,000,000.00	1,099,230.00
FINNISH GOV'T 2	1,000,000.00	1,133,800.00
FINNISH GOV'T 2.625	500,000.00	655,610.00
FINNISH GOV'T 2.75	600,000.00	738,624.00
FINNISH GOV'T 3.375	1,200,000.00	1,349,004.00
FINNISH GOV'T 3.5	1,000,000.00	1,163,070.00
FINNISH GOV'T 4	1,000,000.00	1,310,750.00
FINNISH GOV'T 4.375	1,000,000.00	1,119,890.00
FRANCE O.A.T. 0	1,000,000.00	1,006,140.00

FRANCE O.A.T. 0	3,000,000.00	3,031,440.00	
FRANCE O.A.T. 0	3,000,000.00	3,033,150.00	
FRANCE O.A.T. 0	3,000,000.00	3,017,700.00	
FRANCE O.A.T. 0	2,000,000.00	1,990,380.00	
FRANCE O.A.T. 0.25	3,000,000.00	3,056,820.00	
FRANCE O.A.T. 0.25	2,000,000.00	1,855,280.00	
FRANCE O.A.T. 0.5	3,000,000.00	3,077,340.00	
FRANCE O.A.T. 0.5	4,000,000.00	3,930,160.00	
FRANCE O.A.T. 0.5	3,000,000.00	2,881,800.00	
FRANCE O.A.T. 1	3,000,000.00	3,059,970.00	
FRANCE O.A.T. 1	3,000,000.00	3,081,870.00	
FRANCE O.A.T. 1	2,000,000.00	2,067,240.00	
FRANCE O.A.T. 1	3,000,000.00	3,042,810.00	
FRANCE O.A.T. 1.25	2,000,000.00	1,840,560.00	
FRANCE O.A.T. 1.5	3,000,000.00	3,021,450.00	
FRANCE O.A.T. 1.75	4,000,000.00	4,363,800.00	
FRANCE O.A.T. 1.75	4,000,000.00	4,354,440.00	
FRANCE O.A.T. 1.75	1,000,000.00	850,050.00	
FRANCE O.A.T. 2.25	3,800,000.00	4,249,502.00	
FRANCE O.A.T. 2.25	4,000,000.00	4,505,240.00	
FRANCE O.A.T. 2.5	4,500,000.00	4,961,655.00	
FRANCE O.A.T. 2.5	4,000,000.00	4,558,080.00	
FRANCE O.A.T. 2.75	4,000,000.00	4,647,120.00	
FRANCE O.A.T. 3	5,000,000.00	5,767,700.00	
FRANCE O.A.T. 3.25	4,800,000.00	5,546,304.00	
FRANCE O.A.T. 3.25	3,200,000.00	4,021,120.00	
FRANCE O.A.T. 3.5	5,000,000.00	5,614,750.00	
FRANCE O.A.T. 3.5	5,000,000.00	6,145,850.00	
FRANCE O.A.T. 3.75	5,000,000.00	5,563,700.00	
FRANCE O.A.T. 3.75	4,700,000.00	5,471,176.00	
FRANCE O.A.T. 4	4,000,000.00	4,217,120.00	
FRANCE O.A.T. 4	3,700,000.00	5,177,447.00	
FRANCE O.A.T. 4	1,370,000.00	2,030,216.70	
FRANCE O.A.T. 4	1,500,000.00	2,258,280.00	
FRANCE O.A.T. 4.25	4,000,000.00	4,324,720.00	
FRANCE O.A.T. 4.25	4,400,000.00	4,856,720.00	
FRANCE O.A.T. 4.25	5,000,000.00	6,288,050.00	
FRANCE O.A.T. 4.5	4,200,000.00	6,310,920.00	
FRANCE O.A.T. 4.75	3,100,000.00	4,631,493.00	
FRANCE O.A.T. 5.5	3,500,000.00	5,187,560.00	
FRANCE O.A.T. 5.75	4,200,000.00	6,716,472.00	
FRANCE O.A.T. 6	3,500,000.00	5,050,430.00	

FRANCE O.A.T. 8.5	850,000.00	1,054,867.00
FRANCE O.A.T. 8.5	700,000.00	1,051,925.00
IRISH GOVT 0.8	1,000,000.00	1,036,180.00
IRISH GOVT 1	1,000,000.00	995,450.00
IRISH GOVT 2	1,000,000.00	965,950.00
IRISH GOVT 2.4	1,000,000.00	1,100,000.00
IRISH GOVT 3.4	1,000,000.00	1,192,620.00
IRISH GOVT 3.9	1,000,000.00	1,214,290.00
IRISH GOVT 4.4	1,000,000.00	1,112,460.00
IRISH GOVT 4.5	1,000,000.00	1,082,600.00
IRISH GOVT 4.5	1,490,000.00	1,714,647.30
IRISH GOVT 5	1,000,000.00	1,193,530.00
IRISH GOVT 5.4	1,500,000.00	2,031,525.00
IRISH GOVT 5.9	800,000.00	934,120.00
NETHERLANDS GOVT 0	2,000,000.00	2,017,700.00
NETHERLANDS GOVT 0	2,000,000.00	2,028,560.00
NETHERLANDS GOVT 0.25	2,000,000.00	2,051,740.00
NETHERLANDS GOVT 0.25	2,000,000.00	1,989,420.00
NETHERLANDS GOVT 0.5	1,500,000.00	1,504,530.00
NETHERLANDS GOVT 1.25	2,000,000.00	2,075,180.00
NETHERLANDS GOVT 1.75	2,200,000.00	2,460,304.00
NETHERLANDS GOVT 2	2,000,000.00	2,276,380.00
NETHERLANDS GOVT 2.25	2,000,000.00	2,275,360.00
NETHERLANDS GOVT 2.5	1,100,000.00	1,368,279.00
NETHERLANDS GOVT 2.75	2,000,000.00	2,772,480.00
NETHERLANDS GOVT 3.25	1,500,000.00	1,747,950.00
NETHERLANDS GOVT 3.5	2,000,000.00	2,280,300.00
NETHERLANDS GOVT 3.75	1,000,000.00	1,234,870.00
NETHERLANDS GOVT 3.75	1,500,000.00	2,371,335.00
NETHERLANDS GOVT 4	1,500,000.00	1,600,500.00
NETHERLANDS GOVT 4	1,500,000.00	1,670,010.00
NETHERLANDS GOVT 4	2,200,000.00	3,404,258.00
NETHERLANDS GOVT 5.5	1,500,000.00	2,280,330.00
REP OF AUSTRIA 0.25	1,000,000.00	1,023,700.00
REP OF AUSTRIA 0.75	900,000.00	914,004.00
REP OF AUSTRIA 1.15	1,000,000.00	1,030,880.00
REP OF AUSTRIA 1.2	1,500,000.00	1,602,750.00
REP OF AUSTRIA 1.5	1,000,000.00	993,830.00
REP OF AUSTRIA 1.65	1,000,000.00	1,108,960.00
REP OF AUSTRIA 1.75	1,000,000.00	1,115,750.00
REP OF AUSTRIA 1.95	1,000,000.00	1,061,130.00
REP OF AUSTRIA 2.4	1,000,000.00	1,203,200.00
REP OF AUSTRIA 3.15	500,000.00	694,875.00

REP OF AUSTRIA 3.4	1,000,000.00	1,204,670.00	
REP OF AUSTRIA 3.5	2,000,000.00	2,355,960.00	
REP OF AUSTRIA 3.65	1,000,000.00	1,201,480.00	
REP OF AUSTRIA 3.8	500,000.00	837,705.00	
REP OF AUSTRIA 3.9	1,500,000.00	1,728,420.00	
REP OF AUSTRIA 4.15	1,300,000.00	1,972,776.00	
REP OF AUSTRIA 4.35	1,200,000.00	1,324,860.00	
REP OF AUSTRIA 4.85	1,000,000.00	1,394,570.00	
REP OF AUSTRIA 6.25	1,000,000.00	1,575,060.00	
SPANISH GOV'T 0.25	2,000,000.00	2,012,500.00	
SPANISH GOV'T 0.25	3,000,000.00	3,023,640.00	
SPANISH GOV'T 0.75	2,000,000.00	2,040,860.00	
SPANISH GOV'T 1.15	3,000,000.00	3,110,460.00	
SPANISH GOV'T 1.3	2,000,000.00	1,942,720.00	
SPANISH GOV'T 1.4	2,000,000.00	2,082,860.00	
SPANISH GOV'T 1.6	2,000,000.00	2,034,560.00	
SPANISH GOV'T 1.95	2,500,000.00	2,579,275.00	
SPANISH GOV'T 1.95	2,000,000.00	1,959,900.00	
SPANISH GOV'T 2.15	2,000,000.00	2,105,780.00	
SPANISH GOV'T 2.75	2,000,000.00	2,127,020.00	
SPANISH GOV'T 2.75	3,000,000.00	3,322,770.00	
SPANISH GOV'T 2.9	1,000,000.00	990,810.00	
SPANISH GOV'T 3.45	500,000.00	512,530.00	
SPANISH GOV'T 3.75	2,200,000.00	2,351,250.00	
SPANISH GOV'T 3.8	3,000,000.00	3,547,230.00	
SPANISH GOV'T 4	3,000,000.00	3,377,280.00	
SPANISH GOV'T 4.1	2,000,000.00	2,125,480.00	
SPANISH GOV'T 4.2	2,050,000.00	2,571,171.50	
SPANISH GOV'T 4.3	3,000,000.00	3,349,800.00	
SPANISH GOV'T 4.4	3,000,000.00	3,666,960.00	
SPANISH GOV'T 4.5	2,500,000.00	2,612,625.00	
SPANISH GOV'T 4.6	2,500,000.00	2,785,550.00	
SPANISH GOV'T 4.65	3,000,000.00	3,765,840.00	
SPANISH GOV'T 4.7	1,500,000.00	2,021,445.00	
SPANISH GOV'T 4.8	2,000,000.00	2,503,000.00	
SPANISH GOV'T 4.85	2,000,000.00	2,346,100.00	
SPANISH GOV'T 4.9	2,500,000.00	3,443,750.00	
SPANISH GOV'T 5.15	1,500,000.00	2,011,560.00	
SPANISH GOV'T 5.15	2,000,000.00	2,861,620.00	
SPANISH GOV'T 5.4	3,000,000.00	3,811,980.00	
SPANISH GOV'T 5.5	3,000,000.00	3,659,250.00	
SPANISH GOV'T 5.75	2,200,000.00	3,210,064.00	

	SPANISH GOV'T 5.85	2,500,000.00	3,154,875.00
	SPANISH GOV'T 5.9	2,500,000.00	3,438,050.00
	SPANISH GOV'T 6	3,400,000.00	4,882,944.00
	ユーロ 小計	602,170,000.00	699,128,004.40 (83,762,526,207)
英bond	UK TSY GILT 0.5	1,000,000.00	990,200.00
	UK TSY GILT 1.25	3,500,000.00	3,557,435.00
	UK TSY GILT 1.5	3,000,000.00	3,125,550.00
	UK TSY GILT 1.5	2,500,000.00	2,567,200.00
	UK TSY GILT 1.5	1,000,000.00	913,080.00
	UK TSY GILT 1.75	2,000,000.00	2,077,880.00
	UK TSY GILT 1.75	3,000,000.00	3,182,700.00
	UK TSY GILT 1.75	1,000,000.00	978,000.00
	UK TSY GILT 2	3,000,000.00	3,172,050.00
	UK TSY GILT 2	2,500,000.00	2,691,100.00
	UK TSY GILT 2.25	2,700,000.00	2,958,660.00
	UK TSY GILT 2.5	1,500,000.00	1,869,825.00
	UK TSY GILT 2.75	2,000,000.00	2,267,800.00
	UK TSY GILT 3.25	3,000,000.00	3,827,670.00
	UK TSY GILT 3.5	2,500,000.00	3,341,675.00
	UK TSY GILT 3.5	2,000,000.00	3,178,000.00
	UK TSY GILT 3.75	2,000,000.00	2,185,300.00
	UK TSY GILT 3.75	2,800,000.00	3,148,600.00
	UK TSY GILT 3.75	2,400,000.00	2,758,824.00
	UK TSY GILT 3.75	2,300,000.00	3,455,382.00
	UK TSY GILT 4	1,500,000.00	1,761,660.00
	UK TSY GILT 4	2,000,000.00	3,362,660.00
	UK TSY GILT 4.25	1,300,000.00	1,684,657.00
	UK TSY GILT 4.25	2,000,000.00	2,708,380.00
	UK TSY GILT 4.25	3,000,000.00	4,176,720.00
	UK TSY GILT 4.25	1,500,000.00	2,145,525.00
	UK TSY GILT 4.25	2,500,000.00	3,631,775.00
	UK TSY GILT 4.25	1,900,000.00	2,906,715.00
	UK TSY GILT 4.25	1,900,000.00	3,026,092.00
	UK TSY GILT 4.25	2,100,000.00	3,564,435.00
	UK TSY GILT 4.5	2,700,000.00	2,945,322.00
	UK TSY GILT 4.5	2,500,000.00	3,543,050.00
	UK TSY GILT 4.5	2,000,000.00	3,059,220.00
	UK TSY GILT 4.75	2,700,000.00	3,074,004.00
	UK TSY GILT 4.75	2,300,000.00	3,201,370.00
	UK TSY GILT 4.75	2,500,000.00	3,787,725.00
	UK TSY GILT 5	2,500,000.00	2,628,050.00
	UK TSY GILT 5	2,500,000.00	3,274,725.00

	UK TSY GILT 6	1,200,000.00	1,799,520.00	
	UK TSY GILT 8	1,620,000.00	2,148,233.40	
英債券 小計		87,920,000.00	110,676,769.40	(15,517,989,837)
スイスフラン	SWISS (GOVT) 2.25	900,000.00	996,030.00	
	SWISS (GOVT) 3	1,000,000.00	1,089,500.00	
	SWISS (GOVT) 4	500,000.00	638,550.00	
	SWISS (GOVT) 4	700,000.00	1,022,000.00	
スイスフラン 小計		3,100,000.00	3,746,080.00	(421,621,304)
スウェーデンクローナ	SWEDISH GOVRNMNT 1	8,000,000.00	8,244,640.00	
	SWEDISH GOVRNMNT 1.5	12,000,000.00	13,007,880.00	
	SWEDISH GOVRNMNT 2.5	8,000,000.00	9,324,080.00	
	SWEDISH GOVRNMNT 3.5	11,000,000.00	13,035,220.00	
	SWEDISH GOVRNMNT 3.5	6,000,000.00	8,028,900.00	
	SWEDISH GOVRNMNT 4.25	12,000,000.00	13,209,360.00	
	SWEDISH GOVRNMNT 5	11,000,000.00	13,196,700.00	
スウェーデンクローナ 小計		68,000,000.00	78,046,780.00	(988,852,702)
ノルウェークローネ	NORWEGIAN GOV'T 1.5	5,000,000.00	4,937,500.00	
	NORWEGIAN GOV'T 1.75	5,000,000.00	5,074,500.00	
	NORWEGIAN GOV'T 2	10,000,000.00	10,411,500.00	
	NORWEGIAN GOV'T 3	4,000,000.00	4,420,000.00	
	NORWEGIAN GOV'T 3.75	11,000,000.00	12,255,100.00	
	NORWEGIAN GOV'T 4.5	6,000,000.00	6,513,600.00	
ノルウェークローネ 小計		41,000,000.00	43,612,200.00	(589,200,822)
デンマーククローネ	DENMARK - BULLET 0.25	10,000,000.00	10,153,000.00	
	DENMARK - BULLET 1.5	5,000,000.00	5,507,000.00	
	DENMARK - BULLET 1.75	10,000,000.00	11,230,600.00	
	DENMARK - BULLET 3	10,000,000.00	11,582,300.00	
	DENMARK - BULLET 4	8,000,000.00	9,014,400.00	
	DENMARK - BULLET 4.5	17,000,000.00	28,701,100.00	
	DENMARK - BULLET 7	3,080,000.00	4,721,024.00	
デンマーククローネ 小計		63,080,000.00	80,909,424.00	(1,304,259,914)
ポーランドズロチ	POLAND GOVT BOND 1.5	3,000,000.00	2,895,000.00	
	POLAND GOVT BOND 1.75	3,000,000.00	2,851,800.00	
	POLAND GOVT BOND 2	3,000,000.00	2,939,700.00	
	POLAND GOVT BOND 2.5	5,000,000.00	5,035,000.00	
	POLAND GOVT BOND 2.5	4,000,000.00	3,615,200.00	
	POLAND GOVT BOND 3.25	5,000,000.00	4,900,000.00	

	POLAND GOVT BOND 4	2,000,000.00	2,084,000.00
	POLAND GOVT BOND 5.25	5,000,000.00	5,122,500.00
	POLAND GOVT BOND 5.25	2,000,000.00	2,170,000.00
	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	4,732,686.00
	POLAND GOVT BOND 5.75	2,000,000.00	2,362,200.00
	ポーランドズロチ 小計	46,200,000.00	47,516,086.00 (1,316,195,582)
オーストラリアドル	AUSTRALIAN GOVT. 1.75	3,000,000.00	2,962,200.00
	AUSTRALIAN GOVT. 2	1,000,000.00	988,300.00
	AUSTRALIAN GOVT. 2.25	2,000,000.00	1,878,600.00
	AUSTRALIAN GOVT. 2.75	3,000,000.00	3,064,650.00
	AUSTRALIAN GOVT. 2.75	3,000,000.00	3,031,176.00
	AUSTRALIAN GOVT. 2.75	2,000,000.00	1,983,600.00
	AUSTRALIAN GOVT. 2.75	1,000,000.00	913,200.00
	AUSTRALIAN GOVT. 3	1,000,000.00	855,675.00
	AUSTRALIAN GOVT. 3.25	2,000,000.00	2,049,160.00
	AUSTRALIAN GOVT. 3.25	4,000,000.00	4,174,800.00
	AUSTRALIAN GOVT. 3.25	1,500,000.00	1,543,500.00
	AUSTRALIAN GOVT. 3.25	1,000,000.00	949,100.00
	AUSTRALIAN GOVT. 3.75	1,000,000.00	1,034,200.00
	AUSTRALIAN GOVT. 4.25	4,000,000.00	4,494,800.00
	AUSTRALIAN GOVT. 4.5	3,000,000.00	3,225,468.00
	AUSTRALIAN GOVT. 4.5	1,500,000.00	1,740,450.00
	AUSTRALIAN GOVT. 4.75	3,200,000.00	3,747,520.00
	AUSTRALIAN GOVT. 5.25	3,000,000.00	3,205,533.00
	AUSTRALIAN GOVT. 5.5	2,500,000.00	2,939,125.00
	AUSTRALIAN GOVT. 5.75	3,000,000.00	3,434,100.00
	AUSTRALIAN GOVT. 5.75	4,000,000.00	4,698,200.00
	オーストラリアドル 小計	49,700,000.00	52,913,357.00 (4,580,180,181)
シンガポールドル	SINGAPORE GOV'T 2.25	500,000.00	512,750.00
	SINGAPORE GOV'T 2.75	1,000,000.00	1,048,500.00
	SINGAPORE GOV'T 2.75	400,000.00	418,400.00
	SINGAPORE GOV'T 2.875	400,000.00	416,656.00
	SINGAPORE GOV'T 3	1,000,000.00	1,062,500.00
	SINGAPORE GOV'T 3.125	1,000,000.00	1,069,000.00
	SINGAPORE GOV'T 3.25	1,000,000.00	1,061,200.00
	SINGAPORE GOV'T 3.375	500,000.00	558,750.00
	SINGAPORE GOV'T 3.5	1,500,000.00	1,653,000.00
	SINGAPORE GOV'T 4	2,100,000.00	2,193,660.00
		9,400,000.00	9,994,416.00

シンガポールドル 小計			(795,855,346)	
マレーシアリングット	MALAYSIA GOVT 3.418	8,000,000.00	7,820,000.00	
	MALAYSIA GOVT 3.502	9,000,000.00	8,336,817.00	
	MALAYSIA GOVT 4.24	5,000,000.00	5,054,500.00	
	MALAYSIA GOVT 4.378	5,000,000.00	5,110,500.00	
マレーシアリングット 小計		27,000,000.00	26,321,817.00	(666,994,842)
南アフリカランド	REP SOUTH AFRICA 6.5	60,000,000.00	43,380,000.00	
	REP SOUTH AFRICA 6.75	30,000,000.00	28,765,500.00	
	REP SOUTH AFRICA 7	60,000,000.00	49,992,000.00	
	REP SOUTH AFRICA 8	10,000,000.00	10,065,000.00	
南アフリカランド 小計		160,000,000.00	132,202,500.00	(1,142,229,600)
合計			212,934,137,705	(212,934,137,705)

(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%	44.8%
カナダドル	国債証券 33銘柄	2.2%	2.3%
メキシコペソ	国債証券 9銘柄	0.8%	0.8%
ユーロ	国債証券 276銘柄	38.7%	39.3%
英ポンド	国債証券 40銘柄	7.2%	7.3%
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 21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

「注記表(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。

【中間財務諸表】

- 1 . 当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和52年大蔵省令第38号)ならびに同規則第38条の3、第57条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)に基づいて作成しております。
なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
- 2 . 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第3期中間計算期間(平成29年 2月21日から平成29年 8月20日まで)の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。

【三井住友・DC年金バランスゼロ（債券型）】

（１）【中間貸借対照表】

（単位：円）

第3期中間計算期間
（平成29年 8月20日現在）

資産の部	
流動資産	
金銭信託	846,290
コール・ローン	3,548,694
親投資信託受益証券	83,151,152
未収入金	80,000
流動資産合計	87,626,136
資産合計	87,626,136
負債の部	
流動負債	
未払解約金	126,895
未払受託者報酬	12,845
未払委託者報酬	81,305
未払利息	28
その他未払費用	2,080
流動負債合計	223,153
負債合計	223,153
純資産の部	
元本等	
元本	86,036,724
剰余金	
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	1,366,259
元本等合計	87,402,983
純資産合計	87,402,983
負債純資産合計	87,626,136

(2) 【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

第3期中間計算期間	
自 平成29年 2月21日	
至 平成29年 8月20日	
営業収益	
有価証券売買等損益	1,020,243
営業収益合計	1,020,243
営業費用	
支払利息	1,434
受託者報酬	12,845
委託者報酬	81,305
その他費用	2,229
営業費用合計	97,813
営業利益又は営業損失（ ）	922,430
経常利益又は経常損失（ ）	922,430
中間純利益又は中間純損失（ ）	922,430
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（ ）	30,332
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	254,582
剰余金増加額又は欠損金減少額	239,183
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	239,183
剰余金減少額又は欠損金増加額	19,604
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	19,604
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-
分配金	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	1,366,259

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針の注記)

項 目	第3期中間計算期間	
	自 平成29年 2月21日	至 平成29年 8月20日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>	
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>計算期間の取扱い</p> <p>当中間計算期間は前期末が休日のため、平成29年 2月21日から平成29年 8月20日までとなっております。</p>	

(中間貸借対照表に関する注記)

項 目	第3期中間計算期間	
	(平成29年 8月20日現在)	
1. 当中間計算期間の末日における受益権の総数		86,036,724口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額	1.0159円
	(10,000口当たりの純資産額)	10,159円)

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項目	第3期中間計算期間 (平成29年 8月20日現在)
1. 中間貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券（親投資信託受益証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

項目	第3期中間計算期間 (平成29年 8月20日現在)
期首元本額	70,811,010円
期中追加設定元本額	19,707,798円
期中一部解約元本額	4,482,084円

（参考）

三井住友・DC年金バランスゼロ（債券型）は、「国内債券パッシブ・マザーファンド」および「外国債券パッシブ・マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、中間貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同マザーファンドの受益証券です。

なお、以下に記載した状況は、監査の対象外です。

国内債券パッシブ・マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

（平成29年 8月20日現在）

資産の部	
流動資産	
金銭信託	158,775,729
コール・ローン	666,728,394
国債証券	166,306,160,290
地方債証券	19,523,527,537
特殊債券	28,890,227,447

(平成29年 8月20日現在)

社債券	9,175,837,000
未収入金	299,177,300
未収利息	701,061,790
前払費用	17,565,165
流動資産合計	225,739,060,652
資産合計	225,739,060,652
負債の部	
流動負債	
未払金	100,000,000
未払解約金	367,218,336
未払利息	1,837
その他未払費用	620
流動負債合計	467,220,793
負債合計	467,220,793
純資産の部	
元本等	
元本	179,598,103,680
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	45,673,736,179
元本等合計	225,271,839,859
純資産合計	225,271,839,859
負債純資産合計	225,739,060,652

注記表

(重要な会計方針の注記)

項目	自 平成29年 2月21日 至 平成29年 8月20日
有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券は個別法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

項目	(平成29年 8月20日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	179,598,103,680口

項目	（平成29年 8月20日現在）	
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額	1,2543円
	(10,000口当たりの純資産額)	12,543円)

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

項目	（平成29年 8月20日現在）	
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券（国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。	

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

（平成29年 8月20日現在）	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	176,575,927,018円
同期中における追加設定元本額	16,283,151,269円
同期中における一部解約元本額	13,260,974,607円
平成29年 8月20日現在における元本の内訳	
三井住友・DC年金バランス30（債券重点型）	3,302,856,064円
三井住友・DC年金バランス50（標準型）	5,787,372,224円
三井住友・DC年金バランス70（株式重点型）	1,251,448,294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）	418,975,762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）	52,790,558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）	134,372,925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）	223,787,643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）	139,418,143円

（平成29年 8月20日現在）	
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2040（4資産タイプ）	55,573,243円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2045（4資産タイプ）	119,812,402円
三井住友・DC年金バランスゼロ（債券型）	52,414,193円
アセットアロケーション・ファンド（安定型）	8,040,560,459円
アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）	1,797,560,676円
アセットアロケーション・ファンド（成長型）	1,356,471,137円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2050	3,875,297円
SMAM・年金グローバル債券ファンド＜適格機関投資家限定＞	5,933,026,458円
SMAM・バランスファンドVA25＜適格機関投資家専用＞	25,267,740,822円
SMAM・バランスファンドVA37.5＜適格機関投資家専用＞	8,849,808,385円
SMAM・バランスファンドVA50＜適格機関投資家専用＞	21,569,155,376円
SMAM・バランスファンドVL30＜適格機関投資家限定＞	369,486,123円
SMAM・バランスファンドVL50＜適格機関投資家限定＞	698,241,414円
世界6資産バランスファンドVA＜適格機関投資家限定＞	18,202,536円
SMAM・バランスファンドVA75＜適格機関投資家専用＞	325,335,199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＞	138,491,518円
SMAM・インデックス・バランスVA25＜適格機関投資家専用＞	2,313,691,765円
SMAM・インデックス・バランスVA50＜適格機関投資家専用＞	2,481,341,188円
SMAM・バランスファンドVA40＜適格機関投資家専用＞	5,815,278,303円
SMAM・バランスファンドVA35＜適格機関投資家専用＞	13,278,687,073円
SMAM・バランスVA株40T＜適格機関投資家限定＞	189,954,060円
三井住友・国内債券インデックスファンド・VAS（適格機関投資家専用）	6,876,208,035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）	20,957,732,297円
SMAM・グローバルバランス40VA＜適格機関投資家限定＞	644,533,825円
SMAM・バランスファンドVA20＜適格機関投資家専用＞	1,033,600,844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）	17,756,586,381円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A＜適格機関投資家専用＞	1,061,622,105円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A＜適格機関投資家専用＞	235,062,728円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A＜適格機関投資家専用＞	54,229,354円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L＜適格機関投資家専用＞	2,502,019,956円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L＜適格機関投資家専用＞	2,965,056,787円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T＜適格機関投資家専用＞	2,837,992,640円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A2＜適格機関投資家専用＞	1,150,753,522円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A2＜適格機関投資家専用＞	261,243,315円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A2＜適格機関投資家専用＞	22,640,906円
SMAM・アセットバランスファンドVA30L2＜適格機関投資家専用＞	403,876,679円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L2＜適格機関投資家専用＞	7,483,706,225円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T2＜適格機関投資家専用＞	328,591,574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＞	2,502,466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＞	1,283,063,013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＞	614,797,665円

（平成29年 8月20日現在）	
S M A M ・ マルチアセットストラテジー ・ オープン < 適格機関投資家限定 >	1,136,554,123円
合計	179,598,103,680円

外国債券パッシブ・マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

（平成29年 8月20日現在）

資産の部

流動資産

預金	661,147,609
金銭信託	50,399,561
コール・ローン	211,636,997
国債証券	196,748,388,132
派生商品評価勘定	8,380,304
未収入金	789,589,511
未収利息	1,447,902,880
前払費用	33,934,572
流動資産合計	199,951,379,566

資産合計

199,951,379,566

負債の部

流動負債

派生商品評価勘定	8,611
未払解約金	703,356,198
未払利息	583
その他未払費用	243
流動負債合計	703,365,635

負債合計

703,365,635

純資産の部

元本等

元本	115,595,070,004
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	83,652,943,927
元本等合計	199,248,013,931

純資産合計

199,248,013,931

負債純資産合計

199,951,379,566

注記表

（重要な会計方針の注記）

項目	自 平成29年 2月21日 至 平成29年 8月20日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券は個別法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。</p>
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建資産等の会計処理</p> <p>「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

項目	(平成29年 8月20日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	115,595,070,004口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.7237円
	(10,000口当たりの純資産額 17,237円)

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項目	(平成29年 8月20日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。

項目	(平成29年 8月20日現在)
2.時価の算定方法	(1) 有価証券（国債証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(デリバティブ取引に関する注記)

(平成29年 8月20日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位：円)

区分	種類	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	657,450	-	648,839	8,611
	米ドル	146,921	-	144,973	1,948
	カナダドル	1,694	-	1,679	15
	ユーロ	362,301	-	357,874	4,427
	英ポンド	146,534	-	144,313	2,221
	売建	758,406,533	-	750,026,229	8,380,304
	米ドル	355,455,487	-	351,676,531	3,778,956
	カナダドル	19,002,499	-	18,923,667	78,832
	ユーロ	324,985,556	-	321,074,184	3,911,372
英ポンド	58,962,991	-	58,351,847	611,144	
合計		759,063,983	-	750,675,068	8,371,693

(注) 1. 時価の算定方法

(1) 為替予約取引の時価の算定方法について

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

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

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

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

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

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

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

（その他の注記）

（平成29年 8月20日現在）	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	130,285,580,252円
同期中における追加設定元本額	3,492,695,207円
同期中における一部解約元本額	18,183,205,455円
平成29年 8月20日現在における元本の内訳	
三井住友・DC外国債券インデックスファンドS	8,924,969,741円
三井住友・DC年金バランス30（債券重点型）	432,739,853円
三井住友・DC年金バランス50（標準型）	1,190,017,300円
三井住友・DC年金バランス70（株式重点型）	599,440,204円
SMAM・グローバルバランスファンド（機動的資産配分型）	98,026,832円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2020（4資産タイプ）	9,071,872円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2025（4資産タイプ）	28,735,340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）	72,480,933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）	62,313,818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）	31,179,381円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2045（4資産タイプ）	78,379,906円
三井住友・DC年金バランスゼロ（債券型）	10,099,223円
アセットアロケーション・ファンド（安定型）	121,810,575円
アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）	632,889,150円
アセットアロケーション・ファンド（成長型）	717,135,936円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2050	1,755,766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＞	1,607,538,431円
SMAM・バランスファンドVA安定成長型＜適格機関投資家限定＞	1,751,113,573円
SMAM・バランスファンドVA25＜適格機関投資家専用＞	15,931,769,616円
SMAM・バランスファンドVA37.5＜適格機関投資家専用＞	6,915,598,780円
SMAM・バランスファンドVA50＜適格機関投資家専用＞	15,587,145,095円
SMAM・バランスファンドVL30＜適格機関投資家限定＞	43,696,403円
SMAM・バランスファンドVL50＜適格機関投資家限定＞	124,314,234円
世界6資産バランスファンドVA＜適格機関投資家限定＞	3,675,036円
SMAM・バランスファンドVA75＜適格機関投資家専用＞	946,967,050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＞	150,035,225円
SMAM・インデックス・バランスVA25＜適格機関投資家専用＞	1,452,491,154円
SMAM・インデックス・バランスVA50＜適格機関投資家専用＞	1,787,668,605円
SMAM・バランスファンドVA40＜適格機関投資家専用＞	4,190,186,151円
SMAM・バランスファンドVA35＜適格機関投資家専用＞	8,204,336,257円
SMAM・バランスVA株40T＜適格機関投資家限定＞	135,800,424円
SMAM・外国債券パッシブファンドVA＜適格機関投資家限定＞	13,051,840,185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）	1,181,379,245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）	2,508,619,932円

(平成29年 8月20日現在)	
S M A M ・ グローバルバランス40VA <適格機関投資家限定>	231,794,728円
S M A M ・ バランスファンドVA20 <適格機関投資家専用>	745,036,065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)	2,828,287,390円
S M A M ・ アセットバランスファンドVA20A <適格機関投資家専用>	176,651,232円
S M A M ・ アセットバランスファンドVA35A <適格機関投資家専用>	50,626,930円
S M A M ・ アセットバランスファンドVA50A <適格機関投資家専用>	16,471,948円
S M A M ・ アセットバランスファンドVA20L <適格機関投資家専用>	185,233,638円
S M A M ・ アセットバランスファンドVA25L <適格機関投資家専用>	647,284,583円
S M A M ・ アセットバランスファンドVA20T <適格機関投資家専用>	209,203,479円
S M A M ・ アセットバランスファンドVA20A2 <適格機関投資家専用>	190,989,078円
S M A M ・ アセットバランスファンドVA35A2 <適格機関投資家専用>	56,026,095円
S M A M ・ アセットバランスファンドVA50A2 <適格機関投資家専用>	7,027,104円
S M A M ・ アセットバランスファンドVA25L2 <適格機関投資家専用>	1,636,040,746円
S M A M ・ アセットバランスファンドVA20T2 <適格機関投資家専用>	25,080,455円
S M A M ・ グローバルバランスファンド(標準型)VA <適格機関投資家限定>	4,870,494,295円
S M A M ・ 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>	2,458,850,783円
S M A M ・ 世界バランスファンドVA <適格機関投資家限定>	7,711,123,569円
S M A M ・ 世界バランスファンドVA2 <適格機関投資家限定>	3,976,822,005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>	602,227円
S M A M ・ マルチアセットストラテジーファンド2016-04 <適格機関投資家限定>	418,271,207円
S M A M ・ マルチアセットストラテジーファンド2016-05 <適格機関投資家限定>	200,340,775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>	367,590,446円
合計	115,595,070,004円

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

三井住友・DC年金バランスゼロ（債券型）

2017年 9月29日現在

資産総額	89,800,069円
負債総額	1,214,046円
純資産総額（ - ）	88,586,023円
発行済口数	86,777,425口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0208円
（1万口当たり純資産額）	（10,208円）

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

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

イ 名義書換

該当事項はありません。

ロ 受益者名簿

作成しません。

ハ 受益者に対する特典

ありません。

ニ 受益権の譲渡および譲渡制限等

(イ) 受益権の譲渡

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

(ロ) 受益権の譲渡制限および譲渡の対抗要件

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

ホ 受益権の再分割

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

へ 償還金

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

ト 質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

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

第三部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

イ 資本金の額および株式数

	2017年 9月29日現在
資本金の額	2,000百万円
会社が発行する株式の総数	60,000株
発行済株式総数	17,640株

ロ 最近5年間における資本金の額の増減 該当ありません。

八 会社の機構

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

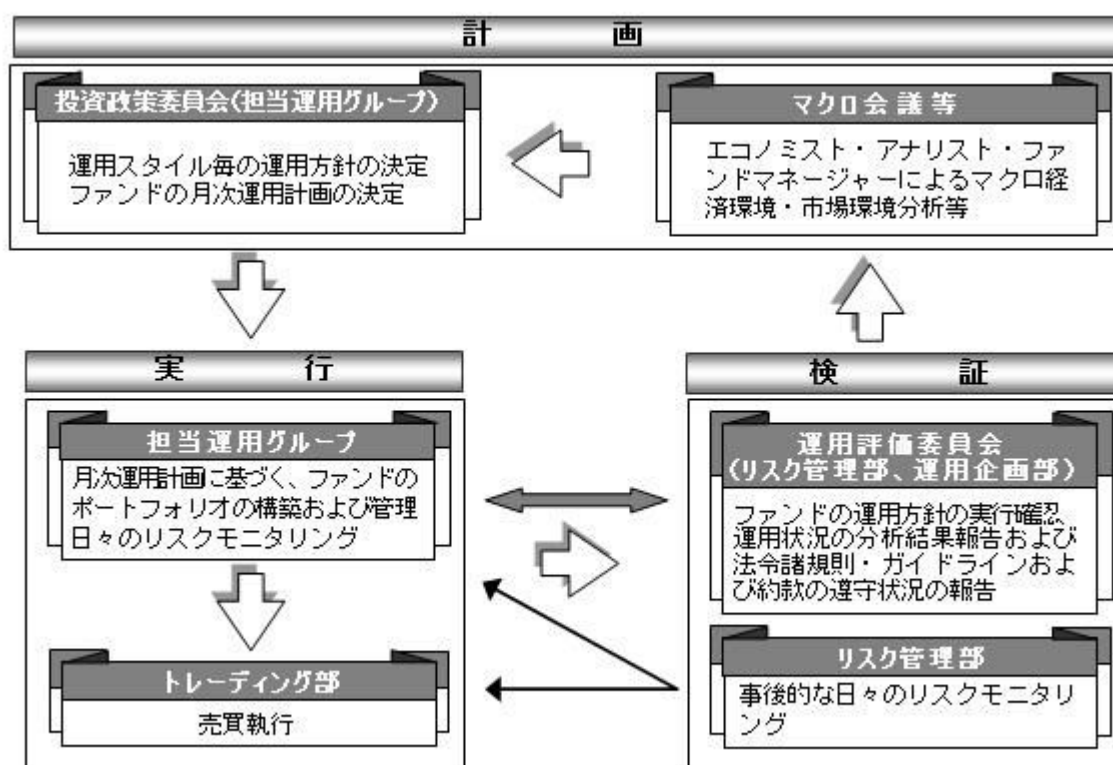
取締役の任期は、選任後1年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会の終結の時までとし、補欠または増員によって選任された取締役の任期は、他の現任取締役の任期の満了する時までとします。

委託会社の業務上重要な事項は、取締役会の決議により決定します。

取締役会は、取締役会の決議によって、代表取締役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。

2017年9月29日現在、委託会社が運用を行っている投資信託（親投資信託は除きます）は、以下の通りです。

(2017年9月29日現在)

		本数(本)	純資産総額(百万円)
株式投資信託	単位型	75 (27)	204,777 (107,082)
	追加型	449 (190)	5,365,442 (2,790,734)
	計	524 (217)	5,570,219 (2,897,816)
公社債投資信託	単位型	104 (104)	410,244 (410,244)
	追加型	1 (0)	29,799 (0)
	計	105 (104)	440,043 (410,244)
合計		629 (321)	6,010,263 (3,308,061)

()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								株主資本 合計
	資本金	資本剰余金		利益準備金	利益剰余金			利益剰余金 合計	
		資本準備金	資本剰余金 合計		その他利益剰余金				
				配当準備 積立金	別途積立金	繰越利益 剰余金			
当期首残高	2,000,000	8,628,984	8,628,984	284,245	60,000	1,476,959	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								株主資本 合計
	資本金	資本剰余金		利益準備金	利益剰余金			利益剰余金 合計	
		資本準備金	資本剰余金 合計		その他利益剰余金				
				配当準備 積立金	別途積立金	繰越利益 剰余金			
当期首残高	2,000,000	8,628,984	8,628,984	284,245	60,000	1,476,959	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			
其他有価証券	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			
其他有価証券	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、記載しておりません。

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、記載しておりません。

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、記載しておりません。

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、記載しておりません。

3. 当事業年度中に売却したその他有価証券

前事業年度(自 平成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の主な原因別の内訳

(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)
流動の部		
繰延税金資産		
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
固定の部		
繰延税金資産		
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
繰延税金負債		
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

2017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2018年2月1日付効力発生の定款の変更
- 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(2017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(2017年3月末現在)
- ・ 事業の内容 銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

ロ 販売会社

(イ) 名称	(ロ) 資本金の額	(ハ) 事業の内容
株式会社SBI証券	48,323百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
カブドットコム証券株式会社	7,196百万円	
マネックス証券株式会社	12,200百万円	
楽天証券株式会社	7,495百万円	
株式会社三井住友銀行	1,770,996百万円	銀行法に基づき、銀行業を営んでいます。

資本金の額は、2017年3月末現在。

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け付け、収益分配金、償還金の支払事務等を行います。

3【資本関係】

該当ありません。

第3【その他】

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

独立監査人の監査報告書

平成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3月28日

三井住友アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士 小澤 陽一 印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている三井住友・DC年金バランスゼロ（債券型）の平成28年2月19日から平成29年2月20日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三井住友・DC年金バランスゼロ（債券型）の平成29年2月20日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以上

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

独立監査人の中間監査報告書

平成29年9月26日

三井住友アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている三井住友・DC年金バランスゼロ（債券型）の平成29年2月21日から平成29年8月20日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、三井住友・DC年金バランスゼロ（債券型）の平成29年8月20日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（平成29年2月21日から平成29年8月20日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

利害関係

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

以上

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