

【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30年1月23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】	アセットアロケーション・ファンド（安定型） アセットアロケーション・ファンド（安定成長型） アセットアロケーション・ファンド（成長型）
【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30年1月24日から平成30年7月23日まで) アセットアロケーション・ファンド（安定型） 2兆5,000億円を上限とします。 アセットアロケーション・ファンド（安定成長型） 2兆5,000億円を上限とします。 アセットアロケーション・ファンド（成長型） 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】

アセットアロケーション・ファンド（安定型）

アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）

アセットアロケーション・ファンド（成長型）

以下、上記3ファンドを総称して「当ファンド」ということがあり、それぞれを「各ファンド」ということがあります。また、「アセットアロケーション・ファンド（安定型）」を「安定型」、「アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）」を「安定成長型」、「アセットアロケーション・ファンド（成長型）」を「成長型」という略称でいうことがあります。

（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】

各ファンド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、「安定型」は「らっぷ安定」、「安定成長型」は「らっぷ安成」、「成長型」は「らっぷ成長」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】

原則として、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）に、1.08%（税抜き1.0%）を上限として、販売会社がそれぞれ別に定める申込手数料率を乗じて得た額となります。

累積投資契約に基づく収益分配金の再投資の場合は無手数料となります。

申込手数料に関する詳細は、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問い合わせることにより知ることができます。

（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】

2018年1月24日から2018年7月23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。

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

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）に申込手数料および当該手数料にかかる消費税等相当額を加算した額を、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

(1 2) 【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 スイッチング

販売会社によっては、「スイッチング」（ある投資信託の換金による手取額をもって、他の投資信託を買い付けること）による当ファンドの取得申込みを取り扱う場合があります。

ニ お申込不可日

上記にかかわらず、ニューヨークの取引所または銀行の休業日のいずれかに当たる場合には、ファンドの取得申込みはできません（また、該当日には、解約請求のお申込みもできません。）。

ホ 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。

ヘ 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、主として、投資信託証券等への投資を通じて、世界各国の債券、株式および不動産投資信託（リート）等に投資することにより、信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。
- ロ 委託会社は、受託会社と合意の上、各ファンドそれぞれ金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。
- ハ 当ファンドが該当する商品分類、属性区分は次の通りです。

(イ) 当ファンドが該当する商品分類

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

(ロ) 当ファンドが該当する属性区分

項目	該当する属性区分	内容
投資対象資産	その他資産（投資信託証券（資産複合（株式、債券、不動産投信）資産配分変更型））	目論見書または信託約款において、主として投資信託証券に投資する旨の記載があるものをいいます。「投資信託証券」以下のカッコ内は投資信託証券の先の実質投資対象について記載しています。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株式、債券および不動産投信であり、ファンドの収益はそれぞれの市場の動向に左右されるものであるため、商品分類上の投資対象資産（収益の源泉）は「資産複合」となります。
決算頻度	年1回	目論見書または信託約款において、年1回決算する旨の記載があるものをいいます。
投資対象地域	グローバル (日本を含む)	目論見書または信託約款において、組入資産による投資収益が日本を含む世界の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
投資形態	ファンド・オブ・ファンズ	一般社団法人投資信託協会「投資信託等の運用に関する規則」第2条に規定するファンド・オブ・ファンズをいいます。
為替ヘッジ	為替ヘッジあり (部分ヘッジ)	目論見書または信託約款において、一部の資産に対円での為替のヘッジを行う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)
単位型	国内	株式
	海外	債券
		不動産投信
追加型	内外	その他資産 () 資産複合

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

属性区分表

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

属性区分の「為替ヘッジ」は、対円での為替変動リスクに対するヘッジの有無を記載しています。

商品分類、属性区分は、一般社団法人投資信託協会「商品分類に関する指針」に基づき記載しています。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】

2015年4月17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。

〔参考情報：投資顧問会社〕

以下の各法人は当ファンドの関係法人には該当しませんが、当ファンドの運用に関し助言等を行う投資顧問会社であり、間接的に当ファンドの運用に関与します。

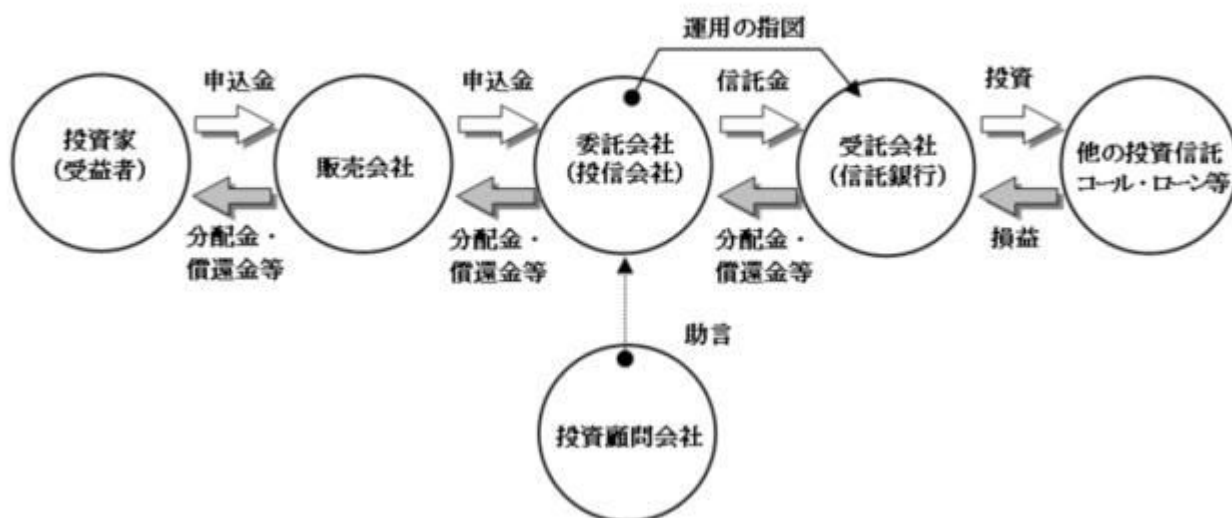
日興グローバルラップ株式会社

「安定型」・「安定成長型」・「成長型」の各ファンドの「保守的」・「中立的」・「積極的」資産配分に関する投資助言等を行います。

エドモン・ドゥ・ロスチャイルド・アセット・マネジメント(ルクセンブルグ)

世界経済の見通しと組入資産の投資見通しに関する投資助言を行います。

運営の仕組み



□ 委託会社の概況

(イ) 資本金の額

2,000百万円（2017年11月30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

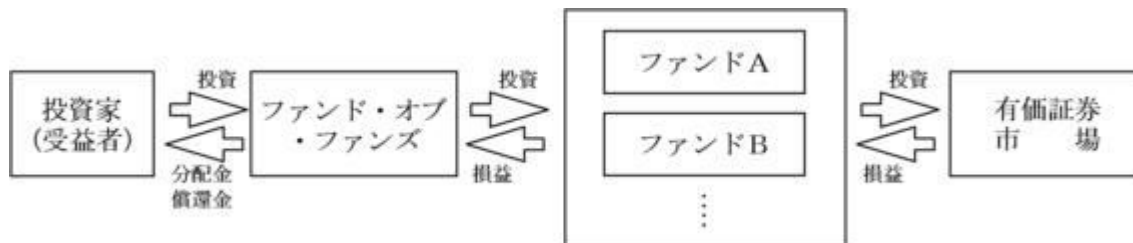
（2017年11月30日現在）

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

ハ ファンドの運用形態（ファンド・オブ・ファンズによる運用）

一般に、「ファンド・オブ・ファンズ」においては、株式や債券などの有価証券に直接投資するのではなく、複数の他の投資信託（ファンド）を組み入れることにより運用を行います（投資信託に投資する投資信託）。また、種々の特長を持った投資信託を購入することにより、効率的に資産配分を行います。

〔ファンド・オブ・ファンズによる運用〕



2【投資方針】

(1)【投資方針】

イ 基本方針

当ファンドは、投資信託証券等への投資を通じて、世界各国の債券、株式および不動産投資信託（リート）等に投資することにより、信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。

ロ 投資態度

- (イ) 主として投資信託証券への投資を通じて、世界各国の債券、株式および不動産投資信託（リート）等に投資することにより、安定型は信託財産の安定性を、安定成長型は信託財産の安定性と収益性のバランスを、成長型は信託財産の収益性を重視した運用を行います。
- () 主として、国内株式、先進国株式（除く日本）、新興国株式、国内リート、外国リート、国内債券、先進国債券（除く日本）、為替ヘッジ付き先進国債券（除く日本）、新興国債券、為替ヘッジ付き新興国債券、ハイイールド債券、為替ヘッジ付きハイイールド債券に投資します。
- () 投資対象とする投資信託証券は、継続的にモニタリングを行い必要な場合は追加・入替えも行います。
- (ロ) 運用にあたっては、市場のリスク選好状況を定量的に捉え、一定の範囲で資産配分を調整することにより、下方リスクを抑制しつつ、中長期的に収益の獲得を目指します。
- (ハ) 対円での為替ヘッジを行う投資信託証券を組み入れることがあります。また、投資対象とする投資信託証券の外貨建資産に対して対円での為替ヘッジを行うことがあります。
- (ニ) 投資信託証券への投資は、高位を保つことを原則とします。
- (ホ) 資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。
- (ヘ) 主要投資対象とする投資信託証券は、下記の通りとします。ただし、運用状況等により変更となる場合があります。

■投資対象とする投資信託の投資方針等

- すべての投資信託証券に投資するとは限りません。

▶債券

国内債券

ファンド名	国内債券パッシブ・マザーファンド
形態	国内籍親投資信託
運用会社	三井住友アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	<ul style="list-style-type: none"> ● NOMURA-BPI(総合)の動きに連動する投資成果を目指します。 ● 日本の公社債および短期金融資産を主要投資対象とします。
信託財産留保額	追加設定時、一部解約時にそれぞれ0.03%

先進国債券（除く日本）…為替ヘッジなし

ファンド名	外国債券パッシブ・マザーファンド
形態	国内籍親投資信託
運用会社	三井住友アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	<ul style="list-style-type: none"> ● FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)をベンチマークとし、ベンチマークの動きに連動する投資成果を目指します。 ● ベンチマーク採用国の国債を主要投資対象とします。 ● 保有する外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行いません。
信託財産留保額	追加設定時、一部解約時にそれぞれ0.1%

為替ヘッジ付き先進国債券（除く日本）…為替ヘッジあり

ファンド名	ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド
形態	国内籍親投資信託
運用会社	三井住友アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	<ul style="list-style-type: none"> ● FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ヘッジベース)をベンチマークとし、ベンチマークの動きに連動する投資成果を目指します。 ● ベンチマーク採用国の国債を主要投資対象とします。 ● 保有する外貨建資産については、対円での為替のフルヘッジを原則とします。
信託財産留保額	追加設定時、一部解約時にそれぞれ0.1%

新興国債券…為替ヘッジなし*	
ファンド名	バンガード・米ドル建て新興国政府債券ETF
形態	米国籍外国投資信託
運用会社	ザ・バンガード・グループ・インク
運用の基本方針	<ul style="list-style-type: none"> ブルームバーグ・バークレイズ米ドル建て新興市場政府債RIC基準インデックスをベンチマークとし、インデックスの構成銘柄の債券を主要投資対象とします。 ベンチマークのパフォーマンスへの連動を目指します。
取引通貨	米ドル
管理報酬等**	年0.32%程度
一般投資者の日本での購入の可否***	購入可能です。

ファンド名	iシェアーズ J.P.モルガン・米ドル建てエマージング・マーケット債券ETF
形態	米国籍外国投資信託
運用会社	ブラックロック・ファンド・アドバイザーズ
運用の基本方針	<ul style="list-style-type: none"> J.P.モルガンEMBIグローバル・コア・インデックスをベンチマークとし、インデックスの構成銘柄の債券を主要投資対象とします。 ベンチマークのパフォーマンスへの連動を目指します。
取引通貨	米ドル
管理報酬等**	年0.39%程度
一般投資者の日本での購入の可否***	購入可能です。

ハイイールド債券…為替ヘッジなし*	
ファンド名	SPDR ブルームバーグ・バークレイズ・ハイ・イールド債券ETF
形態	米国籍外国投資信託
運用会社	SSgA ファンズ・マネジメント・インク
運用の基本方針	<ul style="list-style-type: none"> ブルームバーグ・バークレイズ・ハイ・イールド・ベリー・リキッド・インデックスをベンチマークとし、インデックスの構成銘柄の債券を主要投資対象とします。 ベンチマークの値動きと利回りに、経費控除前で、概ね連動する投資成果を上げることが目標とします。
取引通貨	米ドル
管理報酬等**	年0.40%程度
一般投資者の日本での購入の可否***	購入可能です。

*上記の投資信託証券を組み入れた場合、安定型・安定成長型・成長型の各ファンドにおいて対円での為替ヘッジを行うことがあります。

**管理報酬等とは各ETFの運用管理費用およびその他費用を各ETFの平均純資産総額で除したもので、本書の数値は各ETFの直近の目論見書で開示されているものです（以下同じ。）。

***外国籍のETFは、海外の上場有価証券を取り次ぐことのできる証券会社を通じて、日本国内の一般の投資者が、直接、購入することができるものがあります。直接購入される際は、売買委託手数料（証券会社ごとに異なります。）がかかります。また、円貨を外貨に交換する際に、証券会社が別途定める手数料がかかります。

▶ 株式

国内株式

ファンド名	国内株式インデックス・マザーファンド(B号)
形態	国内籍親投資信託
運用会社	三井住友アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	主として東京証券取引所第1部に上場している株式に投資を行い、TOPIX(東証株価指数、配当込み)の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。
信託財産留保額	追加設定時、一部解約時にそれぞれ0.08%

先進国株式(除く日本)…為替ヘッジなし

ファンド名	外国株式インデックス・マザーファンド
形態	国内籍親投資信託
運用会社	三井住友アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	<ul style="list-style-type: none"> 主として世界各国の株式に投資し、MSCIコクサイインデックス(配当込み、円ベース)の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。 外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行わないものとします。
信託財産留保額	追加設定時、一部解約時にそれぞれ0.15%

新興国株式…為替ヘッジなし

ファンド名	エマージング株式インデックス・マザーファンド
形態	国内籍親投資信託
運用会社	三井住友アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	<ul style="list-style-type: none"> 主として新興国の株式指数を対象とした先物取引、新興国の株式等を主要投資対象とする上場投資信託証券および新興国の株式(預託証券(DR)、株式の値動きに連動する有価証券を含みます。)に投資し、MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円ベース)の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。 外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行わないものとします。
信託財産留保額	追加設定時、一部解約時にそれぞれ0.15%

▶ リート

国内リート

ファンド名	Jリート・インデックス・マザーファンド
形態	国内籍親投資信託
運用会社	三井住友アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	<ul style="list-style-type: none"> ● 東証REIT指数(配当込み)をベンチマークとし、ベンチマークの動きに連動する投資成果を目指します。 ● 日本の取引所に上場(上場予定を含みます。)している不動産投資信託(REIT)を主要投資対象とします。
信託財産留保額	追加設定時、一部解約時にそれぞれ0.15%

外国リート…為替ヘッジなし

ファンド名	外国リート・インデックス・マザーファンド
形態	国内籍親投資信託
運用会社	三井住友アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	<ul style="list-style-type: none"> ● S&P先進国REIT指数(除く日本、配当込み、円ベース)をベンチマークとし、ベンチマークの動きに連動する投資成果を目指します。 ● 日本を除く世界各国の不動産投資信託(REIT)などを主要投資対象とします。 ● 外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行わないものとします。
信託財産留保額	追加設定時、一部解約時にそれぞれ0.15%

ファンドの特色

1

投資信託証券等への投資を通じて、世界各国の債券、株式および不動産投資信託（リート）等に分散投資します。

- 主として、インデックスファンドや上場投資信託証券（ETF）への投資を通じて、以下の資産等に投資します。

債券

国内債券

先進国債券(除く日本)*1

新興国債券*2

ハイールド債券*2

株式

国内株式

先進国株式(除く日本)

新興国株式

リート

国内リート

外国リート

*1 対円での為替ヘッジを行う投資信託証券を組み入れることがあります。

*2 当該資産を投資対象とする外貨建投資信託証券に対して対円での為替ヘッジを行うことがあります。

2

資産配分比率は、ラップ口座の投資助言に実績を持つ日興グローバルラップおよびエドモン・ドゥ・ロスチャイルド・アセット・マネジメント（ルクセンブルグ）からの投資助言を基に決定します。

- 日興グローバルラップから、「安定型」・「安定成長型」・「成長型」の各ファンドの3つの基本資産配分（「保守的」・「中立的」・「積極的」資産配分）に関する投資助言を受けます。また、エドモン・ドゥ・ロスチャイルド・アセット・マネジメント（ルクセンブルグ）から、世界経済の見通しと組入資産の投資見通しに関する投資助言を受けます。
- 市場のリスク選好状況に応じて、「保守的」・「中立的」・「積極的」資産配分のいずれかに調整します。市場のリスク選好状況の判断には、三井住友アセットマネジメント独自のリスク態度指数を使用します。

3

目標リスク水準の異なる「安定型」・「安定成長型」・「成長型」の3つのファンドからお選びいただけます。

各ファンド間でのスイッチングが可能です。

安定型 信託財産の安定性を重視した運用を行います。

安定成長型 信託財産の安定性と収益性のバランスを重視した運用を行います。

成長型 信託財産の収益性を重視した運用を行います。

□ 一部のファンドのみの取扱いとなる場合があります。また、スイッチングが行え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。

※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

□ ファンド・オブ・ファンズ方式で運用を行います。

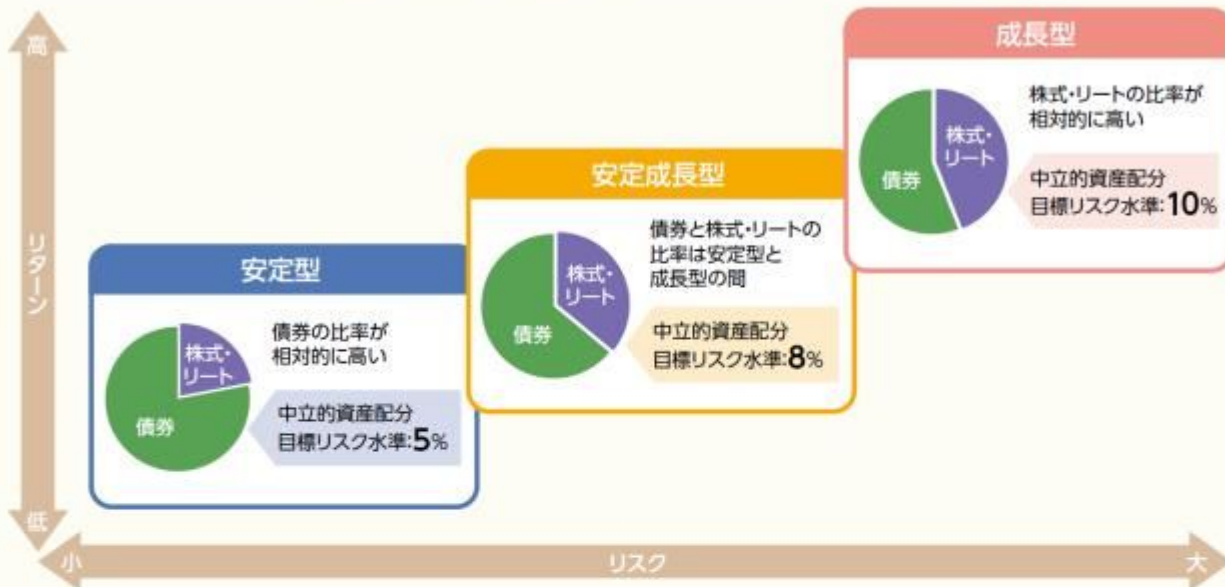


※日興グローバルラップは三井住友アセットマネジメントの子会社です(100%出資)。

お客様の投資スタイルに合わせて3つのファンドから選択

■お客様の投資スタイルに合わせて3つのファンド（安定型、安定成長型、成長型）からお選びいただけます。

〔 3つのファンド（安定型、安定成長型、成長型）のリスク・リターン特性のイメージ 〕



〔 各ファンドの3つの基本資産配分の目標リスク水準について 〕

各ファンドの目標リスク水準

	安定型	安定成長型	成長型
保守的資産配分	3%	5.5%	7%
中立的資産配分	5%	8%	10%
積極的資産配分	7%	10.5%	13%

- 中立的資産配分の目標リスク水準は、現時点で想定される各ファンドの中長期的な騰落率の変動率（年率標準偏差）を示します。
- 当ファンドでは、市場のリスク選好状況に応じて一定の範囲内で資産配分を調整するため、年1回（原則として毎年2月）、中立的資産配分に加えて、保守的資産配分、積極的資産配分の3つの基本資産配分を策定します。

（出所）日興グローバルラップ

※上記はイメージであり、実際とは異なる場合があります。各ファンドの基準価額の騰落率の変動率（年率標準偏差）が目標リスク水準通りになるとは限りません。また、一部のファンドのみの取扱いとなる場合があります。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

※上記の目標リスク水準は2017年2月末現在のものであり、今後変更される場合があります。

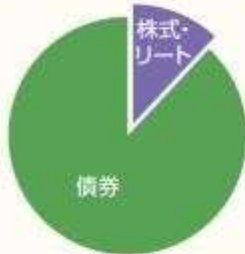
資産配分の調整について

■市場のリスク選好状況に応じて、「保守的」・「中立的」・「積極的」資産配分のいずれかに資産配分を調整することで、中長期的な収益の獲得を目指します。

〔市場のリスク選好状況に応じた資産配分の調整〕

保守的資産配分

債券の比率が相対的に高い

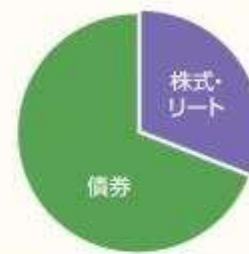


中立的資産配分



積極的資産配分

株式・リートの比率が相対的に高い



市場のリスク選好状況

低

市場のリスク選好状況に応じて、「保守的」・「中立的」・「積極的」資産配分のいずれかに調整します。市場のリスク選好状況の判断には、当社独自のリスク態度指数を使用します。

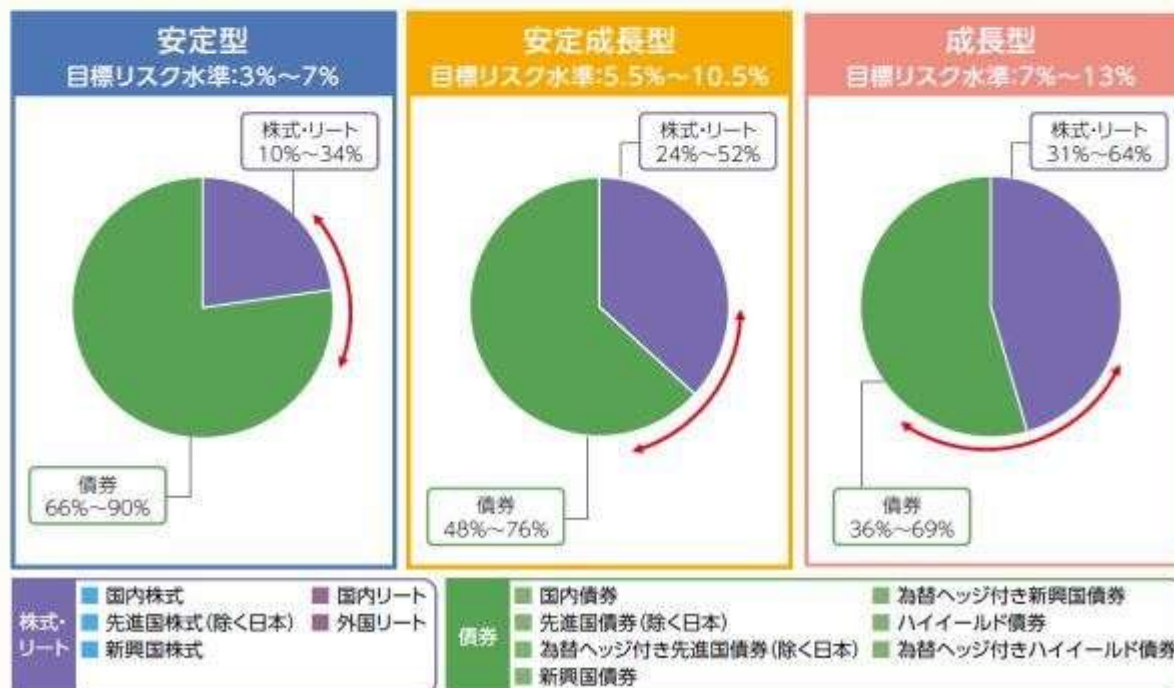
高

※資産配分の決定にあたっては、エドモン・ドゥ・ロスタイルド・アセット・マネジメント(ルクセンブルグ)から投資助言を受けます。

※上記は、安定型を例にした資産配分の調整のイメージであり、実際とは異なる場合があります。

ポートフォリオのイメージ

▶資産配分



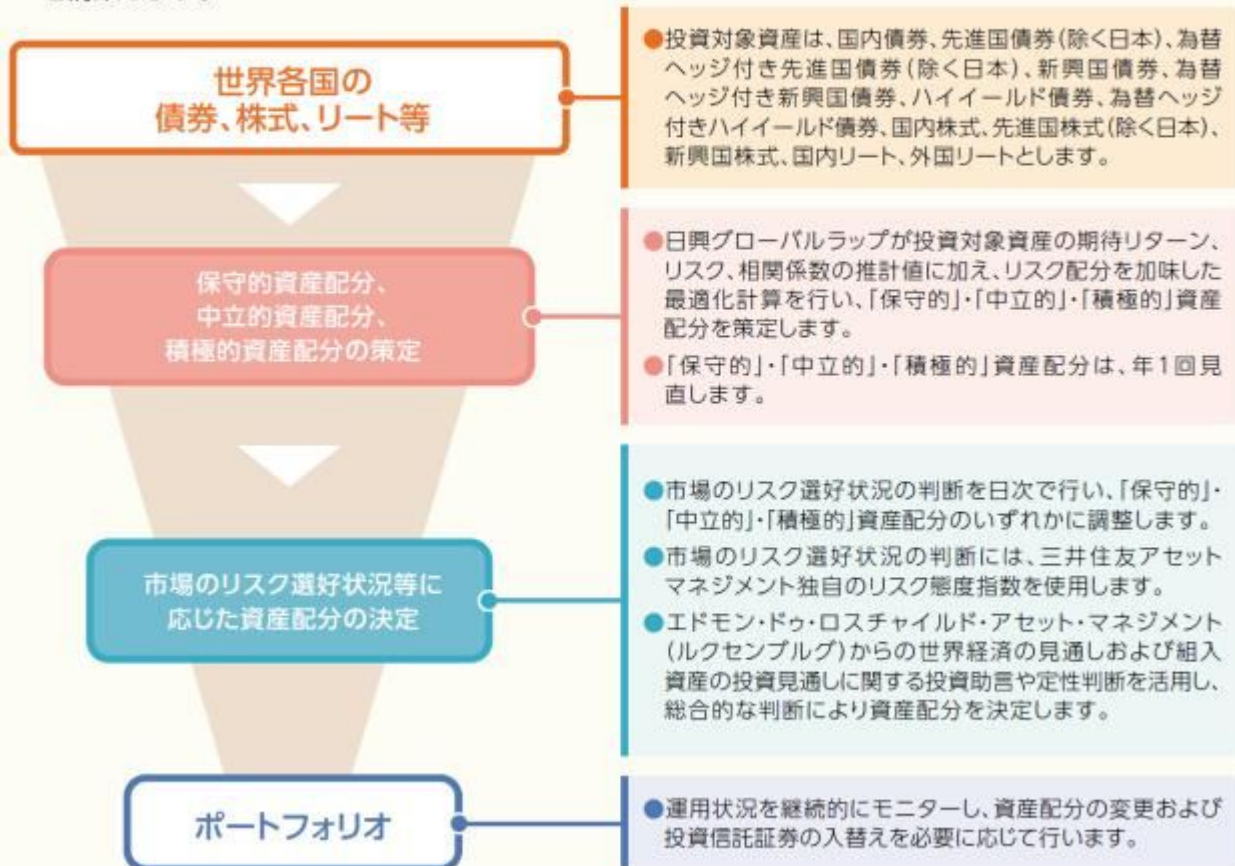
(出所)日興グローバルラップ

※上記はイメージであり、実際とは異なる場合があります。

※上記は2017年2月に日興グローバルラップから受けた投資助言に基づく資産配分であり、今後変更される場合があります。

運用プロセス

■世界各国の債券、株式およびリート等を投資対象資産とし、各ファンドについて、「保守的」・「中立的」・「積極的」資産配分を策定します。市場のリスク選好状況等に応じて資産配分を決定し、ポートフォリオを構築します。



※上記の運用プロセスは2017年11月末現在のものであり、今後変更される場合があります。

（２）【投資対象】

イ 投資対象とする資産の種類

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．約束手形
- 3．金銭債権

（ロ）特定資産以外の資産で、以下に掲げる資産

- 1．為替手形

ロ 投資対象とする有価証券

委託会社は、信託金を、主として、投資信託証券（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。））ならびに投資証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。））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．コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等
- 2．外国または外国の者の発行する本邦通貨表示の証券で、前号の性質を有するもの

3. 国債証券、地方債証券、特別の法律により法人の発行する債券および社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券の新株引受権証券および短期社債等を除きます。）

なお、第3号の証券にかかる運用の指図は買い現先取引（売戻条件付の買入れ）および債券貸借取引（現金担保付債券借入れ）に限り行うことができます。

八 投資対象とする金融商品

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

1. 預金
2. 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
3. コール・ローン
4. 手形割引市場において売買される手形

主要投資対象となる投資信託証券の名称、運用会社、主要運用対象、運用の基本方針に関しましては、上記「（1）投資方針」の記載をご覧ください。

（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。

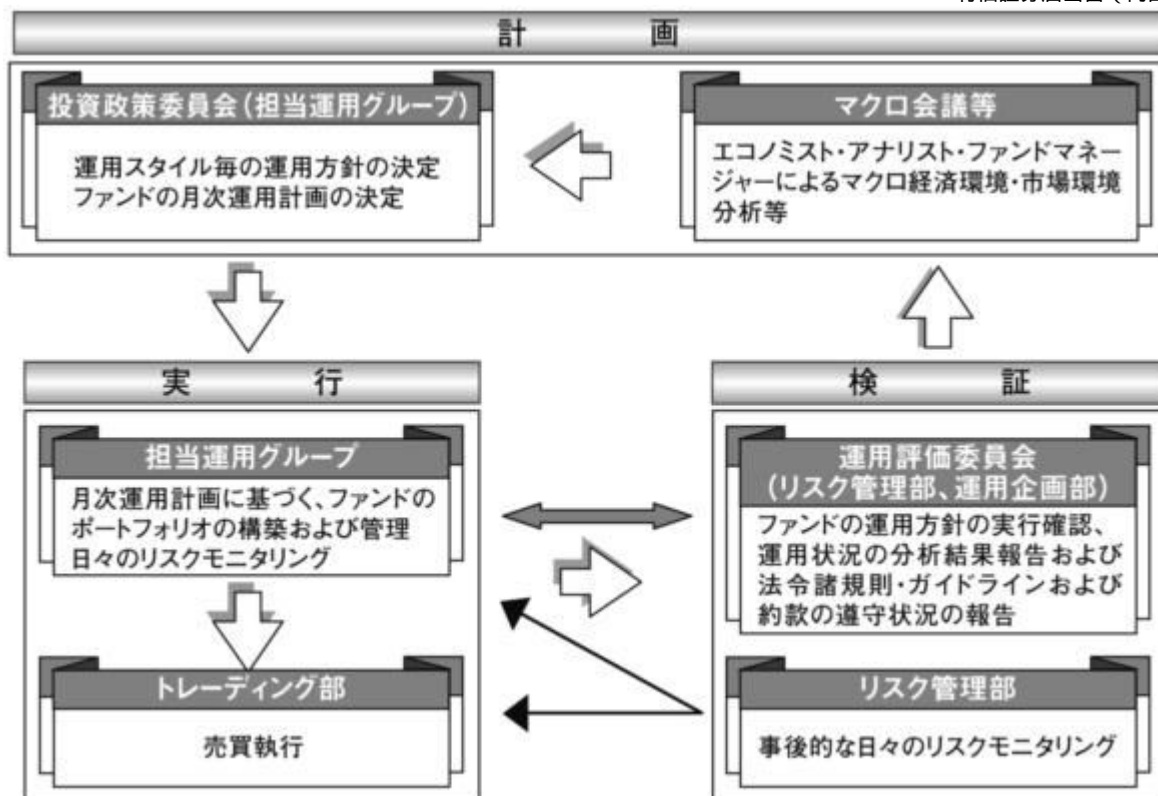
売買執行については、組織的に分離されたトレーディング部が、最良と思われる手法をもって売買を執行します。

（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。

他の運用会社が設定・運用を行うファンド（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）【配分方針】

年1回（原則として毎年4月26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 分配対象額は、経費控除後の利子、配当等収益と売買益（評価損益を含みます。）等の範囲内とします。
- 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。
- 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、元本部分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投資制限

- イ 投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。
- ロ 投資信託証券とコマーシャル・ペーパーおよび短期社債等以外の有価証券への投資は、買い現先取引または債券貸借取引に限ります。
- ハ 外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。
- ニ 投資信託証券を組み入れる場合において、一般社団法人投資信託協会規則に定めるエクスポージャーがルックスルーできる場合に該当しないときは、当該投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。
- ホ 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。
- ヘ 外国為替予約取引の指図
委託会社は、信託財産に属する外貨建資産について、当該外貨建資産の対円での為替ヘッジのため、外国為替の売買の予約を指図することができます。
- ト 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、受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は当該有価証券等の売却代金、解約代金および償還金の合計額を限度とします。ただし、資金借入額は、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%を超えないこととします。
 - (ハ) 収益分配金の再投資にかかる借入期間は、信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。
- (二) 借入金の利息は、信託財産中から支弁します。

法令に基づく投資制限

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

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

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

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、投資信託を組み入れることにより運用を行います。当ファンドが組み入れる投資信託は、主として内外の株式、債券および不動産投資信託（リート）を投資対象としており、その価格は、保有する株式、債券および不動産投資信託（リート）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。当ファンドが組み入れる投資信託の価格の変動により、当ファンドの基準価額も上下します。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（他の投資信託の組入れを通じた実質的なリスク等となります。）のうち主要なものは、以下の通りです。

（イ）株式市場リスク

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

（ロ）債券市場リスク

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

（ハ）不動産投資信託（リート）に関するリスク

リーートの価格は、不動産市況や金利・景気動向、関連法制度（税制、建築規制、会計制度等）の変更等の影響を受け変動します。また、リートに組み入れられている個々の不動産等の市場価値、賃貸収入等がマーケット要因によって上下するほか、自然災害等により個々の不動産等の毀損・滅失が生じる可能性もあります。さらに個々のリートは一般の法人と同様、運営如何によっては倒産の可能性もあります。これらの影響により、ファンドが組み入れているリーートの価格が下落した場合、ファンドの基準価額が下落する要因となります。

（ニ）信用リスク

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

（ホ）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。

実質外貨建資産の一部に対し、原則として対円での為替ヘッジを行うため、為替の変動による影響は限定的と考えられます。なお、対円での為替ヘッジ比率は、資産配分の調整に伴い変動します。

(ヘ) 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。

(ト) 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。

(チ) ファミリーファンド方式にかかる留意点

当ファンドは一部、実質的に「ファミリーファンド方式」により運用します。そのため、当ファンドと同じマザーファンドを投資対象とする他のベビーファンドに追加設定・一部解約により資金の流出入が生じた場合、その結果として、当該マザーファンドにおいても組入有価証券の売買等が生じ、当ファンドの基準価額に影響を及ぼすことがあります。

(リ) 換金制限等に関する留意点

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

(ヌ) 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。

■アセットアロケーション・ファンド(安定型)



「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：
2016年4月～2017年11月

他の資産クラス：
2012年12月～2017年11月



■アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)



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

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

※すべての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。

【 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。

■アセットアロケーション・ファンド（成長型）



※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	FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース) FTSE Fixed Income LLCにより運営されている指数で、日本を除く世界の主要国の国債を対象としています。
新興国債	JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ダイバーシファイド(円ベース) J.P. Morganが算出、公表する指数で、新興国が発行する現地通貨建て国債を対象としています。

※海外の指数は、為替ヘッジなしによる投資を想定して、円ベースとしています。

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

4 【手数料等及び税金】

(1) 【申込手数料】

原則として、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）に、1.08%（税抜き

1.0%)を上限として、販売会社がそれぞれ別に定める申込手数料率を乗じて得た額となります。

申込手数料は販売会社によるファンドの募集・販売の取扱い事務等の対価です。

累積投資契約に基づく収益分配金の再投資の場合は無手数料となります。

申込手数料に関する詳細は、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。

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) 【換金(解約)手数料】

解約手数料はありません。

(3) 【信託報酬等】

ファンド	純資産総額に年1.0044%(税抜き0.93%)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0.47%	ファンド運用の指図等の対価
	販売会社	年0.43%	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。			
投資対象とする 投資信託	各ETFの配分比率の変動幅を加味した場合、管理報酬等の概算値は以下の通りとなります。		
	安定型	年0.02847%～年0.09115% 程度	
	安定成長型	年0.06749%～年0.13523% 程度	
	成長型	年0.08718%～年0.12990% 程度	
管理報酬等は年度によって異なります。			
実質的な負担	ファンドの純資産総額に対して		
	安定型	年1.03287%(税抜き0.95847%)～年1.09555%(税抜き1.02115%)程度	
	安定成長型	年1.07189%(税抜き0.99749%)～年1.13963%(税抜き1.06523%)程度	
	成長型	年1.09158%(税抜き1.01718%)～年1.13430%(税抜き1.05990%)程度	

上記は直近の基本資産配分および管理報酬率を用いた試算の結果であり、基本資産配分の見直しおよび実際の組入れ状況等により変動します。
新興国債券の費用は、管理報酬がより高いETFの数値を用いて試算しています。

(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0.00648% (税抜き0.006%) 以内の率を乗じて得た金額が信託財産の費用として計上され、毎計算期間の最初の6ヵ月終了日と各計算期末または信託終了のときに、信託財産中から支弁するものとします。監査費用は、将来、監査法人との契約等により変更となることがあります。
- ロ 信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用および受託会社の立て替えた立替金の利息は、信託財産中から支弁します。
- ハ 有価証券の売買時の手数料、デリバティブ取引等に要する費用、および外国における資産の保管等に要する費用等(それらにかかる消費税等相当額を含みます。)は、信託財産中から支弁するものとします。

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

上記(1)~(4)にかかる手数料等および他の投資信託(ファンド)の組入れを通じて間接的に負担する手数料等の合計額、その上限額、計算方法等は、手数料等に保有期間に応じて異なるものが含まれていたり、発生時・請求時に初めて具体的金額を認識するものがあったりすることから、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

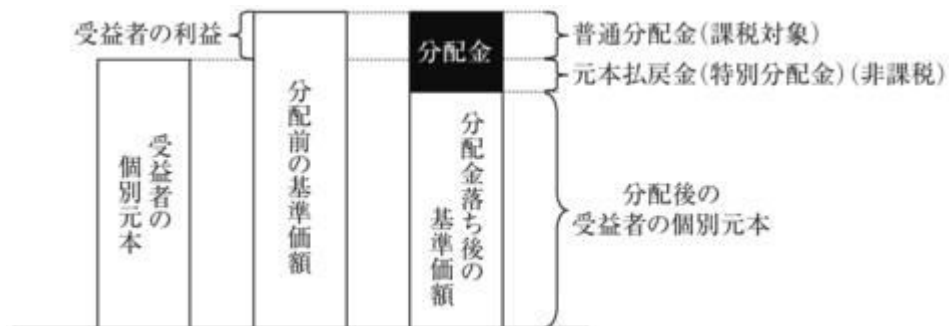
追加型株式投資信託の収益分配金には、課税扱いとなる「普通分配金」と、非課税扱いとなる

「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）の区分がありません。

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での適用対象としない場合があります。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

当ファンドは、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には制限を設けません。

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「(5)課税上の取扱い」ほか税制に関する本書の記載は、2017年11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】

アセットアロケーション・ファンド(安定型)

2017年11月30日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
投資信託受益証券	アメリカ	5,547,290,387	14.29
親投資信託受益証券	日本	32,656,729,748	84.15
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		604,106,283	1.56
合計(純資産総額)		38,808,126,418	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。

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	売建		5,207,301,840	13.41

アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)

2017年11月30日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
投資信託受益証券	アメリカ	6,046,885,580	23.31

親投資信託受益証券	日本	19,458,891,366	75.00
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		438,947,820	1.69
合計(純資産総額)		25,944,724,766	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		36,821,680	0.14
	売建		5,855,206,720	22.56

アセットアロケーション・ファンド(成長型)

2017年11月30日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
投資信託受益証券	アメリカ	5,686,252,252	29.31
親投資信託受益証券	日本	13,365,771,382	68.90
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		345,456,868	1.79
合計(純資産総額)		19,397,480,502	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	売建		5,461,248,320	28.15

(2)【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

アセットアロケーション・ファンド(安定型)

イ 主要投資銘柄

2017年11月30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	ヘッジ付き外国債券パッシブ・マ ザーファンド	13,792,829,521	1.3809	19,046,518,286	1.3918	19,196,860,127	49.47

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	7,590,730,305	1.2539	9,518,016,730	1.2565	9,537,752,628	24.58
アメリカ	投資信託受益証券	iシェアーズ J.P.モルガン・米ドル建てエマージング・マーケット債券ETF	231,710	12,843.17	2,975,891,152	12,954.10	3,001,594,627	7.73
アメリカ	投資信託受益証券	SPDR ブルームバーグ・バークレイズ・ハイ・イールド債券ETF	551,201	4,159.29	2,292,608,114	4,140.24	2,282,108,562	5.88
日本	親投資信託受益証券	外国株式インデックス・マザーファンド	474,783,223	3.0389	1,442,818,737	3.3807	1,605,099,641	4.14
日本	親投資信託受益証券	国内株式インデックス・マザーファンド（B号）	548,727,701	2.3197	1,272,902,983	2.7242	1,494,844,003	3.85
アメリカ	投資信託受益証券	バンガード・米ドル建て新興国政府債券ETF	29,277	8,988.65	263,160,735	9,003.21	263,587,198	0.68
日本	親投資信託受益証券	エマージング株式インデックス・マザーファンド	173,974,761	1.2552	218,379,333	1.4363	249,879,949	0.64
日本	親投資信託受益証券	リート・インデックス・マザーファンド	102,040,007	1.9143	195,335,186	1.8748	191,304,605	0.49
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	107,638,375	1.6767	180,477,264	1.7766	191,230,337	0.49
日本	親投資信託受益証券	外国リート・インデックス・マザーファンド	93,740,285	1.9667	184,359,019	2.0243	189,758,458	0.49

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11月30日現在

種類	投資比率（％）
投資信託受益証券	14.29
親投資信託受益証券	84.15
合計	98.44

アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）

イ 主要投資銘柄

2017年11月30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	ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド	7,273,835,945	1.3805	10,041,530,523	1.3918	10,123,724,868	39.02
アメリカ	投資信託受益証券	iシェアーズ J.P.モルガン・米ドル建てエマージング・マーケット債券ETF	185,583	12,843.17	2,383,474,203	12,954.10	2,404,060,833	9.27
日本	親投資信託受益証券	国内株式インデックス・マザーファンド（B号）	870,164,102	2.3143	2,013,890,789	2.7242	2,370,501,046	9.14
アメリカ	投資信託受益証券	SPDR ブルームバーグ・バークレイズ・ハイ・イールド債券ETF	541,443	4,160.41	2,252,628,391	4,140.24	2,241,708,027	8.64
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	1,772,817,323	1.2538	2,222,758,360	1.2565	2,227,544,966	8.59
日本	親投資信託受益証券	外国株式インデックス・マザーファンド	523,522,153	3.0395	1,591,245,585	3.3807	1,769,871,342	6.82
アメリカ	投資信託受益証券	バンガード・米ドル建て新興国政府債券ETF	155,624	8,988.65	1,398,849,823	9,003.21	1,401,116,720	5.40
日本	親投資信託受益証券	エマージング株式インデックス・マザーファンド	742,401,732	1.2351	916,940,380	1.4363	1,066,311,607	4.11
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	581,027,114	1.6855	979,321,201	1.7766	1,032,252,770	3.98
日本	親投資信託受益証券	リート・インデックス・マザーファンド	395,533,056	1.9113	755,982,330	1.8748	741,545,373	2.86
日本	親投資信託受益証券	外国リート・インデックス・マザーファンド	62,806,597	1.9749	124,036,749	2.0243	127,139,394	0.49

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11月30日現在

種類	投資比率（％）
投資信託受益証券	23.31
親投資信託受益証券	75.00
合計	98.31

アセットアロケーション・ファンド（成長型）

イ 主要投資銘柄

2017年11月30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	ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド	3,480,090,455	1.3805	4,804,264,874	1.3918	4,843,589,895	24.97
アメリカ	投資信託受益証券	iシェアーズ J.P.モルガン・米ドル建てエマージング・マーケット債券ETF	194,528	12,843.17	2,498,356,368	12,954.10	2,519,935,262	12.99
日本	親投資信託受益証券	国内株式インデックス・マザーファンド(B号)	880,688,782	2.3233	2,046,121,571	2.7242	2,399,172,379	12.37
アメリカ	投資信託受益証券	SPDR ブルームバーグ・バークレイズ・ハイ・イールド債券ETF	495,024	4,160.41	2,059,506,017	4,140.24	2,049,521,878	10.57
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	1,273,806,716	1.2533	1,596,461,958	1.2565	1,600,538,138	8.25
日本	親投資信託受益証券	外国株式インデックス・マザーファンド	472,274,091	3.0468	1,438,924,701	3.3807	1,596,617,019	8.23
アメリカ	投資信託受益証券	バンガード・米ドル建て新興国政府債券ETF	124,044	8,988.65	1,114,988,225	9,003.21	1,116,795,112	5.76
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	622,079,100	1.6845	1,047,892,244	1.7766	1,105,185,729	5.70
日本	親投資信託受益証券	エマージング株式インデックス・マザーファンド	692,964,255	1.2342	855,256,484	1.4363	995,304,559	5.13
日本	親投資信託受益証券	Jリート・インデックス・マザーファンド	371,651,930	1.9114	710,375,500	1.8748	696,773,038	3.59
日本	親投資信託受益証券	外国リート・インデックス・マザーファンド	63,523,502	1.9688	125,065,071	2.0243	128,590,625	0.66

以上が、当ファンドが保有する有価証券のすべてです。

□ 種類別の投資比率

2017年11月30日現在

種類	投資比率(%)
投資信託受益証券	29.31
親投資信託受益証券	68.90
合計	98.22

【投資不動産物件】

アセットアロケーション・ファンド(安定型)

該当事項はありません。

アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）

該当事項はありません。

アセットアロケーション・ファンド（成長型）

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

アセットアロケーション・ファンド（安定型）

2017年11月30日現在

種類	資産の名称	買建 / 売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	米ドル	売建	46,527,000.00	5,296,204,318	5,207,301,840	13.41

(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。

アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）

2017年11月30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	329,000.00	37,116,793	36,821,680	0.14
	米ドル	売建	52,316,000.00	5,954,616,325	5,855,206,720	22.56

(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。

アセットアロケーション・ファンド（成長型）

2017年11月30日現在

種類	資産の名称	買建 / 売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	米ドル	売建	48,796,000.00	5,554,413,846	5,461,248,320	28.15

(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。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

アセットアロケーション・ファンド（安定型）

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 4月26日)	13,358,665,467	13,358,665,467	9,514	9,514
第2期	(2017年 4月26日)	48,551,937,727	48,551,937,727	9,992	9,992
	2016年11月末日	33,613,439,573		9,722	
	12月末日	38,237,700,300		9,904	
	2017年 1月末日	41,446,062,616		9,872	
	2月末日	45,883,435,389		9,966	
	3月末日	50,332,911,497		9,948	
	4月末日	48,138,950,530		9,993	
	5月末日	45,749,718,709		10,085	
	6月末日	43,785,942,765		10,059	
	7月末日	42,414,768,801		10,069	
	8月末日	41,312,180,547		10,126	
	9月末日	39,769,129,547		10,108	
	10月末日	39,300,431,964		10,152	
	11月末日	38,808,126,418		10,162	

アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)

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 4月26日)	12,391,100,166	12,391,100,166	9,296	9,296
第2期	(2017年 4月26日)	32,241,957,798	32,241,957,798	10,040	10,040
	2016年11月末日	22,664,897,686		9,617	
	12月末日	26,940,563,789		9,893	
	2017年 1月末日	28,909,816,739		9,897	
	2月末日	31,279,981,003		9,994	
	3月末日	33,837,906,337		9,984	
	4月末日	31,921,874,825		10,031	
	5月末日	30,519,400,563		10,166	
	6月末日	29,218,290,367		10,164	
	7月末日	28,625,947,747		10,206	
	8月末日	27,419,575,758		10,263	
	9月末日	26,781,359,919		10,299	
	10月末日	26,685,114,291		10,388	
	11月末日	25,944,724,766		10,408	

アセットアロケーション・ファンド(成長型)

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 4月26日)	12,509,183,920	12,509,183,920	9,159	9,159
第2期 (2017年 4月26日)	27,043,239,176	27,043,239,176	10,069	10,069
2016年11月末日	21,873,991,678		9,545	
12月末日	25,147,741,995		9,896	
2017年 1月末日	26,270,582,003		9,899	
2月末日	28,314,900,466		10,024	
3月末日	30,284,797,506		10,007	
4月末日	26,602,796,283		10,053	
5月末日	24,185,917,175		10,208	
6月末日	22,759,962,351		10,221	
7月末日	22,642,173,458		10,275	
8月末日	21,668,039,144		10,328	
9月末日	21,077,228,816		10,401	
10月末日	20,623,488,315		10,511	
11月末日	19,397,480,502		10,536	

【分配の推移】

アセットアロケーション・ファンド（安定型）

	計算期間	1万口当たり分配金(円)
第1期	2015年 4月17日～2016年 4月26日	0
第2期	2016年 4月27日～2017年 4月26日	0

アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）

	計算期間	1万口当たり分配金(円)
第1期	2015年 4月17日～2016年 4月26日	0
第2期	2016年 4月27日～2017年 4月26日	0

アセットアロケーション・ファンド（成長型）

	計算期間	1万口当たり分配金(円)
第1期	2015年 4月17日～2016年 4月26日	0
第2期	2016年 4月27日～2017年 4月26日	0

【収益率の推移】

アセットアロケーション・ファンド（安定型）

	収益率（％）
第1期	4.9
第2期	5.0
第3期（中間期）	1.3

（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。

アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）

	収益率（％）
第1期	7.0
第2期	8.0
第3期（中間期）	3.2

（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。

アセットアロケーション・ファンド（成長型）

	収益率（％）
第1期	8.4
第2期	9.9
第3期（中間期）	4.1

（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】

アセットアロケーション・ファンド（安定型）

	設定口数（口）	解約口数（口）
第1期	14,471,203,211	430,595,693
第2期	39,440,607,065	4,888,096,644
第3期（中間期）	1,842,201,760	11,370,178,583

（注）本邦外における設定および解約の実績はありません。

アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）

	設定口数（口）	解約口数（口）
第1期	13,473,777,867	144,788,717
第2期	22,569,690,166	3,786,328,653
第3期（中間期）	1,147,632,282	7,482,935,661

（注）本邦外における設定および解約の実績はありません。

アセットアロケーション・ファンド（成長型）

	設定口数（口）	解約口数（口）
第1期	13,883,023,089	225,050,831
第2期	19,324,709,567	6,124,106,042
第3期（中間期）	1,562,362,836	8,689,292,883

（注）本邦外における設定および解約の実績はありません。

（参考）

（1）投資状況

国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

2017年11月30日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 （円）	投資比率 （%）
株式	日本	190,034,814,150	98.45
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		2,990,490,200	1.55
合計（純資産総額）		193,025,304,350	100.00

その他以下の取引を行っております。

種類	買建/ 売建	国/地域	時価合計（円）	投資 比率 （%）
株価指数先物取引	買建	日本	2,803,320,000	1.45
合計	買建	-	2,803,320,000	1.45

外国株式インデックス・マザーファンド

2017年11月30日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
株式	アメリカ	115,682,898,706	58.97
	イギリス	12,944,763,075	6.60
	ドイツ	7,619,923,496	3.88
	フランス	7,512,541,054	3.83
	カナダ	7,404,370,914	3.77
	スイス	6,915,248,621	3.52
	オーストラリア	4,590,040,880	2.34
	オランダ	3,847,568,211	1.96
	アイルランド	2,750,029,577	1.40
	スペイン	2,629,432,129	1.34
	スウェーデン	2,125,742,270	1.08
	香港	1,821,288,334	0.93
	イタリア	1,557,908,371	0.79
	シンガポール	1,543,017,510	0.79
	デンマーク	1,403,125,628	0.72
	ジャージー	1,063,491,345	0.54
	バミューダ	945,643,717	0.48
	ベルギー	886,276,089	0.45
	フィンランド	744,867,129	0.38
	ノルウェー	523,423,302	0.27
	ケイマン諸島	509,063,807	0.26
	キュラソー	454,422,820	0.23
	イスラエル	347,699,893	0.18
	ルクセンブルグ	243,163,087	0.12
	オーストリア	207,118,850	0.11
	ポルトガル	121,121,829	0.06
	ニュージーランド	115,158,906	0.06
	リベリア	112,228,204	0.06
	英ヴァージン諸島	47,020,746	0.02
	パプアニューギニア	36,522,681	0.02
マン島	31,757,949	0.02	
モーリシャス	11,178,074	0.01	
小計		186,748,057,204	95.19

投資証券	アメリカ	3,257,911,590	1.66
	オーストラリア	638,624,429	0.33
	フランス	256,611,965	0.13
	イギリス	169,409,389	0.09
	香港	127,791,485	0.07
	シンガポール	90,472,246	0.05
	カナダ	34,923,924	0.02
	小計	4,575,745,028	2.33
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		4,858,267,065	2.48
合計(純資産総額)		196,182,069,297	100.00

その他以下の取引を行っております。

種類	買建/ 売建	国/地域	時価合計(円)	投資 比率 (%)
株価指数先物取引	買建	アメリカ	3,338,516,864	1.70
	買建	ドイツ	919,431,677	0.46
	買建	イギリス	344,530,803	0.17
	買建	オーストラリア	229,874,638	0.11
合計	買建	-	4,832,353,982	2.44

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		225,422,600	0.11

エマージング株式インデックス・マザーファンド

2017年11月30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	223,151,309	5.20
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		4,068,322,768	94.80
合計(純資産総額)		4,291,474,077	100.00

その他以下の取引を行っております。

種類	買建/ 売建	国/地域	時価合計（円）	投資 比率 （％）
株価指数先物取引	買建	アメリカ	4,299,896,340	100.19
合計	買建	-	4,299,896,340	100.19

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		3,490,261,084	81.33
	売建		115,605,335	2.69

Jリート・インデックス・マザーファンド

2017年11月30日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 （円）	投資比率 （％）
投資証券	日本	9,548,351,550	98.87
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		108,745,582	1.13
合計(純資産総額)		9,657,097,132	100.00

外国リート・インデックス・マザーファンド

2017年11月30日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 （円）	投資比率 （％）
投資証券	アメリカ	2,769,840,285	70.53
	オーストラリア	308,147,705	7.85
	イギリス	201,326,728	5.13
	フランス	178,917,889	4.56
	シンガポール	132,140,834	3.36
	香港	79,977,070	2.04
	カナダ	70,608,379	1.80
	スペイン	30,978,618	0.79
	ベルギー	26,874,345	0.68
	ニュージーランド	17,511,683	0.45
	オランダ	17,379,890	0.44

	アイルランド	12,089,156	0.31
	ドイツ	7,367,703	0.19
	イスラエル	3,837,600	0.10
	イタリア	3,570,624	0.09
	マン島	2,240,091	0.06
	ガーンジー	2,145,961	0.05
	小計	3,864,954,561	98.41
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		62,274,592	1.59
合計(純資産総額)		3,927,229,153	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		16,348,319	0.41

国内債券パッシブ・マザーファンド

2017年11月30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	165,047,024,810	74.73
地方債証券	日本	19,366,390,146	8.77
特殊債券	日本	26,434,714,927	11.97
社債券	日本	8,152,937,000	3.69
	オランダ	200,604,000	0.09
	オーストラリア	200,598,000	0.09
	アメリカ	200,432,000	0.09
	小計	8,754,571,000	3.96
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1,266,776,149	0.57
合計(純資産総額)		220,869,477,032	100.00

外国債券パッシブ・マザーファンド

2017年11月30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	83,983,648,084	42.68
	フランス	19,961,412,671	10.15
	イタリア	19,740,762,442	10.03
	ドイツ	13,802,256,514	7.01

イギリス	13,592,382,168	6.91
スペイン	11,331,471,052	5.76
ベルギー	5,063,826,163	2.57
カナダ	4,147,811,310	2.11
オランダ	4,120,440,478	2.09
オーストラリア	4,116,738,634	2.09
オーストリア	3,422,356,321	1.74
メキシコ	1,683,700,218	0.86
アイルランド	1,547,487,590	0.79
デンマーク	1,293,533,978	0.66
フィンランド	1,256,521,786	0.64
ポーランド	1,222,765,128	0.62
南アフリカ	1,036,885,080	0.53
スウェーデン	903,281,659	0.46
マレーシア	861,707,637	0.44
シンガポール	743,747,716	0.38
ノルウェー	591,299,816	0.30
スイス	340,728,477	0.17
小計	194,764,764,922	98.99
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	1,991,834,228	1.01
合計(純資産総額)	196,756,599,150	100.00

ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド

2017年11月30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	24,458,468,350	42.24
	フランス	5,952,799,328	10.28
	イタリア	5,642,342,275	9.75
	ドイツ	3,990,358,074	6.89
	イギリス	3,968,106,621	6.85
	スペイン	3,216,077,064	5.55
	ベルギー	1,551,851,648	2.68
	オランダ	1,265,097,327	2.19
	カナダ	1,208,255,337	2.09
	オーストラリア	1,202,462,814	2.08
	オーストリア	943,725,546	1.63
	メキシコ	486,656,516	0.84
	シンガポール	475,502,476	0.82
	アイルランド	471,431,275	0.81
デンマーク	376,564,579	0.65	

	ポーランド	355,272,322	0.61
	フィンランド	338,988,227	0.59
	南アフリカ	289,235,320	0.50
	スウェーデン	269,311,810	0.47
	ノルウェー	166,881,292	0.29
	スイス	107,860,754	0.19
	小計	56,737,248,955	97.99
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1,161,558,510	2.01
合計(純資産総額)		57,898,807,465	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	売建		57,145,996,000	98.69

(2) 投資資産

投資有価証券の主要銘柄

国内株式インデックス・マザーファンド(B号)

イ 主要投資銘柄(上位30銘柄)

2017年11月30日現在

国/ 地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	投資 比率 (%)
日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	902,900	6,661.40	6,014,578,060	7,044.00	6,360,027,600	3.29
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	5,174,500	672.94	3,482,128,030	792.10	4,098,721,450	2.12
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	329,900	6,842.50	2,257,340,750	9,485.00	3,129,101,500	1.62
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	523,000	4,649.69	2,431,787,870	5,879.00	3,074,717,000	1.59
日本	株式	ソニー	電気機器	495,700	3,297.82	1,634,729,374	5,201.00	2,578,135,700	1.34
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	554,300	4,221.96	2,340,232,428	4,547.00	2,520,402,100	1.31
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	668,300	3,338.71	2,231,259,893	3,744.00	2,502,115,200	1.30
日本	株式	キーエンス	電気機器	36,400	41,274.26	1,502,383,064	64,910.00	2,362,724,000	1.22
日本	株式	KDDI	情報・通信業	656,100	3,002.19	1,969,736,859	3,215.00	2,109,361,500	1.09
日本	株式	任天堂	その他製品	45,700	27,671.34	1,264,580,238	45,200.00	2,065,640,000	1.07
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	9,950,000	203.11	2,020,944,500	203.90	2,028,805,000	1.05
日本	株式	ファナック	電気機器	70,600	19,363.02	1,367,029,212	27,945.00	1,972,917,000	1.02
日本	株式	キヤノン	電気機器	399,800	3,270.96	1,307,729,808	4,298.00	1,718,340,400	0.89
日本	株式	日本たばこ産業	食料品	461,100	3,937.08	1,815,387,588	3,720.00	1,715,292,000	0.89

日本	株式	武田薬品工業	医薬品	273,500	4,696.37	1,284,457,195	6,184.00	1,691,324,000	0.88
日本	株式	NTTドコモ	情報・通信業	539,400	2,631.21	1,419,274,674	2,907.50	1,568,305,500	0.81
日本	株式	信越化学工業	化学	129,500	8,514.34	1,102,607,030	11,765.00	1,523,567,500	0.79
日本	株式	日立製作所	電気機器	1,783,000	614.20	1,095,118,600	834.20	1,487,378,600	0.77
日本	株式	東日本旅客鉄道	陸運業	133,400	9,802.42	1,307,642,828	10,865.00	1,449,391,000	0.75
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	547,500	1,567.89	858,419,775	2,647.00	1,449,232,500	0.75
日本	株式	三菱商事	卸売業	513,300	2,474.29	1,270,053,057	2,813.00	1,443,912,900	0.75
日本	株式	パナソニック	電気機器	848,400	1,167.35	990,379,740	1,668.00	1,415,131,200	0.73
日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	306,500	4,446.25	1,362,775,625	4,605.00	1,411,432,500	0.73
日本	株式	東海旅客鉄道	陸運業	66,500	18,885.95	1,255,915,675	20,775.00	1,381,537,500	0.72
日本	株式	三菱電機	電気機器	742,200	1,579.37	1,172,208,414	1,852.50	1,374,925,500	0.71
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	276,000	4,889.20	1,349,419,200	4,960.00	1,368,960,000	0.71
日本	株式	日本電産	電気機器	89,300	10,251.65	915,472,345	15,270.00	1,363,611,000	0.71
日本	株式	花王	化学	182,600	5,293.51	966,594,926	7,438.00	1,358,178,800	0.70
日本	株式	ブリヂストン	ゴム製品	262,400	4,363.59	1,145,006,016	5,095.00	1,336,928,000	0.69
日本	株式	ダイキン工業	機械	101,300	10,756.09	1,089,591,917	12,920.00	1,308,796,000	0.68

□ 種類別・業種別の投資比率

2017年11月30日現在

種類	国内 / 外国	業種	投資比率 (%)
株式	国内	水産・農林業	0.10
		鉱業	0.31
		建設業	3.26
		食料品	4.42
		繊維製品	0.68
		パルプ・紙	0.26
		化学	7.17
		医薬品	4.33
		石油・石炭製品	0.62
		ゴム製品	0.95
		ガラス・土石製品	1.00
		鉄鋼	1.15
		非鉄金属	0.96
		金属製品	0.70
		機械	5.39
		電気機器	13.73
		輸送用機器	8.62
		精密機器	1.58
		その他製品	2.12
		電気・ガス業	1.56
陸運業	3.90		

	海運業	0.23
	空運業	0.60
	倉庫・運輸関連業	0.20
	情報・通信業	7.66
	卸売業	4.40
	小売業	4.60
	銀行業	7.17
	証券、商品先物取引業	0.97
	保険業	2.22
	その他金融業	1.20
	不動産業	2.24
	サービス業	4.15
合計		98.45

外国株式インデックス・マザーファンド

イ 主要投資銘柄（上位30銘柄）

2017年11月30日現在

国/ 地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	投資 比率 (%)
アメリカ	株式	APPLE INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	246,626	12,691.90	3,130,153,392	18,990.23	4,683,485,450	2.39
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	347,221	6,882.11	2,389,613,464	9,338.24	3,242,435,462	1.65
アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	小売	19,234	86,669.55	1,667,002,212	130,120.30	2,502,733,918	1.28
アメリカ	株式	FACEBOOK INC-A	ソフトウェア・サービス	111,951	13,710.43	1,534,897,244	19,623.31	2,196,849,905	1.12
アメリカ	株式	JOHNSON & JOHNSON	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	127,528	12,652.68	1,613,571,741	15,665.71	1,997,816,729	1.02
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	168,193	8,979.68	1,510,320,496	11,622.94	1,954,898,241	1.00
アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORPORATION	エネルギー	200,408	9,611.64	1,926,251,353	9,218.35	1,847,431,788	0.94
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	ソフトウェア・サービス	14,783	87,227.56	1,289,485,071	114,477.00	1,692,313,535	0.86
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	ソフトウェア・サービス	14,090	89,480.88	1,260,785,726	116,238.42	1,637,799,465	0.83
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	470,144	2,330.63	1,095,736,412	3,168.77	1,489,780,083	0.76
アメリカ	株式	WELLS FARGO & COMPANY	銀行	224,146	5,874.78	1,316,808,774	6,350.99	1,423,549,901	0.73
スイス	株式	NESTLE SA-REGISTERED	食品・飲料・タバコ	146,927	7,911.18	1,162,366,679	9,669.85	1,420,763,300	0.72
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	各種金融	58,894	17,767.76	1,046,414,958	21,272.69	1,252,833,952	0.64
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	121,080	9,350.57	1,132,167,318	10,015.02	1,212,619,711	0.62

アメリカ	株式	AT&T INC	電気通信サービス	290,049	4,462.95	1,294,474,620	4,087.58	1,185,599,652	0.60
アメリカ	株式	CHEVRON CORPORATION	エネルギー	89,396	12,416.26	1,109,964,024	13,130.01	1,173,771,179	0.60
アメリカ	株式	PFIZER INC	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	282,523	3,582.23	1,012,064,768	4,057.33	1,146,289,185	0.58
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	45,460	17,722.94	805,685,239	24,973.70	1,135,304,584	0.58
アメリカ	株式	HOME DEPOT INC	小売	56,599	14,670.70	830,347,318	19,860.86	1,124,104,957	0.57
アメリカ	株式	INTEL CORP	半導体・半導体製造装置	222,928	3,993.46	890,254,496	4,924.59	1,097,830,671	0.56
アメリカ	株式	CITIGROUP INC	銀行	129,886	6,277.04	815,299,748	8,408.23	1,092,111,622	0.56
アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS INC	電気通信サービス	192,817	5,751.52	1,108,992,085	5,591.29	1,078,096,728	0.55
アメリカ	株式	VISA INC	ソフトウェア・サービス	87,403	8,927.02	780,248,635	12,309.81	1,075,914,586	0.55
イギリス	株式	HSBC HOLDINGS PLC	銀行	945,731	965.11	912,742,579	1,117.25	1,056,620,381	0.54
スイス	株式	NOVARTIS AG-REG SHS	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	105,095	8,018.18	842,671,173	9,527.57	1,001,300,074	0.51
アメリカ	株式	CISCO SYSTEMS INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	236,707	3,346.93	792,242,588	4,199.63	994,082,765	0.51
アメリカ	株式	COCA-COLA CO/THE	食品・飲料・タバコ	192,153	4,610.85	885,990,101	5,098.27	979,648,836	0.50
スイス	株式	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	33,114	25,983.97	860,433,318	28,207.07	934,049,048	0.48
アメリカ	株式	COMCAST CORP-CLASS A	メディア	223,235	3,957.60	883,476,175	4,167.13	930,251,386	0.47
アメリカ	株式	DOWDUPONT INC	素材	110,457	6,243.42	689,630,106	8,042.94	888,400,018	0.45

□ 種別・業種別の投資比率

2017年11月30日現在

種類	国内 / 外国	業種	投資比率 (%)
株式	外国	エネルギー	6.42
		素材	4.86
		資本財	7.25
		商業・専門サービス	0.92
		運輸	1.91
		自動車・自動車部品	1.56
		耐久消費財・アパレル	1.77
		消費者サービス	1.80
		メディア	2.36
		小売	3.84
		食品・生活必需品小売り	1.71

	食品・飲料・タバコ	5.68
	家庭用品・パーソナル用品	1.59
	ヘルスケア機器・サービス	3.91
	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	7.98
	銀行	9.33
	各種金融	4.52
	保険	4.27
	不動産	0.88
	ソフトウェア・サービス	9.80
	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	4.48
	電気通信サービス	2.58
	公益事業	3.24
	半導体・半導体製造装置	2.53
投資証券		2.33
合計		97.52

エマージング株式インデックス・マザーファンド

イ 主要投資銘柄

2017年11月30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	TREASURY BILL	2,000,000	11,145.14	222,902,841	11,157.56	223,151,309	0.000	2018/3/29	5.20

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11月30日現在

種類	投資比率 (%)
国債証券	5.20
合計	5.20

J リート・インデックス・マザーファンド

イ 主要投資銘柄（上位30銘柄）

2017年11月30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	投資証券	日本ビルファンド投資法人	1,217	570,072.23	693,777,914	563,000	685,171,000	7.09
日本	投資証券	ジャパンリアルエステイト投資法人	1,189	556,127.17	661,235,210	546,000	649,194,000	6.72
日本	投資証券	野村不動産マスターファンド投資法人	3,607	148,661.15	536,220,802	141,700	511,111,900	5.29

日本	投資証券	日本リテールファンド投資法人	2,419	202,496.9	489,840,020	199,300	482,106,700	4.99
日本	投資証券	ユナイテッド・アーバン投資法人	2,773	164,741.17	456,827,282	159,300	441,738,900	4.57
日本	投資証券	オリックス不動産投資法人	2,425	162,476.88	394,006,437	157,700	382,422,500	3.96
日本	投資証券	日本プロロジスリート投資法人	1,581	238,461.44	377,007,545	241,100	381,179,100	3.95
日本	投資証券	大和ハウスリート投資法人	1,292	276,057.45	356,666,238	269,400	348,064,800	3.60
日本	投資証券	アドバンス・レジデンス投資法人	1,164	277,923.58	323,503,057	273,700	318,586,800	3.30
日本	投資証券	日本プライムリアルティ投資法人	794	397,289.19	315,447,617	377,500	299,735,000	3.10
日本	投資証券	ジャパン・ホテル・リート投資法人	3,629	76,917.74	279,134,512	78,200	283,787,800	2.94
日本	投資証券	GLP投資法人	2,199	120,604.04	265,208,293	121,500	267,178,500	2.77
日本	投資証券	アクティブ・プロパティーズ投資法人	543	481,321.48	261,357,566	465,500	252,766,500	2.62
日本	投資証券	ケネディクス・オフィス投資法人	367	626,952.03	230,091,396	632,000	231,944,000	2.40
日本	投資証券	フロンティア不動産投資法人	427	468,895.69	200,218,463	457,000	195,139,000	2.02
日本	投資証券	日本アコモデーションファンド投資法人	418	448,896.79	187,638,861	454,000	189,772,000	1.97
日本	投資証券	森ヒルズリート投資法人	1,348	139,562.59	188,130,372	137,600	185,484,800	1.92
日本	投資証券	日本ロジスティクスファンド投資法人	837	225,191.45	188,485,247	207,500	173,677,500	1.80
日本	投資証券	産業ファンド投資法人	342	492,459.77	168,421,243	491,500	168,093,000	1.74
日本	投資証券	インヴィンシブル投資法人	3,441	47,711.14	164,174,034	48,150	165,684,150	1.72
日本	投資証券	ジャパンエクセレント投資法人	1,127	132,807.66	149,674,240	135,000	152,145,000	1.58
日本	投資証券	大和証券オフィス投資法人	271	554,781.38	150,345,755	556,000	150,676,000	1.56
日本	投資証券	森トラスト総合リート投資法人	899	177,312.93	159,404,325	164,000	147,436,000	1.53
日本	投資証券	ヒューリックリート投資法人	856	168,552.18	144,280,671	165,300	141,496,800	1.47
日本	投資証券	イオンリート投資法人	1,194	118,776.13	141,818,710	116,900	139,578,600	1.45
日本	投資証券	プレミア投資法人	1,134	105,480.88	119,615,321	105,600	119,750,400	1.24
日本	投資証券	日本賃貸住宅投資法人	1,412	82,210.66	116,081,454	83,000	117,196,000	1.21
日本	投資証券	東急リアル・エステート投資法人	842	136,364.44	114,818,863	138,900	116,953,800	1.21
日本	投資証券	日本リート投資法人	338	314,201.36	106,200,062	337,000	113,906,000	1.18
日本	投資証券	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	460	237,192.1	109,108,366	240,900	110,814,000	1.15

ロ 種類別の投資比率

2017年11月30日現在

種類	投資比率(%)
投資証券	98.87
合計	98.87

外国リート・インデックス・マザーファンド

イ 主要投資銘柄(上位30銘柄)

2017年11月30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(%)
アメリカ	投資証券	SIMON PROPERTY GROUP INC	9,098	17,578.40	159,928,320	17,785.69	161,814,267	4.12
アメリカ	投資証券	PROLOGIS INC	15,537	6,987.43	108,563,824	7,409.86	115,127,096	2.93
アメリカ	投資証券	PUBLIC STORAGE	4,366	22,998.26	100,410,414	23,559.63	102,861,358	2.62

アメリカ	投資証券	WELLTOWER INC	11,424	7,998.35	91,373,171	7,538.72	86,122,383	2.19
フランス	投資証券	UNIBAIL-RODAMCO SE	2,875	28,162.36	80,966,786	28,872.89	83,009,570	2.11
アメリカ	投資証券	AVALONBAY COMMUNITIES INC	4,003	21,139.35	84,620,830	20,397.58	81,651,521	2.08
アメリカ	投資証券	EQUITY RESIDENTIAL	10,600	7,607.07	80,634,989	7,478.21	79,269,100	2.02
アメリカ	投資証券	DIGITAL REALTY TRUST INC	5,871	13,170.35	77,323,166	13,108.72	76,961,351	1.96
アメリカ	投資証券	VENTAS INC	10,260	7,567.85	77,646,212	7,179.04	73,656,986	1.88
香港	投資証券	LINK REIT	67,100	911.35	61,151,617	1,009.52	67,738,960	1.72
アメリカ	投資証券	BOSTON PROPERTIES INC	4,455	13,453.84	59,936,873	14,011.85	62,422,803	1.59
アメリカ	投資証券	ESSEX PROPERTY TRUST INC	2,039	29,803.21	60,768,747	27,752.54	56,587,437	1.44
オーストラリア	投資証券	SCENTRE GROUP	151,413	333.53	50,502,156	359.00	54,357,282	1.38
アメリカ	投資証券	REALTY INCOME CORPORATION	8,384	6,442.87	54,017,064	6,215.41	52,110,027	1.33
アメリカ	投資証券	GGP INC	19,576	2,340.42	45,816,125	2,621.97	51,327,685	1.31
アメリカ	投資証券	HOST HOTELS AND RESORTS INC	20,883	2,018.02	42,142,322	2,204.02	46,026,623	1.17
アメリカ	投資証券	VORNADO REALTY TRUST	4,848	8,349.96	40,480,636	8,620.00	41,789,792	1.06
アメリカ	投資証券	MID-AMERICA APARTMENT COMMUNITIES	3,508	12,042.01	42,243,384	11,457.11	40,191,551	1.02
アメリカ	投資証券	HCP, INC.	13,118	3,222.55	42,273,516	3,014.14	39,539,554	1.01
オーストラリア	投資証券	WESTFIELD CORP	54,869	635.67	34,878,923	709.51	38,930,280	0.99
アメリカ	投資証券	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITIES, INC.	2,611	13,551.32	35,382,515	14,226.98	37,146,667	0.95
アメリカ	投資証券	SL GREEN REALTY CORP	3,206	10,880.05	34,881,456	11,454.87	36,724,318	0.94
アメリカ	投資証券	UDR INC	8,312	4,385.63	36,453,415	4,410.28	36,658,314	0.93
アメリカ	投資証券	EXTRA SPACE STORAGE INC	3,814	8,687.23	33,133,120	9,530.97	36,351,131	0.93
オーストラリア	投資証券	GOODMAN GROUP	48,256	706.11	34,074,449	739.21	35,671,689	0.91
アメリカ	投資証券	REGENCY CENTERS CORP	4,651	7,312.38	34,009,893	7,619.39	35,437,829	0.90
アメリカ	投資証券	DUKE REALTY CORP	10,915	3,286.42	35,871,345	3,210.23	35,039,688	0.89
アメリカ	投資証券	FEDERAL REALTY INVESTMENT TRUST	2,252	14,214.66	32,011,421	14,801.80	33,333,665	0.85
アメリカ	投資証券	IRON MOUNTAIN INC	7,300	4,324.00	31,565,270	4,540.26	33,143,942	0.84
イギリス	投資証券	LAND SECURITIES GROUP PLC	23,462	1,510.81	35,446,777	1,398.06	32,801,495	0.84

ロ 種類別の投資比率

2017年11月30日現在

種類	投資比率(%)
投資証券	98.41
合計	98.41

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11月30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	103.16	3,177,605,200	1.000	2020/9/20	1.44

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	104.98	2,939,608,000	0.800	2023/6/20	1.33
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	100.81	2,626,308,900	0.100	2021/6/20	1.19
日本	国債証券	第131回利付国債(5年)	2,450,000,000	101.06	2,475,970,000	100.97	2,473,765,000	0.100	2022/3/20	1.12
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	100.92	2,372,699,730	0.100	2026/9/20	1.07
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	100.78	2,318,124,000	0.100	2027/3/20	1.05
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	104.06	2,232,172,800	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	104.72	2,204,461,250	1.300	2021/3/20	1.00
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	100.61	2,153,096,800	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	100.85	2,136,172,440	0.100	2026/12/20	0.97
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	100.98	1,999,463,400	0.100	2026/6/20	0.91
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	103.40	1,897,500,100	0.400	2025/6/20	0.86
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	104.71	1,884,852,000	1.200	2021/6/20	0.85
日本	国債証券	第340回利付国債(10年)	1,790,000,000	103.38	1,850,569,000	103.44	1,851,576,000	0.400	2025/9/20	0.84
日本	国債証券	第342回利付国債(10年)	1,810,000,000	100.74	1,823,457,800	101.03	1,828,787,800	0.100	2026/3/20	0.83
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	100.93	1,816,812,000	0.100	2021/12/20	0.82
日本	国債証券	第333回利付国債(10年)	1,635,000,000	104.61	1,710,373,500	104.29	1,705,288,650	0.600	2024/3/20	0.77
日本	国債証券	第341回利付国債(10年)	1,627,000,000	102.53	1,668,312,400	102.66	1,670,278,200	0.300	2025/12/20	0.76
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	100.87	1,624,119,700	0.100	2021/9/20	0.74
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	109.15	1,588,161,600	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	103.04	1,545,705,000	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	100.68	1,530,442,400	0.100	2020/9/20	0.69
日本	国債証券	第335回利付国債(10年)	1,450,000,000	103.95	1,507,382,000	103.92	1,506,927,000	0.500	2024/9/20	0.68
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	103.40	1,504,557,300	0.400	2025/3/20	0.68
日本	国債証券	第348回利付国債(10年)	1,465,000,000	100.55	1,473,125,500	100.68	1,475,005,950	0.100	2027/9/20	0.67
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	100.76	1,440,882,300	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	104.38	1,424,868,900	0.800	2022/9/20	0.65
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	105.18	1,404,206,400	0.800	2023/9/20	0.64
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	112.63	1,329,081,200	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	104.43	1,321,128,050	0.600	2024/6/20	0.60

□ 種類別の投資比率

2017年11月30日現在

種類	投資比率（％）
国債証券	74.73
地方債証券	8.77
特殊債券	11.97
社債券	3.96
合計	99.43

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11月30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	11,136.11	890,889,034	11,283.78	902,702,812	2.375	2024/8/15	0.46
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.125	7,900,000	11,136.31	879,768,755	11,106.95	877,449,544	2.125	2024/9/30	0.45
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.25	7,500,000	10,959.14	821,936,052	11,142.84	835,713,549	2.250	2025/11/15	0.42
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.5	7,000,000	11,264.97	788,548,514	11,374.82	796,237,805	2.500	2024/5/15	0.40
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.25	7,000,000	11,107.42	777,519,432	11,081.56	775,709,898	2.250	2027/2/15	0.39
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 3.625	6,000,000	12,159.17	729,550,547	12,911.13	774,668,183	3.625	2043/8/15	0.39
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 3	5,000,000	15,480.54	774,027,305	15,215.90	760,795,445	3.000	2022/4/25	0.39
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 4.5	3,500,000	20,921.55	732,254,575	21,522.12	753,274,414	4.500	2041/4/25	0.38
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 4.25	4,500,000	17,015.44	765,694,805	16,680.93	750,642,120	4.250	2023/10/25	0.38
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 1.625	7,000,000	10,319.02	722,331,588	10,582.59	740,781,812	1.625	2026/5/15	0.38
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 1.5	7,000,000	10,203.27	714,229,110	10,448.66	731,406,375	1.500	2026/8/15	0.37
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.25	6,600,000	11,179.72	737,861,575	11,067.56	730,459,206	2.250	2027/8/15	0.37
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 2.75	4,500,000	15,898.89	715,450,125	16,052.21	722,349,605	2.750	2027/10/25	0.37
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 3.75	5,000,000	14,931.16	746,558,213	14,406.43	720,321,597	3.750	2019/10/25	0.37
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.75	6,200,000	11,444.85	709,581,135	11,556.03	716,473,964	2.750	2023/11/15	0.36
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 3.75	4,700,000	15,626.54	734,447,800	15,192.00	714,024,145	3.750	2021/4/25	0.36
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.25	6,300,000	11,042.52	695,679,232	11,191.86	705,087,758	2.250	2024/11/15	0.36
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 3.625	6,000,000	11,887.80	713,268,281	11,651.44	699,086,953	3.625	2020/2/15	0.36
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2	6,300,000	10,784.81	679,443,188	10,993.15	692,568,794	2.000	2025/2/15	0.35
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2	6,300,000	10,729.90	675,984,204	10,956.38	690,252,511	2.000	2025/8/15	0.35
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 5.75	3,100,000	21,961.11	680,794,685	22,052.83	683,637,881	5.750	2032/10/25	0.35
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2	6,200,000	10,729.90	665,254,296	10,869.72	673,922,977	2.000	2026/11/15	0.34
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 3.5	4,000,000	16,675.45	667,018,304	16,796.74	671,869,853	3.500	2026/4/25	0.34
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.375	6,000,000	11,318.95	679,137,291	11,193.61	671,617,199	2.375	2027/5/15	0.34

アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.125	6,000,000	10,892.38	653,542,830	11,075.44	664,526,531	2.125	2025/5/15	0.34
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 3.25	4,300,000	15,519.06	667,319,782	15,170.48	652,330,978	3.250	2021/10/25	0.33
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 4.75	3,100,000	20,797.24	644,714,723	20,874.27	647,102,647	4.750	2035/4/25	0.33
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 3.625	5,000,000	12,341.77	617,088,763	12,930.39	646,519,749	3.625	2044/2/15	0.33
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 3.125	5,400,000	11,192.67	604,404,423	11,883.42	641,705,100	3.125	2044/8/15	0.33
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 1.625	6,000,000	10,364.62	621,877,500	10,606.23	636,373,969	1.625	2026/2/15	0.32

ロ 種類別の投資比率

2017年11月30日現在

種類	投資比率（％）
国債証券	98.99
合計	98.99

ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド

イ 主要投資銘柄（上位30銘柄）

2017年11月30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 2.25	2,500,000	11,314.42	282,860,596	11,142.84	278,571,182	2.250	2025/11/15	0.48
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 3	1,700,000	15,294.53	260,007,051	15,215.90	258,670,451	3.000	2022/4/25	0.45
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2	2,300,000	11,032.54	253,748,606	10,869.72	250,003,684	2.000	2026/11/15	0.43
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.25	2,200,000	11,260.14	247,723,292	11,081.56	243,794,539	2.250	2027/2/15	0.42
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 3.25	1,600,000	15,270.62	244,330,026	15,170.48	242,727,806	3.250	2021/10/25	0.42
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 3.5	1,400,000	16,692.22	233,691,147	16,796.74	235,154,448	3.500	2026/4/25	0.41
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 4.25	1,400,000	16,749.06	234,486,945	16,680.93	233,533,104	4.250	2023/10/25	0.40
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 3.625	2,000,000	11,812.52	236,250,421	11,651.44	233,028,984	3.625	2020/2/15	0.40
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2	2,100,000	11,120.08	233,521,829	10,956.38	230,084,170	2.000	2025/8/15	0.40
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 1.5	2,200,000	10,594.85	233,086,761	10,448.66	229,870,575	1.500	2026/8/15	0.40
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 3.125	1,900,000	12,015.61	228,296,622	11,883.42	225,785,128	3.125	2044/8/15	0.39
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.375	2,000,000	11,469.36	229,387,359	11,283.78	225,675,703	2.375	2024/8/15	0.39
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 5.75	1,000,000	21,925.73	219,257,357	22,052.83	220,528,349	5.750	2032/10/25	0.38
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.75	1,900,000	11,746.86	223,190,470	11,556.03	219,564,601	2.750	2023/11/15	0.38
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 4.5	1,000,000	21,219.05	212,190,537	21,522.12	215,221,261	4.500	2041/4/25	0.37
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.125	1,900,000	11,235.63	213,477,136	11,075.44	210,433,402	2.125	2025/5/15	0.36
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.625	1,800,000	11,589.29	208,607,338	11,450.10	206,101,969	2.625	2020/11/15	0.36
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 1.5	1,800,000	11,238.26	202,288,768	11,164.73	200,965,177	1.500	2019/5/31	0.35

アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 1.75	1,800,000	11,120.08	200,161,568	10,973.02	197,514,387	1.750	2023/5/15	0.34
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 2.25	1,300,000	15,168.62	197,192,171	15,180.71	197,349,285	2.250	2024/5/25	0.34
ドイツ	国債証券	DEUTSCHLAND REP 2.5	1,100,000	17,639.61	194,035,808	17,637.16	194,008,848	2.500	2046/8/15	0.34
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 3.625	1,500,000	13,092.34	196,385,133	12,930.39	193,955,925	3.625	2044/2/15	0.33
イタリア	国債証券	BTPS 6	1,000,000	18,646.65	186,466,568	19,209.50	192,095,056	6.000	2031/5/1	0.33
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 1.625	1,800,000	10,756.80	193,622,400	10,606.23	190,912,191	1.625	2026/2/15	0.33
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 1.625	1,800,000	10,734.03	193,212,717	10,582.59	190,486,751	1.625	2026/5/15	0.33
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 1.75	1,300,000	14,641.37	190,337,847	14,631.41	190,208,357	1.750	2023/5/25	0.33
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 1.5	1,700,000	11,222.50	190,782,633	11,113.08	188,922,428	1.500	2020/5/31	0.33
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.25	1,700,000	11,198.66	190,377,320	11,067.56	188,148,581	2.250	2027/8/15	0.32
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 4.75	900,000	20,672.80	186,055,255	20,874.27	187,868,510	4.750	2035/4/25	0.32
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 1.375	1,700,000	11,108.70	188,848,019	10,993.15	186,883,642	1.375	2021/4/30	0.32

□ 種類別の投資比率

2017年11月30日現在

種類	投資比率(%)
国債証券	97.99
合計	97.99

投資不動産物件

国内株式インデックス・マザーファンド(B号)

該当事項はありません。

外国株式インデックス・マザーファンド

該当事項はありません。

エマージング株式インデックス・マザーファンド

該当事項はありません。

Jリート・インデックス・マザーファンド

該当事項はありません。

外国リート・インデックス・マザーファンド

該当事項はありません。

国内債券パッシブ・マザーファンド

該当事項はありません。

外国債券パッシブ・マザーファンド

該当事項はありません。

ヘッジ付き外国債券パッシブ・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

国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

2017年11月30日現在

種類	取引所等	名称	買建/ 売建	数量	通貨	簿価 （円）	時価 （円）	投資 比率 （%）
株価指数先物取引	大阪取引所	東証株価指数先物	買建	156	日本円	2,781,496,960	2,803,320,000	1.45

（注）主たる取引所の発表する清算値段または最終相場で評価しております。

外国株式インデックス・マザーファンド

2017年11月30日現在

種類	地域	取引所等	名称	買建/ 売建	数量	通貨	帳簿価額	簿価 （円）	評価額	時価 （円）	投資 比率 （%）
株価指数先物取引	アメリカ	シカゴ商業取引所	SPMINI 1712	買建	227	米ドル	29,276,018.5	3,280,377,873	29,794,885	3,338,516,864	1.70
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	DJ EUR 1712	買建	193	ユーロ	7,099,976	942,947,812	6,922,910	919,431,677	0.46
	オーストラリア	シドニー先物取引所	SPI200 1712	買建	18	オーストラリアドル	2,674,806	227,010,785	2,708,550	229,874,638	0.11
	イギリス	ロンドン国際金融先物オプション取引所	FTSE 1712	買建	31	英ポンド	2,310,887	347,395,642	2,291,830	344,530,803	0.17

（注）主たる取引所の発表する清算値段または最終相場で評価しております。

2017年11月30日現在

種類	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価 （円）	時価 （円）	投資 比率 （%）
為替予約取引	米ドル	買建	1,500,000.00	167,400,000	168,060,000	0.08
	カナダドル	買建	40,000.00	3,482,000	3,483,600	0.00
	ユーロ	買建	240,000.00	31,740,000	31,874,400	0.01
	英ポンド	買建	100,000.00	14,916,000	15,032,000	0.00
	スイスフラン	買建	30,000.00	3,401,400	3,414,900	0.00
	スウェーデンクローナ	買建	100,000.00	1,337,000	1,338,000	0.00
	ノルウェークローネ	買建	10,000.00	135,600	135,700	0.00
	デンマーククローネ	買建	30,000.00	533,100	535,200	0.00
	香港ドル	買建	50,000.00	715,000	717,000	0.00

	シンガポールドル	買建	10,000.00	829,200	831,800	0.00
--	----------	----	-----------	---------	---------	------

(注) 日本における対顧客先物相場の仲値で評価しております。

エマージング株式インデックス・マザーファンド

2017年11月30日現在

種類	地域	取引所等	名称	買建/ 売建	数量	通貨	帳簿価額	簿価 (円)	評価額	時価 (円)	投資 比率 (%)
株価指 数先物 取引	アメリ カ	インターコ ンチネンタ ル取引所	MSCIE 1712	買建	678	米ドル	37,593,013	4,212,297,107	38,374,800	4,299,896,340	100.19

(注) 主たる取引所の発表する清算値段または最終相場で評価しております。

2017年11月30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	31,174,179.06	3,386,000,000	3,490,261,084	81.33
	米ドル	売建	1,032,559.28	115,000,000	115,605,335	2.69

(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。

Jリート・インデックス・マザーファンド

該当事項はありません。

外国リート・インデックス・マザーファンド

2017年11月30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	103,980.72	11,650,000	11,647,920	0.29
	カナダドル	買建	3,444.55	300,000	299,951	0.00
	ユーロ	買建	9,790.63	1,300,000	1,300,293	0.03
	英ポンド	買建	5,656.86	850,000	850,282	0.02
	オーストラリアドル	買建	15,324.77	1,300,000	1,300,153	0.03
	香港ドル	買建	27,874.56	400,000	399,721	0.01
	シンガポールドル	買建	6,612.96	550,000	549,999	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。

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。

ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド

2017年11月30日現在

種類	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	米ドル	売建	219,400,000.00	24,956,664,434	24,572,800,000	42.44
	カナダドル	売建	13,900,000.00	1,225,484,882	1,210,273,000	2.09
	メキシコペソ	売建	83,400,000.00	492,182,931	501,234,000	0.86
	ユーロ	売建	177,700,000.00	23,551,174,518	23,602,114,000	40.76
	英ポンド	売建	26,500,000.00	4,004,631,770	3,982,950,000	6.87
	スイスフラン	売建	1,000,000.00	114,043,800	113,850,000	0.19
	スウェーデンクローナ	売建	20,400,000.00	277,281,084	272,952,000	0.47
	ノルウェークローネ	売建	12,500,000.00	174,031,875	169,625,000	0.29
	デンマーククローネ	売建	21,100,000.00	375,943,764	376,424,000	0.65
	ポーランドズロチ	売建	11,300,000.00	352,639,439	356,854,000	0.61
	オーストラリアドル	売建	14,200,000.00	1,235,788,654	1,204,444,000	2.08
	シンガポールドル	売建	5,800,000.00	483,864,420	482,270,000	0.83
	南アフリカランド	売建	36,700,000.00	293,548,620	300,206,000	0.51

(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11月30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

■アセットアロケーション・ファンド(安定型)



※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 4月	0円
2016年 4月	0円
設定来累計	0円

※分配金は1万口当たり、税引前です。

■アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)



※基準価額は、1万口当たり、信託報酬控除後です。

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

※分配金は1万口当たり、税引前です。

■アセットアロケーション・ファンド(成長型)



※基準価額は、1万口当たり、信託報酬控除後です。

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

※分配金は1万口当たり、税引前です。

主要な資産の状況

▶ 投資対象とする投資信託の現況

■ 国内債券パッシブ・マザーファンド

主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	利率(%)	償還期限	比率(%)
日本	国債証券	第310回利付国債(10年)	1.000	2020/09/20	1.44
日本	国債証券	第329回利付国債(10年)	0.800	2023/06/20	1.33
日本	国債証券	第128回利付国債(5年)	0.100	2021/06/20	1.19
日本	国債証券	第131回利付国債(5年)	0.100	2022/03/20	1.12
日本	国債証券	第344回利付国債(10年)	0.100	2026/09/20	1.07
日本	国債証券	第346回利付国債(10年)	0.100	2027/03/20	1.05
日本	国債証券	第312回利付国債(10年)	1.200	2020/12/20	1.01
日本	国債証券	第313回利付国債(10年)	1.300	2021/03/20	1.00
日本	国債証券	第124回利付国債(5年)	0.100	2020/06/20	0.97
日本	国債証券	第345回利付国債(10年)	0.100	2026/12/20	0.97

■ 外国債券パッシブ・マザーファンド

主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	利率(%)	償還期限	比率(%)
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.375	2.375	2024/08/15	0.46
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.125	2.125	2024/09/30	0.45
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.25	2.250	2025/11/15	0.42
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.5	2.500	2024/05/15	0.40
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.25	2.250	2027/02/15	0.39
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 3.625	3.625	2043/08/15	0.39
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 3	3.000	2022/04/25	0.39
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 4.5	4.500	2041/04/25	0.38
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 4.25	4.250	2023/10/25	0.38
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 1.625	1.625	2026/05/15	0.38

■ ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド

主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	利率(%)	償還期限	比率(%)
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.25	2.250	2025/11/15	0.48
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 3	3.000	2022/04/25	0.45
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2	2.000	2026/11/15	0.43
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.25	2.250	2027/02/15	0.42
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 3.25	3.250	2021/10/25	0.42
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 3.5	3.500	2026/04/25	0.41
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 4.25	4.250	2023/10/25	0.40
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 3.625	3.625	2020/02/15	0.40
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2	2.000	2025/08/15	0.40
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 1.5	1.500	2026/08/15	0.40

※比率は、各マザーファンドのそれぞれの純資産総額に対する時価の比率です。

■バンガード・米ドル建て新興国政府債券ETF

主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	利率(%)	償還期限	比率(%)
ロシア	国債証券	Russian Federation 7.5 03/31/2030	7.500	2030/03/31	0.58
オランダ	政府機関債	Petrobras Global Finance BV 8.375 05/23/2021	8.375	2021/05/23	0.54
アルゼンチン	国債証券	Argentine Republic 7.5 04/22/2026	7.500	2026/04/22	0.46
サウジアラビア	国債証券	Kingdom of Saudi Arabia 4.5 10/26/2046	4.500	2046/10/26	0.46
オランダ	政府機関債	Petrobras Global Finance BV 5.999 01/27/2028	5.999	2028/01/27	0.43
ロシア	国債証券	Russian Federation 5.625 04/04/2042	5.625	2042/04/4	0.43
ロシア	国債証券	Russian Federation 4.875 09/16/2023	4.875	2023/09/16	0.40
アルゼンチン	国債証券	Argentine Republic 7.625 04/22/2046	7.625	2046/04/22	0.39
コロンビア	国債証券	Republic of Colombia 5.0 06/15/2045	5.000	2045/06/15	0.39
オランダ	政府機関債	Petrobras Global Finance BV 8.75 05/23/2026	8.750	2026/05/23	0.38

※比率は、当該投資信託証券の純資産総額に対する時価の比率です。

※「バンガード・米ドル建て新興国政府債券ETF」の公開情報を基に三井住友アセットマネジメント作成

※国・地域は発行国基準です。

※Petrobras Global Finance BVはブラジルの国営石油会社です(ブラジル石油公社とも表記されます)。

■シェアーズ J.P.モルガン・米ドル建てエマージング・マーケット債券ETF

主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	利率(%)	償還期限	比率(%)
ウルグアイ	国債証券	URUGUAY (ORIENTAL REPUBLIC OF) 5.1%6/18/2050	5.100	2050/06/18	1.00
ロシア連邦	国債証券	RUSSIAN (FEDERATION OF) Reg 5.75%3/31/2030	7.500	2030/03/31	0.84
ペルー	国債証券	PERU (REPUBLIC OF) 8.75%11/21/2033	8.750	2033/11/21	0.80
ポーランド	国債証券	POLAND (REPUBLIC OF) 5%3/23/2022	5.000	2022/03/23	0.78
ペルー	国債証券	PERU (REPUBLIC OF) 5.63%11/18/2050	5.630	2050/11/18	0.74
ハンガリー	国債証券	HUNGARY (REPUBLIC OF) 6.38%3/29/2021	6.380	2021/03/29	0.72
アルゼンチン	国債証券	ARGENTINA REPUBLIC OF GOVERNMENT MTN 7.5%4/22/2026	7.500	2026/04/22	0.71
エジプト	国債証券	EGYPT (ARAB REPUBLIC OF) MTN Reg 8.5%1/31/2047	8.500	2047/01/31	0.71
バーミンガム(英債)	政府機関債	1MDB GLOBAL INVESTMENTS LTD Reg 5.4%3/9/2023	4.400	2023/03/09	0.70
パナマ	国債証券	PANAMA (REPUBLIC OF) 6.7%1/26/2036	6.700	2036/01/26	0.66

※比率は、当該投資信託証券の純資産総額に対する時価の比率です。

※「シェアーズ J.P.モルガン・米ドル建てエマージング・マーケット債券ETF」の公開情報を基に三井住友アセットマネジメント作成

※国・地域は発行国基準です。

■SPDR ブルームバーグ・パークレイズ・ハイ・イールド債券ETF

主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	利率(%)	償還期限	比率(%)
フランス	社債券	SFR GROUP SA 7.375 05/01/2026	7.375	2026/05/01	0.63
アメリカ	社債券	SPRINT CORP 7.875 09/15/2023	7.875	2023/09/15	0.56
フランス	社債券	SFR GROUP SA 6 05/15/2022	6.000	2022/05/15	0.50
アメリカ	社債券	WESTERN DIGITAL CORP 10.5 04/01/2024	10.500	2024/04/01	0.45
アメリカ	社債券	FIRST DATA CORPORATION 7 12/01/2023	7.000	2023/12/01	0.44
アメリカ	社債券	PRIME SECSRVC BRW/FINANC 9.25 05/15/2023	9.250	2023/05/15	0.41
アメリカ	社債券	CCO HLDGS LLC/CAP CORP 5.125 05/01/2027	5.125	2027/05/01	0.36
アメリカ	社債券	TENET HEALTHCARE CORP 8.125 04/01/2022	8.125	2022/04/01	0.36
アメリカ	社債券	CHS/COMMUNITY HEALTH SYS IN 6.25 03/31/2023	6.250	2023/03/31	0.35
アメリカ	社債券	ALTICE LUXEMBOURG SA 7.75 05/15/2022	7.750	2022/05/01	0.35

※比率は、当該投資信託証券の純資産総額に対する時価の比率です。

※「SPDR ブルームバーグ・パークレイズ・ハイ・イールド債券ETF」の公開情報を基に三井住友アセットマネジメント作成

※国・地域は発行国基準です。

■国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

主要投資銘柄（上位10銘柄）

国・地域	種類	銘柄名	業種	比率(%)
日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	3.29
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	2.12
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	1.62
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	1.59
日本	株式	ソニー	電気機器	1.34
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	1.31
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	1.30
日本	株式	キーエンス	電気機器	1.22
日本	株式	KDDI	情報・通信業	1.09
日本	株式	任天堂	その他製品	1.07

※上記のほか、国内株式インデックス・マザーファンド(B号)において、株価指数先物取引の買建て(1.45%)を行っています。

■外国株式インデックス・マザーファンド

主要投資銘柄（上位10銘柄）

国・地域	種類	銘柄名	業種	比率(%)
アメリカ	株式	APPLE INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	2.39
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	1.65
アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	小売	1.28
アメリカ	株式	FACEBOOK INC-A	ソフトウェア・サービス	1.12
アメリカ	株式	JOHNSON & JOHNSON	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	1.02
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	1.00
アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORPORATION	エネルギー	0.94
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	ソフトウェア・サービス	0.86
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	ソフトウェア・サービス	0.83
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	0.76

※上記のほか、外国株式インデックス・マザーファンドにおいて、株価指数先物取引の買建て(2.44%)を行っています。

■エマージング株式インデックス・マザーファンド

主要投資銘柄（上位10銘柄）

国・地域	種類	銘柄名	利率(%)	償還期限	比率(%)
アメリカ	国債証券	TREASURY BILL	0.000	2018/03/29	5.20

※上記のほか、エマージング株式インデックス・マザーファンドにおいて、株価指数先物取引の買建て(100.19%)を行っています。

※比率は、各マザーファンドのそれぞれの純資産総額に対する時価の比率です。

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

■Jリート・インデックス・マザーファンド

主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	比率(%)
日本	投資証券	日本ビルファンド投資法人	7.09
日本	投資証券	ジャパンリアルエステイト投資法人	6.72
日本	投資証券	野村不動産マスターファンド投資法人	5.29
日本	投資証券	日本リテールファンド投資法人	4.99
日本	投資証券	ユナイテッド・アーバン投資法人	4.57
日本	投資証券	オリックス不動産投資法人	3.96
日本	投資証券	日本プロロジスリート投資法人	3.95
日本	投資証券	大和ハウスリート投資法人	3.60
日本	投資証券	アドバンス・レジデンス投資法人	3.30
日本	投資証券	日本プライムリアルティ投資法人	3.10

■外国リート・インデックス・マザーファンド

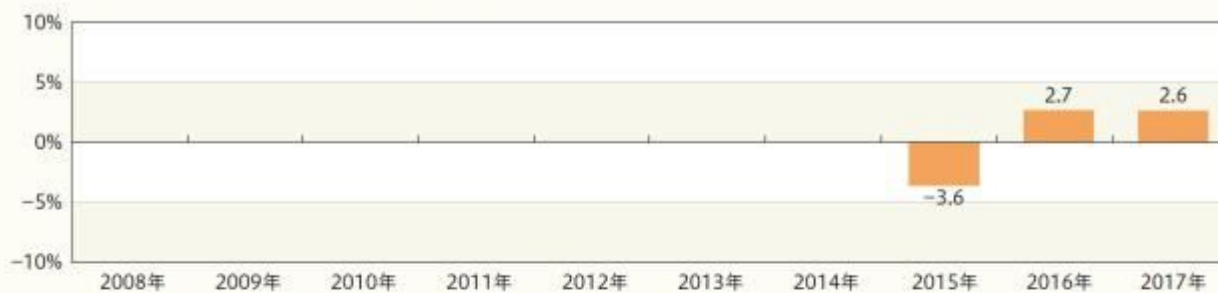
主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	比率(%)
アメリカ	投資証券	SIMON PROPERTY GROUP INC	4.12
アメリカ	投資証券	PROLOGIS INC	2.93
アメリカ	投資証券	PUBLIC STORAGE	2.62
アメリカ	投資証券	WELLTOWER INC	2.19
フランス	投資証券	UNIBAIL-RODAMCO SE	2.11
アメリカ	投資証券	AVALONBAY COMMUNITIES INC	2.08
アメリカ	投資証券	EQUITY RESIDENTIAL	2.02
アメリカ	投資証券	DIGITAL REALTY TRUST INC	1.96
アメリカ	投資証券	VENTAS INC	1.88
香港	投資証券	LINK REIT	1.72

※比率は、各マザーファンドのそれぞれの純資産総額に対する時価の比率です。

年間収益率の推移(暦年ベース)

■アセットアロケーション・ファンド(安定型)



■アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)



■アセットアロケーション・ファンド(成長型)



※ファンド購入時には、購入時手数料がかかる場合があります。また、換金時にも費用・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。

※2015年のファンドの収益率は、ファンドの設定日(2015年4月17日)から年末までの騰落率を表示しています。

※2017年のファンドの収益率は、年初から2017年11月30日までの騰落率を表示しています。

※ファンドにはベンチマークはありません。

第2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

イ 申込方法

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

当ファンドには、「分配金受取りコース」と「分配金自動再投資コース」の2つの申込方法がありますが、販売会社によってはいずれか一方のみの取扱いとなる場合があります。

販売会社によっては、「スイッチング」（ある投資信託の換金による手取額をもって、他の投資信託を買い付けること）による当ファンドの取得申込みを取り扱う場合があります。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。

- (八) 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。

- (二) 申込不可日

上記にかかわらず、取得申込日がニューヨークの取引所または銀行の休業日のいずれかに当たる場合には、当ファンドの取得申込みはできません（また、該当日には、解約請求のお申込みもできません。）。

- 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

原則として、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）に、1.08%（税抜き1.0%）を上限として、販売会社がそれぞれ別に定める申込手数料率を乗じて得た額となります。

累積投資契約に基づく収益分配金の再投資の場合は無手数料となります。

申込手数料に関する詳細は、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。

- 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

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

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

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

- ヘ 申込取扱場所・払込取扱場所

販売会社において申込み・払込みを取り扱います。

- ト 払込期日

取得申込者は、申込金額（取得申込受付日の翌営業日の基準価額×申込口数）に申込手数料および当該手数料にかかる消費税等相当額を加算した額を、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。

ただし、ニューヨークの取引所または銀行の休業日のいずれかに当たる場合には、解約請求の受け付けは行いません。

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6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、「安定型」は「らっぷ安定」、「安定成長型」は「らっぷ安成」、「成長型」は「らっぷ成長」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】

2015年4月17日から2028年4月26日まで、もしくは下記「(5)その他イ 信託の終了」に記載された各事由が生じた場合における信託終了の日までとなります。

(4)【計算期間】

毎年4月27日から翌年4月26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、各ファンドにつき残存口数が10億口を下回ることとなったとき、その他やむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意の上、当ファンドの信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。
- b. 委託会社は、上記aの事項について、書面による決議(以下「書面決議」といいます。)を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに信託契約の解約の理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、当ファンドの知っている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。
- c. 書面決議において、受益者(委託会社等を除きます。)は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行行使することができます。なお、知っている受益者が議決権を行行使しないときは、当該知っている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
- d. 書面決議は議決権を行行使することができる受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います。
- e. 上記b～dまでの取扱いは、委託会社が信託契約の解約について提案をした場合において、当該提案につき、当ファンドのすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。また、信託財産の状況に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、上記b～dまでの取扱いを行うことが困難な場合も同様とします。

(ロ) 信託契約に関する監督官庁の命令

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

(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て）に支払われます。

ただし、分配金自動再投資コースにかかる収益分配金は、原則として、税金を差し引いた後、累積投資契約に基づいて、毎計算期間終了日の翌営業日に無手数料で再投資され、再投資により増加した受益権は、振替口座簿に記載または記録されます。

(ロ) 償還金

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

八 信託約款の変更等

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

二 反対受益者の受益権買取請求の不適用

当ファンドは、受益者が一部解約の実行の請求を行ったときは、委託会社が信託契約の一部解約

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

ホ 販売会社との契約の更改等

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

ヘ 委託会社の事業の譲渡および承継に伴う取扱い

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

ト 公告

委託会社が受益者に対してする公告は、日本経済新聞に掲載します。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てします。)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無手数料で再投資され、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)

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

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

ハ 一部解約実行請求権

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

ニ 書面決議における議決権

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

ホ 帳簿閲覧・謄写請求権

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

第3【ファンドの経理状況】

- 1 . 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）ならびに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づいて作成しております。
なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
- 2 . 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第2期（平成28年 4月27日から平成29年 4月26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】

【アセットアロケーション・ファンド（安定型）】

（１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第1期 （平成28年 4月26日現在）	第2期 （平成29年 4月26日現在）
資産の部		
流動資産		
預金	4,266,067	898,961
金銭信託	239,336,382	457,066,030
コール・ローン	50,219,046	950,988,014
投資信託受益証券	997,238,469	7,765,746,256
親投資信託受益証券	12,211,292,294	39,631,886,119
派生商品評価勘定	-	10,430,730
未収入金	13,631,603	946,607,084
流動資産合計	13,515,983,861	49,763,623,194
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	8,280,157	4,054,641
未払金	89,211,251	546,000,000
未払解約金	9,983,330	454,404,320
未払受託者報酬	1,580,551	6,593,091
未払委託者報酬	47,943,142	199,292,372
未払利息	147	2,758
その他未払費用	319,816	1,338,285
流動負債合計	157,318,394	1,211,685,467
負債合計	157,318,394	1,211,685,467
純資産の部		
元本等		
元本	14,040,607,518	48,593,117,939
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	681,942,051	41,180,212
元本等合計	13,358,665,467	48,551,937,727
純資産合計	13,358,665,467	48,551,937,727
負債純資産合計	13,515,983,861	49,763,623,194

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第1期		第2期	
	自	平成27年 4月17日 至 平成28年 4月26日	自	平成28年 4月27日 至 平成29年 4月26日
営業収益				
受取配当金		33,122,949		302,735,983
受取利息		9,890		-
有価証券売買等損益		141,381,347		1,541,854,874
為替差損益		25,665,286		3,940,173
営業収益合計		133,913,794		1,848,531,030
営業費用				
支払利息		1,265		479,933
受託者報酬		2,128,351		9,736,311
委託者報酬		64,559,632		294,636,585
その他費用		718,593		3,135,127
営業費用合計		67,407,841		307,987,956
営業利益又は営業損失（ ）		201,321,635		1,540,543,074
経常利益又は経常損失（ ）		201,321,635		1,540,543,074
当期純利益又は当期純損失（ ）		201,321,635		1,540,543,074
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（ ）		10,767,186		97,661,177
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		-		681,942,051
剰余金増加額又は欠損金減少額		11,626,018		173,657,907
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		11,626,018		173,657,907
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		-		-
剰余金減少額又は欠損金増加額		503,013,620		975,777,965
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		-		-
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		503,013,620		975,777,965
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		681,942,051		41,180,212

（ 3 ）【注記表】

（ 重要な会計方針の注記 ）

項 目	第2期	
	自 平成28年 4月27日 至 平成29年 4月26日	
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	投資信託受益証券、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。 (1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。 (2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。 (3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。	
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。	
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金の計上基準 受取配当金は原則として、配当落ち日において、確定配当金額または予想配当金額を計上しております。なお、配当金額が未確定の場合は、入金日基準で計上しております。	
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建資産等の会計処理 「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。	

（ 貸借対照表に関する注記 ）

項 目	第1期		第2期	
	（平成28年 4月26日現在）		（平成29年 4月26日現在）	
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	14,040,607,518口		48,593,117,939口	
2. 「投資信託財産の計算に関する規則」第55条の6第10号に規定する額	元本の欠損	681,942,051円	元本の欠損	41,180,212円
3. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額	0.9514円	1口当たり純資産額	0.9992円
	(10,000口当たりの純資産額)	9,514円	(10,000口当たりの純資産額)	9,992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27年 4月17日 至 平成28年 4月26日	自 平成28年 4月27日 至 平成29年 4月26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（94,822,904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（20,766,882円）、および分配準備積立金（0円）より、分配対象収益は115,589,786円（1万口当たり82.32円）ではありますが、分配を行っておりません。	計算期間末における費用控除後の配当等収益（645,523,047円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（547,471,778円）、収益調整金（405,378,198円）、および分配準備積立金（83,030,475円）より、分配対象収益は1,681,403,498円（1万口当たり346.00円）ではありますが、分配を行っておりません。

（金融商品に関する注記）

．金融商品の状況に関する事項

項 目	第2期
	自 平成28年 4月27日 至 平成29年 4月26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、投資信託受益証券、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。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>

項目	第2期 自 平成28年 4月27日 至 平成29年 4月26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 4月26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（投資信託受益証券、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27年 4月17日 至 平成28年 4月26日）

種 類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
投資信託受益証券	9,375,603円
親投資信託受益証券	119,032,739円
合計	128,408,342円

第2期（自 平成28年 4月27日 至 平成29年 4月26日）

種 類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
投資信託受益証券	154,027,678円
親投資信託受益証券	867,760,345円
合計	1,021,788,023円

（デリバティブ取引に関する注記）

第1期（平成28年 4月26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	713,483,543	-	721,763,700	8,280,157
	米ドル	713,483,543	-	721,763,700	8,280,157
	合計	713,483,543	-	721,763,700	8,280,157

第2期（平成29年 4月26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	419,135,255	-	419,003,410	131,845
	米ドル	419,135,255	-	419,003,410	131,845
	売建	7,045,942,487	-	7,039,434,553	6,507,934
	米ドル	7,045,942,487	-	7,039,434,553	6,507,934
	合計	7,465,077,742	-	7,458,437,963	6,376,089

(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)

<p>第2期 自 平成28年 4月27日 至 平成29年 4月26日</p>
<p>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。</p>

(その他の注記)

項 目	第1期 (平成28年 4月26日現在)	第2期 (平成29年 4月26日現在)
期首元本額	88,512,206円	14,040,607,518円
期中追加設定元本額	14,382,691,005円	39,440,607,065円
期中一部解約元本額	430,595,693円	4,888,096,644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

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	米ドル	iシェアーズ J.P.モルガン・米ドル建てエマージング・マーケット債券ETF	278,925	31,964,805.00	
		SPDR ブルームバーグ・パークレイズ・ハイ・イールド債券ETF	907,982	33,704,291.84	
		バンガード・米ドル建て新興国政府債券ETF	50,925	4,085,203.50	
	米ドル 小計		1,237,832	69,754,300.34 (7,765,746,256)	
投資信託受益証券合計				7,765,746,256 (7,765,746,256)	
親投資信託受益証券	日本円	国内株式インデックス・マザーファンド(B号)	1,737,156,542	4,017,521,934	
		外国株式インデックス・マザーファンド	931,097,263	2,824,297,327	
		ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド	17,117,938,799	23,638,161,687	
		外国債券パッシブ・マザーファンド	260,587,749	436,927,478	
		国内債券パッシブ・マザーファンド	3,360,471,450	4,219,071,905	
		Jリート・インデックス・マザーファンド	741,377,245	1,415,882,262	
		外国リート・インデックス・マザーファンド	273,718,992	535,722,811	
		エマージング株式インデックス・マザーファンド	2,076,132,775	2,544,300,715	
親投資信託受益証券合計			26,498,480,815	39,631,886,119	
合計				47,397,632,375 (7,765,746,256)	

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

通貨	銘柄数	組入投資信託受益証券 時価比率	合計金額に対する比率
米ドル	投資信託受益証券 3銘柄	16.0%	100.0%

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。

【アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）】

（１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第1期 （平成28年 4月26日現在）	第2期 （平成29年 4月26日現在）
資産の部		
流動資産		
預金	8,499,909	861,955
金銭信託	220,550,363	329,533,628
コール・ローン	46,277,247	685,639,516
投資信託受益証券	2,171,643,412	8,432,441,682
親投資信託受益証券	10,036,202,031	23,024,760,829
派生商品評価勘定	-	12,985,359
未収入金	34,404,231	775,003,431
流動資産合計	12,517,577,193	33,261,226,400
資産合計		
12,517,577,193		
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	20,530,242	4,267,647
未払金	55,511,975	556,000,000
未払解約金	309,966	317,515,995
未払受託者報酬	1,589,467	4,501,157
未払委託者報酬	48,213,896	136,067,059
未払利息	135	1,988
その他未払費用	321,346	914,756
流動負債合計	126,477,027	1,019,268,602
負債合計		
126,477,027		
純資産の部		
元本等		
元本	13,328,989,150	32,112,350,663
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	937,888,984	129,607,135
元本等合計	12,391,100,166	32,241,957,798
純資産合計		
12,391,100,166		
負債純資産合計		
12,517,577,193		

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第1期		第2期	
	自	平成27年 4月17日 至 平成28年 4月26日	自	平成28年 4月27日 至 平成29年 4月26日
営業収益				
受取配当金		64,576,463		325,338,002
受取利息		12,084		-
有価証券売買等損益		379,159,717		1,757,316,328
為替差損益		45,327,377		63,902,844
営業収益合計		359,898,547		2,018,751,486
営業費用				
支払利息		1,174		352,434
受託者報酬		2,240,986		7,032,474
委託者報酬		67,976,654		212,850,211
その他費用		864,717		2,656,195
営業費用合計		71,083,531		222,891,314
営業利益又は営業損失（ ）		430,982,078		1,795,860,172
経常利益又は経常損失（ ）		430,982,078		1,795,860,172
当期純利益又は当期純損失（ ）		430,982,078		1,795,860,172
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（ ）		5,971,960		141,394,865
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		-		937,888,984
剰余金増加額又は欠損金減少額		2,855,146		203,570,922
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		2,855,146		203,570,922
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		-		-
剰余金減少額又は欠損金増加額		515,734,012		790,540,110
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		-		-
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		515,734,012		790,540,110
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		937,888,984		129,607,135

（ 3 ）【注記表】

（ 重要な会計方針の注記 ）

項 目	第2期	
	自 平成28年 4月27日 至 平成29年 4月26日	
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資信託受益証券、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. 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. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金の計上基準</p> <p>受取配当金は原則として、配当落ち日において、確定配当金額または予想配当金額を計上しております。なお、配当金額が未確定の場合は、入金日基準で計上しております。</p>	
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建資産等の会計処理</p> <p>「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。</p>	

（ 貸借対照表に関する注記 ）

項 目	第1期		第2期	
	（平成28年 4月26日現在）		（平成29年 4月26日現在）	
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	13,328,989,150口		32,112,350,663口	
2. 「投資信託財産の計算に関する規則」第55条の6第10号に規定する額	元本の欠損	937,888,984円	元本の欠損	
3. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額	0.9296円	1口当たり純資産額	1.0040円
	(10,000口当たりの純資産額)	9,296円)	(10,000口当たりの純資産額)	10,040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27年 4月17日 至 平成28年 4月26日	自 平成28年 4月27日 至 平成29年 4月26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（116,723,687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（21,490,914円）、および分配準備積立金（0円）より、分配対象収益は138,214,601円（1万口当たり103.69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（539,926,748円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（640,738,374円）、収益調整金（330,740,600円）、および分配準備積立金（102,086,491円）より、分配対象収益は1,613,492,213円（1万口当たり502.44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 4月27日 至 平成29年 4月26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、投資信託受益証券、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。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>

項目	第2期 自 平成28年 4月27日 至 平成29年 4月26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 4月26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（投資信託受益証券、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27年 4月17日 至 平成28年 4月26日）

種 類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
投資信託受益証券	20,664,797円
親投資信託受益証券	5,908,130円
合計	14,756,667円

第2期（自 平成28年 4月27日 至 平成29年 4月26日）

種 類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
投資信託受益証券	208,536,241円
親投資信託受益証券	1,010,741,345円
合計	1,219,277,586円

（デリバティブ取引に関する注記）

第1期（平成28年 4月26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	1,773,124,618	-	1,793,654,860	20,530,242
	米ドル	1,773,124,618	-	1,793,654,860	20,530,242
	合計	1,773,124,618	-	1,793,654,860	20,530,242

第2期（平成29年 4月26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	530,700,226	-	531,901,860	1,201,634
	米ドル	530,700,226	-	531,901,860	1,201,634
	売建	7,841,627,615	-	7,834,111,537	7,516,078
	米ドル	7,841,627,615	-	7,834,111,537	7,516,078
	合計	8,372,327,841	-	8,366,013,397	8,717,712

(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)

<p>第2期 自 平成28年 4月27日 至 平成29年 4月26日</p>
<p>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。</p>

(その他の注記)

項 目	第1期 (平成28年 4月26日現在)	第2期 (平成29年 4月26日現在)
期首元本額	174,606,430円	13,328,989,150円
期中追加設定元本額	13,299,171,437円	22,569,690,166円
期中一部解約元本額	144,788,717円	3,786,328,653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

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	米ドル	iシェアーズ J.P.モルガン・米ドル建てエマージング・マーケット債券ETF	218,767	25,070,698.20	
		SPDR ブルームバーグ・パークレイズ・ハイ・イールド債券ETF	910,974	33,815,354.88	
		バンガード・米ドル建て新興国政府債券ETF	210,131	16,856,708.82	
	米ドル 小計		1,339,872	75,742,761.90 (8,432,441,682)	
投資信託受益証券合計				8,432,441,682 (8,432,441,682)	
親投資信託受益証券	日本円	国内株式インデックス・マザーファンド(B号)	2,009,611,557	4,647,628,647	
		外国株式インデックス・マザーファンド	935,876,670	2,838,794,703	
		ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド	6,810,810,650	9,405,048,426	
		外国債券パッシブ・マザーファンド	507,159,946	850,355,081	
		国内債券パッシブ・マザーファンド	621,086,811	779,774,491	
		Jリート・インデックス・マザーファンド	761,896,307	1,455,069,567	
		外国リート・インデックス・マザーファンド	297,440,447	582,150,442	
		エマージング株式インデックス・マザーファンド	2,012,190,512	2,465,939,472	
親投資信託受益証券合計			13,956,072,900	23,024,760,829	
合計				31,457,202,511 (8,432,441,682)	

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

通貨	銘柄数	組入投資信託受益証券 時価比率	合計金額に対する比率
米ドル	投資信託受益証券 3銘柄	26.2%	100.0%

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。

【アセットアロケーション・ファンド（成長型）】

（１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第1期 （平成28年 4月26日現在）	第2期 （平成29年 4月26日現在）
資産の部		
流動資産		
預金	11,074,135	1,297,860
金銭信託	210,788,567	306,879,503
コール・ローン	44,228,966	638,504,526
投資信託受益証券	2,838,102,106	8,794,885,399
親投資信託受益証券	9,410,163,174	17,548,426,415
派生商品評価勘定	-	18,973,263
未収入金	140,236,003	882,390,299
流動資産合計	12,654,592,951	28,191,357,265
資産合計		
	12,654,592,951	28,191,357,265
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	27,095,706	5,841,012
未払金	68,690,278	458,800,000
未払解約金	-	553,126,368
未払受託者報酬	1,573,552	4,146,248
未払委託者報酬	47,731,060	125,357,141
未払利息	129	1,852
その他未払費用	318,306	845,468
流動負債合計	145,409,031	1,148,118,089
負債合計		
	145,409,031	1,148,118,089
純資産の部		
元本等		
元本	13,657,972,258	26,858,575,783
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	1,148,788,338	184,663,393
元本等合計	12,509,183,920	27,043,239,176
純資産合計		
	12,509,183,920	27,043,239,176
負債純資産合計		
	12,654,592,951	28,191,357,265

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第1期		第2期	
	自	平成27年 4月17日 至 平成28年 4月26日	自	平成28年 4月27日 至 平成29年 4月26日
営業収益				
受取配当金		74,464,831		288,992,975
受取利息		11,303		-
有価証券売買等損益		471,493,296		2,105,764,120
為替差損益		61,653,473		54,451,344
営業収益合計		458,670,635		2,340,305,751
営業費用				
支払利息		1,229		325,567
受託者報酬		2,205,626		6,658,861
委託者報酬		66,903,902		201,573,152
その他費用		885,905		2,493,855
営業費用合計		69,996,662		211,051,435
営業利益又は営業損失（ ）		528,667,297		2,129,254,316
経常利益又は経常損失（ ）		528,667,297		2,129,254,316
当期純利益又は当期純損失（ ）		528,667,297		2,129,254,316
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（ ）		7,997,324		310,636,910
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		-		1,148,788,338
剰余金増加額又は欠損金減少額		5,642,464		412,959,525
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		5,642,464		412,959,525
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		-		-
剰余金減少額又は欠損金増加額		633,760,829		898,125,200
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		-		-
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		633,760,829		898,125,200
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		1,148,788,338		184,663,393

（ 3 ）【注記表】

（ 重要な会計方針の注記 ）

項 目	第2期	
	自 平成28年 4月27日 至 平成29年 4月26日	
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	投資信託受益証券、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。 (1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。 (2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。 (3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。	
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。	
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金の計上基準 受取配当金は原則として、配当落ち日において、確定配当金額または予想配当金額を計上しております。なお、配当金額が未確定の場合は、入金日基準で計上しております。	
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建資産等の会計処理 「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。	

（ 貸借対照表に関する注記 ）

項 目	第1期		第2期	
	（平成28年 4月26日現在）		（平成29年 4月26日現在）	
1. 当計算期間の末日における受益権の総数		13,657,972,258口		26,858,575,783口
2. 「投資信託財産の計算に関する規則」第55条の6第10号に規定する額	元本の欠損	1,148,788,338円	元本の欠損	
3. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額	0.9159円	1口当たり純資産額	1.0069円
	(10,000口当たりの純資産額)	9,159円)	(10,000口当たりの純資産額)	10,069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27年 4月17日 至 平成28年 4月26日	自 平成28年 4月27日 至 平成29年 4月26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（118,597,842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（24,067,646円）、および分配準備積立金（0円）より、分配対象収益は142,665,488円（1万口当たり104.45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（488,445,325円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（824,770,006円）、収益調整金（259,760,202円）、および分配準備積立金（93,762,890円）より、分配対象収益は1,666,738,423円（1万口当たり620.53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 4月27日 至 平成29年 4月26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、投資信託受益証券、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。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>

項目	第2期 自 平成28年 4月27日 至 平成29年 4月26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 4月26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（投資信託受益証券、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27年 4月17日 至 平成28年 4月26日）

種 類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
投資信託受益証券	97,671,644円
親投資信託受益証券	37,074,394円
合計	60,597,250円

第2期（自 平成28年 4月27日 至 平成29年 4月26日）

種 類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
投資信託受益証券	145,941,398円
親投資信託受益証券	1,158,787,297円
合計	1,304,728,695円

（デリバティブ取引に関する注記）

第1期（平成28年 4月26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	2,340,644,014	-	2,367,739,720	27,095,706
	米ドル	2,340,644,014	-	2,367,739,720	27,095,706
	合計	2,340,644,014	-	2,367,739,720	27,095,706

第2期（平成29年 4月26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	909,992,897	-	915,979,050	5,986,153
	米ドル	909,992,897	-	915,979,050	5,986,153
	売建	8,713,103,570	-	8,705,957,472	7,146,098
	米ドル	8,713,103,570	-	8,705,957,472	7,146,098
	合計	9,623,096,467	-	9,621,936,522	13,132,251

(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)

<p>第2期 自 平成28年 4月27日 至 平成29年 4月26日</p>
<p>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。</p>

(その他の注記)

項 目	第1期 (平成28年 4月26日現在)	第2期 (平成29年 4月26日現在)
期首元本額	175,410,861円	13,657,972,258円
期中追加設定元本額	13,707,612,228円	19,324,709,567円
期中一部解約元本額	225,050,831円	6,124,106,042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

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	米ドル	i シェアーズ J.P.モルガン・米ドル建てエマージング・マーケット債券ETF	257,209	29,476,151.40	
		S P D R ブルームバーグ・パークレイズ・ハイ・イールド債券ETF	896,097	33,263,120.64	
		バンガード・米ドル建て新興国政府債券ETF	202,681	16,259,069.82	
	米ドル 小計		1,355,987	78,998,341.86 (8,794,885,399)	
投資信託受益証券合計				8,794,885,399 (8,794,885,399)	
親投資信託受益証券	日本円	国内株式インデックス・マザーファンド(B号)	2,127,243,879	4,919,676,918	
		外国株式インデックス・マザーファンド	880,369,764	2,670,425,605	
		ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド	2,915,602,988	4,026,156,166	
		外国債券パッシブ・マザーファンド	649,852,762	1,089,608,126	
		国内債券パッシブ・マザーファンド	102,036,221	128,106,475	
		Jリート・インデックス・マザーファンド	783,469,418	1,496,269,894	
		外国リート・インデックス・マザーファンド	336,824,509	659,232,929	
		エマージング株式インデックス・マザーファンド	2,088,086,742	2,558,950,302	
親投資信託受益証券合計			9,883,486,283	17,548,426,415	
合計				26,343,311,814 (8,794,885,399)	

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

通貨	銘柄数	組入投資信託受益証券 時価比率	合計金額に対する比率
米ドル	投資信託受益証券 3銘柄	32.5%	100.0%

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。

（参考）

「アセットアロケーション・ファンド（安定型）」「アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）」および「アセットアロケーション・ファンド（成長型）」は、「国内株式インデックス・マザーファンド（B号）」、「外国株式インデックス・マザーファンド」、「エマージング株式インデックス・マザーファンド」、「リート・インデックス・マザーファンド」、「外国リート・インデックス・マザーファンド」、「国内債券パッシブ・マザーファンド」、「外国債券パッシブ・マザーファンド」、「ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド」、「バンガード・米ドル建て新興国政府債券ETF」、「iシェアーズ」J・P・モルガン・米ドル建てエマージング・マーケット債券ETF」および「SPDR ブルームバーグ・バークレイズ・ハイ・イールド債券ETF」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」および「投資信託受益証券」はこれらの親投資信託および投資信託の受益証券です。

なお、以下に記載した状況は、監査の対象外です。

国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

貸借対照表

	（単位：円）	
	（平成28年 4月26日現在）	（平成29年 4月26日現在）
資産の部		
流動資産		
金銭信託	914,048,541	663,157,244
コール・ローン	191,791,340	1,379,788,804
株式	201,765,513,030	201,459,449,040
派生商品評価勘定	79,446,320	21,258,040
未収入金	2,379,665,850	201,000,000
未収配当金	1,964,324,659	1,893,108,381
差入委託証拠金	-	53,020,000
流動資産合計	207,294,789,740	205,670,781,509
資産合計	207,294,789,740	205,670,781,509
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	-	10,689,480
前受金	79,496,000	10,750,000
未払金	768,647,490	10,603,200
未払解約金	1,399,862,336	831,780,740
未払利息	562	4,002
その他未払費用	27,438	55,629
流動負債合計	2,248,033,826	863,883,051
負債合計	2,248,033,826	863,883,051
純資産の部		
元本等		
元本	100,093,353,772	88,558,263,766
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	104,953,402,142	116,248,634,692
元本等合計	205,046,755,914	204,806,898,458
純資産合計	205,046,755,914	204,806,898,458
負債純資産合計	207,294,789,740	205,670,781,509

注記表

（重要な会計方針の注記）

項目	自 平成28年 4月27日 至 平成29年 4月26日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>先物取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場によっております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金の計上基準</p> <p>受取配当金は原則として、配当落ち日において、確定配当金額または予想配当金額を計上しております。なお、配当金額が未確定の場合は、入金日基準で計上しております。</p>

（貸借対照表に関する注記）

項目	（平成28年 4月26日現在）	（平成29年 4月26日現在）
1. 担保資産	代用として、担保に供している資産は次の通りであります。	代用として、担保に供している資産は次の通りであります。
	株式 2,974,500,000円	株式 3,077,000,000円
2. 当計算期間の末日における受益権の総数	100,093,353,772口	88,558,263,766口
3. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 2.0486円 (10,000口当たりの純資産額 20,486円)	1口当たり純資産額 2.3127円 (10,000口当たりの純資産額 23,127円)

（金融商品に関する注記）

. 金融商品の状況に関する事項

項 目	自 平成28年 4月27日 至 平成29年 4月26日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>(1)金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、株式を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。当計算期間については、先物取引を行っております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2)金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する委員会をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用グループに是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用グループは、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。その後、当該関連運用グループの対処の実施や対処方針の決定等に関し、必要に応じてリスク管理を行う部署が当該部署の担当役員、当該関連運用グループの担当役員およびリスク管理委員会へ報告を行う体制となっております。</p> <p>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する部会にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。</p>
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって認める評価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。

. 金融商品の時価等に関する事項

項目	(平成29年 4月26日現在)
1.貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1) 有価証券（株式） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(デリバティブ取引に関する注記)

(平成28年 4月26日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	2,359,913,680	-	2,439,360,000	79,446,320
	東証株価指数先物	2,359,913,680	-	2,439,360,000	79,446,320
合計		2,359,913,680	-	2,439,360,000	79,446,320

(平成29年 4月26日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	3,219,231,440	-	3,229,800,000	10,568,560
	東証株価指数先物	3,219,231,440	-	3,229,800,000	10,568,560
合計		3,219,231,440	-	3,229,800,000	10,568,560

(注) 1.時価の算定方法

(1) 株価指数先物取引の時価の算定方法について

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

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

自 平成28年 4月27日 至 平成29年 4月26日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。

(その他の注記)

(平成28年 4月26日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	119,585,187,546円
同期中における追加設定元本額	21,937,063,952円
同期中における一部解約元本額	41,428,897,726円
平成28年 4月26日現在における元本の内訳	
三井住友・日本株式インデックス年金ファンド	9,817,037,466円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	525,966,938円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	2,601,422,021円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	1,873,657,801円
SMAM・グローバルバランスファンド(機動的資産配分型)	81,677,905円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2020	7,950,556円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2025	18,222,038円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2030	60,165,679円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2035	46,189,394円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2040	27,526,819円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2045	61,397,469円
国内株式指数ファンド(TOPIX)	2,585,632,388円
三井住友・DC日本株式インデックスファンドS	895,132,016円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	281,954,244円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	556,420,071円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	760,345,139円
SMAM・国内株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	16,667,156,051円
バランスファンドVA(安定運用型) < 適格機関投資家限定 >	115,477,819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 >	13,960,330,068円
SMAM・バランスファンドVA25 < 適格機関投資家専用 >	7,114,999,830円
SMAM・バランスファンドVA37.5 < 適格機関投資家専用 >	4,008,963,308円
SMAM・バランスファンドVA50 < 適格機関投資家専用 >	14,650,027,548円
SMAM・バランスファンドVL30 < 適格機関投資家限定 >	85,242,090円

S M A M ・ バランスファンドV L 5 0 < 適格機関投資家限定 >	344,745,733円
世界6資産バランスファンドV A < 適格機関投資家限定 >	23,976,922円
S M A M ・ バランスファンドV A 7 5 < 適格機関投資家専用 >	1,528,110,917円
S M A M ・ バランスファンドV L 国際分散型 < 適格機関投資家限定 >	85,688,096円
S M A M ・ インデックス・バランスV A 2 5 < 適格機関投資家専用 >	573,208,020円
S M A M ・ インデックス・バランスV A 5 0 < 適格機関投資家専用 >	1,715,554,716円
S M A M ・ バランスファンドV A 4 0 < 適格機関投資家専用 >	2,896,392,095円
S M A M ・ バランスファンドV A 3 5 < 適格機関投資家専用 >	5,243,649,784円
S M A M ・ バランスV A 株 4 0 T < 適格機関投資家限定 >	130,398,140円
三井住友・5資産バランスファンド・V A S (適格機関投資家専用)	3,472,384,673円
S M A M ・ グローバルバランス4 0 V A < 適格機関投資家限定 >	107,938,271円
S M A M ・ バランスファンドV A 2 0 < 適格機関投資家専用 >	187,530,886円
三井住友・7資産バランスファンド・V A S (適格機関投資家専用)	3,090,785,104円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 2 0 A < 適格機関投資家専用 >	165,880,067円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 3 5 A < 適格機関投資家専用 >	76,427,722円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 5 0 A < 適格機関投資家専用 >	36,368,520円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 2 0 L < 適格機関投資家専用 >	371,939,767円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 2 5 L < 適格機関投資家専用 >	628,248,942円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 2 0 T < 適格機関投資家専用 >	265,305,051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 >	179,558,597円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 3 5 A 2 < 適格機関投資家専用 >	82,740,483円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 5 0 A 2 < 適格機関投資家専用 >	13,703,184円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 3 0 L 2 < 適格機関投資家専用 >	133,711,700円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 2 5 L 2 < 適格機関投資家専用 >	1,561,417,346円
S M A M ・ 国内株式インデックスファンド・V A (適格機関投資家専用)	272,134,221円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 2 0 T 2 < 適格機関投資家専用 >	33,498,132円
S M A M ・ F G 新興国重視型バランス2 0 V A < 適格機関投資家限定 >	305,920円
S M A M ・ F G グローバルバランス2 5 V A < 適格機関投資家限定 >	1,582,929円
S M A M ・ 年金Wリスクコントロールファンド < 適格機関投資家限定 >	150,170円
S M A M ・ マルチアセットストラテジーファンド2 0 1 6 - 0 1 < 適格機関投資家限定 >	67,123,006円
合計	100,093,353,772円

(平成29年 4月26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	100,093,353,772円
同期中における追加設定元本額	20,670,066,146円
同期中における一部解約元本額	32,205,156,152円
平成29年 4月26日現在における元本の内訳	
三井住友・日本株式インデックス年金ファンド	9,903,542,452円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	603,105,910円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	2,849,816,592円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	2,045,816,615円
S M A M ・ グローバルバランスファンド(機動的資産配分型)	88,444,758円

三井住友・DCターゲットイヤーファンド2020(4資産タイプ)	8,103,050円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2025(4資産タイプ)	23,079,852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)	58,807,382円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2035(4資産タイプ)	59,286,681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)	32,359,219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)	82,790,418円
国内株式指数ファンド(TOPIX)	1,733,077,513円
三井住友・DC日本株式インデックスファンドS	1,879,511,174円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	1,737,156,542円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	2,009,611,557円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	2,127,243,879円
イオン・バランス戦略ファンド	4,143,496円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2050	3,714,174円
SMAM・国内株式バッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	11,531,039,074円
バランスファンドVA(安定運用型)〈適格機関投資家限定〉	53,038,053円
SMAM・バランスファンドVA安定成長型〈適格機関投資家限定〉	7,188,474,590円
SMAM・バランスファンドVA25〈適格機関投資家専用〉	5,242,604,674円
SMAM・バランスファンドVA37.5〈適格機関投資家専用〉	3,235,121,228円
SMAM・バランスファンドVA50〈適格機関投資家専用〉	11,906,550,508円
SMAM・バランスファンドVL30〈適格機関投資家限定〉	66,465,825円
SMAM・バランスファンドVL50〈適格機関投資家限定〉	286,787,060円
世界6資産バランスファンドVA〈適格機関投資家限定〉	7,947,015円
SMAM・バランスファンドVA75〈適格機関投資家専用〉	1,268,372,695円
SMAM・バランスファンドVL国際分散型〈適格機関投資家限定〉	76,730,984円
SMAM・インデックス・バランスVA25〈適格機関投資家専用〉	463,133,118円
SMAM・インデックス・バランスVA50〈適格機関投資家専用〉	1,414,752,315円
SMAM・バランスファンドVA40〈適格機関投資家専用〉	2,408,713,760円
SMAM・バランスファンドVA35〈適格機関投資家専用〉	4,145,417,817円
SMAM・バランスVA株40T〈適格機関投資家限定〉	106,434,313円
三井住友・5資産バランスファンド・VAS(適格機関投資家専用)	1,962,608,632円
SMAM・グローバルバランス40VA〈適格機関投資家限定〉	87,447,724円
SMAM・バランスファンドVA20〈適格機関投資家専用〉	141,858,852円
三井住友・7資産バランスファンド・VAS(適格機関投資家専用)	2,182,237,989円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A〈適格機関投資家専用〉	133,459,594円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A〈適格機関投資家専用〉	62,338,241円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A〈適格機関投資家専用〉	28,733,110円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L〈適格機関投資家専用〉	284,050,792円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L〈適格機関投資家専用〉	482,778,920円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T〈適格機関投資家専用〉	215,218,371円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A2〈適格機関投資家専用〉	146,623,095円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A2〈適格機関投資家専用〉	71,528,607円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A2〈適格機関投資家専用〉	12,212,418円
SMAM・アセットバランスファンドVA30L2〈適格機関投資家専用〉	97,696,853円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L2〈適格機関投資家専用〉	1,243,055,864円
SMAM・国内株式インデックスファンド・VA(適格機関投資家専用)	234,051,541円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T2〈適格機関投資家専用〉	24,843,673円
SMAM・グローバルバランスファンド(標準型)VA〈適格機関投資家限定〉	2,318,364,544円
SMAM・グローバルバランスファンド(債券重視型)VA〈適格機関投資家限定〉	381,908,627円

S M A M ・ 世界バランスファンドV A < 適格機関投資家限定 >	2,280,387,276円
S M A M ・ 世界バランスファンドV A 2 < 適格機関投資家限定 >	1,271,327,298円
S M A M ・ F G 新興国重視型バランス20V A < 適格機関投資家限定 >	21,880円
S M A M ・ F G グローバルバランス25V A < 適格機関投資家限定 >	24,630円
S M A M ・ 年金Wリスクコントロールファンド< 適格機関投資家限定 >	227,744円
S M A M ・ マルチアセットストラテジーファンド2016 - 04 < 適格機関投資家限定 >	115,594,073円
S M A M ・ マルチアセットストラテジーファンド2016 - 05 < 適格機関投資家限定 >	55,350,457円
S M A M ・ マルチアセットストラテジー・オープン< 適格機関投資家限定 >	73,118,668円
合計	88,558,263,766円

附属明細表

有価証券明細表

(a) 株式

(単位：円)

銘柄	株数	評価額		備考
		単価	金額	
極洋	4,500	2,935.00	13,207,500	
日本水産	129,200	533.00	68,863,600	
マルハニチロ	19,000	3,115.00	59,185,000	
カネコ種苗	4,700	1,440.00	6,768,000	
サカタのタネ	14,600	3,590.00	52,414,000	
ホクト	10,000	2,108.00	21,080,000	
日鉄鉱業	2,700	5,720.00	15,444,000	
三井松島産業	6,700	1,431.00	9,587,700	
国際石油開発帝石	532,000	1,071.50	570,038,000	
日本海洋掘削	4,000	2,120.00	8,480,000	
石油資源開発	15,800	2,465.00	38,947,000	
K & O エナジーグループ	7,100	1,721.00	12,219,100	
ショーボンドホールディングス	9,300	5,090.00	47,337,000	
ミライト・ホールディングス	30,700	1,130.00	34,691,000	
タマホーム	10,600	631.00	6,688,600	
ダイセキ環境ソリューション	4,200	1,282.00	5,384,400	
安藤・間	72,000	784.00	56,448,000	
東急建設	35,000	903.00	31,605,000	
コムシスホールディングス	39,500	2,105.00	83,147,500	
ミサワホーム	13,300	1,032.00	13,725,600	
ピーアールホールディングス	12,700	386.00	4,902,200	
高松コンストラクショングループ	7,100	2,650.00	18,815,000	
東建コーポレーション	3,600	8,700.00	31,320,000	

大成建設	513,000	850.00	436,050,000
大林組	300,300	1,076.00	323,122,800
清水建設	306,000	1,076.00	329,256,000
飛鳥建設	98,400	170.00	16,728,000
長谷工コーポレーション	117,000	1,275.00	149,175,000
松井建設	12,800	957.00	12,249,600
銭高組	17,000	400.00	6,800,000
鹿島建設	441,000	758.00	334,278,000
不動テトラ	84,600	184.00	15,566,400
鉄建建設	63,000	331.00	20,853,000
西松建設	118,000	560.00	66,080,000
三井住友建設	391,300	120.00	46,956,000
大豊建設	36,000	545.00	19,620,000
前田建設工業	67,000	1,003.00	67,201,000
ナカノフドー建設	9,600	660.00	6,336,000
奥村組	84,000	677.00	56,868,000
東鉄工業	11,500	3,145.00	36,167,500
イチケン	11,000	424.00	4,664,000
浅沼組	37,000	323.00	11,951,000
戸田建設	118,000	683.00	80,594,000
熊谷組	156,000	300.00	46,800,000
青木あすなる建設	8,000	828.00	6,624,000
北野建設	29,000	298.00	8,642,000
三井ホーム	16,000	689.00	11,024,000
矢作建設工業	14,900	994.00	14,810,600
日本ハウスホールディングス	24,700	471.00	11,633,700
大東建託	37,200	16,335.00	607,662,000
新日本建設	12,700	873.00	11,087,100
N I P P O	22,000	2,127.00	46,794,000
東亜道路工業	25,000	339.00	8,475,000
前田道路	31,000	2,027.00	62,837,000
日本道路	32,000	490.00	15,680,000
東亜建設工業	8,500	2,010.00	17,085,000
若築建設	73,000	146.00	10,658,000
東洋建設	33,100	399.00	13,206,900
五洋建設	113,600	559.00	63,502,400
大林道路	12,400	676.00	8,382,400
世紀東急工業	16,900	584.00	9,869,600
福田組	16,000	996.00	15,936,000
住友林業	69,200	1,698.00	117,501,600
日成ビルド工業	30,000	556.00	16,680,000
ヤマダ・エスバイエルホーム	83,000	81.00	6,723,000

巴コーポレーション	11,100	347.00	3,851,700
パナホーム	37,000	1,221.00	45,177,000
大和ハウス工業	297,400	3,306.00	983,204,400
ライト工業	19,700	1,104.00	21,748,800
積水ハウス	317,200	1,867.50	592,371,000
日特建設	12,500	449.00	5,612,500
北陸電気工事	5,600	908.00	5,084,800
ユアテック	17,000	688.00	11,696,000
中電工	11,800	2,432.00	28,697,600
関電工	39,000	1,055.00	41,145,000
きんでん	66,800	1,556.00	103,940,800
東京エネシス	12,000	938.00	11,256,000
トーエネック	17,000	598.00	10,166,000
住友電設	7,700	1,283.00	9,879,100
日本電設工業	16,100	2,178.00	35,065,800
協和エクシオ	39,500	1,673.00	66,083,500
新日本空調	9,100	1,418.00	12,903,800
N D S	2,100	2,839.00	5,961,900
九電工	19,500	3,200.00	62,400,000
三機工業	22,200	974.00	21,622,800
日揮	94,300	1,969.00	185,676,700
中外炉工業	40,000	214.00	8,560,000
ヤマト	12,400	529.00	6,559,600
太平電業	14,000	1,099.00	15,386,000
高砂熱学工業	27,200	1,595.00	43,384,000
朝日工業社	3,000	3,085.00	9,255,000
明星工業	20,000	635.00	12,700,000
大気社	13,200	2,764.00	36,484,800
ダイダン	14,000	1,094.00	15,316,000
日比谷総合設備	11,000	1,661.00	18,271,000
東芝プラントシステム	16,600	1,799.00	29,863,400
O S J Bホールディングス	38,500	263.00	10,125,500
東洋エンジニアリング	58,000	277.00	16,066,000
千代田化工建設	74,000	745.00	55,130,000
新興プランテック	21,700	836.00	18,141,200
日本製粉	29,000	1,672.00	48,488,000
日清製粉グループ本社	109,700	1,701.00	186,599,700
日東富士製粉	1,300	3,900.00	5,070,000
昭和産業	40,000	597.00	23,880,000
鳥越製粉	11,600	812.00	9,419,200
中部飼料	12,100	1,323.00	16,008,300
フィード・ワン	66,100	207.00	13,682,700

日本甜菜製糖	6,100	2,322.00	14,164,200
三井製糖	6,800	2,735.00	18,598,000
日新製糖	4,600	1,869.00	8,597,400
森永製菓	19,800	5,210.00	103,158,000
中村屋	2,600	4,695.00	12,207,000
江崎グリコ	25,300	5,810.00	146,993,000
名糖産業	5,000	1,475.00	7,375,000
不二家	65,000	269.00	17,485,000
山崎製パン	73,900	2,356.00	174,108,400
モロゾフ	17,000	573.00	9,741,000
亀田製菓	5,700	5,150.00	29,355,000
寿スピリッツ	7,200	2,919.00	21,016,800
カルビー	41,200	3,950.00	162,740,000
森永乳業	91,000	884.00	80,444,000
六甲バター	4,800	2,448.00	11,750,400
ヤクルト本社	54,100	6,350.00	343,535,000
明治ホールディングス	59,600	9,400.00	560,240,000
雪印メグミルク	22,100	3,325.00	73,482,500
プリマハム	62,000	510.00	31,620,000
日本ハム	68,000	3,165.00	215,220,000
丸大食品	48,000	506.00	24,288,000
S Foods	5,200	3,325.00	17,290,000
伊藤ハム米久ホールディングス	57,200	1,028.00	58,801,600
サッポロホールディングス	33,300	3,140.00	104,562,000
アサヒグループホールディングス	189,300	4,229.00	800,549,700
キリンホールディングス	434,200	2,150.50	933,747,100
宝ホールディングス	73,600	1,201.00	88,393,600
オエノンホールディングス	36,000	250.00	9,000,000
養命酒製造	4,500	2,076.00	9,342,000
コカ・コーラボトラーズジャパン	63,600	3,390.00	215,604,000
サントリー食品インターナショナル	68,800	4,980.00	342,624,000
ダイトーグループホールディングス	4,600	5,380.00	24,748,000
伊藤園	30,100	4,050.00	121,905,000
キーコーヒー	8,900	2,203.00	19,606,700
日清オイリオグループ	57,000	656.00	37,392,000
不二製油グループ本社	27,300	2,600.00	70,980,000
J - オイルミルズ	4,700	4,285.00	20,139,500
キッコーマン	70,000	3,510.00	245,700,000
味の素	208,400	2,199.50	458,375,800
キューピー	51,500	2,821.00	145,281,500
ハウス食品グループ本社	37,600	2,464.00	92,646,400
カゴメ	36,700	3,025.00	111,017,500

焼津水産化学工業	4,100	1,243.00	5,096,300
アリアケジャパン	8,100	7,030.00	56,943,000
ニチレイ	49,500	2,725.00	134,887,500
東洋水産	49,400	4,245.00	209,703,000
日清食品ホールディングス	39,200	6,500.00	254,800,000
永谷園ホールディングス	11,000	1,413.00	15,543,000
一正蒲鉾	5,300	1,238.00	6,561,400
フジッコ	9,900	2,570.00	25,443,000
ロック・フィールド	9,700	1,764.00	17,110,800
日本たばこ産業	558,400	3,795.00	2,119,128,000
ケンコーマヨネーズ	4,000	2,843.00	11,372,000
わらべや日洋ホールディングス	6,100	2,776.00	16,933,600
なとり	6,500	1,881.00	12,226,500
ユーグレナ	32,800	1,172.00	38,441,600
ミヨシ油脂	53,000	139.00	7,367,000
理研ビタミン	3,400	4,100.00	13,940,000
片倉工業	12,700	1,350.00	17,145,000
ゲンゼ	69,000	451.00	31,119,000
東洋紡	379,000	198.00	75,042,000
ユニチカ	263,000	90.00	23,670,000
富士紡ホールディングス	5,000	3,040.00	15,200,000
倉敷紡績	93,000	237.00	22,041,000
シキボウ	68,000	133.00	9,044,000
日本毛織	26,300	879.00	23,117,700
帝国繊維	10,300	1,791.00	18,447,300
帝人	76,500	2,151.00	164,551,500
東レ	684,000	978.70	669,430,800
サカイオーベックス	3,400	1,764.00	5,997,600
住江織物	32,000	247.00	7,904,000
アツギ	95,000	134.00	12,730,000
ダイニック	33,000	186.00	6,138,000
セーレン	23,400	1,664.00	38,937,600
小松精練	15,900	704.00	11,193,600
ワコールホールディングス	56,000	1,416.00	79,296,000
ホギメディカル	5,900	6,930.00	40,887,000
レナウン	47,600	158.00	7,520,800
T S Iホールディングス	38,500	745.00	28,682,500
三陽商会	62,000	164.00	10,168,000
ナイガイ	65,000	56.00	3,640,000
オンワードホールディングス	63,000	844.00	53,172,000
ルック	28,000	209.00	5,852,000
ゴールドウイン	4,200	5,950.00	24,990,000

デサント	21,300	1,359.00	28,946,700
特種東海製紙	5,500	4,125.00	22,687,500
王子ホールディングス	363,000	540.00	196,020,000
日本製紙	41,900	2,078.00	87,068,200
三菱製紙	16,000	768.00	12,288,000
北越紀州製紙	52,400	774.00	40,557,600
中越パルプ工業	43,000	234.00	10,062,000
巴川製紙所	21,000	234.00	4,914,000
大王製紙	36,700	1,387.00	50,902,900
レンゴー	91,800	665.00	61,047,000
トモク	33,000	333.00	10,989,000
ザ・パック	6,400	3,135.00	20,064,000
クラレ	157,700	1,778.00	280,390,600
旭化成	588,000	1,074.00	631,512,000
共和レザー	7,500	889.00	6,667,500
昭和電工	63,100	2,069.00	130,553,900
住友化学	690,000	624.00	430,560,000
住友精化	4,000	4,730.00	18,920,000
日産化学工業	51,400	3,430.00	176,302,000
ラサ工業	51,000	136.00	6,936,000
クレハ	7,100	4,960.00	35,216,000
テイカ	16,000	742.00	11,872,000
石原産業	17,400	1,102.00	19,174,800
日東エフシー	6,800	916.00	6,228,800
日本曹達	57,000	615.00	35,055,000
東ソー	271,000	1,045.00	283,195,000
トクヤマ	148,000	501.00	74,148,000
セントラル硝子	98,000	481.00	47,138,000
東亜合成	59,300	1,296.00	76,852,800
大阪ソーダ	40,000	502.00	20,080,000
関東電化工業	19,000	991.00	18,829,000
デンカ	195,000	574.00	111,930,000
信越化学工業	168,800	9,755.00	1,646,644,000
日本カーバイド工業	39,000	155.00	6,045,000
堺化学工業	38,000	387.00	14,706,000
エア・ウォーター	76,900	2,141.00	164,642,900
大陽日酸	72,300	1,325.00	95,797,500
日本化学工業	41,000	227.00	9,307,000
日本パーカライジング	48,800	1,396.00	68,124,800
高圧ガス工業	15,500	730.00	11,315,000
四国化成工業	14,000	1,290.00	18,060,000
戸田工業	28,000	266.00	7,448,000

ステラ ケミファ	4,500	2,970.00	13,365,000
保土谷化学工業	3,600	3,455.00	12,438,000
日本触媒	14,900	7,540.00	112,346,000
大日精化工業	38,000	735.00	27,930,000
カネカ	127,000	887.00	112,649,000
三菱瓦斯化学	87,600	2,393.00	209,626,800
三井化学	426,000	570.00	242,820,000
J S R	94,700	2,045.00	193,661,500
東京応化工業	17,800	3,625.00	64,525,000
大阪有機化学工業	7,700	1,220.00	9,394,000
三菱ケミカルホールディングス	634,600	881.20	559,209,520
K Hネオケム	12,100	1,593.00	19,275,300
ダイセル	127,300	1,291.00	164,344,300
住友ベークライト	84,000	686.00	57,624,000
積水化学工業	213,800	1,871.00	400,019,800
日本ゼオン	80,000	1,270.00	101,600,000
アイカ工業	30,500	3,095.00	94,397,500
宇部興産	475,000	261.00	123,975,000
積水樹脂	14,200	1,937.00	27,505,400
タキロンシーアイ	22,000	572.00	12,584,000
旭有機材	40,000	230.00	9,200,000
日立化成	52,000	3,180.00	165,360,000
ニチバン	11,000	874.00	9,614,000
リケンテクノス	21,700	535.00	11,609,500
大倉工業	26,000	516.00	13,416,000
積水化成品工業	15,000	793.00	11,895,000
群栄化学工業	2,600	3,550.00	9,230,000
ダイキョーニシカワ	16,500	1,425.00	23,512,500
日本化薬	61,000	1,515.00	92,415,000
カーリットホールディングス	11,800	568.00	6,702,400
日本精化	10,400	946.00	9,838,400
扶桑化学工業	6,700	3,310.00	22,177,000
A D E K A	40,700	1,632.00	66,422,400
日油	73,000	1,238.00	90,374,000
花王	239,200	6,140.00	1,468,688,000
第一工業製薬	24,000	406.00	9,744,000
三洋化成工業	5,600	4,820.00	26,992,000
大日本塗料	59,000	251.00	14,809,000
日本ペイントホールディングス	72,300	4,320.00	312,336,000
関西ペイント	98,700	2,472.00	243,986,400
中国塗料	27,800	833.00	23,157,400
日本特殊塗料	7,000	1,709.00	11,963,000

藤倉化成	16,000	659.00	10,544,000
太陽ホールディングス	7,700	4,930.00	37,961,000
D I C	37,000	3,965.00	146,705,000
サカティクス	18,600	1,566.00	29,127,600
東洋インキＳＣホールディングス	89,000	548.00	48,772,000
T & K T O K A	7,700	1,091.00	8,400,700
富士フィルムホールディングス	186,600	4,114.00	767,672,400
資生堂	179,200	3,018.00	540,825,600
ライオン	117,000	2,012.00	235,404,000
高砂香料工業	6,400	3,720.00	23,808,000
マンダム	9,200	5,340.00	49,128,000
ミルボン	4,900	5,430.00	26,607,000
ファンケル	20,000	1,719.00	34,380,000
コーセー	15,200	10,390.00	157,928,000
シーズ・ホールディングス	12,400	3,225.00	39,990,000
ポーラ・オルビスホールディングス	38,400	2,569.00	98,649,600
ノエビアホールディングス	5,700	4,570.00	26,049,000
エステー	7,800	1,749.00	13,642,200
コニシ	14,500	1,320.00	19,140,000
長谷川香料	11,700	2,143.00	25,073,100
星光P M C	5,600	1,219.00	6,826,400
小林製薬	26,200	5,740.00	150,388,000
荒川化学工業	8,000	1,944.00	15,552,000
メック	8,100	1,190.00	9,639,000
日本高純度化学	3,800	2,348.00	8,922,400
タカラバイオ	20,300	1,547.00	31,404,100
J C U	5,800	3,350.00	19,430,000
新田ゼラチン	8,100	733.00	5,937,300
デクセリアルズ	24,900	1,127.00	28,062,300
アース製薬	6,600	6,000.00	39,600,000
イハラケミカル工業	12,800	971.00	12,428,800
北興化学工業	14,000	473.00	6,622,000
大成ラミック	3,200	2,905.00	9,296,000
クミアイ化学工業	21,200	660.00	13,992,000
日本農薬	22,200	725.00	16,095,000
アキレス	8,700	1,782.00	15,503,400
有沢製作所	17,400	786.00	13,676,400
日東電工	67,900	8,404.00	570,631,600
レック	6,200	2,210.00	13,702,000
きもと	23,400	218.00	5,101,200
藤森工業	6,900	3,460.00	23,874,000
前澤化成工業	8,100	1,181.00	9,566,100

J S P	4,500	2,589.00	11,650,500
エフピコ	8,200	5,320.00	43,624,000
天馬	6,300	2,060.00	12,978,000
信越ポリマー	18,400	828.00	15,235,200
東リ	27,100	377.00	10,216,700
ニフコ	16,600	5,570.00	92,462,000
日本バルカー工業	8,600	1,917.00	16,486,200
ユニ・チャーム	191,500	2,713.50	519,635,250
協和発酵キリン	111,600	1,896.00	211,593,600
武田薬品工業	352,800	5,323.00	1,877,954,400
アステラス製薬	961,600	1,565.00	1,504,904,000
大日本住友製薬	66,300	1,819.00	120,599,700
塩野義製薬	119,400	5,728.00	683,923,200
田辺三菱製薬	108,700	2,254.00	245,009,800
あすか製薬	10,600	1,626.00	17,235,600
日本新薬	21,600	5,870.00	126,792,000
中外製薬	93,300	3,945.00	368,068,500
科研製薬	17,800	6,630.00	118,014,000
エーザイ	116,200	5,850.00	679,770,000
ロート製薬	46,300	2,069.00	95,794,700
小野薬品工業	214,600	2,256.50	484,244,900
久光製薬	26,600	5,710.00	151,886,000
持田製薬	6,500	8,290.00	53,885,000
参天製薬	169,800	1,569.00	266,416,200
扶桑薬品工業	4,200	2,886.00	12,121,200
日本ケミファ	1,800	5,230.00	9,414,000
ツムラ	32,000	3,575.00	114,400,000
日医工	22,700	1,729.00	39,248,300
キッセイ薬品工業	16,900	2,858.00	48,300,200
生化学工業	17,700	1,727.00	30,567,900
栄研化学	8,100	2,977.00	24,113,700
鳥居薬品	6,200	2,878.00	17,843,600
J C R ファーマ	7,600	2,377.00	18,065,200
東和薬品	4,400	5,570.00	24,508,000
富士製薬工業	3,500	3,440.00	12,040,000
沢井製薬	16,200	6,100.00	98,820,000
ゼリア新薬工業	19,600	1,693.00	33,182,800
第一三共	277,500	2,451.50	680,291,250
キョーリン製薬ホールディングス	23,100	2,315.00	53,476,500
大幸薬品	5,500	1,826.00	10,043,000
ダイト	6,300	2,270.00	14,301,000
大塚ホールディングス	202,500	5,180.00	1,048,950,000

大正製薬ホールディングス	20,000	9,100.00	182,000,000	
ペプチドリーム	17,400	6,730.00	117,102,000	
日本コークス工業	90,300	97.00	8,759,100	
昭和シェル石油	84,800	1,077.00	91,329,600	
ニチレキ	13,300	956.00	12,714,800	
ユシロ化学工業	6,700	1,388.00	9,299,600	
ビーピー・カストロール	5,200	1,734.00	9,016,800	
MORESCO	4,200	1,888.00	7,929,600	
出光興産	44,800	3,590.00	160,832,000	
JXTGホールディングス	1,434,700	500.10	717,493,470	
コスモエネルギーホールディングス	27,500	1,779.00	48,922,500	
横浜ゴム	57,000	2,206.00	125,742,000	
東洋ゴム工業	50,100	1,966.00	98,496,600	
ブリヂストン	317,500	4,675.00	1,484,312,500	
住友ゴム工業	87,800	2,004.00	175,951,200	
藤倉ゴム工業	10,400	681.00	7,082,400	
オカモト	29,000	1,211.00	35,119,000	
ニッタ	8,400	3,145.00	26,418,000	
住友理工	17,600	1,125.00	19,800,000	
三ツ星ベルト	24,000	1,070.00	25,680,000	
バンドー化学	17,400	1,015.00	17,661,000	
日東紡績	77,000	552.00	42,504,000	
旭硝子	462,000	955.00	441,210,000	
日本板硝子	41,500	852.00	35,358,000	
日本山村硝子	49,000	190.00	9,310,000	
日本電気硝子	194,000	696.00	135,024,000	
オハラ	4,700	1,122.00	5,273,400	
住友大阪セメント	175,000	481.00	84,175,000	
太平洋セメント	568,000	384.00	218,112,000	
日本ヒューム	11,600	689.00	7,992,400	
日本コンクリート工業	26,400	351.00	9,266,400	
三谷セキサン	5,100	2,640.00	13,464,000	
アジアパイルホールディングス	13,800	601.00	8,293,800	
東海カーボン	88,000	493.00	43,384,000	
日本カーボン	48,000	314.00	15,072,000	
東洋炭素	6,100	1,775.00	10,827,500	
ノリタケカンパニーリミテド	5,300	3,005.00	15,926,500	
TOTO	68,800	4,285.00	294,808,000	
日本碍子	118,600	2,442.00	289,621,200	
日本特殊陶業	81,000	2,444.00	197,964,000	
MARUWA	3,800	3,995.00	15,181,000	
品川リフラクトリーズ	28,000	301.00	8,428,000	

黒崎播磨	23,000	427.00	9,821,000
ニッカトー	8,200	423.00	3,468,600
フジミインコーポレーテッド	8,200	2,149.00	17,621,800
ニチアス	49,000	1,142.00	55,958,000
ニチハ	12,500	3,425.00	42,812,500
新日鐵住金	424,200	2,564.00	1,087,648,800
神戸製鋼所	162,500	1,020.00	165,750,000
中山製鋼所	12,400	703.00	8,717,200
合同製鐵	6,000	1,658.00	9,948,000
ジェイ エフ イー ホールディングス	257,300	1,901.50	489,255,950
日新製鋼	43,300	1,388.00	60,100,400
東京製鐵	47,600	821.00	39,079,600
共英製鋼	9,900	1,849.00	18,305,100
大和工業	18,900	2,789.00	52,712,100
東京鐵鋼	23,000	418.00	9,614,000
大阪製鐵	6,200	2,054.00	12,734,800
淀川製鋼所	12,300	2,919.00	35,903,700
東洋鋼鋳	24,300	382.00	9,282,600
丸一鋼管	31,200	3,185.00	99,372,000
モリ工業	3,800	2,121.00	8,059,800
大同特殊鋼	158,000	539.00	85,162,000
日本冶金工業	79,900	205.00	16,379,500
山陽特殊製鋼	56,000	590.00	33,040,000
愛知製鋼	5,400	4,400.00	23,760,000
日立金属	95,200	1,543.00	146,893,600
日本金属	3,600	1,412.00	5,083,200
大平洋金属	61,000	369.00	22,509,000
新日本電工	54,900	338.00	18,556,200
栗本鐵工所	5,400	2,160.00	11,664,000
虹技	21,000	224.00	4,704,000
三菱製鋼	66,000	233.00	15,378,000
日亜鋼業	21,100	266.00	5,612,600
シンニッタン	9,700	719.00	6,974,300
大紀アルミニウム工業所	19,000	497.00	9,443,000
日本軽金属ホールディングス	234,200	244.00	57,144,800
三井金属鋳業	260,000	382.00	99,320,000
東邦亜鉛	56,000	499.00	27,944,000
三菱マテリアル	59,000	3,370.00	198,830,000
住友金属鋳山	245,000	1,502.00	367,990,000
DOWAホールディングス	105,000	829.00	87,045,000
古河機械金属	150,000	214.00	32,100,000
大阪チタニウムテクノロジーズ	11,700	1,678.00	19,632,600

東邦チタニウム	18,300	837.00	15,317,100
U A C J	127,000	302.00	38,354,000
古河電気工業	31,800	4,330.00	137,694,000
住友電気工業	355,400	1,820.00	646,828,000
フジクラ	124,900	824.00	102,917,600
タツタ電線	20,100	549.00	11,034,900
平河ヒューテック	6,000	1,283.00	7,698,000
リョービ	59,000	493.00	29,087,000
アーレスティ	11,800	1,119.00	13,204,200
アサヒホールディングス	14,500	2,063.00	29,913,500
稲葉製作所	6,900	1,367.00	9,432,300
宮地エンジニアリンググループ	35,000	213.00	7,455,000
トーカロ	6,700	2,955.00	19,798,500
S U M C O	98,800	1,915.00	189,202,000
川田テクノロジーズ	1,900	7,230.00	13,737,000
東洋製罐グループホールディングス	67,000	1,865.00	124,955,000
ホッカンホールディングス	28,000	514.00	14,392,000
コロナ	7,300	1,132.00	8,263,600
横河ブリッジホールディングス	17,400	1,367.00	23,785,800
駒井ハルテック	2,700	2,109.00	5,694,300
三和ホールディングス	93,900	1,113.00	104,510,700
文化シャッター	26,800	853.00	22,860,400
三協立山	12,600	1,623.00	20,449,800
アルインコ	9,100	979.00	8,908,900
L I X I L グループ	131,000	2,744.00	359,464,000
日本フィルコン	11,700	593.00	6,938,100
ノーリツ	18,700	2,134.00	39,905,800
長府製作所	10,100	2,685.00	27,118,500
リンナイ	16,100	9,240.00	148,764,000
日東精工	17,500	459.00	8,032,500
岡部	20,100	992.00	19,939,200
ジーテクト	9,900	1,980.00	19,602,000
東プレ	18,300	2,940.00	53,802,000
高周波熱錬	18,700	908.00	16,979,600
東京製綱	7,600	1,699.00	12,912,400
パイオラックス	14,400	2,578.00	37,123,200
日本発條	89,400	1,252.00	111,928,800
三益半導体工業	8,700	1,724.00	14,998,800
日本製綱所	31,300	1,796.00	56,214,800
三浦工業	38,500	1,842.00	70,917,000
タクマ	29,900	1,113.00	33,278,700
ツガミ	25,000	837.00	20,925,000

オークマ	61,000	1,183.00	72,163,000
東芝機械	56,000	469.00	26,264,000
アマダホールディングス	125,800	1,332.00	167,565,600
アイダエンジニアリング	26,300	971.00	25,537,300
滝澤鉄工所	38,000	165.00	6,270,000
富士機械製造	27,700	1,394.00	38,613,800
牧野フライス製作所	46,000	1,008.00	46,368,000
オーエスジー	43,100	2,291.00	98,742,100
旭ダイヤモンド工業	26,600	851.00	22,636,600
D M G 森精機	56,100	1,801.00	101,036,100
ソディック	24,300	1,081.00	26,268,300
ディスコ	11,000	17,500.00	192,500,000
日東工器	6,100	2,599.00	15,853,900
O K K	54,000	118.00	6,372,000
津田駒工業	32,000	177.00	5,664,000
島精機製作所	12,300	4,015.00	49,384,500
フリュー	6,600	1,414.00	9,332,400
ヤマシンフィルタ	2,200	1,999.00	4,397,800
日阪製作所	14,700	981.00	14,420,700
やまびこ	17,100	1,344.00	22,982,400
ペガサスミシン製造	10,200	840.00	8,568,000
ナプテスコ	49,000	3,115.00	152,635,000
三井海洋開発	9,600	2,332.00	22,387,200
レオン自動機	8,500	1,016.00	8,636,000
S M C	28,200	31,280.00	882,096,000
新川	9,500	774.00	7,353,000
ホソカワミクロン	3,600	4,055.00	14,598,000
ユニオンツール	3,900	3,340.00	13,026,000
オイレス工業	12,000	1,995.00	23,940,000
日精エー・エス・ビー機械	3,200	2,878.00	9,209,600
サトーホールディングス	11,900	2,542.00	30,249,800
日精樹脂工業	8,700	1,082.00	9,413,400
ワイエイシイホールディングス	4,500	1,362.00	6,129,000
小松製作所	434,500	2,945.00	1,279,602,500
住友重機械工業	274,000	787.00	215,638,000
日立建機	41,900	2,798.00	117,236,200
日工	3,900	2,066.00	8,057,400
巴工業	5,000	1,774.00	8,870,000
井関農機	96,000	233.00	22,368,000
T O W A	7,900	1,890.00	14,931,000
丸山製作所	3,200	1,793.00	5,737,600
北川鉄工所	5,200	2,142.00	11,138,400

ローツェ	3,500	2,248.00	7,868,000
クボタ	450,400	1,749.00	787,749,600
三菱化工機	38,000	214.00	8,132,000
月島機械	17,300	1,197.00	20,708,100
帝国電機製作所	8,200	1,059.00	8,683,800
新東工業	21,700	959.00	20,810,300
澁谷工業	8,000	2,966.00	23,728,000
アイチ コーポレーション	14,900	834.00	12,426,600
小森コーポレーション	22,600	1,477.00	33,380,200
鶴見製作所	7,600	1,640.00	12,464,000
住友精密工業	22,000	363.00	7,986,000
酒井重工業	22,000	305.00	6,710,000
荏原製作所	42,600	3,355.00	142,923,000
西島製作所	11,200	1,041.00	11,659,200
北越工業	11,100	973.00	10,800,300
ダイキン工業	122,600	10,800.00	1,324,080,000
オルガノ	22,000	502.00	11,044,000
トーヨーカネツ	48,000	285.00	13,680,000
栗田工業	53,200	2,862.00	152,258,400
椿本チエイン	52,000	973.00	50,596,000
大同工業	24,000	277.00	6,648,000
アネスト岩田	16,800	982.00	16,497,600
ダイフク	44,700	2,752.00	123,014,400
加藤製作所	5,300	2,876.00	15,242,800
タダノ	47,600	1,439.00	68,496,400
フジテック	25,700	1,301.00	33,435,700
C K D	26,400	1,396.00	36,854,400
キトー	12,400	1,173.00	14,545,200
平和	27,900	2,853.00	79,598,700
理想科学工業	8,600	1,941.00	16,692,600
S A N K Y O	25,100	3,895.00	97,764,500
日本金銭機械	9,200	1,298.00	11,941,600
マースエンジニアリング	5,600	2,340.00	13,104,000
福島工業	5,400	3,915.00	21,141,000
オーイズミ	5,200	585.00	3,042,000
ダイコク電機	4,500	1,620.00	7,290,000
竹内製作所	16,200	1,989.00	32,221,800
アマノ	27,000	2,228.00	60,156,000
J U K I	14,000	1,287.00	18,018,000
サンデンホールディングス	56,000	352.00	19,712,000
蛇の目ミシン工業	10,600	778.00	8,246,800
マックス	14,000	1,518.00	21,252,000

グローリー	28,800	3,760.00	108,288,000
新晃工業	6,900	1,689.00	11,654,100
大和冷機工業	13,600	1,111.00	15,109,600
セガサミーホールディングス	89,300	1,510.00	134,843,000
日本ピストンリング	4,000	2,416.00	9,664,000
リケン	4,200	4,905.00	20,601,000
T P R	9,900	3,740.00	37,026,000
ツバキ・ナカシマ	10,100	1,929.00	19,482,900
ホシザキ	19,700	9,040.00	178,088,000
大豊工業	7,700	1,494.00	11,503,800
日本精工	183,800	1,576.00	289,668,800
N T N	208,000	569.00	118,352,000
ジェイテクト	94,900	1,822.00	172,907,800
不二越	91,000	599.00	54,509,000
日本トムソン	29,200	607.00	17,724,400
T H K	63,600	2,906.00	184,821,600
ユーシン精機	4,300	3,150.00	13,545,000
前澤給装工業	4,400	1,567.00	6,894,800
イーグル工業	9,400	1,570.00	14,758,000
日本ピラー工業	9,800	1,462.00	14,327,600
キッツ	42,500	773.00	32,852,500
日立工機	24,500	869.00	21,290,500
マキタ	116,800	4,010.00	468,368,000
日立造船	72,600	641.00	46,536,600
三菱重工業	1,508,000	455.30	686,592,400
I H I	692,000	379.00	262,268,000
スター精密	15,800	1,860.00	29,388,000
日清紡ホールディングス	50,400	1,137.00	57,304,800
イビデン	63,100	1,776.00	112,065,600
コニカミノルタ	209,300	995.00	208,253,500
ブラザー工業	116,100	2,298.00	266,797,800
ミネベアミツミ	164,000	1,603.00	262,892,000
日立製作所	2,159,000	618.50	1,335,341,500
東芝	1,833,000	220.90	404,909,700
三菱電機	959,200	1,538.50	1,475,729,200
富士電機	271,000	639.00	173,169,000
東洋電機製造	5,000	1,644.00	8,220,000
安川電機	103,800	2,085.00	216,423,000
シンフォニアテクノロジー	60,000	307.00	18,420,000
明電舎	84,000	401.00	33,684,000
オリジン電気	18,000	313.00	5,634,000
山洋電気	24,000	788.00	18,912,000

デンヨー	8,700	1,610.00	14,007,000
東芝テック	57,000	593.00	33,801,000
芝浦メカトロニクス	20,000	275.00	5,500,000
マブチモーター	25,300	6,240.00	157,872,000
日本電産	116,600	10,270.00	1,197,482,000
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	1,100	3,030.00	3,333,000
東光高岳	5,200	1,907.00	9,916,400
ダブル・スコープ	9,000	1,528.00	13,752,000
ダイヘン	50,000	708.00	35,400,000
田淵電機	15,800	330.00	5,214,000
ヤーマン	1,400	5,340.00	7,476,000
JVCケンウッド	67,000	301.00	20,167,000
ミマキエンジニアリング	9,700	666.00	6,460,200
第一精工	5,200	1,678.00	8,725,600
日新電機	18,500	1,319.00	24,401,500
大崎電気工業	18,000	948.00	17,064,000
オムロン	95,200	5,020.00	477,904,000
日東工業	12,900	1,591.00	20,523,900
I D E C	12,700	1,206.00	15,316,200
ジーエス・ユアサ コーポレーション	173,000	516.00	89,268,000
サクサホールディングス	30,000	212.00	6,360,000
メルコホールディングス	5,200	3,205.00	16,666,000
テクノメディカ	2,800	1,964.00	5,499,200
日本電気	1,236,000	279.00	344,844,000
富士通	868,000	685.40	594,927,200
沖電気工業	39,100	1,692.00	66,157,200
岩崎通信機	40,000	83.00	3,320,000
電気興業	27,000	554.00	14,958,000
サンケン電気	53,000	509.00	26,977,000
アイホン	5,700	1,761.00	10,037,700
ルネサスエレクトロニクス	46,200	1,138.00	52,575,600
セイコーエプソン	133,300	2,293.00	305,656,900
ワコム	71,900	416.00	29,910,400
アルバック	15,100	5,130.00	77,463,000
E I Z O	9,000	3,665.00	32,985,000
ジャパンディスプレイ	168,800	244.00	41,187,200
日本信号	25,100	1,065.00	26,731,500
京三製作所	28,000	437.00	12,236,000
能美防災	10,100	1,539.00	15,543,900
ホーチキ	7,500	1,430.00	10,725,000
エレコム	8,100	2,293.00	18,573,300
日本無線	6,200	1,418.00	8,791,600

パナソニック	1,032,000	1,360.00	1,403,520,000
アンリツ	66,500	805.00	53,532,500
富士通ゼネラル	30,000	2,246.00	67,380,000
日立国際電気	23,400	2,675.00	62,595,000
ソニー	634,800	3,742.00	2,375,421,600
T D K	50,500	6,990.00	352,995,000
タムラ製作所	35,000	516.00	18,060,000
アルプス電気	82,900	3,150.00	261,135,000
池上通信機	42,000	150.00	6,300,000
パイオニア	137,500	216.00	29,700,000
日本電波工業	12,100	814.00	9,849,400
日本トリム	2,500	3,810.00	9,525,000
ローランド ディー . ジー .	4,800	3,440.00	16,512,000
フォスター電機	10,800	1,885.00	20,358,000
クラリオン	48,000	439.00	21,072,000
S M K	27,000	402.00	10,854,000
ヨコオ	7,200	1,369.00	9,856,800
ホシデン	27,800	1,229.00	34,166,200
ヒロセ電機	14,500	15,100.00	218,950,000
日本航空電子工業	26,000	1,461.00	37,986,000
T O A	11,900	954.00	11,352,600
日立マクセル	13,400	2,057.00	27,563,800
古野電気	13,300	699.00	9,296,700
ユニデンホールディングス	38,000	164.00	6,232,000
アルパイン	21,900	1,588.00	34,777,200
スミダコーポレーション	8,200	1,374.00	11,266,800
アイコム	5,700	2,557.00	14,574,900
リオン	4,700	1,494.00	7,021,800
本多通信工業	3,700	1,350.00	4,995,000
船井電機	11,400	826.00	9,416,400
横河電機	97,400	1,712.00	166,748,800
新電元工業	35,000	507.00	17,745,000
アズビル	27,200	3,775.00	102,680,000
日本光電工業	37,800	2,504.00	94,651,200
チノー	5,500	1,239.00	6,814,500
共和電業	15,500	459.00	7,114,500
堀場製作所	17,900	6,530.00	116,887,000
アドバンテスト	61,300	2,191.00	134,308,300
エスベック	8,600	1,352.00	11,627,200
キーエンス	40,800	44,250.00	1,805,400,000
日置電機	5,600	2,159.00	12,090,400
シスメックス	69,700	6,630.00	462,111,000

日本マイクロニクス	17,600	923.00	16,244,800
メガチップス	8,600	2,944.00	25,318,400
O B A R A G R O U P	5,300	5,050.00	26,765,000
コーセル	12,600	1,431.00	18,030,600
イリソ電子工業	2,900	6,970.00	20,213,000
オブテックスグループ	7,000	3,065.00	21,455,000
千代田インテグレ	5,000	2,401.00	12,005,000
アイ・オー・データ機器	3,600	1,131.00	4,071,600
レーザーテック	19,800	1,426.00	28,234,800
スタンレー電気	63,900	3,190.00	203,841,000
岩崎電気	44,000	168.00	7,392,000
ウシオ電機	55,000	1,394.00	76,670,000
ハリオス テクノ ホールディング	10,600	614.00	6,508,400
日本セラミック	7,600	2,369.00	18,004,400
遠藤照明	7,400	918.00	6,793,200
古河電池	8,000	724.00	5,792,000
山一電機	8,800	1,462.00	12,865,600
図研	7,300	1,313.00	9,584,900
日本電子	34,000	537.00	18,258,000
カシオ計算機	72,700	1,592.00	115,738,400
ファナック	91,200	23,265.00	2,121,768,000
日本シイエムケイ	21,800	681.00	14,845,800
エンプラス	4,400	3,090.00	13,596,000
大真空	3,900	1,355.00	5,284,500
ローム	43,400	7,890.00	342,426,000
浜松ホトニクス	70,100	3,255.00	228,175,500
三井ハイテック	12,600	1,050.00	13,230,000
新光電気工業	33,700	794.00	26,757,800
京セラ	147,600	6,318.00	932,536,800
太陽誘電	44,100	1,369.00	60,372,900
村田製作所	94,300	15,080.00	1,422,044,000
ユーシン	14,100	788.00	11,110,800
双葉電子工業	14,700	1,993.00	29,297,100
北陸電気工業	50,000	135.00	6,750,000
ニチコン	28,200	1,037.00	29,243,400
日本ケミコン	78,000	370.00	28,860,000
K O A	12,900	1,848.00	23,839,200
市光工業	20,000	564.00	11,280,000
小糸製作所	53,500	5,740.00	307,090,000
ミツバ	16,500	2,132.00	35,178,000
S C R E E Nホールディングス	18,500	8,000.00	148,000,000
キャノン電子	7,200	2,042.00	14,702,400

キヤノン	483,800	3,598.00	1,740,712,400	
リコー	269,400	932.00	251,080,800	
東京エレクトロン	60,000	13,020.00	781,200,000	
トヨタ紡織	31,100	2,495.00	77,594,500	
芦森工業	33,000	158.00	5,214,000	
ユニプレス	17,100	2,383.00	40,749,300	
豊田自動織機	81,800	5,570.00	455,626,000	
モリタホールディングス	15,600	1,634.00	25,490,400	
三櫻工業	14,800	799.00	11,825,200	
デンソー	221,400	5,031.00	1,113,863,400	
東海理化電機製作所	23,700	2,142.00	50,765,400	
三井造船	325,000	172.00	55,900,000	
川崎重工業	700,000	339.00	237,300,000	
名村造船所	26,900	738.00	19,852,200	
日本車輛製造	40,000	314.00	12,560,000	
ニチユ三菱フォークリフト	13,000	679.00	8,827,000	
日産自動車	1,060,300	1,075.00	1,139,822,500	
いすゞ自動車	261,700	1,492.00	390,456,400	
トヨタ自動車	1,093,300	6,154.00	6,728,168,200	代用有価証券 500,000株
日野自動車	127,800	1,366.00	174,574,800	
三菱自動車工業	329,600	714.00	235,334,400	
エフテック	6,600	1,347.00	8,890,200	
武蔵精密工業	10,500	2,784.00	29,232,000	
日産車体	39,400	1,053.00	41,488,200	
新明和工業	36,000	1,064.00	38,304,000	
極東開発工業	18,200	1,882.00	34,252,400	
日信工業	19,700	1,996.00	39,321,200	
トピー工業	7,500	2,931.00	21,982,500	
ティラド	43,000	327.00	14,061,000	
曙ブレーキ工業	42,100	329.00	13,850,900	
タチエス	15,500	2,157.00	33,433,500	
N O K	43,400	2,659.00	115,400,600	
フタバ産業	27,600	769.00	21,224,400	
K Y B	101,000	557.00	56,257,000	
大同メタル工業	13,500	985.00	13,297,500	
プレス工業	48,400	545.00	26,378,000	
ミクニ	16,500	430.00	7,095,000	
太平洋工業	18,300	1,500.00	27,450,000	
ケーヒン	20,800	1,760.00	36,608,000	
河西工業	12,400	1,386.00	17,186,400	
アイシン精機	81,900	5,290.00	433,251,000	
富士機工	12,100	599.00	7,247,900	

マツダ	285,500	1,636.00	467,078,000
今仙電機製作所	10,800	1,013.00	10,940,400
本田技研工業	808,600	3,256.00	2,632,801,600
スズキ	178,600	4,629.00	826,739,400
S U B A R U	279,400	4,264.00	1,191,361,600
安永	3,700	1,469.00	5,435,300
ヤマハ発動機	126,500	2,622.00	331,683,000
ショーワ	23,300	968.00	22,554,400
T B K	14,900	489.00	7,286,100
エクセディ	11,800	3,080.00	36,344,000
豊田合成	29,000	2,839.00	82,331,000
愛三工業	15,900	919.00	14,612,100
ヨロズ	8,500	1,720.00	14,620,000
エフ・シー・シー	14,900	2,202.00	32,809,800
シマノ	36,200	17,250.00	624,450,000
テイ・エス テック	21,000	2,941.00	61,761,000
ジャムコ	5,800	2,662.00	15,439,600
テルモ	137,900	4,045.00	557,805,500
日機装	30,900	1,118.00	34,546,200
島津製作所	115,400	1,876.00	216,490,400
J M S	23,000	331.00	7,613,000
ブイ・テクノロジー	1,900	16,810.00	31,939,000
東京計器	39,000	230.00	8,970,000
愛知時計電機	1,900	3,720.00	7,068,000
東京精密	17,100	3,495.00	59,764,500
マニー	12,100	2,826.00	34,194,600
ニコン	156,800	1,602.00	251,193,600
トプコン	45,100	1,959.00	88,350,900
オリンパス	143,100	4,260.00	609,606,000
理研計器	8,600	1,647.00	14,164,200
タムロン	8,200	2,063.00	16,916,600
H O Y A	185,300	5,343.00	990,057,900
ノーリツ鋼機	10,600	842.00	8,925,200
シチズン時計	98,600	738.00	72,766,800
リズム時計工業	50,000	189.00	9,450,000
大研医器	9,800	802.00	7,859,600
メニコン	6,100	3,425.00	20,892,500
松風	6,500	1,308.00	8,502,000
セイコーホールディングス	62,000	468.00	29,016,000
ニプロ	62,400	1,670.00	104,208,000
スノーピーク	1,700	3,090.00	5,253,000
パラマウントベッドホールディングス	8,600	4,640.00	39,904,000

トランザクション	4,800	930.00	4,464,000
ニホンフラッシュ	5,200	1,336.00	6,947,200
前田工織	9,800	1,470.00	14,406,000
永大産業	15,000	510.00	7,650,000
アートネイチャー	12,800	730.00	9,344,000
ダンロップスポーツ	7,900	1,052.00	8,310,800
バンダイナムコホールディングス	99,000	3,460.00	342,540,000
S H O E I	4,500	3,160.00	14,220,000
フランスベッドホールディングス	13,900	938.00	13,038,200
パイロットコーポレーション	15,600	4,495.00	70,122,000
萩原工業	3,400	2,641.00	8,979,400
トッパン・フォームズ	15,100	1,137.00	17,168,700
フジシールインターナショナル	20,000	2,644.00	52,880,000
タカラトミー	35,000	1,121.00	39,235,000
アーク	47,100	101.00	4,757,100
プロネクサス	9,800	1,419.00	13,906,200
大建工業	7,300	2,055.00	15,001,500
凸版印刷	254,000	1,122.00	284,988,000
大日本印刷	257,000	1,228.00	315,596,000
図書印刷	14,000	502.00	7,028,000
共同印刷	32,000	366.00	11,712,000
日本写真印刷	14,900	2,794.00	41,630,600
宝印刷	5,900	1,725.00	10,177,500
アシックス	89,000	1,992.00	177,288,000
ツツミ	3,700	2,047.00	7,573,900
小松ウオール工業	4,000	2,026.00	8,104,000
ヤマハ	60,400	3,195.00	192,978,000
河合楽器製作所	4,200	2,352.00	9,878,400
クリナップ	12,400	812.00	10,068,800
ピジョン	54,300	3,510.00	190,593,000
キングジム	8,000	881.00	7,048,000
リンテック	21,500	2,440.00	52,460,000
T A S A K I	2,000	2,196.00	4,392,000
イトーキ	21,000	711.00	14,931,000
任天堂	55,400	27,620.00	1,530,148,000
三菱鉛筆	7,200	5,550.00	39,960,000
タカラスタンド	18,300	1,864.00	34,111,200
コクヨ	46,700	1,413.00	65,987,100
ナカバヤシ	18,000	266.00	4,788,000
グローブライド	5,300	1,947.00	10,319,100
岡村製作所	31,200	967.00	30,170,400
美津濃	47,000	578.00	27,166,000

東京電力ホールディングス	760,600	443.00	336,945,800
中部電力	297,000	1,495.00	444,015,000
関西電力	367,300	1,455.50	534,605,150
中国電力	123,200	1,232.00	151,782,400
北陸電力	88,100	1,055.00	92,945,500
東北電力	224,500	1,521.00	341,464,500
四国電力	81,200	1,285.00	104,342,000
九州電力	197,900	1,212.00	239,854,800
北海道電力	84,500	809.00	68,360,500
沖縄電力	13,000	2,609.00	33,917,000
電源開発	71,500	2,600.00	185,900,000
エフオン	4,500	883.00	3,973,500
イーレックス	12,100	1,323.00	16,008,300
東京瓦斯	965,000	533.70	515,020,500
大阪瓦斯	874,000	433.90	379,228,600
東邦瓦斯	224,000	803.00	179,872,000
北海道瓦斯	24,000	272.00	6,528,000
広島ガス	20,400	357.00	7,282,800
西部瓦斯	100,000	255.00	25,500,000
静岡ガス	26,800	765.00	20,502,000
メタウォーター	5,100	2,876.00	14,667,600
SBSホールディングス	9,900	805.00	7,969,500
東武鉄道	477,000	580.00	276,660,000
相鉄ホールディングス	144,000	535.00	77,040,000
東京急行電鉄	489,000	813.00	397,557,000
京浜急行電鉄	247,000	1,278.00	315,666,000
小田急電鉄	143,300	2,207.00	316,263,100
京王電鉄	249,000	914.00	227,586,000
京成電鉄	67,200	2,739.00	184,060,800
富士急行	25,000	1,017.00	25,425,000
新京成電鉄	14,000	417.00	5,838,000
東日本旅客鉄道	173,800	10,000.00	1,738,000,000
西日本旅客鉄道	86,700	7,497.00	649,989,900
東海旅客鉄道	74,700	19,095.00	1,426,396,500
西武ホールディングス	124,400	1,999.00	248,675,600
鴻池運輸	12,300	1,496.00	18,400,800
西日本鉄道	108,000	478.00	51,624,000
ハマキョウレックス	6,400	2,335.00	14,944,000
サカイ引越センター	3,400	3,365.00	11,441,000
近鉄グループホールディングス	905,000	411.00	371,955,000
阪急阪神ホールディングス	113,600	3,730.00	423,728,000
南海電気鉄道	190,000	553.00	105,070,000

京阪ホールディングス	201,000	713.00	143,313,000
神戸電鉄	25,000	384.00	9,600,000
名古屋鉄道	328,000	517.00	169,576,000
山陽電気鉄道	33,000	580.00	19,140,000
日本通運	346,000	599.00	207,254,000
ヤマトホールディングス	161,200	2,420.00	390,104,000
山九	119,000	710.00	84,490,000
丸全昭和運輸	33,000	442.00	14,586,000
センコーグループホールディングス	42,400	732.00	31,036,800
トナミホールディングス	23,000	384.00	8,832,000
ニッコンホールディングス	30,600	2,339.00	71,573,400
福山通運	54,000	680.00	36,720,000
セイノーホールディングス	63,600	1,302.00	82,807,200
神奈川中央交通	13,000	717.00	9,321,000
日立物流	18,000	2,454.00	44,172,000
丸和運輸機関	2,700	2,580.00	6,966,000
C & F ロジホールディングス	9,700	1,445.00	14,016,500
九州旅客鉄道	67,100	3,450.00	231,495,000
日本郵船	759,000	228.00	173,052,000
商船三井	471,000	347.00	163,437,000
川崎汽船	345,000	289.00	99,705,000
N S ユナイテッド海運	45,000	230.00	10,350,000
飯野海運	49,200	463.00	22,779,600
乾汽船	9,000	910.00	8,190,000
日本航空	162,000	3,481.00	563,922,000
A N A ホールディングス	1,668,000	338.00	563,784,000
パスコ	10,000	357.00	3,570,000
トランコム	2,800	5,690.00	15,932,000
日新	40,000	378.00	15,120,000
三菱倉庫	59,000	1,468.00	86,612,000
三井倉庫ホールディングス	56,000	335.00	18,760,000
住友倉庫	68,000	690.00	46,920,000
澁澤倉庫	31,000	346.00	10,726,000
東陽倉庫	21,200	292.00	6,190,400
日本トランスシティ	25,000	478.00	11,950,000
安田倉庫	10,400	730.00	7,592,000
東洋埠頭	38,000	175.00	6,650,000
上組	107,000	1,019.00	109,033,000
キューソー流通システム	3,100	2,559.00	7,932,900
郵船ロジスティクス	9,100	1,102.00	10,028,200
近鉄エクスプレス	16,200	1,699.00	27,523,800
エーアイティー	7,600	1,010.00	7,676,000

NEC ネットエスアイ	9,600	2,227.00	21,379,200
システナ	8,000	1,907.00	15,256,000
デジタルアーツ	4,300	3,025.00	13,007,500
新日鉄住金ソリューションズ	14,500	2,256.00	32,712,000
コア	4,900	1,352.00	6,624,800
ソフトクリエイティブホールディングス	6,200	1,408.00	8,729,600
T I S	29,600	2,832.00	83,827,200
電算システム	4,100	1,688.00	6,920,800
グリー	54,100	880.00	47,608,000
コーエーテクモホールディングス	20,900	2,258.00	47,192,200
三菱総合研究所	3,900	3,285.00	12,811,500
ファインデックス	8,000	990.00	7,920,000
ヒト・コミュニケーションズ	2,700	1,699.00	4,587,300
ブレインパッド	2,000	1,065.00	2,130,000
K L a b	18,000	792.00	14,256,000
ポルトゥウィン・ピットクルーホールディングス	7,600	1,373.00	10,434,800
ネクソン	97,400	1,875.00	182,625,000
アイスタイル	15,300	906.00	13,861,800
エイチーム	5,200	2,940.00	15,288,000
テクノスジャパン	7,600	1,027.00	7,805,200
コロプラ	25,700	1,066.00	27,396,200
モバイルクリエイティブ	9,100	362.00	3,294,200
ブロードリーフ	22,000	717.00	15,774,000
ハーツユナイテッドグループ	5,100	1,382.00	7,048,200
メディアドゥ	2,200	2,935.00	6,457,000
ブイキューブ	3,700	585.00	2,164,500
ディー・エル・イー	4,200	562.00	2,360,400
フィックスターズ	1,600	2,832.00	4,531,200
VOYAGE GROUP	3,800	2,072.00	7,873,600
オブティム	2,200	2,692.00	5,922,400
ベリサーブ	1,300	2,668.00	3,468,400
ティーガイア	8,600	1,918.00	16,494,800
日本アジアグループ	14,400	385.00	5,544,000
豆蔵ホールディングス	8,100	874.00	7,079,400
テクマトリックス	6,700	1,462.00	9,795,400
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	185,400	253.00	46,906,200
GMOペイメントゲートウェイ	7,400	4,845.00	35,853,000
インターネットイニシアティブ	13,500	2,013.00	27,175,500
さくらインターネット	7,700	854.00	6,575,800
SRAホールディングス	5,100	2,885.00	14,713,500
フリービット	6,000	864.00	5,184,000
コムチュア	1,900	3,760.00	7,144,000

メディカル・データ・ビジョン	3,400	2,066.00	7,024,400
gumi	10,600	1,047.00	11,098,200
PCIホールディングス	1,300	2,488.00	3,234,400
LINE	14,800	4,220.00	62,456,000
AOI TYO Holdings	8,600	815.00	7,009,000
フェイス	4,600	1,177.00	5,414,200
野村総合研究所	66,200	4,005.00	265,131,000
サイバネットシステム	9,300	711.00	6,612,300
インタージホールディングス	6,200	2,060.00	12,772,000
ソースネクスト	7,000	536.00	3,752,000
クレスコ	2,700	2,846.00	7,684,200
フジ・メディア・ホールディングス	92,500	1,589.00	146,982,500
オービック	30,700	5,960.00	182,972,000
ジャストシステム	14,500	1,329.00	19,270,500
TDCソフトウェアエンジニアリング	5,000	1,307.00	6,535,000
ヤフー	635,800	525.00	333,795,000
トレンドマイクロ	47,100	5,010.00	235,971,000
日本オラクル	14,300	6,420.00	91,806,000
アルファシステムズ	4,200	1,875.00	7,875,000
フューチャー	14,200	873.00	12,396,600
CAC Holdings	9,300	1,058.00	9,839,400
ソフトバンク・テクノロジー	2,500	3,690.00	9,225,000
オービックビジネスコンサルタント	4,600	5,520.00	25,392,000
伊藤忠テクノソリューションズ	20,400	3,240.00	66,096,000
アイティフォー	14,900	594.00	8,850,600
大塚商会	23,800	6,130.00	145,894,000
サイボウズ	16,700	448.00	7,481,600
ソフトブレーン	13,300	531.00	7,062,300
電通国際情報サービス	5,900	2,530.00	14,927,000
デジタルガレージ	13,300	2,319.00	30,842,700
EMシステムズ	4,400	1,814.00	7,981,600
ウェザーニューズ	3,700	3,735.00	13,819,500
日本エンタープライズ	12,000	252.00	3,024,000
WOWOW	4,100	3,735.00	15,313,500
スカラ	6,800	824.00	5,603,200
イマジカ・ロボットホールディングス	9,100	684.00	6,224,400
ネットワンシステムズ	39,200	921.00	36,103,200
システムソフト	19,000	133.00	2,527,000
アルゴグラフィックス	4,800	2,415.00	11,592,000
マーベラス	15,700	933.00	14,648,100
エイベックス・グループ・ホールディングス	16,600	1,631.00	27,074,600
日本ユニシス	24,400	1,553.00	37,893,200

兼松エレクトロニクス	5,500	2,936.00	16,148,000
東京放送ホールディングス	58,800	2,006.00	117,952,800
日本テレビホールディングス	80,900	1,878.00	151,930,200
朝日放送	11,600	761.00	8,827,600
テレビ朝日ホールディングス	24,700	2,084.00	51,474,800
スカパーJ S A Tホールディングス	57,600	502.00	28,915,200
テレビ東京ホールディングス	7,400	2,475.00	18,315,000
ワイヤレスゲート	4,000	1,411.00	5,644,000
コネクシオ	8,300	1,658.00	13,761,400
日本通信	42,800	174.00	7,447,200
日本電信電話	712,700	4,711.00	3,357,529,700
K D D I	878,300	2,887.50	2,536,091,250
光通信	10,600	10,780.00	114,268,000
N T T ドコモ	663,500	2,581.00	1,712,493,500
エムティーアイ	15,600	657.00	10,249,200
G M O インターネット	32,500	1,275.00	41,437,500
カドカワ	25,700	1,576.00	40,503,200
学研ホールディングス	3,600	3,060.00	11,016,000
ゼンリン	12,100	2,099.00	25,397,900
アイネット	7,000	1,275.00	8,925,000
松竹	59,000	1,278.00	75,402,000
東宝	58,000	3,220.00	186,760,000
東映	33,000	958.00	31,614,000
エヌ・ティ・ティ・データ	54,500	5,190.00	282,855,000
D T S	9,100	2,894.00	26,335,400
スクウェア・エニックス・ホールディングス	34,300	3,250.00	111,475,000
シーイーシー	5,700	2,127.00	12,123,900
カプコン	21,100	2,306.00	48,656,600
ジャステック	8,100	1,228.00	9,946,800
S C S K	24,200	4,525.00	109,505,000
日本システムウエア	3,900	1,453.00	5,666,700
アイネス	13,000	1,084.00	14,092,000
T K C	8,300	3,010.00	24,983,000
富士ソフト	13,100	2,917.00	38,212,700
N S D	17,900	1,667.00	29,839,300
コナミホールディングス	40,200	4,650.00	186,930,000
福井コンピュータホールディングス	3,000	2,892.00	8,676,000
J B C C ホールディングス	11,000	805.00	8,855,000
ミロク情報サービス	7,200	2,143.00	15,429,600
ソフトバンクグループ	399,600	8,366.00	3,343,053,600
伊藤忠食品	2,500	4,675.00	11,687,500
エレマテック	4,400	1,850.00	8,140,000

JALUX	3,500	2,534.00	8,869,000
あらた	4,100	3,050.00	12,505,000
東京エレクトロン デバイス	4,200	1,632.00	6,854,400
フィールズ	8,100	1,283.00	10,392,300
双日	525,500	282.00	148,191,000
アルフレッサ ホールディングス	104,700	2,002.00	209,609,400
横浜冷凍	23,300	1,108.00	25,816,400
アルコニックス	6,300	1,954.00	12,310,200
神戸物産	4,900	4,300.00	21,070,000
あい ホールディングス	12,700	2,792.00	35,458,400
ダイワボウホールディングス	76,000	323.00	24,548,000
マクニカ・富士エレホールディングス	16,100	1,611.00	25,937,100
バイタルケーエスケー・ホールディングス	17,100	990.00	16,929,000
UKCホールディングス	6,200	2,016.00	12,499,200
TOKAIホールディングス	40,600	849.00	34,469,400
三洋貿易	5,400	2,071.00	11,183,400
ウイン・パートナーズ	7,100	975.00	6,922,500
シップヘルスケアホールディングス	17,200	2,905.00	49,966,000
コメダホールディングス	12,900	1,955.00	25,219,500
小野建	8,900	1,519.00	13,519,100
佐島電機	9,200	813.00	7,479,600
伯東	8,400	1,191.00	10,004,400
コンドーテック	8,900	916.00	8,152,400
ナガイレーベン	13,100	2,500.00	32,750,000
三菱食品	9,400	3,575.00	33,605,000
松田産業	7,300	1,471.00	10,738,300
第一興商	14,900	4,745.00	70,700,500
メディバルホールディングス	88,800	1,848.00	164,102,400
萩原電気	4,200	2,245.00	9,429,000
アズワン	7,100	4,795.00	34,044,500
尾家産業	4,400	1,134.00	4,989,600
シモジマ	7,100	1,137.00	8,072,700
ドウシシャ	10,800	2,234.00	24,127,200
小津産業	2,400	2,252.00	5,404,800
高速	6,400	1,099.00	7,033,600
黒田電気	11,800	2,324.00	27,423,200
丸文	10,900	720.00	7,848,000
ハピネット	8,000	1,803.00	14,424,000
日本ライフライン	7,900	2,250.00	17,775,000
エクセル	5,100	1,436.00	7,323,600
マルカキカイ	3,800	1,806.00	6,862,800
IDOM	25,100	577.00	14,482,700

日本エム・ディ・エム	8,300	753.00	6,249,900
進和	6,100	1,881.00	11,474,100
シークス	6,400	4,455.00	28,512,000
オーハシテクニカ	6,600	1,376.00	9,081,600
伊藤忠商事	650,200	1,565.50	1,017,888,100
丸紅	877,000	673.00	590,221,000
長瀬産業	54,000	1,618.00	87,372,000
蝶理	6,500	1,985.00	12,902,500
豊田通商	98,900	3,405.00	336,754,500
三共生興	20,300	385.00	7,815,500
兼松	187,000	222.00	41,514,000
三井物産	803,500	1,570.50	1,261,896,750
日本紙パルプ商事	47,000	381.00	17,907,000
日立ハイテクノロジーズ	30,900	4,590.00	141,831,000
カメイ	11,900	1,223.00	14,553,700
スターゼン	4,000	4,495.00	17,980,000
山善	33,500	1,034.00	34,639,000
住友商事	560,200	1,476.00	826,855,200
内田洋行	5,300	2,425.00	12,852,500
三菱商事	666,200	2,405.00	1,602,211,000
第一実業	22,000	699.00	15,378,000
キャノンマーケティングジャパン	25,700	2,297.00	59,032,900
西華産業	35,000	350.00	12,250,000
佐藤商事	9,300	858.00	7,979,400
菱洋エレクトロ	9,100	1,597.00	14,532,700
東京産業	12,500	451.00	5,637,500
ユアサ商事	8,300	3,145.00	26,103,500
阪和興業	90,000	787.00	70,830,000
カナデン	10,600	1,079.00	11,437,400
菱電商事	17,000	714.00	12,138,000
フルサト工業	6,200	1,661.00	10,298,200
岩谷産業	101,000	652.00	65,852,000
すてきナイスグループ	56,000	163.00	9,128,000
三愛石油	23,800	958.00	22,800,400
稲畑産業	20,800	1,369.00	28,475,200
G S I クレオス	34,000	145.00	4,930,000
ワキタ	19,900	1,267.00	25,213,300
東邦ホールディングス	28,900	2,425.00	70,082,500
サンゲツ	31,500	1,961.00	61,771,500
ミツウロコグループホールディングス	17,100	704.00	12,038,400
シナネンホールディングス	5,100	2,229.00	11,367,900
伊藤忠エネクス	19,000	922.00	17,518,000

サンリオ	27,800	2,039.00	56,684,200
サンワテクノス	6,900	1,204.00	8,307,600
リョーサン	13,800	3,660.00	50,508,000
新光商事	11,400	1,289.00	14,694,600
トーホー	4,900	2,744.00	13,445,600
三信電気	11,300	1,320.00	14,916,000
東陽テクニカ	10,200	1,057.00	10,781,400
モスフードサービス	11,600	3,495.00	40,542,000
加賀電子	8,200	1,963.00	16,096,600
ソーダニッカ	12,800	517.00	6,617,600
立花エレテック	7,000	1,370.00	9,590,000
PALTAC	13,900	3,230.00	44,897,000
三谷産業	15,900	383.00	6,089,700
太平洋興発	63,000	97.00	6,111,000
ヤマタネ	4,400	1,544.00	6,793,600
日鉄住金物産	7,500	4,545.00	34,087,500
トラスコ中山	19,900	2,509.00	49,929,100
オートバックスセブン	34,300	1,685.00	57,795,500
加藤産業	13,600	2,711.00	36,869,600
イノテック	11,100	620.00	6,882,000
イエローハット	8,600	2,537.00	21,818,200
J Kホールディングス	12,800	665.00	8,512,000
日伝	4,300	3,445.00	14,813,500
杉本商事	6,700	1,550.00	10,385,000
因幡電機産業	12,300	4,060.00	49,938,000
バイテックホールディングス	5,600	1,330.00	7,448,000
ミスミグループ本社	100,200	2,072.00	207,614,400
タキヒヨー	20,000	454.00	9,080,000
スズケン	40,400	3,725.00	150,490,000
ジェコス	7,900	1,123.00	8,871,700
ローソン	28,000	7,340.00	205,520,000
サンエー	6,500	5,040.00	32,760,000
カワチ薬品	7,100	3,070.00	21,797,000
エービーシー・マート	16,200	6,360.00	103,032,000
ハードオフコーポレーション	6,200	1,054.00	6,534,800
アスクル	9,300	3,125.00	29,062,500
ゲオホールディングス	15,200	1,219.00	18,528,800
アダストリア	13,900	2,785.00	38,711,500
くらコーポレーション	5,800	4,620.00	26,796,000
キャンドウ	6,200	1,683.00	10,434,600
パルグループホールディングス	5,000	2,800.00	14,000,000
エディオン	33,600	1,084.00	36,422,400

サーラコーポレーション	15,100	632.00	9,543,200
ハローズ	3,400	2,328.00	7,915,200
あみやき亭	2,200	4,215.00	9,273,000
ひらまつ	16,100	646.00	10,400,600
ゲンキー	3,800	2,844.00	10,807,200
大黒天物産	2,500	5,240.00	13,100,000
ハニーズホールディングス	9,500	1,120.00	10,640,000
アルペン	7,600	2,008.00	15,260,800
クオール	10,600	1,497.00	15,868,200
ジーンズ	6,100	6,100.00	37,210,000
ビックカメラ	50,100	1,105.00	55,360,500
D C Mホールディングス	53,700	984.00	52,840,800
Monotaro	31,600	3,610.00	114,076,000
アークランドサービスホールディングス	3,100	3,130.00	9,703,000
J.フロント リテイリング	111,900	1,639.00	183,404,100
ドトール・日レスホールディングス	15,500	2,327.00	36,068,500
マツモトキヨシホールディングス	16,800	5,540.00	93,072,000
ブロンコビリー	4,900	2,550.00	12,495,000
スタートトゥデイ	81,600	2,336.00	190,617,600
物語コーポレーション	2,800	5,080.00	14,224,000
ココカラファイン	9,100	5,170.00	47,047,000
三越伊勢丹ホールディングス	176,300	1,247.00	219,846,100
ウエルシアホールディングス	17,100	3,570.00	61,047,000
クリエイトSDホールディングス	12,700	2,592.00	32,918,400
チムニー	3,200	2,834.00	9,068,800
シュッピン	3,800	1,858.00	7,060,400
ネクステージ	4,200	1,460.00	6,132,000
ジョイフル本田	14,400	3,690.00	53,136,000
鳥貴族	2,800	2,563.00	7,176,400
ホットランド	5,800	1,200.00	6,960,000
すかいらーく	37,700	1,692.00	63,788,400
綿半ホールディングス	4,600	1,803.00	8,293,800
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホール	28,200	1,100.00	31,020,000
ブックオフコーポレーション	8,300	785.00	6,515,500
ゴルフダイジェスト・オンライン	4,600	811.00	3,730,600
あさひ	8,000	1,435.00	11,480,000
日本調剤	3,400	3,820.00	12,988,000
コスモス薬品	4,500	22,450.00	101,025,000
セブン&アイ・ホールディングス	371,300	4,647.00	1,725,431,100
薬王堂	4,600	3,095.00	14,237,000
クリエイト・レストランツ・ホールディング	22,500	902.00	20,295,000
ツルハホールディングス	17,700	11,220.00	198,594,000

サンマルクホールディングス	5,700	3,375.00	19,237,500
トリドールホールディングス	11,200	2,645.00	29,624,000
パロックジャパンリミテッド	6,200	1,111.00	6,888,200
クスリのアオキホールディングス	7,000	4,875.00	34,125,000
メディカルシステムネットワーク	13,700	490.00	6,713,000
総合メディカル	4,400	4,460.00	19,624,000
ノジマ	10,600	1,695.00	17,967,000
カップ・クリエイト	13,900	1,268.00	17,625,200
ライトオン	8,200	969.00	7,945,800
良品計画	11,700	25,170.00	294,489,000
三城ホールディングス	16,700	465.00	7,765,500
アドヴァン	10,200	1,161.00	11,842,200
アルビス	2,800	3,595.00	10,066,000
コナカ	15,000	598.00	8,970,000
G - 7ホールディングス	3,000	2,344.00	7,032,000
コーナン商事	12,700	2,184.00	27,736,800
エコス	5,400	1,161.00	6,269,400
ワタミ	12,300	1,332.00	16,383,600
ドンキホーテホールディングス	57,400	4,065.00	233,331,000
西松屋チェーン	15,900	1,183.00	18,809,700
ゼンショーホールディングス	46,700	1,900.00	88,730,000
幸楽苑ホールディングス	5,800	1,751.00	10,155,800
サイゼリヤ	14,400	3,170.00	45,648,000
V Tホールディングス	30,500	564.00	17,202,000
魚力	3,600	1,268.00	4,564,800
ユナイテッドアローズ	12,000	3,450.00	41,400,000
ハイデイ日高	9,600	2,349.00	22,550,400
京都きもの友禅	6,300	955.00	6,016,500
コロワイド	29,200	1,824.00	53,260,800
ピーシーデポコーポレーション	13,900	562.00	7,811,800
壱番屋	6,100	3,615.00	22,051,500
スギホールディングス	19,600	5,500.00	107,800,000
スクロール	19,700	365.00	7,190,500
ヨンドシーホールディングス	6,800	2,750.00	18,700,000
ユニー・ファミリーマートホールディングス	38,800	6,350.00	246,380,000
木曽路	11,600	2,609.00	30,264,400
サトレストランシステムズ	13,800	866.00	11,950,800
千趣会	18,900	817.00	15,441,300
ケーヨー	16,800	656.00	11,020,800
上新電機	21,000	1,182.00	24,822,000
日本瓦斯	16,400	3,345.00	54,858,000
ベスト電器	37,700	161.00	6,069,700

ロイヤルホールディングス	14,300	2,186.00	31,259,800
いなげや	9,900	1,594.00	15,780,600
鳥忠	23,100	2,566.00	59,274,600
チヨダ	10,300	2,841.00	29,262,300
ライフコーポレーション	6,800	2,966.00	20,168,800
リンガーハット	10,700	2,311.00	24,727,700
MrMax	16,200	466.00	7,549,200
AOKIホールディングス	17,500	1,379.00	24,132,500
オークワ	14,000	1,186.00	16,604,000
コメリ	14,300	2,846.00	40,697,800
青山商事	18,600	3,930.00	73,098,000
しまむら	10,300	15,230.00	156,869,000
高島屋	149,000	1,033.00	153,917,000
松屋	20,300	961.00	19,508,300
エイチ・ツー・オー リテイリング	46,000	1,896.00	87,216,000
近鉄百貨店	39,000	352.00	13,728,000
パルコ	8,800	1,160.00	10,208,000
丸井グループ	93,700	1,564.00	146,546,800
アクシアル リテイリング	6,900	4,265.00	29,428,500
イオン	365,800	1,662.00	607,959,600
イズミ	17,600	5,590.00	98,384,000
平和堂	17,600	2,393.00	42,116,800
フジ	10,100	2,794.00	28,219,400
ヤオコー	9,700	4,315.00	41,855,500
ゼビオホールディングス	12,100	1,843.00	22,300,300
ケーズホールディングス	41,300	2,152.00	88,877,600
Olympicグループ	9,100	560.00	5,096,000
日産東京販売ホールディングス	17,200	437.00	7,516,400
アインホールディングス	11,500	7,690.00	88,435,000
元気寿司	2,700	2,205.00	5,953,500
ヤマダ電機	296,400	581.00	172,208,400
アークランドサカモト	15,500	1,358.00	21,049,000
ニトリホールディングス	38,300	14,490.00	554,967,000
グルメ杵屋	9,000	1,063.00	9,567,000
愛眼	12,800	197.00	2,521,600
吉野家ホールディングス	32,200	1,799.00	57,927,800
松屋フーズ	4,500	4,210.00	18,945,000
サガミチェーン	12,200	1,343.00	16,384,600
関西スーパーマーケット	8,100	1,604.00	12,992,400
王将フードサービス	6,400	4,155.00	26,592,000
プレナス	9,800	2,337.00	22,902,600
ミニストップ	7,000	2,105.00	14,735,000

アークス	16,300	2,391.00	38,973,300
パローホールディングス	19,700	2,681.00	52,815,700
ベルク	3,900	4,855.00	18,934,500
大庄	6,600	1,617.00	10,672,200
ファーストリテイリング	14,800	36,800.00	544,640,000
サンドラッグ	33,800	3,865.00	130,637,000
サクスパー ホールディングス	9,600	1,220.00	11,712,000
ヤマザワ	2,300	1,751.00	4,027,300
やまや	2,900	1,624.00	4,709,600
ペルーナ	22,300	1,029.00	22,946,700
じもとホールディングス	62,600	198.00	12,394,800
めぶきフィナンシャルグループ	425,200	448.00	190,489,600
東京ＴＹフィナンシャルグループ	12,800	3,225.00	41,280,000
九州フィナンシャルグループ	146,500	713.00	104,454,500
ゆうちょ銀行	250,100	1,414.00	353,641,400
富山第一銀行	24,000	533.00	12,792,000
コンコルディア・フィナンシャルグループ	581,100	536.20	311,585,820
西日本フィナンシャルホールディングス	60,800	1,107.00	67,305,600
新生銀行	843,000	215.00	181,245,000
あおぞら銀行	562,000	415.00	233,230,000
三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	6,724,500	720.00	4,841,640,000
りそなホールディングス	1,034,600	630.50	652,315,300
三井住友トラスト・ホールディングス	184,700	3,902.00	720,699,400
三井住友フィナンシャルグループ	710,800	4,200.00	2,985,360,000
第四銀行	109,000	452.00	49,268,000
北越銀行	9,800	2,743.00	26,881,400
千葉銀行	341,000	758.00	258,478,000
群馬銀行	198,700	606.00	120,412,200
武蔵野銀行	14,100	3,315.00	46,741,500
千葉興業銀行	24,800	634.00	15,723,200
筑波銀行	37,500	328.00	12,300,000
七十七銀行	139,000	492.00	68,388,000
青森銀行	71,000	394.00	27,974,000
秋田銀行	58,000	361.00	20,938,000
山形銀行	50,000	500.00	25,000,000
岩手銀行	5,800	4,645.00	26,941,000
東邦銀行	78,000	413.00	32,214,000
東北銀行	50,000	152.00	7,600,000
みちのく銀行	50,000	189.00	9,450,000
ふくおかフィナンシャルグループ	361,000	511.00	184,471,000
静岡銀行	242,000	964.00	233,288,000
十六銀行	120,000	368.00	44,160,000

スルガ銀行	90,600	2,341.00	212,094,600
八十二銀行	167,900	664.00	111,485,600
山梨中央銀行	55,000	501.00	27,555,000
大垣共立銀行	125,000	331.00	41,375,000
福井銀行	78,000	273.00	21,294,000
北國銀行	96,000	423.00	40,608,000
清水銀行	3,000	3,455.00	10,365,000
富山銀行	1,600	4,185.00	6,696,000
滋賀銀行	84,000	593.00	49,812,000
南都銀行	8,600	4,260.00	36,636,000
百五銀行	80,000	457.00	36,560,000
京都銀行	159,000	889.00	141,351,000
紀陽銀行	33,900	1,770.00	60,003,000
三重銀行	4,000	2,324.00	9,296,000
ほくほくフィナンシャルグループ	58,700	1,781.00	104,544,700
広島銀行	260,000	495.00	128,700,000
山陰合同銀行	54,100	928.00	50,204,800
中国銀行	62,100	1,675.00	104,017,500
鳥取銀行	3,100	1,767.00	5,477,700
伊予銀行	95,600	812.00	77,627,200
百十四銀行	99,000	373.00	36,927,000
四国銀行	70,000	318.00	22,260,000
阿波銀行	76,000	746.00	56,696,000
大分銀行	52,000	440.00	22,880,000
宮崎銀行	61,000	351.00	21,411,000
佐賀銀行	54,000	300.00	16,200,000
十八銀行	56,000	357.00	19,992,000
沖縄銀行	8,500	4,320.00	36,720,000
琉球銀行	18,900	1,554.00	29,370,600
セブン銀行	334,600	383.00	128,151,800
みずほフィナンシャルグループ	12,044,400	206.20	2,483,555,280
高知銀行	37,000	129.00	4,773,000
山口フィナンシャルグループ	83,000	1,242.00	103,086,000
長野銀行	3,000	2,015.00	6,045,000
名古屋銀行	7,300	4,135.00	30,185,500
北洋銀行	145,500	431.00	62,710,500
愛知銀行	3,000	6,270.00	18,810,000
第三銀行	5,300	1,696.00	8,988,800
中京銀行	3,600	2,340.00	8,424,000
大光銀行	32,000	240.00	7,680,000
愛媛銀行	10,600	1,426.00	15,115,600
トマト銀行	3,700	1,592.00	5,890,400

みなと銀行	7,900	2,110.00	16,669,000
京葉銀行	74,000	494.00	36,556,000
関西アーバン銀行	12,500	1,399.00	17,487,500
栃木銀行	50,700	538.00	27,276,600
北日本銀行	3,000	3,215.00	9,645,000
東和銀行	167,000	118.00	19,706,000
福島銀行	100,000	89.00	8,900,000
大東銀行	52,000	167.00	8,684,000
トモニホールディングス	73,400	599.00	43,966,600
フィデアホールディングス	90,600	211.00	19,116,600
池田泉州ホールディングス	94,600	480.00	45,408,000
F P G	33,000	984.00	32,472,000
S B Iホールディングス	100,900	1,559.00	157,303,100
ジャフコ	15,100	4,065.00	61,381,500
大和証券グループ本社	827,000	701.00	579,727,000
野村ホールディングス	1,814,500	697.30	1,265,250,850
岡三証券グループ	76,000	678.00	51,528,000
丸三証券	28,300	896.00	25,356,800
東洋証券	31,000	272.00	8,432,000
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	103,400	578.00	59,765,200
光世証券	25,000	167.00	4,175,000
水戸証券	30,800	301.00	9,270,800
いちよし証券	20,600	915.00	18,849,000
松井証券	50,900	915.00	46,573,500
マネックスグループ	94,700	286.00	27,084,200
カブドットコム証券	67,100	362.00	24,290,200
極東証券	12,400	1,689.00	20,943,600
岩井コスモホールディングス	9,000	1,075.00	9,675,000
藍澤證券	16,500	701.00	11,566,500
マネーパートナーズグループ	12,000	481.00	5,772,000
かんぽ生命保険	33,700	2,533.00	85,362,100
S O M P Oホールディングス	185,200	4,206.00	778,951,200
アニコム ホールディングス	6,500	2,689.00	17,478,500
M S & A Dインシュアランスグループホールディングス	265,500	3,635.00	965,092,500
ソニーフィナンシャルホールディングス	85,500	1,871.00	159,970,500
第一生命ホールディングス	534,500	1,937.00	1,035,326,500
東京海上ホールディングス	359,500	4,728.00	1,699,716,000
T & Dホールディングス	322,800	1,669.00	538,753,200
アドバンスクリエイト	2,500	1,987.00	4,967,500
全国保証	25,100	3,960.00	99,396,000
クレディセゾン	67,300	2,053.00	138,166,900
アクリーティブ	8,300	365.00	3,029,500

芙蓉総合リース	10,100	5,190.00	52,419,000
興銀リース	16,700	2,416.00	40,347,200
東京センチュリー	17,500	3,900.00	68,250,000
日本証券金融	40,100	595.00	23,859,500
アイフル	149,700	336.00	50,299,200
ポケットカード	7,800	685.00	5,343,000
リコーリース	7,000	3,645.00	25,515,000
イオンフィナンシャルサービス	56,700	2,181.00	123,662,700
アコム	179,000	463.00	82,877,000
ジャックス	48,000	476.00	22,848,000
オリエントコーポレーション	193,000	202.00	38,986,000
日立キャピタル	21,000	2,872.00	60,312,000
アプラスフィナンシャル	48,900	107.00	5,232,300
オリックス	628,800	1,737.50	1,092,540,000
三菱UFJリース	223,700	596.00	133,325,200
日本取引所グループ	275,700	1,628.00	448,839,600
イー・ギャランティ	2,800	2,437.00	6,823,600
NECキャピタルソリューション	4,000	1,773.00	7,092,000
いちご	83,800	328.00	27,486,400
日本駐車場開発	118,000	144.00	16,992,000
ヒューリック	185,000	1,094.00	202,390,000
三栄建築設計	4,600	1,570.00	7,222,000
野村不動産ホールディングス	59,000	1,827.00	107,793,000
三重交通グループホールディングス	21,100	375.00	7,912,500
サムティ	8,400	1,102.00	9,256,800
日本商業開発	5,400	1,862.00	10,054,800
プレサンスコーポレーション	13,900	1,290.00	17,931,000
ユニゾホールディングス	7,900	2,892.00	22,846,800
日本管理センター	7,700	1,314.00	10,117,800
フージャースホールディングス	16,000	622.00	9,952,000
オープンハウス	12,900	2,724.00	35,139,600
東急不動産ホールディングス	214,500	617.00	132,346,500
飯田グループホールディングス	74,100	1,769.00	131,082,900
エコナックホールディングス	57,000	62.00	3,534,000
パーク24	45,600	2,899.00	132,194,400
パラカ	3,500	2,132.00	7,462,000
三井不動産	471,000	2,481.00	1,168,551,000
三菱地所	660,000	2,153.50	1,421,310,000
平和不動産	17,700	1,746.00	30,904,200
東京建物	103,100	1,524.00	157,124,400
ダイビル	23,900	1,014.00	24,234,600
京阪神ビルディング	17,100	628.00	10,738,800

住友不動産	213,000	3,043.00	648,159,000
大京	162,000	236.00	38,232,000
テオオーシー	35,300	1,018.00	35,935,400
東京楽天地	18,000	538.00	9,684,000
レオパレス21	113,900	596.00	67,884,400
スターツコーポレーション	8,800	2,461.00	21,656,800
フジ住宅	11,400	738.00	8,413,200
空港施設	15,400	580.00	8,932,000
住友不動産販売	8,100	3,595.00	29,119,500
ゴールドクレスト	8,500	1,997.00	16,974,500
日神不動産	14,500	598.00	8,671,000
日本エスコン	13,300	389.00	5,173,700
タカラレーベン	40,700	535.00	21,774,500
サンヨーハウジング名古屋	7,500	1,014.00	7,605,000
イオンモール	57,800	1,917.00	110,802,600
トーセイ	14,200	799.00	11,345,800
エヌ・ティ・ティ都市開発	56,000	1,012.00	56,672,000
サンフロンティア不動産	9,700	987.00	9,573,900
エフ・ジェー・ネクスト	8,500	1,005.00	8,542,500
日本空港ビルデング	28,600	3,930.00	112,398,000
日本工営	6,500	2,924.00	19,006,000
Lifull	23,400	774.00	18,111,600
ジェイエイシーリクルートメント	6,200	1,707.00	10,583,400
日本M&Aセンター	27,000	3,785.00	102,195,000
タケエイ	9,900	1,003.00	9,929,700
トラスト・テック	4,200	1,935.00	8,127,000
コシダカホールディングス	3,900	2,808.00	10,951,200
パソナグループ	8,800	830.00	7,304,000
リンクアンドモチベーション	23,400	636.00	14,882,400
GCA	10,100	914.00	9,231,400
エス・エム・エス	13,400	2,928.00	39,235,200
テンブホールディングス	72,300	2,027.00	146,552,100
リニカル	6,000	1,401.00	8,406,000
クックパッド	21,400	878.00	18,789,200
学情	4,800	1,293.00	6,206,400
スタジオアリス	4,700	2,331.00	10,955,700
シミックホールディングス	6,000	1,414.00	8,484,000
総合警備保障	34,100	4,775.00	162,827,500
カカクコム	67,400	1,629.00	109,794,600
アイロムグループ	2,300	1,144.00	2,631,200
ルネサンス	5,800	1,813.00	10,515,400
ディップ	12,100	2,474.00	29,935,400

オプトホールディング	8,200	1,058.00	8,675,600
ツクイ	23,100	623.00	14,391,300
エムスリー	81,700	2,966.00	242,322,200
ツカダ・グローバルホールディング	11,100	584.00	6,482,400
アウトソーシング	5,500	4,140.00	22,770,000
ウェルネット	8,100	1,543.00	12,498,300
ワールドホールディングス	2,200	2,072.00	4,558,400
ディー・エヌ・エー	42,500	2,417.00	102,722,500
博報堂D Yホールディングス	129,200	1,353.00	174,807,600
ぐるなび	13,700	2,180.00	29,866,000
エスアールジータカミヤ	12,400	534.00	6,621,600
ジャパンベストレスキューシステム	18,100	265.00	4,796,500
ファンコミュニケーションズ	23,300	867.00	20,201,100
ライク	2,200	2,655.00	5,841,000
WDBホールディングス	4,100	1,532.00	6,281,200
インフォマート	40,200	664.00	26,692,800
J Pホールディングス	33,400	290.00	9,686,000
E P Sホールディングス	12,000	1,474.00	17,688,000
プレステージ・インターナショナル	15,200	976.00	14,835,200
アミューズ	5,500	2,585.00	14,217,500
ドリームインキュベータ	3,600	2,049.00	7,376,400
クイック	5,900	1,212.00	7,150,800
ケネディクス	119,200	511.00	60,911,200
電通	104,500	6,370.00	665,665,000
テイクアンドギヴ・ニーズ	6,000	928.00	5,568,000
ぴあ	3,400	2,900.00	9,860,000
イオンファンタジー	3,200	2,990.00	9,568,000
シーティーエス	6,800	685.00	4,658,000
ネクシィーズグループ	3,800	1,431.00	5,437,800
みらかホールディングス	24,200	5,180.00	125,356,000
アルプス技研	3,900	3,625.00	14,137,500
日本空調サービス	11,600	676.00	7,841,600
オリエンタルランド	101,700	6,509.00	661,965,300
ダスキン	24,400	2,471.00	60,292,400
明光ネットワークジャパン	12,400	1,400.00	17,360,000
ファルコホールディングス	5,800	1,527.00	8,856,600
ラウンドワン	30,500	944.00	28,792,000
リゾートトラスト	36,500	1,948.00	71,102,000
ビー・エム・エル	12,300	2,427.00	29,852,100
りらいあコミュニケーションズ	15,500	1,099.00	17,034,500
リソー教育	18,800	811.00	15,246,800
ユー・エス・エス	114,100	1,970.00	224,777,000

サイバーエージェント	49,700	3,255.00	161,773,500
楽天	481,400	1,191.50	573,588,100
クリーク・アンド・リバー社	4,300	977.00	4,201,100
テー・オー・ダブリュー	10,700	763.00	8,164,100
セントラルスポーツ	3,600	3,340.00	12,024,000
フルキャストホールディングス	10,200	1,082.00	11,036,400
テクノプロ・ホールディングス	15,500	4,275.00	66,262,500
インターワークス	3,200	1,091.00	3,491,200
イー・ガーディアン	3,600	1,659.00	5,972,400
リブセンス	10,000	488.00	4,880,000
ジャパンマテリアル	7,200	1,715.00	12,348,000
ベクトル	8,200	1,525.00	12,505,000
I B J	9,100	585.00	5,323,500
アサンテ	5,200	1,685.00	8,762,000
N・フィールド	5,600	1,298.00	7,268,800
M&Aキャピタルパートナーズ	1,300	4,995.00	6,493,500
アビスト	1,800	3,840.00	6,912,000
ウィルグループ	5,600	821.00	4,597,600
エスクロー・エージェント・ジャパン	2,200	2,026.00	4,457,200
リクルートホールディングス	204,900	5,570.00	1,141,293,000
日本郵政	245,400	1,393.00	341,842,200
ベルシステム24ホールディングス	15,100	1,041.00	15,719,100
ソラスト	5,300	1,551.00	8,220,300
リログループ	35,000	1,810.00	63,350,000
東祥	2,200	4,815.00	10,593,000
エイチ・アイ・エス	15,100	2,631.00	39,728,100
共立メンテナンス	15,200	3,310.00	50,312,000
イチネンホールディングス	11,000	1,166.00	12,826,000
建設技術研究所	7,900	1,128.00	8,911,200
スペース	5,800	1,405.00	8,149,000
東京テアトル	47,000	149.00	7,003,000
ナガワ	1,800	3,875.00	6,975,000
よみうりランド	25,000	433.00	10,825,000
東京都競馬	66,000	263.00	17,358,000
常磐興産	3,400	1,734.00	5,895,600
カナモト	13,100	3,030.00	39,693,000
東京ドーム	37,000	1,040.00	38,480,000
西尾レントオール	7,500	3,365.00	25,237,500
トランス・コスモス	10,700	2,634.00	28,183,800
乃村工藝社	19,600	2,130.00	41,748,000
藤田観光	37,000	360.00	13,320,000
KNT-CTホールディングス	64,000	135.00	8,640,000

日本管財	8,100	1,830.00	14,823,000
トーカイ	4,200	4,135.00	17,367,000
白洋舎	1,000	2,992.00	2,992,000
セコム	97,500	8,044.00	784,290,000
セントラル警備保障	5,200	1,680.00	8,736,000
丹青社	15,700	1,021.00	16,029,700
メイテック	11,400	4,735.00	53,979,000
アサツー ディ・ケイ	15,300	2,877.00	44,018,100
応用地質	10,000	1,378.00	13,780,000
船井総研ホールディングス	12,300	2,126.00	26,149,800
オオバ	11,200	515.00	5,768,000
ベネッセホールディングス	31,800	3,485.00	110,823,000
イオンディライト	10,100	3,280.00	33,128,000
ナック	8,600	947.00	8,144,200
ニチイ学館	18,000	822.00	14,796,000
ダイセキ	16,500	2,471.00	40,771,500
合 計	135,278,000		201,459,449,040

(b) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

外国株式インデックス・マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	（平成28年 4月26日現在）	（平成29年 4月26日現在）
資産の部		
流動資産		
預金	3,637,979,845	1,853,599,989
金銭信託	169,893,059	66,471,201
コール・ローン	35,648,016	138,302,371
株式	149,825,025,362	197,388,118,688
投資証券	3,934,204,370	5,147,098,719
派生商品評価勘定	106,122,759	83,317,769
未収入金	42,432,592	277,846,426
未収配当金	223,847,436	282,449,027
差入委託証拠金	1,522,490,920	1,722,543,431
流動資産合計	159,497,644,359	206,959,747,621
資産合計	159,497,644,359	206,959,747,621
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	11,409,385	7,796,112

	（平成28年 4月26日現在）	（平成29年 4月26日現在）
前受金	94,676,574	77,937,995
未払解約金	193,192,657	610,757,602
未払利息	104	401
その他未払費用	8,749	5,591
流動負債合計	299,287,469	696,497,701
負債合計	299,287,469	696,497,701
純資産の部		
元本等		
元本	60,595,656,831	67,999,201,436
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	98,602,700,059	138,264,048,484
元本等合計	159,198,356,890	206,263,249,920
純資産合計	159,198,356,890	206,263,249,920
負債純資産合計	159,497,644,359	206,959,747,621

注記表

（重要な会計方針の注記）

項目	自 平成28年 4月27日 至 平成29年 4月26日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式、投資証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1) 先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場によっております。</p> <p>(2) 為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金の計上基準 受取配当金は原則として、配当落ち日において、確定配当金額または予想配当金額を計上しております。なお、配当金額が未確定の場合は、入金日基準で計上しております。</p>
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建資産等の会計処理 「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。</p>

（貸借対照表に関する注記）

項目	（平成28年 4月26日現在）	（平成29年 4月26日現在）
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	60,595,656,831口	67,999,201,436口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 2.6272円 (10,000口当たりの純資産額 26,272円)	1口当たり純資産額 3.0333円 (10,000口当たりの純資産額 30,333円)

（金融商品に関する注記）

. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 平成28年 4月27日 至 平成29年 4月26日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	(1)金融商品の内容 1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、株式、投資証券を組み入れております。 2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいておりません。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。当計算期間については、先物取引、為替予約取引を行っております。 3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 (2)金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。

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

・金融商品の時価等に関する事項

項目	(平成29年 4月26日現在)
1.貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	<p>(1) 有価証券（株式、投資証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

(デリバティブ取引に関する注記)

(平成28年 4月26日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

（単位：円）

区 分	種 類	契 約 額 等	うち1年超	時 価	評 価 損 益
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	5,221,996,934	-	5,316,673,508	94,676,574
	SPMINI 1606	3,590,310,896	-	3,629,411,452	39,100,556
	DJ EUR 1606	953,868,750	-	998,875,000	45,006,250
	FTSE 1606	418,584,108	-	419,466,096	881,988
	SPI200 1606	259,233,180	-	268,920,960	9,687,780
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	178,710,700	-	178,673,900	36,800
	米ドル	98,754,400	-	98,754,400	-
	カナダドル	10,508,400	-	10,504,800	3,600
	ユーロ	27,513,200	-	27,500,000	13,200
	英ポンド	20,914,400	-	20,902,700	11,700
	スイスフラン	9,108,800	-	9,107,200	1,600
	スウェーデンクローナ	3,410,000	-	3,407,500	2,500
	ノルウェークローネ	405,900	-	405,300	600
	デンマーククローネ	1,008,600	-	1,008,000	600
	オーストラリアドル	3,424,000	-	3,423,200	800
	香港ドル	1,431,000	-	1,430,000	1,000
	シンガポールドル	1,641,600	-	1,641,400	200
	イスラエルシェケル	590,400	-	589,400	1,000
合計		5,400,707,634	-	5,495,347,408	94,713,374

（平成29年 4月26日現在）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

（単位：円）

区 分	種 類	契 約 額 等	うち1年超	時 価	評 価 損 益
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	3,622,372,706	-	3,700,310,701	77,937,995

市場取引以外 の取引	SPMINI 1706	2,490,724,859	-	2,535,735,577	45,010,718
	DJ EUR 1706	670,477,528	-	698,808,644	28,331,116
	FTSE 1706	269,270,219	-	268,400,080	870,139
	SPI200 1706	191,900,100	-	197,366,400	5,466,300
	為替予約取引				
	買建	302,058,240	-	306,096,600	4,038,360
	米ドル	201,201,180	-	203,715,600	2,514,420
	カナダドル	12,232,350	-	12,306,000	73,650
	ユーロ	31,010,200	-	31,657,600	647,400
	英ポンド	26,766,630	-	27,145,300	378,670
	スイスフラン	4,423,720	-	4,484,400	60,680
	スウェーデンク ローナ	4,717,320	-	4,833,600	116,280
	ノルウェークロー ネ	772,200	-	780,000	7,800
	デンマーククロー ネ	2,887,200	-	2,944,800	57,600
	オーストラリアド ル	9,982,800	-	10,078,800	96,000
	ニュージーランド ドル	774,200	-	773,000	1,200
	香港ドル	4,807,600	-	4,862,000	54,400
	シンガポールドル	1,578,340	-	1,598,400	20,060
	イスラエルシュケ ル	904,500	-	917,100	12,600
	売建	564,027,802	-	570,482,500	6,454,698
	米ドル	396,744,940	-	400,752,000	4,007,060
	カナダドル	26,006,870	-	26,252,800	245,930
	ユーロ	44,174,300	-	45,051,200	876,900
	英ポンド	52,156,760	-	52,861,900	705,140
	スイスフラン	18,806,120	-	19,058,700	252,580
	スウェーデンク ローナ	6,223,400	-	6,360,000	136,600
ノルウェークロー ネ	2,704,350	-	2,730,000	25,650	
デンマーククロー ネ	4,185,100	-	4,253,600	68,500	
香港ドル	8,353,262	-	8,437,000	83,738	
シンガポールドル	3,163,580	-	3,196,800	33,220	

イスラエルシュケ ル	1,509,120	-	1,528,500	19,380
合計	4,488,458,748	-	4,576,889,801	75,521,657

(注) 1. 時価の算定方法

(1) 株価指数先物取引の時価の算定方法について

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

2) 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

(2) 為替予約取引の時価の算定方法について

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

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

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

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

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

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

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

自 平成28年 4月27日 至 平成29年 4月26日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。

(その他の注記)

(平成28年 4月26日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	69,360,029,291円
同期中における追加設定元本額	15,388,983,831円
同期中における一部解約元本額	24,153,356,291円
平成28年 4月26日現在における元本の内訳	
三井住友・DC外国株式インデックスファンドS	8,795,281,236円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	200,831,501円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	873,812,975円

三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	583,556,304円
S M A M・グローバルバランスファンド(機動的資産配分型)	31,160,710円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2020	3,083,623円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2025	6,895,840円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2030	26,520,031円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2035	25,236,236円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2040	15,756,688円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2045	36,426,019円
外国株式指数ファンド	435,879,343円
三井住友・DC全海外株式インデックスファンド	597,508,328円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	167,308,242円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	244,719,365円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	306,239,750円
S M A M・外国株式バッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	7,666,075,277円
バランスファンドVA(安定運用型) <適格機関投資家限定>	45,288,459円
S M A M・バランスファンドVA安定成長型 <適格機関投資家限定>	5,296,983,372円
S M A M・バランスファンドVA25 <適格機関投資家専用>	3,680,514,668円
S M A M・バランスファンドVA37.5 <適格機関投資家専用>	2,721,234,810円
S M A M・バランスファンドVA50 <適格機関投資家専用>	11,262,781,335円
S M A M・バランスファンドVL30 <適格機関投資家限定>	30,694,337円
S M A M・バランスファンドVL50 <適格機関投資家限定>	179,198,981円
世界6資産バランスファンドVA <適格機関投資家限定>	13,782,411円
S M A M・バランスファンドVA75 <適格機関投資家専用>	1,343,045,993円
S M A M・バランスファンドVL国際分散型 <適格機関投資家限定>	100,455,805円
S M A M・インデックス・バランスVA25 <適格機関投資家専用>	295,414,154円
S M A M・インデックス・バランスVA50 <適格機関投資家専用>	1,324,189,446円
S M A M・バランスファンドVA40 <適格機関投資家専用>	2,298,633,991円
S M A M・バランスファンドVA35 <適格機関投資家専用>	3,035,654,992円
S M A M・バランスVA株40T <適格機関投資家限定>	100,751,800円
三井住友・外国株式インデックスファンド・VAS(適格機関投資家専用)	1,234,361,763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)	2,719,996,061円
S M A M・グローバルバランス40VA <適格機関投資家限定>	256,808,648円
S M A M・バランスファンドVA20 <適格機関投資家専用>	148,942,135円
三井住友・7資産バランスファンド・VAS(適格機関投資家専用)	2,420,994,748円
S M A M・アセットバランスファンドVA20A <適格機関投資家専用>	43,589,645円
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>	23,914,178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>	11,985,311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>	94,837,863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>	211,165,907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>	204,909,839円
S M A M・FG新興国重視型バランス20VA <適格機関投資家限定>	224,527円
S M A M・FGグローバルバランス25VA <適格機関投資家限定>	2,208,393円
S M A M・外国株式インデックスファンドSA <適格機関投資家限定>	1,406,257,655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>	117,335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>	70,426,801円
合計	60,595,656,831円

（平成29年 4月26日現在）	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	60,595,656,831円
同期中における追加設定元本額	28,872,734,717円
同期中における一部解約元本額	21,469,190,112円
平成29年 4月26日現在における元本の内訳	
三井住友・DC外国株式インデックスファンドS	10,418,988,820円
三井住友・DC年金バランス30（債券重点型）	230,805,834円
三井住友・DC年金バランス50（標準型）	935,783,173円
三井住友・DC年金バランス70（株式重点型）	627,104,468円
SMAM・グローバルバランスファンド（機動的資産配分型）	60,757,768円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2020（4資産タイプ）	3,182,251円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2025（4資産タイプ）	8,510,038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）	24,354,352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）	30,270,820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）	17,898,322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）	47,303,180円
外国株式指数ファンド	415,051,347円
三井住友・DC全海外株式インデックスファンド	1,199,751,216円
アセットアロケーション・ファンド（安定型）	931,097,263円
アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）	935,876,670円
アセットアロケーション・ファンド（成長型）	880,369,764円
イオン・バランス戦略ファンド	13,343,762円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2050	2,396,324円
SMAM・外国株式パッシブ・ファンド（適格機関投資家専用）	4,942,432,921円
バランスファンドVA（安定運用型）＜適格機関投資家限定＞	19,954,153円
SMAM・バランスファンドVA安定成長型＜適格機関投資家限定＞	2,752,885,982円
SMAM・バランスファンドVA25＜適格機関投資家専用＞	2,669,039,616円
SMAM・バランスファンドVA37.5＜適格機関投資家専用＞	2,174,701,240円
SMAM・バランスファンドVA50＜適格機関投資家専用＞	9,165,841,912円
SMAM・バランスファンドVL30＜適格機関投資家限定＞	25,330,001円
SMAM・バランスファンドVL50＜適格機関投資家限定＞	146,511,419円
世界6資産バランスファンドVA＜適格機関投資家限定＞	4,482,815円
SMAM・バランスファンドVA75＜適格機関投資家専用＞	1,113,631,695円
SMAM・バランスファンドVL国際分散型＜適格機関投資家限定＞	88,388,252円
SMAM・インデックス・バランスVA25＜適格機関投資家専用＞	238,655,942円
SMAM・インデックス・バランスVA50＜適格機関投資家専用＞	1,077,432,916円
SMAM・バランスファンドVA40＜適格機関投資家専用＞	1,860,359,937円
SMAM・バランスファンドVA35＜適格機関投資家専用＞	2,379,275,574円
SMAM・バランスVA株40T＜適格機関投資家限定＞	80,843,554円
三井住友・外国株式インデックスファンド・VAS（適格機関投資家専用）	1,060,371,106円
三井住友・5資産バランスファンド・VAS（適格機関投資家専用）	1,515,857,893円
SMAM・グローバルバランス40VA＜適格機関投資家限定＞	202,333,290円
SMAM・バランスファンドVA20＜適格機関投資家専用＞	109,430,512円
三井住友・7資産バランスファンド・VAS（適格機関投資家専用）	1,680,619,492円

S M A M ・ アセットバランスファンドV A 2 0 A < 適格機関投資家専用 >	34,200,641円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 3 5 A < 適格機関投資家専用 >	19,069,543円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 5 0 A < 適格機関投資家専用 >	9,334,115円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 2 0 L < 適格機関投資家専用 >	71,351,535円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 2 5 L < 適格機関投資家専用 >	161,423,410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 >	164,923,475円
S M A M ・ グローバルバランスファンド（標準型）V A < 適格機関投資家限定 >	1,785,260,105円
S M A M ・ グローバルバランスファンド（債券重視型）V A < 適格機関投資家限定 >	296,907,571円
S M A M ・ 世界バランスファンドV A < 適格機関投資家限定 >	9,480,190,036円
S M A M ・ 世界バランスファンドV A 2 < 適格機関投資家限定 >	3,282,776,313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 >	17,298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 >	31,661円
S M A M ・ 外国株式インデックスファンドS A < 適格機関投資家限定 >	2,441,436,609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 >	127,797円
S M A M ・ マルチアセットストラテジーファンド2 0 1 6 - 0 4 < 適格機関投資家限定 >	76,227,799円
S M A M ・ マルチアセットストラテジーファンド2 0 1 6 - 0 5 < 適格機関投資家限定 >	36,503,645円
S M A M ・ マルチアセットストラテジー・オープン< 適格機関投資家限定 >	48,194,289円
合計	67,999,201,436円

附属明細表

有価証券明細表

(a) 株式

通貨	銘柄	株数	評価額		備考
			単価	金額	
米ドル	ANADARKO PETROLEUM CORP	30,772	60.08	1,848,781.76	
	ANTERO RESOURCES CORP	8,176	21.85	178,645.60	
	APACHE CORPORATION	20,891	50.25	1,049,772.75	
	BAKER HUGHES INC	21,577	59.29	1,279,300.33	
	CABOT OIL & GAS CORPORATION	26,164	24.41	638,663.24	
	CHENIERE ENERGY INC	11,680	46.34	541,251.20	
	CHEVRON CORPORATION	103,937	106.73	11,093,196.01	
	CIMAREX ENERGY CO	5,271	120.85	637,000.35	
	CONCHO RESOURCES INC	8,234	130.98	1,078,489.32	
	CONOCOPHILLIPS	68,219	48.79	3,328,405.01	
	CONTINENTAL RESOURCES, INC.	5,758	44.19	254,446.02	
	CORE LABORATORIES N.V.	2,680	113.91	305,278.80	
	DEVON ENERGY CORPORATION	25,946	40.59	1,053,148.14	
	DIAMONDBACK ENERGY INC	4,749	103.97	493,753.53	
	EOG RESOURCES INC	31,739	95.27	3,023,774.53	
	EQT CORPORATION	9,689	63.44	614,670.16	

EXXON MOBIL CORPORATION	228,310	81.73	18,659,776.30
HALLIBURTON CO	47,595	47.02	2,237,916.90
HELMERICH & PAYNE INC	6,307	65.39	412,414.73
HESS CORPORATION	16,082	48.64	782,228.48
HOLLYFRONTIER CORP	8,311	28.76	239,024.36
KINDER MORGAN INC	104,474	20.90	2,183,506.60
MARATHON OIL CORP	48,323	15.61	754,322.03
MARATHON PETROLEUM CORPORATION	29,061	50.03	1,453,921.83
MURPHY OIL CORPORATION	9,993	27.35	273,308.55
NATIONAL-OILWELL VARCO INC.	22,038	35.82	789,401.16
NEWFIELD EXPLORATION CO	10,715	35.88	384,454.20
NOBLE ENERGY INC	24,229	34.43	834,204.47
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	42,075	62.50	2,629,687.50
ONEOK INC	12,008	54.73	657,197.84
PARSLEY ENERGY INC-CLASS A	11,937	30.46	363,601.02
PHILLIPS 66	25,809	78.08	2,015,166.72
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	9,345	178.35	1,666,680.75
PLAINS GP HOLDINGS LP-CL A	7,806	30.78	240,268.68
RANGE RESOURCES CORPORATION	10,817	27.56	298,116.52
SCHLUMBERGER LTD	76,150	74.09	5,641,953.50
SOUTHWESTERN ENERGY COMPANY	29,453	7.72	227,377.16
TARGA RESOURCES CORP	10,314	56.98	587,691.72
TECHNIPFMC PLC	24,396	32.12	783,599.52
TESORO CORPORATION	6,712	80.66	541,389.92
VALERO ENERGY CORP	24,923	65.83	1,640,681.09
WILLIAMS COS INC	44,930	30.81	1,384,293.30
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	11,471	141.73	1,625,784.83
ALBEMARLE CORPORATION	6,617	108.09	715,231.53
ARCONIC INC	25,812	26.98	696,407.76
ASHLAND GLOBAL HOLDINGS INC	3,401	127.56	433,831.56
AVERY DENNISON CORP	4,688	82.41	386,338.08
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	10,777	32.20	347,019.40
BALL CORPORATION	8,974	75.14	674,306.36
CELANESE CORPORATION	7,980	89.11	711,097.80
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	12,356	27.34	337,813.04
CROWN HOLDINGS INC	7,595	55.92	424,712.40
DOW CHEMICAL	61,175	64.81	3,964,751.75
DU PONT (E.I.) DE NEMOURS	47,416	82.21	3,898,069.36
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	8,696	81.63	709,854.48
ECOLAB INC	14,161	128.25	1,816,148.25
FMC CORPORATION	7,651	73.74	564,184.74
FREEMPORT-MCMORAN INC	74,285	13.10	973,133.50

INTERNATIONAL PAPER CO	20,814	53.69	1,117,503.66
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	4,622	139.09	642,873.98
LYONDELLBASELL INDU-CL A	18,669	87.01	1,624,389.69
MARTIN MARIETTA MATERIALS	3,548	223.50	792,978.00
MONSANTO CO	23,812	116.94	2,784,575.28
MOSAIC CO/THE	19,208	27.54	528,988.32
NEWMONT MINING CORP	28,172	32.89	926,577.08
NUCOR CORP	16,963	60.94	1,033,725.22
PACKAGING CORP OF AMERICA	5,524	94.36	521,244.64
PPG INDUSTRIES INC	14,194	110.82	1,572,979.08
PRAXAIR INC	15,966	124.70	1,990,960.20
SEALED AIR CORP	11,115	44.87	498,730.05
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	4,430	331.18	1,467,127.40
VALSPAR CORP/THE	4,415	112.45	496,466.75
VULCAN MATERIALS CO	6,976	121.45	847,235.20
WESTROCK CO	14,346	54.36	779,848.56
WR GRACE & CO	3,500	70.35	246,225.00
3M COMPANY	33,116	195.13	6,461,925.08
ACUITY BRANDS INC	2,353	176.32	414,880.96
AERCAP HOLDINGS NV	7,913	45.12	357,034.56
AGCO CORP	3,447	62.91	216,850.77
AMETEK INC	13,323	57.03	759,810.69
BOEING CO	32,281	183.51	5,923,886.31
CATERPILLAR INC	31,829	104.42	3,323,584.18
CUMMINS INC	8,568	152.11	1,303,278.48
DANAHER CORP	34,276	83.30	2,855,190.80
DEERE & CO	14,902	113.15	1,686,161.30
DOVER CORP	8,642	81.27	702,335.34
EATON CORP PLC	25,253	76.52	1,932,359.56
EMERSON ELECTRIC CO	34,789	61.22	2,129,782.58
FASTENAL COMPANY	16,429	45.72	751,133.88
FLOWERVE CORPORATION	7,675	50.60	388,355.00
FLUOR CORP	7,277	52.11	379,204.47
FORTIVE CORP	17,402	62.33	1,084,666.66
GENERAL DYNAMICS CORP	14,064	193.24	2,717,727.36
GENERAL ELECTRIC CO	486,743	29.45	14,334,581.35
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	39,863	129.30	5,154,285.90
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES	2,653	205.00	543,865.00
ILLINOIS TOOL WORKS	17,736	139.26	2,469,915.36
INGERSOLL-RAND PLC	13,777	85.66	1,180,137.82
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	7,005	55.11	386,045.55
JARDINE MATHESON HOLDINGS LIMITED	14,100	64.90	915,090.00

JARDINE STRATEGIC HOLDINGS LIMITED	12,600	42.00	529,200.00
L3 TECHNOLOGIES INC	4,316	170.46	735,705.36
LOCKHEED MARTIN CORPORATION	14,386	270.02	3,884,507.72
MASCO CORP	18,535	36.90	683,941.50
MIDDLEBY CORP	3,388	139.48	472,558.24
NORTHROP GRUMMAN CORP	9,072	248.13	2,251,035.36
PACCAR INC	18,774	65.76	1,234,578.24
PARKER HANNIFIN CORPORATION	7,528	165.22	1,243,776.16
PENTAIR PLC-REGISTERED	9,682	64.66	626,038.12
RAYTHEON COMPANY	15,937	156.01	2,486,331.37
ROCKWELL AUTOMATION INC	6,830	160.14	1,093,756.20
ROCKWELL COLLINS INC	9,110	105.51	961,196.10
ROPER TECHNOLOGIES INC	5,414	216.36	1,171,373.04
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	10,115	41.14	416,131.10
SNAP-ON INC	3,266	174.90	571,223.40
STANLEY BLACK & DECKER INC	8,025	136.87	1,098,381.75
TEXTRON INC	14,631	47.03	688,095.93
TRANSDIGM GROUP INC	2,954	248.17	733,094.18
UNITED RENTALS INC	5,006	113.30	567,179.80
UNITED TECHNOLOGIES CORP	42,751	116.87	4,996,309.37
WABTEC CORP	4,279	84.38	361,062.02
WW GRAINGER INC	3,265	193.36	631,320.40
XYLEM INC	9,156	51.81	474,372.36
CINTAS CORP	4,708	125.11	589,017.88
DUN & BRADSTREET CORP	2,078	109.72	227,998.16
EQUIFAX INC	6,641	139.47	926,220.27
IHS MARKIT LTD	18,862	43.76	825,401.12
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	50,724	43.20	2,191,276.80
MANPOWERGROUP	4,034	103.72	418,406.48
NIELSEN HOLDINGS PLC	19,909	39.98	795,961.82
REPUBLIC SERVICES INC	13,657	63.89	872,545.73
ROBERT HALF INTL INC	7,661	47.30	362,365.30
STERICYCLE, INC.	4,902	86.79	425,444.58
VERISK ANALYTICS INC	9,152	82.97	759,341.44
WASTE CONNECTIONS INC	9,249	90.25	834,722.25
WASTE MANAGEMENT INC	24,706	74.23	1,833,926.38
AMERCO	390	370.75	144,592.50
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	6,589	46.61	307,113.29
C.H.ROBINSON WORLDWIDE, INC.	7,794	77.70	605,593.80
CSX CORPORATION	50,806	50.94	2,588,057.64
DELTA AIR LINES INC	10,570	46.73	493,936.10
EXPEDITORS INTL WASH INC	10,211	57.30	585,090.30

FEDEX CORP	13,719	188.97	2,592,479.43
J.B. HUNT TRANSPORT SERVICES INC	5,307	92.13	488,933.91
KANSAS CITY SOUTHERN	6,279	90.36	567,370.44
MACQUARIE INFRASTRUCTURE CORP	3,832	81.11	310,813.52
NORFOLK SOUTHERN CORP	16,345	116.78	1,908,769.10
SOUTHWEST AIRLINES	8,327	57.09	475,388.43
UNION PACIFIC CORP	45,033	110.48	4,975,245.84
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS INC	4,745	70.97	336,752.65
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	37,621	107.36	4,038,990.56
AUTOLIV INC	4,682	103.36	483,931.52
BORGWARNER INC	12,178	40.84	497,349.52
DELPHI AUTOMOTIVE PLC	15,341	79.42	1,218,382.22
FORD MOTOR COMPANY	201,121	11.48	2,308,869.08
GENERAL MOTORS CO	74,631	33.99	2,536,707.69
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	15,385	35.86	551,706.10
HARLEY-DAVIDSON INC	10,083	57.21	576,848.43
LEAR CORP	3,609	140.93	508,616.37
MOBILEYE NV	10,004	61.91	619,347.64
TESLA INC	6,947	313.79	2,179,899.13
WABCO HOLDINGS INC	2,658	118.70	315,504.60
COACH INC	15,728	39.57	622,356.96
D.R.HORTON INC	20,208	32.65	659,791.20
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY	9,004	64.93	584,629.72
GARMIN LTD	5,834	50.74	296,017.16
HANESBRANDS INC	21,525	21.96	472,689.00
HASBRO INC	6,377	101.57	647,711.89
LEGGETT & PLATT INC	7,789	53.54	417,023.06
LENNAR CORP-CL A	10,746	50.70	544,822.20
LULULEMON ATHLETICA INC	5,472	52.46	287,061.12
MATTEL INC	19,175	22.13	424,342.75
MICHAEL KORS HOLDINGS LIMITED	9,739	37.47	364,920.33
MOHAWK INDUSTRIES INC	3,598	238.42	857,835.16
NEWELL BRANDS INC	24,405	48.52	1,184,130.60
NIKE INC -CL B	72,909	55.45	4,042,804.05
POLARIS INDUSTRIES INC	3,113	83.58	260,184.54
PULTE GROUP INC	16,248	22.20	360,705.60
PVH CORP	4,758	102.87	489,455.46
RALPH LAUREN CORPORATION	2,646	80.57	213,188.22
SMITH(A.O.) CORP	8,542	52.76	450,675.92
TOLL BROTHERS INC	9,275	35.63	330,468.25
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	11,107	19.53	216,919.71
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	11,448	17.97	205,720.56

VF CORP	17,553	56.11	984,898.83
WHIRLPOOL CORP	4,289	180.94	776,051.66
ARAMARK	12,558	36.76	461,632.08
CARNIVAL CORP	19,931	60.03	1,196,457.93
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	1,668	471.76	786,895.68
DARDEN RESTAURANTS INC	6,806	85.55	582,253.30
DOMINO'S PIZZA INC	2,742	180.59	495,177.78
H&R BLOCK INC	13,015	24.24	315,483.60
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS INC	11,081	58.54	648,681.74
LAS VEGAS SANDS CORP	23,432	58.47	1,370,069.04
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	17,889	94.57	1,691,762.73
MCDONALD'S CORPORATION	45,447	141.70	6,439,839.90
MELCO RESORTS & ENTERTAINMENET-ADR	10,584	20.96	221,840.64
MGM MIRAGE	25,809	29.35	757,494.15
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDINGS	8,343	51.08	426,160.44
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	9,610	99.15	952,831.50
STARBUCKS CORP	79,496	60.96	4,846,076.16
WYNDHAM WORLDWIDE CORP	6,427	92.22	592,697.94
WYNN RESORTS LTD	4,682	118.22	553,506.04
YUM! BRANDS INC	19,326	65.98	1,275,129.48
CBS CORP-CL B	21,802	66.41	1,447,870.82
CHARTER COMMUNICATTIONS INC-A	11,811	344.50	4,068,889.50
COMCAST CORP-CLASS A	262,450	38.49	10,101,700.50
DISCOVERY COMMUNICATIONS INC-A	7,075	29.29	207,226.75
DISCOVERY COMMUNICATIONS INC-C	11,427	28.76	328,697.65
DISH NETWORK CORP.	12,925	62.54	808,329.50
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	22,642	24.55	555,861.10
LIBERTY BROADBAND-C	5,788	90.89	526,071.32
LIBERTY GLOBAL PLC-A	14,258	35.77	510,008.66
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	34,465	34.99	1,205,930.35
LIBERTY LILAC GROUP-C	5,259	22.37	117,643.83
LIBERTY SIRIUS GROUP-C	11,891	40.44	480,872.04
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-A	4,141	40.74	168,704.34
NEWS CORP-CLASS A	22,918	13.07	299,538.26
OMNICOM GROUP	12,567	83.54	1,049,847.18
SCRIPPS NETWORKS INTERACTIVE	4,484	75.96	340,604.64
SIRIUS XM HOLDINGS INC	100,341	5.20	522,274.90
TEGNA INC	10,189	25.58	260,634.62
THE WALT DISNEY CO.	82,925	115.18	9,551,301.50
TIME WARNER INC	42,090	100.04	4,210,683.60
TWENTY-FIRST CE CL-A	57,039	30.61	1,745,963.79
TWENTY-FIRST CE CL-B	25,050	29.89	748,744.50

VIACOM INC-CLASS B	19,259	42.95	827,174.05
ADVANCE AUTO PARTS	4,092	145.67	596,081.64
AMAZON.COM INC	22,196	907.62	20,145,533.52
AUTONATION INC	4,917	43.86	215,659.62
AUTOZONE INC	1,596	712.06	1,136,447.76
BED BATH & BEYOND INC	8,527	39.36	335,622.72
BEST BUY COMPANY INC	16,151	51.77	836,137.27
CARMAX INC	9,888	58.74	580,821.12
DICK'S SPORTING GOODS INC	4,201	50.23	211,016.23
DOLLAR GENERAL CORP	15,009	71.55	1,073,893.95
DOLLAR TREE INC	13,251	80.69	1,069,223.19
EXPEDIA INC	7,045	135.43	954,104.35
FOOT LOCKER INC	7,641	76.60	585,300.60
GAP INC/THE	11,623	25.92	301,268.16
GENUINE PARTS CO	8,452	93.29	788,487.08
HOME DEPOT INC	67,070	153.03	10,263,722.10
KOHL'S CORP	10,244	39.38	403,408.72
L BRANDS INC	12,641	50.60	639,634.60
LIBERTY INTERACTIVE CORP QVC GROUP-A	24,979	20.95	523,310.05
LKQ CORPORATION	16,373	29.77	487,424.21
LOWE'S COMPANIES INC	47,461	84.51	4,010,929.11
MACY'S INC	17,457	29.28	511,140.96
NETFLIX INC	23,379	152.16	3,557,348.64
NORDSTROM INC	6,499	47.15	306,427.85
O'REILLY AUTOMOTIVE INC NEW	5,249	263.96	1,385,526.04
PRICELINE GROUP INC/THE	2,697	1,799.09	4,852,145.73
ROSS STORES INC	21,299	64.75	1,379,110.25
SIGNET JEWELERS LTD	2,864	66.87	191,515.68
STAPLES INC	38,290	9.83	376,390.70
TARGET CORP	29,869	55.15	1,647,275.35
TIFFANY & CO	7,222	92.83	670,418.26
TJX COMPANIES INC	35,441	78.78	2,792,041.98
TRACTOR SUPPLY COMPANY	7,486	64.96	486,290.56
TRIPADVISOR INC-W/I	7,039	43.65	307,252.35
ULTA BEAUTY INC	3,353	277.99	932,100.47
COSTCO WHOLESALE CORP	23,855	172.68	4,119,281.40
CVS HEALTH CORPORATION	58,263	82.17	4,787,470.71
KROGER CO	49,385	29.84	1,473,648.40
RITE AID CORP	59,420	3.97	235,897.40
SYSCO CORP	28,607	53.13	1,519,889.91
WAL-MART STORES INC	85,155	75.05	6,390,882.75
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	50,269	85.92	4,319,112.48

WHOLE FOODS MARKET INC	17,976	36.06	648,214.56
ALTRIA GROUP INC	107,379	72.43	7,777,460.97
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	31,681	45.58	1,444,019.98
BROWN-FORMAN CORPORATION	12,263	47.32	580,285.16
BUNGE LIMITED	7,871	78.60	618,660.60
CAMPBELL SOUP CO	11,170	57.59	643,280.30
COCA-COLA CO/THE	225,374	43.11	9,715,873.14
CONAGRA BRANDS INC	22,020	39.33	866,046.60
CONSTELLATION BRANDS INC-A	9,785	172.54	1,688,303.90
DR.PEPPER SNAPPLE GROUP, INC	10,115	98.41	995,417.15
GENERAL MILLS INC	32,561	58.24	1,896,352.64
HORMEL FOODS CORPORATION	16,378	35.43	580,272.54
INGREDION INC	4,088	122.07	499,022.16
JM SMUCKER CO/THE-NEW COM	6,757	126.93	857,666.01
KELLOGG CO	14,766	72.35	1,068,320.10
KRAFT HEINZ COMPANY	33,125	92.29	3,057,106.25
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	6,460	100.68	650,392.80
MEAD JOHNSON NUTRITION COMPANY	10,257	88.80	910,821.60
MOLSON COORS BREWING COMPANY	10,377	96.52	1,001,588.04
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	84,225	45.51	3,833,079.75
MONSTER BEVERAGE CORPORATION	22,009	45.37	998,548.33
PEPSICO INC	78,964	114.16	9,014,530.24
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL INC.	85,415	113.09	9,659,582.35
REYNOLDS AMERICAN INC	47,101	64.82	3,053,086.82
THE HERSHEY COMPANY	8,215	108.46	890,998.90
TYSON FOODS INC-CL A	15,998	65.13	1,041,949.74
CHURCH & DWIGHT CO INC	14,360	50.30	722,308.00
CLOROX COMPANY	6,829	136.15	929,768.35
COLGATE-PALMOLIVE COMPANY	46,009	74.22	3,414,787.98
COTY INC-CL A	27,462	18.22	500,357.64
EDGEWELL PERSONAL CARE CO	2,963	73.01	216,328.63
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	12,238	87.38	1,069,356.44
KIMBERLY-CLARK CORP	19,719	132.82	2,619,077.58
PROCTER & GAMBLE CO	140,778	90.00	12,670,020.00
SPECTRUM BRANDS HOLDINGS INC	1,690	145.07	245,168.30
ABBOTT LABORATORIES	93,968	43.76	4,112,039.68
AETNA INC	19,320	133.83	2,585,595.60
ALIGN TECHNOLOGY INC	4,163	118.78	494,481.14
AMERISOURCEBERGEN CORP	9,013	81.49	734,469.37
ANTHEM INC	14,504	172.46	2,501,359.84
BARD(C.R.) INC	3,906	303.51	1,185,510.06
BAXTER INTERNATIONAL INC	26,521	53.21	1,411,182.41

BECTON DICKINSON & CO	11,690	179.07	2,093,328.30
BOSTON SCIENTIFIC CORP	76,162	25.74	1,960,409.88
CARDINAL HEALTH INC	17,622	72.36	1,275,127.92
CENTENE CORP	9,578	73.45	703,504.10
CERNER CORP	16,958	59.45	1,008,153.10
CIGNA CORP	14,136	157.18	2,221,896.48
COOPER COMPANIES INC (THE)	2,852	201.32	574,164.64
DAVITA INC	9,291	68.50	636,433.50
DENTSPLY SIRONA INC	13,264	62.98	835,366.72
DEXCOM INC	4,938	74.94	370,053.72
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	11,392	98.92	1,126,896.64
ENVISION HEALTHCARE CORP	6,386	54.99	351,166.14
EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO	34,651	60.01	2,079,406.51
HCA HOLDINGS, INC.	16,671	84.61	1,410,533.31
HENRY SCHEIN INC	4,543	170.22	773,309.46
HOLOGIC INC	14,057	44.43	624,552.51
HUMANA INC.	8,209	217.97	1,789,315.73
IDEXX LABORATORIES INC	4,934	162.43	801,429.62
INTUITIVE SURGICAL INC	2,133	827.24	1,764,502.92
LABORATORY CRP OF AMR HLDGS	5,705	138.89	792,367.45
MALLINCKRODT PLC	5,503	45.91	252,642.73
MCKESSON CORP	12,648	135.00	1,707,480.00
MEDNAX INC	4,959	61.54	305,176.86
MEDTRONIC PLC	76,725	81.76	6,273,036.00
PATTERSON COS INC	4,102	44.23	181,431.46
QUEST DIAGNOSTICS	7,908	105.87	837,219.96
QUINTILES IMS HOLDINGS INC	8,462	82.65	699,384.30
RESMED INC	7,656	70.94	543,116.64
STRYKER CORP	18,287	135.59	2,479,534.33
TELEFLEX INC	2,592	201.80	523,065.60
TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES-SP ADR	49,603	30.76	1,525,788.28
UNITEDHEALTH GROUP INC	52,405	174.04	9,120,566.20
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	4,903	121.42	595,322.26
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	5,497	88.37	485,769.89
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	10,735	124.49	1,336,400.15
ABBVIE INC	89,475	65.10	5,824,822.50
AGILENT TECHNOLOGIES INC	17,191	54.81	942,238.71
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	12,508	120.55	1,507,839.40
ALKERMES PLC	8,922	57.00	508,554.00
ALLERGAN PLC	20,499	238.22	4,883,271.78
AMGEN INC	40,959	164.70	6,745,947.30
BIOGEN INC	11,851	286.89	3,399,933.39

BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	9,504	94.19	895,181.76
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	91,384	53.94	4,929,252.96
CELGENE CORP	42,393	125.52	5,321,169.36
ELI LILLY & CO	54,282	81.20	4,407,698.40
GILEAD SCIENCES INC	72,013	67.12	4,833,512.56
ILLUMINA INC	8,088	181.50	1,467,972.00
INCYTE CORP	9,335	124.39	1,161,180.65
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	3,564	154.90	552,063.60
JOHNSON & JOHNSON	149,506	123.43	18,453,525.58
MERCK & CO. INC.	151,803	62.30	9,457,326.90
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL INC	1,522	509.44	775,367.68
MYLAN NV	24,190	36.85	891,401.50
PERRIGO CO PLC	8,020	67.81	543,836.20
PFIZER INC	334,113	33.76	11,279,654.88
REGENERON PHARMACEUTICALS	4,276	372.32	1,592,040.32
SEATTLE GENETICS INC	5,832	66.80	389,577.60
TARO PHARMACEUTICAL INDUSTRIES	906	114.21	103,474.26
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	21,521	158.81	3,417,750.01
UNITED THERAPEUTICS CORP	2,169	121.74	264,054.06
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	13,656	117.27	1,601,439.12
WATERS CORP	4,625	171.46	793,002.50
ZOETIS INC	25,830	55.12	1,423,749.60
BANK OF AMERICA CORP	556,366	23.98	13,341,656.68
BB & T CORPORATION	43,869	43.65	1,914,881.85
CIT GROUP INC	11,525	45.02	518,855.50
CITIGROUP INC	156,286	60.21	9,409,980.06
CITIZENS FINANCIAL GROUP	29,170	36.45	1,063,246.50
COMERICA INC	9,983	70.65	705,298.95
FIFTH THIRD BANCORP	43,129	25.01	1,078,656.29
FIRST REPUBLIC BANK/CA	8,821	93.17	821,852.57
HUNTINGTON BANCSHARES INC	61,678	13.04	804,281.12
JPMORGAN CHASE & CO	196,607	88.26	17,352,533.82
KEYCORP	57,430	18.62	1,069,346.60
M & T BANK CORP	7,959	157.73	1,255,373.07
NEW YORK COMMUNITY BANCORP	28,674	13.74	393,980.76
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL INC	18,321	17.98	329,411.58
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	26,486	121.11	3,207,719.46
REGIONS FINANCIAL CORPORATION	70,213	13.86	973,152.18
SIGNATURE BANK	3,150	141.47	445,630.50
SUNTRUST BANKS INC	26,366	57.19	1,507,871.54
US BANCORP	92,906	52.13	4,843,189.78
WELLS FARGO & COMPANY	262,693	54.56	14,332,530.08

AFFILIATED MANAGERS GROUP	3,086	166.12	512,646.32
ALLY FINANCIAL INC	24,733	20.70	511,973.10
AMERICAN EXPRESS COMPANY	42,376	80.63	3,416,776.88
AMERIPRISE FINANCIAL INC	9,015	130.88	1,179,883.20
BANK OF NEW YORK MELLON CORP(THE)	57,445	47.23	2,713,127.35
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	67,424	167.53	11,295,542.72
BLACKROCK INC	6,598	388.19	2,561,277.62
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	27,115	85.58	2,320,501.70
CME GROUP INC.	18,386	119.94	2,205,216.84
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	21,190	67.28	1,425,663.20
E*TRADE FINANCIAL CORPORATION	16,112	35.50	571,976.00
EATON VANCE CORP	5,530	43.65	241,384.50
FIRST DATA CORP-CLASS A	20,440	15.75	321,930.00
FRANKLIN RESOURCES INC	21,228	42.04	892,425.12
GOLDMAN SACHS GROUP INC	19,551	226.63	4,430,843.13
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	32,208	60.97	1,963,721.76
INVESCO LIMITED	23,418	32.17	753,357.06
LEUCADIA NATIONAL CORPORATION	18,603	26.17	486,840.51
MOODY'S CORP	9,155	118.07	1,080,930.85
MORGAN STANLEY	76,494	44.27	3,386,389.38
MSCI INC-A	5,292	99.45	526,289.40
NASDAQ INC	6,596	70.53	465,215.88
NAVIENT CORPORATION	15,911	15.87	252,507.57
NORTHERN TRUST CORP	11,433	90.58	1,035,601.14
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	7,507	75.19	564,451.33
S&P GLOBAL INC	14,497	135.61	1,965,938.17
SCHWAB (CHARLES) CORP	64,805	39.62	2,567,574.10
SEI INVESTMENTS COMPANY	8,073	50.80	410,108.40
STATE STREET CORP	20,775	80.62	1,674,880.50
SYNCHRONY FINANCIAL	44,374	33.82	1,500,728.68
T ROWE PRICE GROUP INC	13,893	69.59	966,813.87
TD AMERITRADE HOLDING CORPORATION	15,062	39.04	588,020.48
AFLAC INC	21,973	75.01	1,648,194.73
ALLEGHANY CORPORATION	879	613.10	538,914.90
ALLSTATE CORP	19,838	81.22	1,611,242.36
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	55,972	60.07	3,362,238.04
AON PLC	14,184	120.07	1,703,072.88
ARCH CAPITAL GROUP LTD.	6,878	96.51	663,795.78
ARTHUR J GALLAGHER & CO	10,422	56.44	588,217.68
ASSURANT INC	3,023	96.92	292,989.16
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	5,338	67.68	361,275.84
CHUBB LTD	25,361	137.12	3,477,500.32

CINCINNATI FINANCIAL CORP	8,560	71.82	614,779.20
EVEREST RE GROUP LTD	2,331	251.92	587,225.52
FNF GROUP	13,005	40.50	526,702.50
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	21,634	47.75	1,033,023.50
LINCOLN NATIONAL CORP	13,187	67.29	887,353.23
LOEWS CORPORATION	16,336	47.34	773,346.24
MARKEL CORP	799	980.32	783,275.68
MARSH & MCLENNAN COS	27,910	73.06	2,039,104.60
METLIFE INC	50,752	52.37	2,657,882.24
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	15,265	64.35	982,302.75
PROGRESSIVE CORP	31,057	39.92	1,239,795.44
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	23,338	107.89	2,517,936.82
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	3,662	130.31	477,195.22
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	2,159	141.89	306,340.51
TORCHMARK CORPORATION	6,698	77.27	517,554.46
TRAVELERS COS INC(THE)	15,349	121.32	1,862,140.68
UNUM GROUP	13,176	47.14	621,116.64
VOYA FINANCIAL INC	11,788	38.02	448,179.76
W.R.BERKLEY CORPORATION	5,781	68.21	394,322.01
WILLIS TOWERS WATSON PLC	6,878	131.79	906,451.62
XL GROUP LTD	15,879	41.63	661,042.77
CBRE GROUP INC-A	17,067	34.30	585,398.10
CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP	20,222	94.27	1,906,327.94
EQUINIX INC	4,184	406.55	1,701,005.20
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	63,800	7.64	487,432.00
JONES LANG LASALLE INC	2,660	111.43	296,403.80
ACCENTURE PLC-CL A	33,872	118.69	4,020,267.68
ACTIVISION BLIZZARD INC	32,006	51.36	1,643,828.16
ADOBE SYSTEMS INC	27,095	133.49	3,616,911.55
AKAMAI TECHNOLOGIES	9,733	61.80	601,499.40
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	2,965	263.01	779,824.65
ALPHABET INC-CL A	16,260	888.84	14,452,538.40
ALPHABET INC-CL C	17,057	872.30	14,878,821.10
ANSYS INC	4,975	109.77	546,105.75
AUTODESK INC	11,299	90.32	1,020,525.68
AUTOMATIC DATA PROCESSING	24,498	105.01	2,572,534.98
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS	6,436	69.72	448,717.92
CA INC	17,874	32.60	582,692.40
CADENCE DESIGN SYS INC	17,210	31.93	549,515.30
CDK GLOBAL INC	7,248	65.29	473,221.92
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES	7,332	105.36	772,499.52
CITRIX SYSTEMS INC	8,155	84.05	685,427.75

COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS CORPORATION	32,806	59.09	1,938,506.54
COSTAR GROUP INC	1,621	216.12	350,330.52
EBAY INC	57,413	32.81	1,883,720.53
ELECTRONIC ARTS INC	16,214	92.99	1,507,739.86
FACEBOOK INC-A	128,627	146.49	18,842,569.23
FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES	16,723	83.86	1,402,390.78
FISERV INC	11,644	119.62	1,392,855.28
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	4,885	148.86	727,181.10
FORTINET INC	9,060	40.27	364,846.20
GARTNER INC	4,712	113.21	533,445.52
GLOBAL PAYMENTS INC	8,574	81.98	702,896.52
INTL BUSINESS MACHINES CORP	49,531	160.39	7,944,277.09
INTUIT INC	13,132	119.08	1,563,758.56
MASTERCARD INC-CL A	52,677	116.13	6,117,380.01
MERCADOLIBRE INC	2,340	230.63	539,674.20
MICROSOFT CORP	406,146	67.92	27,585,436.32
NUANCE COMMUNICATIONS INC	16,413	17.94	294,449.22
ORACLE CORPORATION	168,744	44.72	7,546,231.68
PAYCHEX INC	18,205	59.55	1,084,107.75
PAYPAL HOLDINGS INC	58,969	44.71	2,636,503.99
RED HAT INC	10,322	87.59	904,103.98
SABRE CORP	12,278	23.26	285,586.28
SALESFORCE.COM, INC.	35,086	84.75	2,973,538.50
SERVICENOW INC	8,722	90.24	787,073.28
SPLUNK INC	7,630	63.85	487,175.50
SYMANTEC CORPORATION	34,431	31.25	1,075,968.75
SYNOPSYS INC	8,909	73.34	653,386.06
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	9,740	54.31	528,979.40
TWITTER INC	31,928	14.66	468,064.48
VANTIV INC-CL A	9,060	65.74	595,604.40
VERISIGN INC	5,652	89.28	504,610.56
VISA INC	102,424	92.11	9,434,274.64
VMWARE INC	3,826	93.00	355,818.00
WESTERN UNION COMPANY	25,805	20.12	519,196.60
WORKDAY INC-CLASS A	6,281	86.87	545,630.47
XEROX CORP	50,705	6.99	354,427.95
YAHOO! INC	50,889	48.40	2,463,027.60
ZILLOW GROUP INC-C	5,320	37.59	199,978.80
AMPHENOL CORPORATION -CL A	17,380	72.18	1,254,488.40
APPLE INC	293,337	144.53	42,395,996.61
ARROW ELECTRONICS INC	5,286	73.26	387,252.36
AVNET INC	6,544	44.85	293,498.40

CDW CORP/DE	8,240	59.33	488,879.20
CISCO SYSTEMS INC	276,099	33.42	9,227,228.58
CORNING INC	52,919	28.54	1,510,308.26
DELL TECHNOLOGIES INC-CL V	12,719	66.35	843,905.65
DXC TECHNOLOGY CO	16,226	76.13	1,235,285.38
F5 NETWORKS INC	3,897	138.19	538,526.43
FLEX LTD	30,801	16.26	500,824.26
FLIR SYSTEMS INC	7,048	37.51	264,370.48
HARRIS CORP	7,099	111.21	789,479.79
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE C	93,531	18.52	1,732,194.12
HP INC	95,491	18.61	1,777,087.51
JUNIPER NETWORKS INC	20,290	27.78	563,656.20
MOTOROLA SOLUTIONS INC	8,355	85.39	713,433.45
NETAPP INC	16,097	39.97	643,397.09
PALO ALTO NETWORKS INC	5,121	110.40	565,358.40
QORVO INC	7,285	71.31	519,493.35
QUALCOMM INC	80,692	53.00	4,276,676.00
SEAGATE TECHNOLOGY	16,785	50.51	847,810.35
SKYWORKS SOLUTIONS INC	10,477	104.00	1,089,608.00
TE CONNECTIVITY LTD	19,087	75.60	1,442,977.20
TRIMBLE INC	14,277	32.74	467,428.98
WESTERN DIGITAL CORP	15,243	86.88	1,324,311.84
AT&T INC	338,113	39.94	13,504,233.22
CENTURYLINK INC	32,141	25.93	833,416.13
FRONTIER COMMUNICATIONS CORPORATION	55,620	1.96	109,015.20
LEVEL 3 COMMUNICATIONS INC	16,844	60.96	1,026,810.24
SBA COMMUNICATIONS CORP	6,527	124.02	809,478.54
SPRINT CORP	42,299	8.95	378,576.05
T-MOBILE US INC	16,265	67.35	1,095,447.75
VERIZON COMMUNICATIONS INC	223,737	46.70	10,448,517.90
ZAYO GROUP HOLDINGS INC	9,150	35.05	320,707.50
AES CORPORATION	34,931	11.62	405,898.22
ALLIANT ENERGY CORP	13,271	40.01	530,972.71
AMEREN CORPORATION	13,376	55.08	736,750.08
AMERICAN ELECTRIC POWER	27,073	67.86	1,837,173.78
AMERICAN WATER WORKS CO INC	9,814	80.97	794,639.58
ATMOS ENERGY CORP	5,637	80.46	453,553.02
CALPINE CORP	16,738	10.02	167,714.76
CENTERPOINT ENERGY INC	23,598	28.39	669,947.22
CMS ENERGY CORPORATION	16,033	45.51	729,661.83
CONSOLIDATED EDISON INC	16,778	79.40	1,332,173.20
DOMINION RESOURCES INC/VA	34,056	77.70	2,646,151.20

DTE ENERGY COMPANY	9,879	104.28	1,030,182.12	
DUKE ENERGY CORP	37,935	82.69	3,136,845.15	
EDISON INTERNATIONAL	17,595	80.82	1,422,027.90	
ENERGY CORP	10,217	76.71	783,746.07	
EVERSOURCE ENERGY	17,785	60.00	1,067,100.00	
EXELON CORP	50,834	35.08	1,783,256.72	
FIRSTENERGY CORP	23,453	30.61	717,896.33	
NEXTERA ENERGY INC	25,459	132.92	3,384,010.28	
NISOURCE INC	19,053	24.43	465,464.79	
OGE ENERGY CORP	11,114	35.02	389,212.28	
P G & E CORPORATION	27,841	67.66	1,883,722.06	
PINNACLE WEST CAPITAL CORPORATION	5,985	86.36	516,864.60	
PPL CORPORATION	37,419	38.16	1,427,909.04	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	27,854	44.72	1,245,630.88	
SCANA CORP	7,744	66.85	517,686.40	
SEMPRA ENERGY	12,762	113.61	1,449,890.82	
SOUTHERN CO	54,001	50.16	2,708,690.16	
UGI CORPORATION	9,182	49.66	455,978.12	
WEC ENERGY GROUP INC	17,377	60.73	1,055,305.21	
WESTAR ENERGY INC	8,114	51.96	421,603.44	
XCEL ENERGY INC	27,967	45.01	1,258,794.67	
ADVANCED MICRO DEVICES	44,937	13.49	606,200.13	
ANALOG DEVICES INC	20,522	79.35	1,628,420.70	
APPLIED MATERIALS INC	60,633	40.79	2,473,220.07	
BROADCOM LTD	21,988	223.20	4,907,721.60	
INTEL CORP	259,916	36.87	9,583,102.92	
KLA-TENCOR CORPORATION	8,674	101.71	882,232.54	
LAM RESEARCH CORP	8,980	145.76	1,308,924.80	
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	24,825	15.49	384,539.25	
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	15,825	45.12	714,024.00	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	12,238	76.73	939,021.74	
MICRON TECHNOLOGY INC	58,658	26.99	1,583,179.42	
NVIDIA CORP	29,348	104.74	3,073,909.52	
NXP SEMICONDUCTORS NV	16,193	105.21	1,703,665.53	
TEXAS INSTRUMENTS INC	54,589	82.36	4,495,950.04	
XILINX INC	14,382	60.69	872,843.58	
	17,176,668		1,158,197,425.52	
			(128,942,119,383)	
カナダドル				
ALTAGAS LTD	6,948	30.78	213,859.44	
ARC RESOURCES LTD	20,661	18.28	377,683.08	
CAMECO CORP	24,102	15.09	363,699.18	
CANADIAN NATURAL RESOURCES	59,764	45.33	2,709,102.12	

CENOVUS ENERGY INC	46,412	14.26	661,835.12
CRESCENT POINT ENERGY CORP	29,608	13.36	395,562.88
ENBRIDGE INC	89,689	57.49	5,156,220.61
ENCANA CORP	59,142	14.90	881,215.80
HUSKY ENERGY INC	21,322	16.08	342,857.76
IMPERIAL OIL LTD	15,807	41.41	654,567.87
INTER PIPELINE LTD	18,081	28.39	513,319.59
KEYERA CORP	8,467	38.44	325,471.48
PEMBINA PIPELINE CORP	20,978	44.50	933,521.00
PEYTO EXPLORATION & DEV CORP	8,811	25.40	223,799.40
PRAIRIESKY ROYALTY LTD	12,442	29.52	367,287.84
SEVEN GENERATIONS ENERGY-A	14,441	25.08	362,180.28
SUNCOR ENERGY INC	91,679	42.22	3,870,687.38
TOURMALINE OIL CORP	12,887	27.61	355,810.07
TRANSCANADA CORP	48,854	64.20	3,136,426.80
VERESEN INC	20,344	15.90	323,469.60
VERMILION ENERGY INC	5,586	48.48	270,809.28
AGNICO EAGLE MINES LIMITED	12,763	58.93	752,123.59
AGRIUM INC	7,862	125.61	987,545.82
BARRICK GOLD CORP	65,680	22.89	1,503,415.20
CCL INDUSTRIES INC-CL B	1,387	302.90	420,122.30
ELDORADO GOLD CORPORATION	41,255	4.62	190,598.10
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	39,175	13.34	522,594.50
FRANCO-NEVADA CORPORATION	9,959	90.54	901,687.86
GOLDCORP INC	46,502	19.50	906,789.00
KINROSS GOLD CORP	75,698	4.77	361,079.46
METHANEX CORPORATION	5,484	62.32	341,762.88
POTASH CORP OF SASKATCHEWAN	44,140	22.55	995,357.00
SILVER WHEATON CORPORATION	23,656	27.34	646,755.04
TECK RESOURCES LIMITED-CL B	31,222	28.84	900,442.48
TURQUOISE HILL RESOURCES LTD	45,107	3.70	166,895.90
WEST FRASER TIMBER CO LTD	2,873	61.30	176,114.90
YAMANA GOLD INC	51,365	3.72	191,077.80
BOMBARDIER INC 'B'	115,394	2.26	260,790.44
CAE INC	13,932	20.90	291,178.80
FINNING INTERNATIONAL INC	7,972	25.70	204,880.40
SNC-LAVALIN GROUP INC	8,714	54.54	475,261.56
CANADIAN NATL RAILWAY CO	42,231	99.15	4,187,203.65
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	7,699	209.99	1,616,713.01
LINAMAR CORP	2,200	57.69	126,918.00
MAGNA INTERNATIONAL INC	20,332	56.29	1,144,488.28
GILDAN ACTIVEWEAR INC	12,997	37.79	491,156.63

RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	12,023	79.35	954,025.05
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	23,050	28.65	660,382.50
THOMSON REUTERS CORP	17,386	58.23	1,012,386.78
CANADIAN TIRE CORP -CL A	3,990	167.16	666,968.40
DOLLARAMA INC	6,425	119.28	766,374.00
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC-B	23,176	62.02	1,437,375.52
EMPIRE CO LTD A	7,235	20.58	148,896.30
JEAN COUTU GROUP INC A	2,801	22.07	61,818.07
LOBLAW COMPANIES LTD	12,221	74.75	913,519.75
METRO INC	13,589	45.18	613,951.02
WESTON (GEORGE) LTD	3,180	118.87	378,006.60
SAPUTO INC	13,709	44.92	615,808.28
VALEANT PHARMACEUTICALS INTERN	20,194	12.26	247,578.44
BANK OF MONTREAL	36,494	100.77	3,677,500.38
BANK OF NOVA SCOTIA	65,888	78.41	5,166,278.08
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	21,452	113.38	2,432,227.76
NATIONAL BANK OF CANADA	18,686	55.50	1,037,073.00
ROYAL BANK OF CANADA	81,285	97.03	7,887,083.55
TORONTO-DOMINION BANK	101,543	66.80	6,783,072.40
CI FINANCIAL CORP	14,904	27.01	402,557.04
ELEMENT FLEET MANAGEMENT CORP	19,611	11.65	228,468.15
IGM FINANCIAL INC	5,296	41.30	218,724.80
ONEX CORPORATION	4,217	97.39	410,693.63
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	1,327	625.42	829,932.34
GREAT-WEST LIFECO INC	17,440	36.82	642,140.80
INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANCE AND FINANC	4,851	58.23	282,473.73
INTACT FINANCIAL CORPORATION	7,415	94.92	703,831.80
MANULIFE FINANCIAL CORP	110,560	24.03	2,656,756.80
POWER CORP OF CANADA	21,768	31.86	693,528.48
POWER FINANCIAL CORP	14,523	34.93	507,288.39
SUN LIFE FINANCIAL INC	33,966	49.20	1,671,127.20
BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT INC	47,936	50.19	2,405,907.84
FIRST CAPITAL REALTY INC	6,546	19.94	130,527.24
CGI GROUP INC - CL A	11,985	63.85	765,242.25
CONSTELLATION SOFTWARE	1,073	637.24	683,758.52
OPEN TEXT CORPORATION	14,274	47.27	674,731.98
BLACKBERRY LIMITED	23,701	12.48	295,788.48
BCE INC	8,582	61.67	529,251.94
ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	19,940	62.29	1,242,062.60
TELUS CORPORATION	9,642	44.80	431,961.60
ATCO LTD-CLASS I	4,985	50.09	249,698.65
CANADIAN UTILITIES LIMITED	6,417	38.82	249,107.94

	EMERA INC	2,409	47.57	114,596.13
	FORTIS INC	21,944	44.18	969,485.92
	HYDRO ONE LTD	9,317	23.99	223,514.83
	カナダドル 小計	2,300,580		94,875,824.14 (7,784,561,370)
ユーロ	ENI SPA	140,064	14.48	2,028,126.72
	GALP ENERGIA SGPS S.A	29,714	14.48	430,258.72
	NESTE OYJ	7,547	37.30	281,503.10
	OMV AG	7,435	39.33	292,455.72
	REPSOL SA	61,595	14.77	910,066.12
	SAIPEM	393,610	0.41	162,797.09
	TENARIS S.A.	26,776	15.02	402,175.52
	TOTAL SA	125,291	47.82	5,992,042.07
	VOPAK	3,130	40.92	128,079.60
	AIR LIQUIDE	21,134	110.95	2,344,817.30
	AKZO NOBEL	14,000	82.64	1,156,960.00
	ARCELOR MITTAL	100,783	7.38	744,685.58
	ARKEMA	3,915	96.80	378,972.00
	BASF SE	50,570	92.16	4,660,531.20
	COVESTRO AG	4,691	72.40	339,628.40
	CRH PLC	46,360	33.45	1,550,742.00
	EVONIK INDUSTRIES AG	8,771	30.83	270,453.78
	FUCHS PETROLUB SE-PREF	3,370	47.12	158,794.40
	HEIDELBERGCEMENT AG	8,804	87.40	769,469.60
	IMERYS SA	2,030	80.60	163,618.00
	K+S AG	9,644	21.50	207,394.22
	KONINKLIJKE DSM NV	9,456	66.20	625,987.20
	LANXESS	5,325	65.86	350,704.50
	LINDE AG	10,007	161.15	1,612,628.05
	SOLVAY SA	4,081	115.85	472,783.85
	STORA ENSO OYJ-R SHS	29,833	11.93	355,907.69
	SYMRISE AG	7,266	64.40	467,930.40
	THYSSENKRUPP AG	19,734	22.76	449,244.51
	UMICORE	4,905	52.73	258,640.65
	UPM-KYMMENE OYJ	29,614	24.75	732,946.50
	VOESTALPINE AG	5,931	37.92	224,903.52
	ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	10,891	33.67	366,699.97
	AIRBUS SE	31,436	74.10	2,329,407.60
	ALSTOM RGPT	8,821	29.11	256,823.41
	ANDRITZ AG	4,484	50.16	224,917.44
	BOSKALIS WESTMINSTER NV	5,738	33.89	194,460.82
	BOUYGUES SA	12,200	39.17	477,935.00

BRENTAG AG	8,154	54.51	444,474.54
CNH INDUSTRIAL NV	55,561	9.84	546,720.24
COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	28,491	49.56	1,412,156.41
DASSAULT AVIATION SA	117	1,225.65	143,401.05
EIFFAGE SA	3,580	77.99	279,204.20
FERROVIAL SA	27,801	19.31	536,976.31
GEA GROUP AG	9,966	39.47	393,358.02
HOCHTIEF AG	1,364	164.70	224,650.80
KONE OYJ-B	17,762	44.27	786,323.74
KONINKLIJKE PHILIPS NV	52,221	31.60	1,650,183.60
LEGRAND SA	14,095	59.53	839,075.35
LEONARDO SPA	22,528	14.58	328,458.24
MAN SE	2,092	97.14	203,216.88
METSO OYJ	5,502	31.01	170,617.02
OSRAM LICHT AG	4,588	60.02	275,371.76
PRYSMIAN SPA	9,379	26.30	246,667.70
REXEL SA	18,396	16.80	309,052.80
SAFRAN SA	17,840	75.77	1,351,736.80
SCHNEIDER ELECTRIC SE	30,486	73.92	2,253,525.12
SIEMENS AG-REG	42,120	132.70	5,589,324.00
THALES SA	5,961	94.37	562,539.57
VINCI S.A.	27,493	77.72	2,136,755.96
WARTSILA OYJ-B SHARES	8,572	54.75	469,317.00
ZARDOYA OTIS SA	8,459	8.20	69,363.80
ZODIAC AEROSPACE	10,335	22.49	232,434.15
BIC	1,337	120.90	161,643.30
BUREAU VERITAS SA	15,733	20.79	327,089.07
EDENRED	12,710	24.00	305,040.00
PADDY POWER BETFAIR PLC	4,592	103.35	474,583.20
RANDSTAD HOLDING NV	6,526	55.33	361,083.58
ABERTIS INFRASTRUCTURAS SA	34,535	16.00	552,560.00
AENA SA	3,899	154.80	603,565.20
AEROPORTS DE PARIS (ADP)	1,346	121.20	163,135.20
ATLANTIA SPA	23,300	22.50	524,250.00
BOLLORE	39,433	3.69	145,547.20
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	12,281	16.64	204,355.84
DEUTSCHE POST AG-REG	54,281	32.13	1,744,319.93
FRAPORT AG	1,856	72.00	133,632.00
GROUPE EUROTUNNEL SE	23,484	9.97	234,182.44
INTERNATIONAL CONSOLIDATED AIRLINES GROUP	44,863	6.60	296,185.52
RYANAIR HOLDINGS PLC	1,614	15.73	25,388.22
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	17,832	87.77	1,565,114.64

BAYERISCHE MOTOREN WERKE(BMW)AG-PFD	3,579	74.53	266,742.87
CONTINENTAL AG	5,886	201.15	1,183,968.90
DAIMLER AG	53,013	68.70	3,641,993.10
FERRARI NV	7,007	67.65	474,023.55
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	46,418	9.69	450,022.51
MICHELIN (CGDE)-B	10,441	118.00	1,232,038.00
NOKIAN RENKAAT OYJ	5,507	38.85	213,946.95
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE PEF	9,110	53.90	491,029.00
PSA PEUGEOT CITROEN	27,565	18.95	522,356.75
RENAULT SA	10,422	83.22	867,318.84
SCHAEFFLER AG	9,576	15.92	152,449.92
VALEO SA	12,609	65.20	822,106.80
VOLKSWAGEN AG	1,615	148.25	239,423.75
VOLKSWAGEN AG PFD	9,764	145.65	1,422,126.60
ADIDAS AG	10,183	185.70	1,890,983.10
CHRISTIAN DIOR SE	2,843	252.00	716,436.00
HERMES INTERNATIONAL	1,475	440.75	650,106.25
HUGO BOSS AG	3,891	69.35	269,840.85
KERING	4,322	259.15	1,120,046.30
LUXOTTICA GROUP SPA	9,452	53.30	503,791.60
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	15,354	223.15	3,426,245.10
SEB SA	1,032	142.65	147,214.80
ACCOR SA	9,357	41.53	388,596.21
SODEXO	5,188	114.75	595,323.00
ALTICE NV -A W/I	20,146	22.40	451,270.40
ALTICE NV -B W/I	6,439	22.35	143,911.65
AXEL SPRINGER SE	2,952	53.20	157,046.40
EUTELSAT COMMUNICATIONS	8,726	21.40	186,780.03
JC DECAUX SA	2,828	32.86	92,942.22
LAGARDERE S.C.A.	6,108	27.91	170,504.82
PROSIEBEN SAT.1 MEDIA SE-REG	13,157	39.44	518,977.86
PUBLICIS GROUPE	10,644	66.61	708,996.84
RELX NV	56,723	17.85	1,012,789.16
RTL GROUP	2,567	72.50	186,107.50
SES	21,377	20.70	442,503.90
SFR GROUP SA	5,853	29.94	175,238.82
TELENET GROUP HOLDINGS NV	3,224	55.74	179,705.76
WOLTERS KLUWER-CVA	16,170	38.59	624,000.30
INDITEX	59,304	35.15	2,084,535.60
CARREFOUR SA	31,459	21.54	677,626.86
CASINO GUICHARD PERRACHON	2,725	55.71	151,809.75
COLRUYT NV	3,273	46.54	152,325.42

DISTRIBUIDORA INTERNACIONAL	29,663	5.47	162,493.91
JERONIMO MARTINS SGPS S.A.	12,194	16.66	203,213.01
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	73,083	18.76	1,371,037.08
METRO AG	9,739	30.30	295,091.70
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	42,054	104.50	4,394,643.00
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	11,503	35.20	404,905.60
DANONE	32,378	63.77	2,064,745.06
HEINEKEN HOLDING NV	5,455	77.43	422,380.65
HEINEKEN NV	13,142	82.20	1,080,272.40
KERRY GROUP PLC-A	9,177	75.98	697,268.46
PERNOD-RICARD SA	12,111	115.00	1,392,765.00
REMY COINTREAU	1,273	91.61	116,619.53
UNILEVER NV-CVA	88,982	48.00	4,271,136.00
BEIERSDORF AG	5,727	90.41	517,778.07
HENKEL AG & CO KGAA	5,401	106.95	577,636.95
HENKEL AG & CO KGAA	10,125	123.60	1,251,450.00
L'OREAL	13,869	184.65	2,560,910.85
ESSILOR INTERNATIONAL	11,408	118.80	1,355,270.40
FRESENIUS MEDICAL CARE AG AND CO.KGAA	11,752	81.54	958,258.08
FRESENIUS SE & CO KGAA	23,398	74.39	1,740,577.22
BAYER AG	45,217	108.45	4,903,783.65
EUROFINS SCIENTIFIC	646	440.00	284,240.00
GRIFOLS S.A.	17,560	24.41	428,727.40
MERCK KGAA	7,156	107.05	766,049.80
ORION OYJ	6,170	50.20	309,734.00
QIAGEN N.V.	12,422	27.17	337,505.74
SANOFI	63,894	85.09	5,436,740.46
UCB SA	6,820	70.93	483,742.60
ZALANDO SE	5,372	40.18	215,846.96
ABN AMRO GROUP NV-CVA	18,153	23.76	431,406.04
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	361,546	7.63	2,758,595.98
BANCO DE SABADELL SA	293,755	1.77	521,121.37
BANCO ESPIRITO SANTO,S.A(BES)	187,906	0.01	1,879.06
BANCO POPULAR ESPANOL	155,616	0.70	108,931.20
BANCO SANTANDER SA	802,878	6.04	4,849,383.12
BANK OF IRELAND	1,626,681	0.25	418,057.01
BANKIA SA	276,240	1.11	306,902.64
BANKINTER,S.A.	34,025	8.25	280,842.35
BNP PARIBAS	58,334	66.95	3,905,461.30
CAIXABANK	189,114	4.14	784,444.87
COMMERZBANK AG	60,611	9.05	548,590.16
CREDIT AGRICOLE SA	61,121	13.80	843,469.80

ERSTE GROUP BANK AG	16,913	32.20	544,598.60
INTESA SANPAOLO	685,439	2.75	1,889,069.88
INTESA SANPAOLO-RSP	50,545	2.57	130,102.83
KBC GROUPE SA	13,707	65.92	903,565.44
NATIXIS	57,006	6.34	361,874.08
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG	6,210	20.65	128,236.50
SOCIETE GENERALE	41,541	50.91	2,114,852.31
UNICREDIT SPA	103,794	15.82	1,642,021.08
DEUTSCHE BANK AG -REG	112,857	16.94	1,911,797.58
DEUTSCHE BOERSE AG	10,594	87.83	930,471.02
EURAZEO	1,926	62.80	120,952.80
EXOR NV	6,517	49.50	322,591.50
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	4,260	88.54	377,180.40
ING GROEP NV-CVA	211,438	14.98	3,168,398.43
MEDIOBANCA SPA	34,833	8.67	302,002.11
WENDEL	1,532	126.50	193,798.00
AEGON NV	102,134	4.73	483,706.62
AGEAS	11,146	38.06	424,272.49
ALLIANZ SE-REG	25,162	175.50	4,415,931.00
ASSICURAZIONI GENERALI	65,527	14.82	971,110.14
AXA SA	106,443	25.00	2,661,075.00
CNP ASSURANCES	11,162	18.93	211,352.47
HANNOVER RUECKVERSICHERUNG SE	3,033	110.90	336,359.70
MAPFRE SA	68,075	3.30	224,647.50
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	8,867	188.00	1,666,996.00
NN GROUP NV	16,745	30.67	513,569.15
POSTE ITALIANE SPA	32,840	6.29	206,727.80
SAMPO OYJ-A SHS	24,972	46.57	1,162,946.04
SCOR SE	9,624	36.23	348,725.64
UNIPOLSAI SPA	49,963	2.12	106,021.48
DEUTSCHE WOHNEN AG-BR	18,909	31.82	601,778.92
VONOVIA SE	25,657	33.89	869,515.73
AMADEUS IT GROUP SA	24,840	48.14	1,195,797.60
ATOS SE	4,903	117.70	577,083.10
CAP GEMINI SA	9,296	91.40	849,654.40
DASSAULT SYSTEMES SA	6,868	84.65	581,376.20
GEMALTO	3,838	54.95	210,898.10
SAP SE	53,748	93.13	5,005,551.24
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	5,981	41.58	248,689.98
INGENICO S.A.	3,325	85.52	284,354.00
NOKIA OYJ	321,072	4.97	1,597,654.27
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	178,189	16.46	2,932,990.94

	ELISA OYJ	8,373	31.60	264,586.80
	ILIAD SA	1,546	225.95	349,318.70
	KONINKLIJKE KPN NV	192,155	2.80	538,034.00
	ORANGE S.A.	107,796	14.64	1,578,133.44
	PROXIMUS SA	8,955	29.34	262,739.70
	TELECOM ITALIA SPA	596,054	0.82	493,532.71
	TELECOM ITALIA-RNC	365,506	0.67	246,899.30
	TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	48,244	4.47	215,698.92
	TELEFONICA S.A.	246,482	10.51	2,591,758.23
	VIVENDI SA	56,661	18.67	1,057,860.87
	E.ON SE	112,982	7.23	816,859.86
	EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	127,146	3.11	396,441.22
	ELECTRICITE DE FRANCE(EDF)	16,922	7.68	130,079.41
	ENAGAS	13,652	24.24	330,924.48
	ENDESA S.A.	17,200	21.96	377,712.00
	ENEL SPA	416,668	4.43	1,845,839.24
	ENGIE	87,780	13.23	1,161,329.40
	FORTUM OYJ	24,333	13.00	316,329.00
	GAS NATURAL SDG SA	19,321	20.96	405,064.76
	IBERDROLA SA	304,359	6.60	2,009,378.11
	INNOGY SE	7,205	34.18	246,266.90
	RED ELECTRICA CORPORATION SA	24,948	18.08	451,059.84
	RWE AG	28,403	15.31	434,991.94
	SNAM SPA	127,541	4.05	517,561.37
	SUEZ	17,312	15.14	262,190.24
	TERNA SPA	87,158	4.64	404,413.12
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	28,101	17.49	491,626.99
	ASML HOLDING NV	20,554	123.10	2,530,197.40
	INFINEON TECHNOLOGIES AG	64,968	18.89	1,227,245.52
	STMICROELECTRONICS NV	33,781	14.75	498,438.65
	ユーロ 小計	13,027,933		212,803,995.36 (25,911,014,475)
英債券	BP PLC	1,041,823	4.49	4,680,389.82
	PETROFAC LIMITED	12,177	8.46	103,017.42
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	240,602	20.44	4,919,107.89
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	206,220	21.06	4,342,993.20
	ANGLO AMERICAN PLC	74,953	11.23	841,722.19
	ANTOFAGASTA PLC	19,439	8.38	162,898.82
	BHP BILLITON PLC	119,357	12.06	1,440,042.20
	CRODA INTERNATIONAL PLC	6,223	36.59	227,699.57
	FRESNILLO PLC	11,716	15.03	176,091.48
	GLENCORE PLC	673,667	3.12	2,103,188.37

JOHNSON MATTHEY PLC	11,403	29.65	338,098.95
MONDI PLC	20,772	20.17	418,971.24
RANDGOLD RESOURCES LTD	5,368	67.85	364,218.80
RIO TINTO PLC	67,387	30.99	2,088,660.06
ASHTED GROUP PLC	26,961	16.47	444,047.67
BAE SYSTEMS PLC	170,430	6.30	1,074,561.15
BUNZL PLC	18,074	23.73	428,896.02
COBHAM PLC	73,920	1.30	96,465.60
DCC PLC	4,482	72.80	326,289.60
IMI PLC	16,924	12.64	213,919.36
MEGGITT PLC	52,383	4.65	244,000.01
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	102,142	8.12	829,903.75
SMITHS GROUP PLC	22,759	16.31	371,199.29
TRAVIS PERKINS PLC	12,496	15.98	199,686.08
WEIR GROUP PLC/THE	12,829	20.80	266,843.20
WOLSELEY PLC	13,830	49.04	678,223.20
BABCOCK INTERNATIONAL GROUP PLC	11,442	9.13	104,465.46
CAPITA PLC	41,602	5.59	232,555.18
EXPERIAN PLC	53,872	16.50	888,888.00
G4S PLC	93,347	3.03	282,841.41
INTERTEK GROUP PLC	9,324	40.51	377,715.24
MERLIN ENTERTAINMENTS PLC	44,414	4.85	215,674.38
EASYJET PLC	7,630	11.61	88,584.30
ROYAL MAIL PLC	53,855	4.17	224,736.91
GKN PLC	93,825	3.66	343,493.32
BURBERRY GROUP PLC	23,827	15.89	378,611.03
PERSIMMON PLC	17,735	22.67	402,052.45
TAYLOR WIMPEY PLC	189,280	1.99	378,181.44
THE BERKELEY GROUP HOLDINGS	6,396	32.45	207,550.20
CARNIVAL PLC	10,738	46.25	496,632.50
COMPASS GROUP PLC	88,525	15.32	1,356,203.00
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	10,114	39.85	403,042.90
TUI AG-DI	28,865	11.38	328,483.70
WHITBREAD PLC	9,356	40.00	374,240.00
WILLIAM HILL PLC	41,877	3.02	126,552.29
ITV PLC	187,094	2.19	410,858.42
PEARSON PLC	46,957	6.37	299,350.87
RELX PLC	57,897	15.92	921,720.24
SKY PLC	58,830	9.82	578,004.75
WPP PLC	72,920	17.22	1,255,682.40
DIXONS CARPHONE PLC	49,868	3.24	161,672.05
KINGFISHER PLC	122,444	3.26	399,657.21

MARKS & SPENCER GROUP PLC	89,202	3.65	325,587.30
NEXT PLC	7,873	42.72	336,334.56
SAINSBURY (J) PLC	89,242	2.72	242,916.72
TESCO PLC	458,386	1.77	814,551.92
WILLIAM MORRISON SUPERMARKETS PLC	128,977	2.33	300,903.34
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	19,385	28.15	545,687.75
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	102,649	52.90	5,430,132.10
COCA-COLA HBC AG-CDI	8,704	21.58	187,832.32
DIAGEO PLC	138,536	22.59	3,129,528.24
IMPERIAL BRANDS PLC	52,785	38.17	2,014,803.45
TATE & LYLE PLC	24,535	7.68	188,428.80
UNILEVER PLC	70,665	40.14	2,836,846.42
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	59,885	5.83	349,129.55
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	34,704	73.05	2,535,127.20
MEDICLINIC INTERNATIONAL PLC	15,126	7.42	112,310.55
SMITH & NEPHEW PLC	50,414	12.69	639,753.66
ASTRAZENECA PLC	69,651	46.88	3,265,238.88
GLAXOSMITHKLINE PLC	268,472	15.99	4,292,867.28
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	7,449	19.05	141,903.45
SHIRE PLC	49,745	46.26	2,301,452.42
BARCLAYS PLC	920,279	2.22	2,050,381.61
HSBC HOLDINGS PLC	1,085,592	6.42	6,974,928.60
LLOYDS BANKING GROUP PLC	3,536,743	0.66	2,367,849.43
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	199,689	2.53	506,011.92
STANDARD CHARTERED PLC	183,394	7.28	1,335,291.71
3I GROUP PLC	52,448	7.94	416,437.12
ABERDEEN ASSET MGMT PLC	60,380	2.83	170,996.16
HARGREAVES LANSDOWN PLC	16,261	13.75	223,588.75
INVESTEC PLC	33,008	5.75	189,961.04
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP PLC	17,642	33.07	583,420.94
PROVIDENT FINANCIAL PLC	7,000	31.97	223,790.00
SCHRODERS PLC	8,092	31.55	255,302.60
ADMIRAL GROUP PLC	10,760	20.16	216,921.60
AVIVA PLC	225,689	5.29	1,193,894.81
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	82,732	3.48	288,155.55
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	330,065	2.61	862,129.78
OLD MUTUAL PLC	258,579	1.98	514,313.63
PRUDENTIAL PLC	140,352	16.94	2,377,562.88
RSA INSURANCE GROUP PLC	60,292	5.88	354,818.42
ST JAMES'S PLACE PLC	26,198	11.28	295,513.44
STANDARD LIFE PLC	124,704	3.68	460,033.05
AUTO TRADER GROUP PLC	56,277	4.05	228,428.34

	SAGE GROUP PLC/THE	55,139	6.66	367,225.74	
	WORLDPAY GROUP PLC	102,669	3.00	308,417.67	
	BT GROUP PLC	473,911	3.13	1,485,474.02	
	INMARSAT PLC	20,829	8.21	171,006.09	
	VODAFONE GROUP PLC	1,465,395	2.02	2,967,424.87	
	CENTRICA PLC	301,678	1.99	603,054.32	
	NATIONAL GRID PLC	204,373	10.10	2,065,189.16	
	SEVERN TRENT PLC	14,073	23.28	327,619.44	
	SSE PLC	55,851	13.98	780,796.98	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	38,716	9.79	379,029.64	
	英債券 小計	16,385,566		100,154,889.81 (14,310,130,656)	
スイスフラン	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	421	625.00	263,125.00	
	GIVAUDAN-REG	508	1,920.00	975,360.00	
	LAFARGEHOLCIM LTD	25,963	57.60	1,495,468.80	
	SIKA AG	117	6,280.00	734,760.00	
	SYNGENTA AG	5,083	456.80	2,321,914.40	
	ABB LTD	102,598	23.96	2,458,248.08	
	GEBERIT AG-REG	1,958	445.90	873,072.20	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	1,025	198.30	203,257.50	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	2,341	203.30	475,925.30	
	ADECCO GROUP AG-REG	9,116	75.05	684,155.80	
	SGS SA	312	2,214.00	690,768.00	
	KUEHNE&NAGEL INTL AG-REG	3,195	148.20	473,499.00	
	CIE FINANCIERE RICHEMONT SA-REGD A	28,341	82.35	2,333,881.35	
	THE SWATCH GROUP AG-B	1,730	383.60	663,628.00	
	THE SWATCH GROUP AG-REG	2,516	74.20	186,687.20	
	DUFREY AG-REG	2,687	159.20	427,770.40	
	ARYZTA AG	4,011	32.76	131,400.36	
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	109	1,368.00	149,112.00	
	LINDT & SPRUENGLI AG	60	5,610.00	336,600.00	
	LINDT & SPRUENGLI AG-REG	6	66,515.00	399,090.00	
	NESTLE SA-REGISTERED	170,893	77.20	13,192,939.60	
	SONOVA HOLDING AG	3,138	145.00	455,010.00	
	ACTELION LTD	5,340	279.30	1,491,462.00	
	GALENICA AG-REG	170	1,056.00	179,520.00	
	LONZA GROUP AG-REG	2,987	203.00	606,361.00	
	NOVARTIS AG-REG SHS	122,948	75.70	9,307,163.60	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	38,795	257.00	9,970,315.00	
	CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	112,407	15.30	1,719,827.10	
	JULIUS BAER GROUP LTD	12,563	50.65	636,315.95	
	PARGESA HOLDING SA-BR	1,867	73.30	136,851.10	

	PARTNERS GROUP HOLDING AG	944	587.00	554,128.00
	UBS GROUP AG	201,398	16.53	3,329,108.94
	BALOISE HOLDING AG	2,989	146.30	437,290.70
	SWISS LIFE HOLDING AG	1,719	334.10	574,317.90
	SWISS RE AG	17,504	87.10	1,524,598.40
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	8,288	273.00	2,262,624.00
	SWISS PRIME SITE-REG	4,185	86.90	363,676.50
	SWISSCOM AG-REG	1,349	440.80	594,639.20
	スイスフラン 小計	901,581		63,613,872.38 (7,131,751,232)
スウェーデンク ローナ	INTERNATIONAL PETROLEUM CORP	3,830	35.00	134,050.00
	LUNDIN PETROLEUM AB	11,490	170.10	1,954,449.00
	BOLIDEN AB	15,874	260.00	4,127,240.00
	ALFA LAVAL AB	17,285	180.90	3,126,856.50
	ASSA ABLOY AB-B	56,368	193.90	10,929,755.20
	ATLAS COPCO AB-A SHS	36,852	328.10	12,091,141.20
	ATLAS COPCO AB-B SHS	21,853	294.10	6,426,967.30
	SANDVIK AB	58,705	140.70	8,259,793.50
	SKANSKA AB-B SHS	19,178	212.70	4,079,160.60
	SKF AB-B SHARES	22,855	186.40	4,260,172.00
	VOLVO AB-B SHS	82,881	144.00	11,934,864.00
	SECURITAS AB-B SHS	16,445	144.30	2,373,013.50
	ELECTROLUX AB-SER B	13,837	259.20	3,586,550.40
	HUSQVARNA AB-B SHS	18,593	87.90	1,634,324.70
	HENNES & MAURITZ AB-B SHS	54,332	220.70	11,991,072.40
	ICA GRUPPEN AB	3,550	299.30	1,062,515.00
	SWEDISH MATCH AB	11,038	291.60	3,218,680.80
	SVENSKA CELLULOSA AB-B SHS	32,681	290.80	9,503,634.80
	GETINGE AB-B SHS	9,989	168.20	1,680,149.80
	NORDEA BANK AB	173,353	105.50	18,288,741.50
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN AB-A	85,831	101.80	8,737,595.80
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	86,384	124.40	10,746,169.60
	SWEDBANK AB - A SHARES	48,445	209.10	10,129,849.50
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	9,247	204.00	1,886,388.00
	INVESTOR AB-B SHS	24,219	405.10	9,811,116.90
	KINNEVIK AB-B SHS	11,257	247.30	2,783,856.10
LUNDBERGS AB-B SHS	1,567	629.50	986,426.50	
ERICSSON LM-B SHS	167,176	55.65	9,303,344.40	
HEXAGON AB-B SHS	14,555	376.30	5,477,046.50	
MILLICOM INTL CELLULAR-SDR	3,357	494.00	1,658,358.00	
TELE2 AB-B SHS	18,224	89.55	1,631,959.20	
TELIA CO AB	142,080	36.72	5,217,177.60	

	スウェーデンクローナ 小計	1,293,331		189,032,420.30 (2,404,492,386)
ノルウェークローネ	STATOIL ASA	60,728	142.50	8,653,740.00
	NORSK HYDRO ASA	73,158	53.25	3,895,663.50
	YARA INTERNATIONAL ASA	10,162	335.60	3,410,367.20
	SCHIBSTED ASA	3,623	213.60	773,872.80
	SCIBSTED ASA-B SHS	5,736	189.50	1,086,972.00
	MARINE HARVEST ASA	21,924	138.70	3,040,858.80
	ORKLA ASA	45,534	76.10	3,465,137.40
	DNB ASA	52,931	138.60	7,336,236.60
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	9,626	131.10	1,261,968.60
	TELENOR ASA	43,038	140.90	6,064,054.20
	ノルウェークローネ 小計	326,460		38,988,871.10 (507,245,213)
デンマーククローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	5,510	461.00	2,540,110.00
	NOVOZYMES A/S-B SHARES	13,280	288.40	3,829,952.00
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	11,823	583.50	6,898,720.50
	ISS A/S	8,394	282.00	2,367,108.00
	A P MOLLER-MAERSK A/S-A	226	11,160.00	2,522,160.00
	A P MOLLER-MAERSK A/S-B	379	11,650.00	4,415,350.00
	DSV A/S	10,662	381.20	4,064,354.40
	PANDORA A/S	6,148	715.50	4,398,894.00
	CARLSBERG AS-B	6,051	672.50	4,069,297.50
	COLOPLAST-B	6,296	576.50	3,629,644.00
	WILLIAM DEMANT HOLDING	4,455	153.60	684,288.00
	GENMAB A/S	3,295	1,317.00	4,339,515.00
	NOVO NORDISK A/S-B	105,268	253.70	26,706,491.60
	DANSKE BANK A/S	37,515	242.20	9,086,133.00
	TRYG A/S	5,005	131.40	657,657.00
	TDC A/S	48,014	37.05	1,778,918.70
DONG ENERGY A/S	8,287	268.60	2,225,888.20	
	デンマーククローネ 小計	280,608		84,214,481.90 (1,377,748,923)
オーストラリアドル	CALTEX AUSTRALIA LIMITED	14,497	29.33	425,197.01
	OIL SEARCH LTD	78,703	7.27	572,170.81
	ORIGIN ENERGY LIMITED	100,424	7.47	750,167.28
	SANTOS LTD	91,834	3.63	333,357.42
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	41,745	32.38	1,351,703.10
	ALUMINA LTD	106,977	1.80	193,093.48
	AMCOR LIMITED	60,582	15.65	948,108.30
	BHP BILLITON LTD	176,830	23.94	4,233,310.20
	BORAL LIMITED	72,331	5.98	432,539.38

FORTESCUE METALS GROUP LIMITED	84,994	5.31	451,318.14
INCITEC PIVOT LTD	85,406	3.66	312,585.96
JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	21,998	21.69	477,136.62
NEWCREST MINING LIMITED	42,676	23.58	1,006,300.08
ORICA LIMITED	22,325	18.13	404,752.25
RIO TINTO LIMITED	24,195	59.82	1,447,344.90
SOUTH32 LTD	297,652	2.78	827,472.56
CIMIC GROUP LTD	4,062	35.95	146,028.90
BRAMBLES LIMITED	90,587	9.89	895,905.43
SEEK LIMITED	16,538	16.74	276,846.12
AURIZON HOLDINGS LTD	111,161	5.10	566,921.10
QANTAS AIRWAYS LIMITED	24,631	3.97	97,785.07
ARISTOCRAT LEISURE LTD	27,132	19.30	523,647.60
CROWN RESORTS LTD	22,315	12.31	274,697.65
DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES LIMITED	3,373	61.50	207,439.50
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD	2,650	32.00	84,800.00
TABCORP HOLDINGS LIMITED	47,022	4.81	226,175.82
TATTS GROUP LTD	83,323	4.45	370,787.35
REA GROUP LTD	2,708	62.04	168,004.32
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	33,786	4.23	142,914.78
WESFARMERS LIMITED	61,198	43.75	2,677,412.50
WOOLWORTHS LIMITED	69,444	26.67	1,852,071.48
COCA-COLA AMATIL LIMITED	35,718	9.50	339,321.00
TREASURY WINE ESTATES LTD	40,165	11.99	481,578.35
COCHLEAR LIMITED	2,911	139.41	405,822.51
HEALTHSCOPE LTD	104,035	2.23	231,998.05
RAMSAY HEALTH CARE LTD	8,123	70.42	572,021.66
SONIC HEALTHCARE LTD	21,609	21.54	465,457.86
CSL LIMITED	25,104	128.59	3,228,123.36
AUST AND NZ BANKING GROUP LT	161,182	31.98	5,154,600.36
BANK OF QUEENSLAND LIMITED	17,851	11.78	210,284.78
BENDIGO AND ADELAIDE BANK	27,851	12.03	335,047.53
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	94,875	86.23	8,181,071.25
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	144,835	33.37	4,833,143.95
WESTPAC BANKING CORPORATION	184,234	34.61	6,376,338.74
ASX LTD	11,397	50.19	572,015.43
CHALLENGER FINANCIAL SERVICE	30,000	12.86	385,800.00
MACQUARIE GROUP LTD	17,198	89.10	1,532,341.80
AMP LIMITED	165,331	5.21	861,374.51
INSURANCE AUSTRALIA GROUP LT	132,301	6.08	804,390.08
MEDIBANK PRIVATE LTD	173,315	2.85	493,947.75
QBE INSURANCE GROUP LIMITED	76,262	12.62	962,426.44

	SUNCORP GROUP LTD	67,456	13.56	914,703.36	
	COMPUTERSHARE LIMITED	27,209	13.82	376,028.38	
	VOCUS GROUP LIMITED	33,249	3.40	113,046.60	
	TELSTRA CORPORATION LIMITED	230,155	4.21	968,952.55	
	TPG TELECOM LTD	17,758	5.96	105,837.68	
	AGL ENERGY LIMITED	37,149	26.95	1,001,165.55	
	AUSNET SERVICES	85,220	1.72	146,578.40	
	オーストラリアドル 小計	3,895,592		62,731,413.04 (5,269,438,695)	
ニュージーランドドル	FLETCHER BUILDING LTD	44,092	8.01	353,176.92	
	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	47,051	6.68	314,300.68	
	RYMAN HEALTHCARE LIMITED	22,111	8.63	190,817.93	
	SPARK NEW ZEALAND LIMITED	98,640	3.61	356,090.40	
	CONTACT ENERGY LIMITED	35,357	5.08	179,613.56	
	MERCURY NZ LTD	46,516	3.15	146,757.98	
	MERIDIAN ENERGY LTD	58,158	2.76	160,516.08	
	ニュージーランドドル 小計	351,925		1,701,273.55 (131,525,458)	
香港ドル	NWS HOLDINGS LTD	91,500	14.64	1,339,560.00	
	CATHAY PACIFIC AIRWAYS	57,000	11.24	640,680.00	
	MTR CORPORATION	85,000	44.75	3,803,750.00	
	LI & FUNG LTD	395,200	3.25	1,284,400.00	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	83,000	32.75	2,718,250.00	
	YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	45,000	31.05	1,397,250.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LIMITED	125,000	42.15	5,268,750.00	
	MGM CHINA HOLDINGS LTD	44,000	17.18	755,920.00	
	SANDS CHINA LTD	136,400	35.55	4,849,020.00	
	SHANGRI-LA ASIA LTD.	64,000	11.18	715,520.00	
	SJM HOLDINGS LIMITED	80,000	7.20	576,000.00	
	WYNN MACAU LTD	78,000	16.84	1,313,520.00	
	WH GROUP LIMITED	442,500	6.84	3,026,700.00	
	BANK OF EAST ASIA	74,020	32.10	2,376,042.00	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	205,000	31.40	6,437,000.00	
	HANG SENG BANK LTD	40,600	157.00	6,374,200.00	
	CHEUNG KONG PROPERTY HOLDING	153,924	55.15	8,488,908.60	
	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	146,924	96.85	14,229,589.40	
	FIRST PACIFIC COMPANY	86,000	5.87	504,820.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEARING LIMITED	64,900	192.00	12,460,800.00	
	AIA GROUP LTD	658,200	50.35	33,140,370.00	
	HANG LUNG GROUP LTD	42,000	33.60	1,411,200.00	
HANG LUNG PROPERTIES LTD	134,000	20.05	2,686,700.00		
HENDERSON LAND DEVELOPMENT	63,655	49.30	3,138,191.50		

	HYSAN DEVELOPMENT CO	29,000	36.35	1,054,150.00	
	KERRY PROPERTIES LTD	27,500	28.70	789,250.00	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	327,333	9.67	3,165,310.11	
	SINO LAND CO	160,200	13.06	2,092,212.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	82,000	116.20	9,528,400.00	
	SWIRE PACIFIC LTD 'A'	30,500	74.60	2,275,300.00	
	SWIRE PROPERTIES LIMITED	53,000	26.00	1,378,000.00	
	WHARF HOLDINGS LTD	77,000	66.65	5,132,050.00	
	WHEELLOCK&COMPANY LTD	41,000	62.00	2,542,000.00	
	PCCW LIMITED	194,000	4.42	857,480.00	
	CHEUNG KONG INFRASTRUCTURE	37,000	67.60	2,501,200.00	
	CLP HOLDINGS LTD	87,600	80.80	7,078,080.00	
	HK ELECTRIC INVESTMENTS-SS	160,000	6.81	1,089,600.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	439,981	15.38	6,766,907.78	
	POWER ASSETS HOLDINGS LIMITED	77,000	69.35	5,339,950.00	
	ASM PACIFIC TECHNOLOGY	12,400	111.00	1,376,400.00	
	香港ドル 小計	5,231,337		171,903,431.39 (2,459,938,103)	
シンガポールドル	KEPPEL CORP LTD	80,000	6.59	527,200.00	
	SEMBCORP INDUSTRIES LTD	63,020	3.08	194,101.60	
	SINGAPORE TECHNOLOGIES ENG	93,200	3.77	351,364.00	
	YANGZIJANG SHIPBUILDING HOLDINGS LTD	90,000	1.12	100,800.00	
	COMFORTDELGRO CORP LTD	107,000	2.73	292,110.00	
	SATS LTD	26,800	4.96	132,928.00	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	33,466	10.29	344,365.14	
	GENTING SINGAPORE PLC	351,800	1.07	378,185.00	
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	100,750	3.45	347,587.50	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	4,700	47.72	224,284.00	
	GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	353,600	0.36	129,064.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	122,000	3.55	433,100.00	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	98,200	19.20	1,885,440.00	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	169,300	9.71	1,643,903.00	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	71,700	21.94	1,573,098.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	50,200	7.52	377,504.00	
	CAPITALAND LTD	151,000	3.67	554,170.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	21,000	10.50	220,500.00	
	GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES LIMITED	128,600	2.87	369,082.00	
	UOL GROUP LIMITED	19,200	7.17	137,664.00	
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	438,615	3.75	1,644,806.25		
STARHUB LIMITED	44,700	2.79	124,713.00		
	シンガポールドル 小計	2,618,851		11,985,969.49 (958,038,541)	

イスラエルシュケル	FRUTAROM INDUSTRIES LTD	1,842	215.20	396,398.40	
	ISRAEL CHEMICALS LIMITED	32,527	15.24	495,711.48	
	ELBIT SYSTEMS LTD	1,581	434.00	686,154.00	
	BANK HAPOALIM BM	53,450	22.98	1,228,281.00	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	78,390	17.25	1,352,227.50	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	9,515	59.83	569,282.45	
	AZRIELI GROUP	1,762	199.00	350,638.00	
	NICE LTD	2,768	246.70	682,865.60	
	BEZEQ ISRAELI TELECOMMUNICATION CORP LTD	126,910	6.16	782,400.15	
イスラエルシュケル 小計		308,745		6,543,958.58 (200,114,253)	
合 計		64,099,177		197,388,118,688 (197,388,118,688)	

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

通貨	銘柄数	組入株式時価比率	合計金額に対する比率
米ドル	株式 598銘柄	62.5%	65.3%
カナダドル	株式 91銘柄	3.8%	3.9%
ユーロ	株式 235銘柄	12.6%	13.1%
英ポンド	株式 104銘柄	6.9%	7.2%
スイスフラン	株式 38銘柄	3.5%	3.6%
スウェーデンクローナ	株式 32銘柄	1.2%	1.2%
ノルウェークローネ	株式 10銘柄	0.2%	0.3%
デンマーククローネ	株式 17銘柄	0.7%	0.7%
オーストラリアドル	株式 58銘柄	2.6%	2.7%
ニュージーランドドル	株式 7銘柄	0.1%	0.1%
香港ドル	株式 40銘柄	1.2%	1.2%
シンガポールドル	株式 22銘柄	0.5%	0.5%
イスラエルシュケル	株式 9銘柄	0.1%	0.1%

(b) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	米ドル	AGNC INVESTMENT CORPORATION	19,807	413,372.09	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITIES, INC.	4,202	480,414.66	
		AMERICAN TOWER CORP	23,137	2,867,599.78	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	58,607	688,632.25	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	7,370	1,394,993.60	
		BOSTON PROPERTIES INC	8,255	1,105,922.35	
		BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	16,568	349,253.44	

	CAMDEN PROPERTY TRUST	5,168	434,473.76
	COLONY NORTHSTAR INC-CLASS A	30,148	394,335.84
	DIGITAL REALTY TRUST INC	8,411	942,788.99
	DUKE REALTY CORP	19,835	544,669.10
	EQUITY RESIDENTIAL	19,572	1,270,809.96
	ESSEX PROPERTY TRUST INC	3,456	823,910.40
	EXTRA SPACE STORAGE INC	7,123	559,725.34
	FEDERAL REALTY INVESTMENT TRUST	3,882	522,556.02
	GGP INC	32,657	738,374.77
	HCP, INC.	25,915	830,316.60
	HOST HOTELS AND RESORTS INC	38,771	738,587.55
	HUTCHISON PORT HOLDINGS TRUST	283,000	111,785.00
	IRON MOUNTAIN INC	14,246	520,548.84
	KIMCO REALTY CORPORATION	24,728	536,844.88
	LIBERTY PROPERTY TRUST	8,638	353,294.20
	MACERICH COMPANY/THE	6,717	428,544.60
	MID-AMERICA APARTMENT COMMUNITIES	6,365	645,856.55
	NATIONAL RETAIL PROPERTIES	8,661	381,430.44
	PROLOGIS INC	29,822	1,636,034.92
	PUBLIC STORAGE	8,277	1,866,794.58
	REALTY INCOME CORPORATION	14,528	869,210.24
	REGENCY CENTERS CORP	8,674	565,197.84
	SIMON PROPERTY GROUP INC	17,086	2,871,131.44
	SL GREEN REALTY CORP	5,628	609,287.28
	UDR INC	15,084	559,013.04
	VENTAS INC	18,928	1,224,263.04
	VEREIT INC	54,976	475,542.40
	VORNADO REALTY TRUST	9,519	957,230.64
	WELLTOWER INC	19,443	1,412,922.81
	WEYERHAEUSER CO	42,478	1,444,252.00
	米ドル 小計	929,682	32,569,921.24 (3,626,009,331)
カナダドル	H&R REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	8,036	186,837.00
	RIOCAN REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	7,441	196,219.17
	SMART REAL ESTATE INVESTMENT	4,552	148,986.96
	カナダドル 小計	20,029	532,043.13 (43,654,138)
ユーロ	FONCIERE DES REGIONS	1,550	127,782.00
	GECINA SA	2,342	306,684.90
	ICADE	1,873	128,169.39
	KLEPIERRE	12,954	471,719.91

	UNIBAIL-RODAMCO SE	5,470	1,254,544.50
	ユーロ 小計	24,189	2,288,900.70 (278,696,549)
英ポンド	BRITISH LAND CO PLC	53,233	350,273.14
	HAMMERSON PLC	43,671	263,117.77
	INTU PROPERTIES PLC	52,522	146,011.16
	LAND SECURITIES GROUP PLC	44,622	499,766.40
	SEGRO PLC	57,341	282,461.76
	英ポンド 小計	251,389	1,541,630.23 (220,268,127)
オーストラリアドル	APA GROUP	56,058	513,491.28
	DEXUS PROPERTY GROUP	53,132	537,164.52
	DUET GROUP	144,076	433,668.76
	GOODMAN GROUP	103,937	848,125.92
	GPT GROUP	98,809	526,651.97
	LENLEASE GROUP	30,493	491,547.16
	MIRVAC GROUP	182,452	412,341.52
	SCENTRE GROUP	292,819	1,273,762.65
	STOCKLAND	137,366	664,851.44
	SYDNEY AIRPORT	65,814	445,560.78
	TRANSURBAN GROUP	116,522	1,408,750.98
	VICINITY CENTRES	183,407	535,548.44
	WESTFIELD CORP	109,178	986,969.12
	オーストラリアドル 小計	1,574,063	9,078,434.54 (762,588,501)
香港ドル	HKT TRUST AND HKT LTD	216,000	2,129,760.00
	LINK REIT	123,000	6,918,750.00
	香港ドル 小計	339,000	9,048,510.00 (129,484,178)
シンガポールドル	ASCENDAS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	146,600	373,830.00
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	132,400	215,150.00
	CAPITALAND MALL TRUST	146,900	293,800.00
	SUNTEC REIT	112,900	198,139.50
	シンガポールドル 小計	538,800	1,080,919.50 (86,397,895)
	合計		5,147,098,719 (5,147,098,719)

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

通貨	銘柄数	組入投資証券 時価比率	合計金額に対する比率
----	-----	----------------	------------

米ドル	投資証券	37銘柄	1.8%	70.4%
カナダドル	投資証券	3銘柄	0.0%	0.8%
ユーロ	投資証券	5銘柄	0.1%	5.4%
英ポンド	投資証券	5銘柄	0.1%	4.3%
オーストラリアドル	投資証券	13銘柄	0.4%	14.8%
香港ドル	投資証券	2銘柄	0.1%	2.5%
シンガポールドル	投資証券	4銘柄	0.0%	1.7%

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

エマージング株式インデックス・マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	（平成28年 4月26日現在）	（平成29年 4月26日現在）
資産の部		
流動資産		
預金	193,185,264	10,183,907
金銭信託	4,495,676	76,318,953
コール・ローン	943,311	158,791,958
国債証券	887,573,630	332,535,056
派生商品評価勘定	101,017,159	392,938,251
現先取引勘定	-	6,202,108,000
未収入金	32,000,000	442,800,000
差入委託証拠金	947,154,178	1,470,610,559
流動資産合計	2,166,369,218	9,086,286,684
資産合計		
	2,166,369,218	9,086,286,684
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	857,806	8,141,532
前受金	100,261,949	338,756,037
未払利息	2	460
その他未払費用	318	2,793
流動負債合計	101,120,075	346,900,822
負債合計		
	101,120,075	346,900,822
純資産の部		
元本等		
元本	2,006,026,513	7,131,406,613
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	59,222,630	1,607,979,249
元本等合計	2,065,249,143	8,739,385,862
純資産合計		
	2,065,249,143	8,739,385,862
負債純資産合計		
	2,166,369,218	9,086,286,684

注記表

（重要な会計方針の注記）

項 目	自 平成28年 4月27日 至 平成29年 4月26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>(1) 先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場によっております。</p> <p>(2) 為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。</p>
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建資産等の会計処理</p> <p>「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

項 目	（平成28年 4月26日現在）	（平成29年 4月26日現在）
1. 担保資産	代用として、担保に供している資産は次の通りであります。	
	国債証券 110,937,263円	
2. 当計算期間の末日における受益権の総数	2,006,026,513口	7,131,406,613口
3. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.0295円 (10,000口当たりの純資産額 10,295円)	1口当たり純資産額 1.2255円 (10,000口当たりの純資産額 12,255円)

(金融商品に関する注記)

. 金融商品の状況に関する事項

項 目	自 平成28年 4月27日 至 平成29年 4月26日

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

項目	(平成29年 4月26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 4月26日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	1,996,110,050	-	2,096,371,999	100,261,949
	MSCIE 1606	1,996,110,050	-	2,096,371,999	100,261,949
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	66,000,000	-	65,897,404	102,596
	米ドル	66,000,000	-	65,897,404	102,596
合計		2,062,110,050	-	2,162,269,403	100,159,353

(平成29年 4月26日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	8,397,285,683	-	8,736,041,720	338,756,037
	MSCIE 1706	8,397,285,683	-	8,736,041,720	338,756,037
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	7,411,840,000	-	7,466,004,085	54,164,085

米ドル	7,411,840,000	-	7,466,004,085	54,164,085
売建	533,610,000	-	541,733,403	8,123,403
米ドル	533,610,000	-	541,733,403	8,123,403
合計	16,342,735,683	-	16,743,779,208	384,796,719

(注) 1. 時価の算定方法

(1) 株価指数先物取引の時価の算定方法について

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

(2) 為替予約取引の時価の算定方法について

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

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

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

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

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

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

自 平成28年 4月27日 至 平成29年 4月26日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。

(その他の注記)

(平成28年 4月26日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	119,552,288円
同期中における追加設定元本額	4,468,494,427円
同期中における一部解約元本額	2,582,020,202円
平成28年 4月26日現在における元本の内訳	

三井住友・DC全海外株式インデックスファンド	180,024,359円
三井住友・DC新興国株式インデックスファンド	219,672,433円
アセットアロケーション・ファンド（安定型）	216,585,271円
アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）	620,259,723円
アセットアロケーション・ファンド（成長型）	769,258,695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>	226,032円
合計	2,006,026,513円

（平成29年 4月26日現在）

開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	2,006,026,513円
同期中における追加設定元本額	9,945,059,083円
同期中における一部解約元本額	4,819,678,983円
平成29年 4月26日現在における元本の内訳	
三井住友・DC全海外株式インデックスファンド	374,585,554円
三井住友・DC新興国株式インデックスファンド	511,348,121円
アセットアロケーション・ファンド（安定型）	2,076,132,775円
アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）	2,012,190,512円
アセットアロケーション・ファンド（成長型）	2,088,086,742円
イオン・バランス戦略ファンド	65,650,758円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2050	2,993,261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>	418,890円
合計	7,131,406,613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	TREASURY BILL	3,000,000.00	2,986,931.25	
			3,000,000.00	2,986,931.25	

	米ドル 小計		(332,535,056)
	合計		332,535,056 (332,535,056)

(注1) 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 1銘柄	3.8%	100.0%

(注2) 上記以外に現先取引勘定に含まれる国債証券6,202,108,000円があります。

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。

Jリート・インデックス・マザーファンド

貸借対照表

	(平成28年 4月26日現在)	(平成29年 4月26日現在)
(単位:円)		
資産の部		
流動資産		
金銭信託	9,126,219	18,979,745
コール・ローン	1,914,920	39,489,941
投資証券	12,244,364,800	12,957,860,700
未収入金	132,111,100	3,000,000
未収配当金	96,781,619	123,849,688
流動資産合計	12,484,298,658	13,143,180,074
資産合計	12,484,298,658	13,143,180,074
負債の部		
流動負債		
未払解約金	32,235,000	33,000,000
未払利息	5	114
その他未払費用	827	1,504
流動負債合計	32,235,832	33,001,618
負債合計	32,235,832	33,001,618
純資産の部		
元本等		
元本	6,025,953,718	6,864,702,791
剰余金		
剰余金又は欠損金()	6,426,109,108	6,245,475,665
元本等合計	12,452,062,826	13,110,178,456
純資産合計	12,452,062,826	13,110,178,456
負債純資産合計	12,484,298,658	13,143,180,074

注記表

（重要な会計方針の注記）

項目	自 平成28年 4月27日 至 平成29年 4月26日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金の計上基準</p> <p>受取配当金は原則として、配当落ち日において、確定配当金額または予想配当金額を計上しております。なお、配当金額が未確定の場合は、入金日基準で計上しております。</p>

（貸借対照表に関する注記）

項目	（平成28年 4月26日現在）	（平成29年 4月26日現在）
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	6,025,953,718口	6,864,702,791口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 2.0664円 (10,000口当たりの純資産額 20,664円)	1口当たり純資産額 1.9098円 (10,000口当たりの純資産額 19,098円)

（金融商品に関する注記）

. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 平成28年 4月27日 至 平成29年 4月26日
1. 金融商品に対する取組方針	<p>当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。</p>
	(1) 金融商品の内容

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

金融商品の時価等に関する事項

項目	(平成29年 4月26日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。

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

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

自 平成28年 4月27日 至 平成29年 4月26日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。

（その他の注記）

（平成28年 4月26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	6,918,251,344円
同期中における追加設定元本額	2,079,164,602円
同期中における一部解約元本額	2,971,462,228円
平成28年 4月26日現在における元本の内訳	
アセットアロケーション・ファンド（安定型）	154,724,236円
アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）	248,131,237円
アセットアロケーション・ファンド（成長型）	333,044,826円
世界6資産バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	12,171,451円
三井住友・5資産バランスファンド・VAS（適格機関投資家専用）	3,540,901,696円
三井住友・7資産バランスファンド・VAS（適格機関投資家専用）	1,580,488,457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>	339,743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>	47,708,545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 >	261,016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 >	108,182,511円
合計	6,025,953,718円

(平成29年 4月26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	6,025,953,718円
同期中における追加設定元本額	4,648,294,616円
同期中における一部解約元本額	3,809,545,543円
平成29年 4月26日現在における元本の内訳	
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	741,377,245円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	761,896,307円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	783,469,418円
イオン・バランス戦略ファンド	3,154,211円
三井住友・DC日本リートインデックスファンド	90,325,677円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2050	1,317,116円
世界6資産バランスファンドVA< 適格機関投資家限定 >	5,313,242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)	2,318,589,533円
三井住友・7資産バランスファンド・VAS(適格機関投資家専用)	1,292,957,354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 >	877,450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 >	409,783,442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 >	196,364,148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 >	259,277,648円
合計	6,864,702,791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
投資証券	日本アコモデーションファンド投資法人	547	261,739,500	
	MCUBS MidCity投資法人	332	111,718,000	
	森ヒルズリート投資法人	1,855	269,531,500	

産業ファンド投資法人	446	220,770,000	
アドバンス・レジデンス投資法人	1,524	447,446,400	
ケネディクス・レジデンシャル投資法人	382	111,582,200	
アクティビア・プロパティーズ投資法人	728	385,112,000	
G L P 投資法人	3,021	380,948,100	
コンフォリア・レジデンシャル投資法人	614	152,701,800	
日本プロロジスリート投資法人	2,019	481,127,700	
星野リゾート・リート投資法人	193	110,010,000	
星野リゾート・リート投資法人	1	570,000	
S I A 不動産投資法人	192	36,326,400	
イオンリート投資法人	1,603	196,688,100	
ヒューリックリート投資法人	1,105	199,673,500	
日本リート投資法人	442	126,412,000	
インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人	916	90,409,200	
日本ヘルスケア投資法人	85	14,093,000	
積水ハウス・リート投資法人	980	139,944,000	
トーセイ・リート投資法人	206	21,135,600	
ケネディクス商業リート投資法人	584	142,379,200	
ヘルスケア&メディカル投資法人	209	20,126,700	
サムティ・レジデンシャル投資法人	305	24,918,500	
ジャパン・シニアリビング投資法人	97	13,192,000	
野村不動産マスターファンド投資法人	4,717	771,229,500	
いちごホテルリート投資法人	275	30,277,500	
ラサールロジポート投資法人	1,240	130,200,000	
スターアジア不動産投資法人	387	37,887,300	
マリモ地方創生リート投資法人	101	8,999,100	
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	261	84,042,000	
大江戸温泉リート投資法人	204	18,380,400	
さくら総合リート投資法人	381	29,870,400	
投資法人みらい	205	30,770,500	
森トラスト・ホテルリート投資法人	345	52,440,000	
日本ビルファンド投資法人	1,592	961,568,000	
ジャパンリアルエステイト投資法人	1,524	903,732,000	
日本リテールファンド投資法人	3,100	683,240,000	
オリックス不動産投資法人	3,107	545,899,900	
日本プライムリアルティ投資法人	1,039	441,575,000	
プレミア投資法人	1,484	177,486,400	
東急リアル・エステート投資法人	1,102	151,414,800	
グローバル・ワン不動産投資法人	260	99,320,000	
ユナイテッド・アーバン投資法人	3,551	604,025,100	
森トラスト総合リート投資法人	1,302	226,157,400	
インヴィンシブル投資法人	3,965	172,874,000	

フロンティア不動産投資法人	560	271,600,000
平和不動産リート投資法人	1,076	89,630,800
日本ロジスティクスファンド投資法人	1,022	241,192,000
福岡リート投資法人	817	144,282,200
ケネディクス・オフィス投資法人	471	297,201,000
積水ハウス・S I 投資法人	1,243	147,295,500
いちごオフィスリート投資法人	1,457	93,248,000
大和証券オフィス投資法人	440	238,920,000
阪急リート投資法人	673	99,334,800
スタートプロシード投資法人	275	39,325,000
大和ハウスリート投資法人	1,775	504,810,000
ジャパン・ホテル・リート投資法人	4,369	331,170,200
日本賃貸住宅投資法人	1,846	147,680,000
ジャパンエクセレント投資法人	1,473	192,226,500
合計	66,025	12,957,860,700

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。

外国リート・インデックス・マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

（平成28年 4月26日現在） （平成29年 4月26日現在）

資産の部		
流動資産		
預金	21,517,980	88,657,333
金銭信託	851,471	1,599,132
コール・ローン	178,661	3,327,211
投資証券	3,475,903,318	4,853,273,623
派生商品評価勘定	-	15,120
未収入金	33,462,757	587,391,197
未収配当金	5,089,920	9,999,763
流動資産合計	3,537,004,107	5,544,263,379
資産合計	3,537,004,107	5,544,263,379
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	-	7,771,680
未払解約金	-	610,153,068
未払利息	-	9
その他未払費用	21	306
流動負債合計	21	617,925,063
負債合計	21	617,925,063
純資産の部		
元本等		
元本	1,897,750,493	2,517,086,687
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	1,639,253,593	2,409,251,629
元本等合計	3,537,004,086	4,926,338,316

（平成28年 4月26日現在）

（平成29年 4月26日現在）

純資産合計	3,537,004,086	4,926,338,316
負債純資産合計	3,537,004,107	5,544,263,379

注記表

（重要な会計方針の注記）

項目	自 平成28年 4月27日 至 平成29年 4月26日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金の計上基準 受取配当金は原則として、配当落ち日において、確定配当金額または予想配当金額を計上しております。なお、配当金額が未確定の場合は、入金日基準で計上しております。</p>
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建資産等の会計処理 「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。</p>

（貸借対照表に関する注記）

項目	（平成28年 4月26日現在）	（平成29年 4月26日現在）
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	1,897,750,493口	2,517,086,687口
2. 1単位当たり純資産の額	<p>1口当たり純資産額 1.8638円</p> <p>(10,000口当たりの純資産額 18,638円)</p>	<p>1口当たり純資産額 1.9572円</p> <p>(10,000口当たりの純資産額 19,572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 4月27日 至 平成29年 4月26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、投資証券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。当計算期間については、為替予約取引を行っております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2)金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する委員会をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用グループに是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用グループは、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。その後、当該関連運用グループの対処の実施や対処方針の決定等に関し、必要に応じてリスク管理を行う部署が当該部署の担当役員、当該関連運用グループの担当役員およびリスク管理委員会へ報告を行う体制となっております。</p> <p>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する部会にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。</p>

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

・金融商品の時価等に関する事項

項目	(平成29年 4月26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（投資証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

（デリバティブ取引に関する注記）

（平成28年 4月26日現在）

該当事項はありません。

（平成29年 4月26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	643,304,710	-	651,061,270	7,756,560
	米ドル	471,157,480	-	476,783,560	5,626,080
	カナダドル	10,860,747	-	10,911,320	50,573
	ユーロ	41,700,530	-	42,494,240	793,710
	英ポンド オーストラリアドル	32,683,464 52,684,680	- -	33,145,840 53,165,670	462,376 480,990

ニュージーランドドル	3,871,000	-	3,865,000	6,000
香港ドル	11,643,480	-	11,754,600	111,120
シンガポールドル	18,703,329	-	18,941,040	237,711
合計	643,304,710	-	651,061,270	7,756,560

(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 4月27日
至 平成29年 4月26日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。

(その他の注記)

(平成28年 4月26日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	1,889,466,852円
同期中における追加設定元本額	790,288,128円
同期中における一部解約元本額	782,004,487円
平成28年 4月26日現在における元本の内訳	
アセットアロケーション・ファンド（安定型）	43,481,374円
アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）	64,006,589円
アセットアロケーション・ファンド（成長型）	82,221,482円
世界6資産バランスファンドVA <適格機関投資家限定>	12,834,491円
三井住友・7資産バランスファンド・VAS（適格機関投資家専用）	1,677,164,018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>	126,508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>	17,764,858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>	151,173円
合計	1,897,750,493円

(平成29年 4月26日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	1,897,750,493円
同期中における追加設定元本額	2,572,577,256円
同期中における一部解約元本額	1,953,241,062円
平成29年 4月26日現在における元本の内訳	
アセットアロケーション・ファンド（安定型）	273,718,992円
アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）	297,440,447円
アセットアロケーション・ファンド（成長型）	336,824,509円
イオン・バランス戦略ファンド	2,795,064円
三井住友・DC外国リートインデックスファンド	281,893,463円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2050	529,463円
世界6資産バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	5,520,079円
三井住友・7資産バランスファンド・VAS（適格機関投資家専用）	1,318,190,355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>	174,315円
合計	2,517,086,687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
投資証券	米ドル	ACADIA REALTY TRUST	4,008	123,246.00	
		AGREE REALTY CORP	1,153	58,099.67	
		ALEXANDER'S INC	136	59,636.00	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITIES, INC.	3,761	429,995.13	
		AMERICAN ASSETS TRUST INC	1,900	82,612.00	
		AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES INC	4,780	231,782.20	
		AMERICAN HOMES 4 RENT-A	9,435	221,533.80	

APARTMENT INVESTMENT & MANEGEMENT CO-A	6,213	277,410.45	
APPLE HOSPITALITY REIT INC	5,200	100,464.00	
ARMADA HOFFLER PROPERTIES INC	3,100	45,043.00	
ASHFORD HOSPITALITY PRIME INC	602	6,622.00	
ASHFORD HOSPITALITY TRUST	6,012	39,378.60	
AVALONBAY COMMUNITIES INC	5,213	986,716.64	
BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH	600	7,620.00	
BOSTON PROPERTIES INC	5,755	770,997.35	
BRANDYWINE REALTY TRUST	7,125	122,122.50	
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	8,800	185,504.00	
CAMDEN PROPERTY TRUST	3,068	257,926.76	
CARE CAPITAL PROPERTIES INC	2,452	68,557.92	
CARETRUST REIT INC	1,749	31,079.73	
CBL & ASSOCIATES PROPERTIES	9,301	90,033.68	
CEDAR REALTY TRUST INC	2,130	11,352.90	
CHATHAM LODGING TRUST	2,800	56,336.00	
CHESAPEAKE LODGING TRUST	3,300	81,510.00	
CITY OFFICE REIT INC	600	7,518.00	
COLONY NORTHSTAR INC-CLASS A	19,160	250,612.80	
COLONY STARWOOD HOMES	4,600	158,286.00	
COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	5,400	122,202.00	
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST I	300	7,626.00	
CORECIVIC INC	5,005	172,422.25	
CORESITE REALTY CORPORATION	1,300	120,653.00	
CORPORATE OFFICE PROPERTIES	4,717	157,642.14	
COUSINS PROPERTIES INC	16,083	135,418.86	
CUBESMART	5,847	158,453.70	
CYRUSONE INC	3,200	171,456.00	
DCT INDUSTRIAL TRUST INC	3,000	152,070.00	
DDR CORPORATION	11,595	143,662.05	
DIAMONDROCK HOSPITALITY COMPANY	8,557	98,491.07	
DIGITAL REALTY TRUST INC	5,927	664,357.43	
DOUGLAS EMMETT INC	5,600	217,336.00	
DUKE REALTY CORP	14,515	398,581.90	
DUPONT FABROS TECHNOLOGY	3,500	176,470.00	
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTIES	400	8,168.00	
EASTGROUP PROPERTIES INC	1,102	87,058.00	
EDUCATION REALTY TRUST INC	3,594	143,436.54	
EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	5,600	121,016.00	
EPR PROPERTIES	2,104	157,547.52	
EQUITY COMMONWEALTH REIT	4,408	141,496.80	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES INC	2,808	229,890.96	

EQUITY RESIDENTIAL	13,800	896,034.00	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	2,429	579,073.60	
EXTRA SPACE STORAGE INC	5,114	401,858.12	
FARMLAND PARTNERS INC	300	3,315.00	
FEDERAL REALTY INVESTMENT TRUST	2,602	350,255.22	
FELCOR LODGING TRUST INC	6,567	53,389.71	
FIRST INDUSTRIAL REALTY TRUST INC	5,194	145,380.06	
FIRST POTOMAC REALTY TRUST	3,166	35,110.94	
FOREST CITY REALTY TRUST-A	8,100	185,895.00	
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	1,339	31,520.06	
FRANKLIN STREET PROPERTIES CORPORATION	3,700	44,918.00	
GAMING AND LEISURE PROPERTIES INC	7,680	265,420.80	
GEO GROUP INC	3,000	100,920.00	
GEO GROUP INC-NEW	1,500	50,460.00	
GETTY REALTY CORPORATION	1,428	37,370.76	
GGP INC	21,376	483,311.36	
GLADSTONE COMMERCIAL CORPORATION	1,440	32,558.40	
GLOBAL NET LEASE INC	3,433	82,872.62	
GOVERNMENT PROPERTIES INCOME TRUST	2,700	58,455.00	
GRAMERCY PROPERTY TRUST	5,829	164,086.35	
HCP, INC.	17,218	551,664.72	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	5,072	169,810.56	
HEALTHCARE TRUST OF AMERICA INC	4,600	148,396.00	
HERSHA HOSPITALITY TRUST	1,018	19,128.22	
HIGHWOODS PROPERTIES INC	3,336	171,703.92	
HOSPITALITY PROPERTIES TRUST	7,064	227,107.60	
HOST HOTELS AND RESORTS INC	27,083	515,931.15	
HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC	6,400	224,448.00	
INDEPENDENCE REALTY TRUST	4,641	43,996.68	
INVESTORS REAL ESTATE TRUST	3,233	19,753.63	
INVITATION HOMES INC	4,000	86,880.00	
IRON MOUNTAIN INC	9,700	354,438.00	
ISTAR INC	3,000	37,260.00	
KILROY REALTY CORP	3,404	250,330.16	
KIMCO REALTY CORPORATION	17,547	380,945.37	
KITE REALTY GROUP TRUST	4,261	90,972.35	
LASALLE HOTEL PROPERTIES	5,751	172,817.55	
LEXINGTON REALTY TRUST	8,927	91,591.02	
LIBERTY PROPERTY TRUST	4,995	204,295.50	

LIFE STORAGE INC	1,723	142,819.47
LTC PROPERTIES INC	2,076	101,474.88
MACERICH COMPANY/THE	4,237	270,320.60
MACK-CALI REALTY CORPORATION	2,599	72,668.04
MANULIFE US REAL ESTATE INV	20,000	16,800.00
MEDEQUITIES REALTY TRUST INC	1,500	18,000.00
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	10,231	141,597.04
MID-AMERICA APARTMENT COMMUNITIES	4,608	467,573.76
MONMOUTH REAL ESTATE INVESTMENT CORP	3,536	53,146.08
MONOGRAM RESIDENTIAL TRUST I	8,000	82,720.00
NATIONAL HEALTH INVESTORS INC	1,225	91,323.75
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	5,851	257,678.04
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	1,400	35,644.00
NEW SENIOR INVESTMENT GROUP	2,800	30,072.00
NEXPOINT RESIDENTIAL TRUST	500	12,220.00
NORTHSTAR REALTY EUROPE CORP	2,216	26,126.64
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS INC	7,710	265,224.00
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	1,000	24,680.00
PARK HOTELS AND RESORTS INC	5,500	146,355.00
PARKWAY INC	1,510	30,894.60
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	3,800	117,838.00
PENNSYLVANIA REAL ESTATE INVESTMENT TRUS	2,331	34,009.29
PHYSICIANS REALTY TRUST	5,100	102,561.00
PIEDMONT OFFICE REALTY TRUST INC	6,000	133,680.00
PREFERRED APARTMENT COMMUNITIES INC	100	1,438.00
PROLOGIS INC	20,037	1,099,229.82
PS BUSINESS PARKS INC/CA	604	73,428.28
PUBLIC STORAGE	5,716	1,289,186.64
QTS REALTY TRUST INC-CL A	1,900	99,826.00
QUALITY CARE PROPERTIES	3,883	72,029.65
RAMCO-GERSHENSON PROPERTIES	2,740	38,990.20
REALTY INCOME CORPORATION	9,984	597,342.72
REGENCY CENTERS CORP	5,251	342,155.16
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS CORP	4,100	88,232.00
RETAIL PROPERTIES OF AMERICA	10,600	151,474.00
REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC	2,000	49,820.00
RLJ LODGING TRUST	4,200	95,718.00
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	2,500	160,725.00
SABRA HEALTH CARE REIT	2,800	79,660.00

	SAUL CENTERS INC	703	44,738.92	
	SELECT INCOME REIT	1,900	47,215.00	
	SENIOR HOUSING PROPERTIES TRUST	10,261	223,587.19	
	SERITAGE GROWTH PROP- A REIT	1,500	66,060.00	
	SILVER BAY REALTY TRUST CORP	1,100	23,661.00	
	SIMON PROPERTY GROUP INC	12,198	2,049,751.92	
	SL GREEN REALTY CORP	3,606	390,385.56	
	SPIRIT REALTY CAPITAL INC	15,800	159,264.00	
	STAG INDUSTRIAL INC	3,500	92,925.00	
	STORE CAPITAL CORP	7,000	173,670.00	
	SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	5,200	88,816.00	
	SUN COMMUNITIES INC	2,588	219,151.84	
	SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	9,759	154,094.61	
	TANGER FACTORY OUTLET CENTERS, INC	3,970	129,660.20	
	TAUBMAN CENTERS INC	2,625	172,016.25	
	TERRENO REALTY CORP	3,000	91,530.00	
	TIER REIT INC	1,800	31,986.00	
	UDR INC	9,512	352,514.72	
	UMH PROPERTIES INC	800	12,520.00	
	UNIVERSAL HEALTH REALTY INCOME TRUST	715	49,942.75	
	URBAN EDGE PROPERTIES	4,634	124,839.96	
	URSTADT BIDDLE PROPERTIES - CL A	442	9,043.32	
	VENTAS INC	13,260	857,656.80	
	VEREIT INC	34,410	297,646.50	
	VORNADO REALTY TRUST	6,348	638,354.88	
	WASHINGTON PRIME GROUP INC	9,830	88,568.30	
	WASHINGTON REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	3,670	118,651.10	
	WEINGARTEN REALTY INVESTORS	5,367	181,726.62	
	WELLTOWER INC	13,624	990,056.08	
	WHEELER REAL ESTATE INVESTMENT	125	1,731.25	
	WHITESTONE REIT	200	2,576.00	
	WP CAREY INC	3,650	232,432.00	
	XENIA HOTELS & RESORTS INC	4,000	70,800.00	
	米ドル 小計	858,427	31,413,384.21 (3,497,252,064)	
カナダドル	AGELLAN COMMERCIAL REAL ESTA	500	5,835.00	
	ALLIED PROPERTIES REAL ESTATE	2,100	78,309.00	
	ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	3,800	51,794.00	
	BOARDWALK REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	735	34,140.75	

	BROOKFIELD CANADA OFFICE PROPERTI-U	800	26,088.00	
	CAN APARTMENT PROP	2,197	75,928.32	
	CANADIAN REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	610	30,188.90	
	CHOICE PROPERTIES REIT	2,800	39,116.00	
	COMINAR REAL ESTATE INV-TR	4,692	67,799.40	
	CROMBIE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	1,500	21,900.00	
	CT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	200	2,956.00	
	DREAM GLOBAL REAL ESTATE INVESTMENT TRUS	2,000	19,860.00	
	DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE INVEST TR	100	867.00	
	DREAM OFFICE REAL ESTATE INVESTMENT TRUS	1,476	29,357.64	
	GRANITE REAL ESTATE INVESTME	1,000	48,770.00	
	H&R REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	6,112	142,104.00	
	INTERRENT REAL ESTATE INVEST	1,000	7,900.00	
	KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	1,000	13,040.00	
	MILESTONE APARTMENTS REAL E	2,300	50,692.00	
	MORGUARD NORTH AMERICAN RE	100	1,528.00	
	MORGUARD REAL ESTATE-TR UTS	1,503	23,281.47	
	NORTHVIEW APARTMENT REIT	52	1,190.28	
	NORTHWEST HEALTHCARE PROPERTIES	1,500	16,365.00	
	ONEREIT	3,500	13,160.00	
	PLAZA RETAIL REIT	1,500	7,380.00	
	PURE INDUSTRIAL REAL ESTATE	5,000	32,800.00	
	RIOCAN REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	6,227	164,205.99	
	SLATE OFFICE REIT	1,000	8,310.00	
	SLATE RETAIL REIT	500	7,510.00	
	SMART REAL ESTATE INVESTMENT	2,605	85,261.65	
	カナダドル 小計	58,409	1,107,638.40 (90,881,730)	
ユーロ	AEDIFICA	700	50,540.00	
	ALSTRIA OFFICE REIT-AG	6,170	73,731.50	
	ALTAREA	70	12,740.00	
	AXIARE PATRIMONIO SOCIMI SA	3,230	48,595.35	
	BEFIMMO SCA	744	39,781.68	
	BENI STABILU SPA	55,650	32,944.80	
	COFINIMMO	655	73,098.00	
	EUROCOMMERCIAL	1,214	43,521.90	
	FONCIERE DES REGIONS	1,887	155,564.28	
	GECINA SA	1,654	216,591.30	

	GREEN REIT PLC	42,000	57,330.00	
	HAMBORNER REIT AG	5,340	50,959.62	
	HIBERNIA REIT PLC	45,270	57,130.74	
	HISPANIA ACTIVOS INMOBILIARI	3,600	50,544.00	
	ICADE	1,640	112,225.20	
	IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	3,800	3,112.20	
	INTERVEST OFFICES & WAREHOUSES	300	7,141.50	
	IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	10,100	13,029.00	
	KLEPIERRE	7,281	265,137.61	
	LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIMI SA	2,620	19,519.00	
	MERCIALYS	2,280	41,097.00	
	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	17,820	193,347.00	
	MONTEA	200	9,350.00	
	NSI NV	5,816	22,566.08	
	RETAIL ESTATES	200	15,672.00	
	UNIBAIL-RODAMCO SE	3,715	852,035.25	
	VASTNED RETAIL	925	32,139.12	
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	682	62,232.50	
	WARELDHAVE BELGIUM CVA/SCA	80	8,000.00	
	WERELDHAVE NV	1,645	69,270.95	
	XIOR STUDENT HOUSING NV	50	1,823.75	
	ユーロ 小計	227,338	2,690,771.33 (327,628,317)	
英債券	ASSURA PLC	75,000	44,587.50	
	BIG YELLOW GROUP PLC	5,900	45,931.50	
	BRITISH LAND CO PLC	38,400	252,672.00	
	CAPITAL & REGIONAL PLC	20,000	11,900.00	
	CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	10,000	11,025.00	
	DERWENT LONDON PLC	3,450	102,982.50	
	EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	20,000	21,950.00	
	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	11,900	82,526.50	
	HAMMERSON PLC	33,200	200,030.00	
	HANSTEEN HOLDINGS PLC	40,900	51,043.20	
	INTU PROPERTIES PLC	28,000	77,840.00	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	28,500	319,200.00	
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	38,040	63,564.84	
	MCKAY SECURITIES PLC-ORD	100	230.00	
	MUCKLOW A & J GROUP PLC	2,000	10,080.00	
	NEWRIVER REIT PLC	14,000	47,670.00	
	PRIMARY HEALTH PROPERTIES PLC	38,648	43,672.24	
	REDEFINE INTERNATIONAL PLC	40,100	15,294.14	
	REGIONAL REIT LTD	5,000	5,325.00	

	SAFESTORE HOLDINGS PLC	6,200	25,320.80	
	SCHRODER REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	15,000	9,675.00	
	SEGRO PLC	41,293	203,409.31	
	SHAFTESBURY PLC	8,300	78,144.50	
	TRITAX BIG BOX REIT PLC	50,000	70,400.00	
	UNITE GROUP PLC	11,000	70,785.00	
	WORKSPACE GROUP PLC	4,660	39,446.90	
	英債券 小計	589,591	1,904,705.93 (272,144,383)	
オーストラリアドル	360 CAPITAL GROUP LTD	100	102.00	
	ABACUS PROPERTY GROUP	12,723	43,512.66	
	ALE PROPERTY GROUP	7,000	33,670.00	
	ARENA REIT	3,100	6,634.00	
	ASPEN GROUP	15,400	16,632.00	
	ASTRO JAPAN PROPERTY GROUP	1,983	13,246.44	
	BWP TRUST	11,260	32,991.80	
	CENTUREA URBAN REIT	8,000	17,920.00	
	CHARTER HALL GROUP	20,484	115,939.44	
	CHARTER HALL LONG WALE REIT	5,000	20,000.00	
	CHARTER HALL RETAIL REIT	11,701	52,420.48	
	CROMWELL PROPERTY GROUP	37,000	35,890.00	
	DEXUS PROPERTY GROUP	42,368	428,340.48	
	FOLKESTONE EDUCATION TRUST	7,100	20,306.00	
	GDI PROPERTY GROUP	43,000	44,935.00	
	GENERATION HEALTHCARE REIT	5,000	11,350.00	
	GOODMAN GROUP	67,256	548,808.96	
	GPT GROUP	62,000	330,460.00	
	GROWTHPOINT PROPERTIES AUS	13,000	41,990.00	
	HOTEL PROPERTY INVESTMENTS LTD	100	295.00	
	INDUSTRIA REIT	1,000	2,220.00	
	INGENIA COMMUNITIES GROUP	8,166	22,783.14	
	INVESTA OFFICE FUND	25,559	121,916.43	
	MIRVAC GROUP	144,322	326,167.72	
	NATIONAL STORAGE REIT	11,000	16,500.00	
	PROPERTYLINK GROUP	28,000	22,820.00	
	SCENTRE GROUP	201,413	876,146.55	
	SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA PROPERTY GR	38,000	87,400.00	
	STOCKLAND	97,730	473,013.20	
	VICINITY CENTRES	112,571	328,707.32	
	VIVA ENERGY REIT	18,000	42,660.00	
	WESTFIELD CORP	69,369	627,095.76	

オーストラリアドル 小計		1,128,705	4,762,874.38 (400,081,447)
ニュージーランドドル	ARGOSY PROPERTY LTD	30,000	30,300.00
	GOODMAN PROPERTY TRUST	45,925	56,258.12
	INVESTORE PROPERTY LTD	2,250	2,970.00
	KIWI PROPERTY GROUP LTD	49,907	70,368.87
	PRECINCT PROPERTIES NEW ZEAL	16,000	19,360.00
	PROPERTY FOR INDUSTRY LTD	24,000	39,000.00
	STRIDE STAPLED GROUP	24,000	41,760.00
	VITAL HEALTHCARE PROPERTY TRUST	19,000	41,800.00
ニュージーランドドル 小計		211,082	301,816.99 (23,333,471)
香港ドル	CHAMPION REAL ESTATE INVESTMENT	75,000	375,000.00
	FORTUNE REIT	73,000	654,080.00
	LINK REIT	82,100	4,618,125.00
	PROSPERITY REIT	60,000	190,800.00
	REGAL REAL ESTATE INVESTMENT	3,000	6,810.00
	SPRING REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	28,000	92,120.00
	SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	62,000	297,600.00
	YUEXIU REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	58,000	265,640.00
香港ドル 小計		441,100	6,500,175.00 (93,017,504)
シンガポールドル	AIMS AMP CAPITAL INDUSTRIAL REIT	23,500	32,665.00
	ASCENDAS HOSPITALITY TRUST	25,000	19,500.00
	ASCENDAS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	77,000	196,350.00
	ASCOTT RESIDENCE TRUST	40,000	43,600.00
	CACHE LOGISTICS TRUST	27,000	24,435.00
	CAMBRIDGE INDUSTRIAL TRUST	48,000	27,600.00
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	61,000	99,125.00
	CAPITALAND MALL TRUST	83,500	167,000.00
	CAPITALAND RETAIL CHINA TRUST	20,000	30,800.00
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	17,350	25,504.50
	FAR EAST HOSPITALITY TRUST	46,000	27,830.00
	FIRST REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	28,000	37,380.00
	FRASERS CENTREPOINT TRUST	34,000	71,740.00
	FRASERS COMMERCIAL TRUST	41,800	56,639.00
	FRASERS LOGISTICS & INDUSTRIAL TRUST	40,000	40,400.00
	KEPPEL DC REIT	25,000	31,000.00

	KEPPEL REIT	87,000	91,350.00
	LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL T	100,000	40,500.00
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	76,000	119,320.00
	MAPLETREE GREATER CHINA COMM	78,000	81,120.00
	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	51,800	94,276.00
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	60,250	66,877.50
	OUE COMMERCIAL REAL ESTATE INVESTMENT	2,000	1,400.00
	OUE HOSPITALITY TRUST	36,000	25,380.00
	PARKWAY LIFE REAL ESTATE	10,000	26,000.00
	SABANA SHARIAH COMPLIANT INDUSTRIAL REIT	81,000	36,855.00
	SOILBUILD BUSINESS SPACE REI	26,000	17,160.00
	SPH REIT	43,000	42,140.00
	STARHILL GLOBAL REIT	54,000	41,580.00
	SUNTEC REIT	120,000	210,600.00
	シンガポールドル 小計	1,462,200	1,826,127.00 (145,962,331)
イスラエルシェケル	REIT 1 LTD	8,000	97,200.00
	イスラエルシェケル 小計	8,000	97,200.00 (2,972,376)
	合計		4,853,273,623 (4,853,273,623)

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

通貨	銘柄数	組入投資証券 時価比率	合計金額に対する比率
米ドル	投資証券 160銘柄	71.0%	72.1%
カナダドル	投資証券 30銘柄	1.8%	1.9%
ユーロ	投資証券 31銘柄	6.7%	6.8%
英ポンド	投資証券 26銘柄	5.5%	5.6%
オーストラリアドル	投資証券 32銘柄	8.1%	8.2%
ニュージーランドドル	投資証券 8銘柄	0.5%	0.5%
香港ドル	投資証券 8銘柄	1.9%	1.9%
シンガポールドル	投資証券 30銘柄	3.0%	3.0%
イスラエルシェケル	投資証券 1銘柄	0.1%	0.1%

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。

国内債券パッシブ・マザーファンド

貸借対照表

	(単位：円)	
	(平成28年 4月26日現在)	(平成29年 4月26日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	592,030,680	147,622,892
コール・ローン	124,223,553	307,149,496
国債証券	187,022,593,690	161,177,348,860
地方債証券	19,729,099,215	17,616,234,832
特殊債券	27,476,730,827	27,334,302,311
社債券	14,060,015,000	9,808,138,000
未収入金	189,125,200	802,732,100
未収利息	646,118,982	527,827,717
前払費用	17,968,934	9,828,201
流動資産合計	249,857,906,081	217,731,184,409
資産合計	249,857,906,081	217,731,184,409
負債の部		
流動負債		
未払解約金	93,158,597	498,393,710
未払利息	364	890
その他未払費用	19,393	19,314
流動負債合計	93,178,354	498,413,914
負債合計	93,178,354	498,413,914
純資産の部		
元本等		
元本	195,629,774,814	173,031,066,223
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	54,134,952,913	44,201,704,272
元本等合計	249,764,727,727	217,232,770,495
純資産合計	249,764,727,727	217,232,770,495
負債純資産合計	249,857,906,081	217,731,184,409

注記表

(重要な会計方針の注記)

項 目	自 平成28年 4月27日 至 平成29年 4月26日

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

(貸借対照表に関する注記)

項目	(平成28年 4月26日現在)	(平成29年 4月26日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	195,629,774,814口	173,031,066,223口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.2767円 (10,000口当たりの純資産額 12,767円)	1口当たり純資産額 1.2555円 (10,000口当たりの純資産額 12,555円)

(金融商品に関する注記)

. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 平成28年 4月27日 至 平成29年 4月26日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク</p>

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

・金融商品の時価等に関する事項

項目	(平成29年 4月26日現在)
1.貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	<p>(1) 有価証券（国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

(デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

自 平成28年 4月27日 至 平成29年 4月26日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。

（その他の注記）

（平成28年 4月26日現在）	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	249,241,043,434円
同期中における追加設定元本額	12,597,305,591円
同期中における一部解約元本額	66,208,574,211円
平成28年 4月26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）	2,238,062,965円
三井住友・DC年金バランス50（標準型）	4,074,327,867円
三井住友・DC年金バランス70（株式重点型）	897,628,430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）	337,524,972円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2020	44,290,137円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2025	81,347,134円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2030	170,742,995円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2035	74,505,679円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2040	34,589,102円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2045	64,222,576円
三井住友・DC年金バランスゼロ（債券型）	6,059,237円
アセットアロケーション・ファンド（安定型）	3,001,070,375円
アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）	1,060,660,602円
アセットアロケーション・ファンド（成長型）	807,656,739円
S M A M ・ 年金グローバル債券ファンド＜適格機関投資家限定＞	6,086,628,952円
S M A M ・ バランスファンドVA25＜適格機関投資家専用＞	29,652,243,763円
S M A M ・ バランスファンドVA37.5＜適格機関投資家専用＞	9,321,431,116円
S M A M ・ バランスファンドVA50＜適格機関投資家専用＞	22,464,089,653円
S M A M ・ バランスファンドVL30＜適格機関投資家限定＞	385,746,395円
S M A M ・ バランスファンドVL50＜適格機関投資家限定＞	714,264,941円
世界6資産バランスファンドVA＜適格機関投資家限定＞	66,006,960円

S M A M ・ バランスファンド V A 7 5 < 適格機関投資家専用 >	330,459,356円
S M A M ・ バランスファンド V L 国際分散型 < 適格機関投資家限定 >	133,253,321円
S M A M ・ インデックス・バランス V A 2 5 < 適格機関投資家専用 >	2,376,703,215円
S M A M ・ インデックス・バランス V A 5 0 < 適格機関投資家専用 >	2,697,590,770円
S M A M ・ バランスファンド V A 4 0 < 適格機関投資家専用 >	6,843,122,379円
S M A M ・ バランスファンド V A 3 5 < 適格機関投資家専用 >	14,386,000,378円
S M A M ・ バランス V A 株 4 0 T < 適格機関投資家限定 >	208,544,294円
三井住友・国内債券インデックスファンド・ V A S (適格機関投資家専用)	7,509,648,579円
三井住友・ 5 資産バランスファンド・ V A S (適格機関投資家専用)	33,059,136,364円
S M A M ・ グローバルバランス 4 0 V A < 適格機関投資家限定 >	681,827,212円
S M A M ・ バランスファンド V A 2 0 < 適格機関投資家専用 >	1,196,087,768円
三井住友・ 7 資産バランスファンド・ V A S (適格機関投資家専用)	21,852,275,825円
S M A M ・ アセットバランスファンド V A 2 0 A < 適格機関投資家専用 >	1,115,205,205円
S M A M ・ アセットバランスファンド V A 3 5 A < 適格機関投資家専用 >	240,044,186円
S M A M ・ アセットバランスファンド V A 5 0 A < 適格機関投資家専用 >	53,970,912円
S M A M ・ アセットバランスファンド V A 2 0 L < 適格機関投資家専用 >	2,798,502,611円
S M A M ・ アセットバランスファンド V A 2 5 L < 適格機関投資家専用 >	3,218,771,132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 >	2,998,873,719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 >	1,241,809,743円
S M A M ・ アセットバランスファンド V A 3 5 A 2 < 適格機関投資家専用 >	261,712,641円
S M A M ・ アセットバランスファンド V A 5 0 A 2 < 適格機関投資家専用 >	21,167,802円
S M A M ・ アセットバランスファンド V A 3 0 L 2 < 適格機関投資家専用 >	488,152,676円
S M A M ・ アセットバランスファンド V A 2 5 L 2 < 適格機関投資家専用 >	8,043,150,764円
S M A M ・ アセットバランスファンド V A 2 0 T 2 < 適格機関投資家専用 >	382,692,836円
S M A M ・ F G 新興国重視型バランス 2 0 V A < 適格機関投資家限定 >	436,835円
S M A M ・ F G グローバルバランス 2 5 V A < 適格機関投資家限定 >	4,705,729円
S M A M ・ グローバル・マルチアセット・グロース・ファンド(安定成長型) < 適格機関投資家限定 >	7,619,291円
S M A M ・ 年金マルチ・インカム・ダイナミック・アロケーション ・ ファンド < 適格機関投資家限定 >	3,278,510円
S M A M ・ 年金 W リスクコントロールファンド < 適格機関投資家限定 >	3,164,472円
S M A M ・ マルチアセットストラテジーファンド 2 0 1 6 - 0 1 < 適格機関投資家限定 >	1,888,765,699円
合計	195,629,774,814円

(平成29年 4月26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	195,629,774,814円
同期中における追加設定元本額	22,942,713,121円
同期中における一部解約元本額	45,541,421,712円
平成29年 4月26日現在における元本の内訳	
三井住友・ D C 年金バランス 3 0 (債券重点型)	2,954,754,744円
三井住友・ D C 年金バランス 5 0 (標準型)	5,143,936,169円
三井住友・ D C 年金バランス 7 0 (株式重点型)	1,102,129,578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)	389,505,620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)	50,983,275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)	122,923,952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)	205,844,244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)	120,156,351円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2040(4資産タイプ)	47,792,735円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2045(4資産タイプ)	99,507,796円
三井住友・DC年金バランスゼロ(債券型)	45,044,883円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	3,360,471,450円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	621,086,811円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	102,036,221円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2050	3,627,980円
SMAM・年金グローバル債券ファンド<適格機関投資家限定>	5,926,425,523円
SMAM・バランスファンドVA25<適格機関投資家専用>	25,474,682,363円
SMAM・バランスファンドVA37.5<適格機関投資家専用>	8,748,753,150円
SMAM・バランスファンドVA50<適格機関投資家専用>	21,454,588,776円
SMAM・バランスファンドVL30<適格機関投資家限定>	371,792,432円
SMAM・バランスファンドVL50<適格機関投資家限定>	699,393,788円
世界6資産バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	25,389,356円
SMAM・バランスファンドVA75<適格機関投資家専用>	327,027,102円
SMAM・バランスファンドVL国際分散型<適格機関投資家限定>	138,667,534円
SMAM・インデックス・バランスVA25<適格機関投資家専用>	2,276,740,738円
SMAM・インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用>	2,509,013,146円
SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用>	6,602,128,377円
SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>	13,225,486,810円
SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定>	191,948,032円
三井住友・国内債券インデックスファンド・VAS(適格機関投資家専用)	6,995,514,289円
三井住友・5資産バランスファンド・VAS(適格機関投資家専用)	21,626,537,035円
SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	651,014,789円
SMAM・バランスファンドVA20<適格機関投資家専用>	1,039,782,860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)	18,018,968,776円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>	1,072,287,822円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>	234,065,710円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用>	51,593,207円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>	2,558,679,987円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	2,985,271,586円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T<適格機関投資家専用>	2,867,795,194円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A2<適格機関投資家専用>	1,180,956,571円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A2<適格機関投資家専用>	251,664,247円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A2<適格機関投資家専用>	22,161,672円
SMAM・アセットバランスファンドVA30L2<適格機関投資家専用>	409,987,990円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L2<適格機関投資家専用>	7,541,970,443円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T2<適格機関投資家専用>	334,094,169円
SMAM・FG新興国重視型バランス20VA<適格機関投資家限定>	36,019円
SMAM・FGグローバルバランス25VA<適格機関投資家限定>	77,948円
SMAM・年金Wリスクコントロールファンド<適格機関投資家限定>	2,626,591円
SMAM・マルチアセットストラテジーファンド2016-04<適格機関投資家限定>	1,346,675,341円

S M A M ・ マ ル チ ア セ ッ ト ス ト ラ テ ジ ー フ ァ ン ド 2 0 1 6 - 0 5 < 適 格 機 関 投 資 家 限 定 >	645,366,680円
S M A M ・ マ ル チ ア セ ッ ト ス ト ラ テ ジ ー ・ オ ー プ ン < 適 格 機 関 投 資 家 限 定 >	852,098,361円
合計	173,031,066,223円

附属明細表

有価証券明細表

(a) 株式

該当事項はありません。

(b) 株式以外の有価証券

（単位：円）

種類	銘 柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	第 1 1 7 回 利 付 国 債 (5 年)	15,000,000	15,118,200	
	第 1 2 2 回 利 付 国 債 (5 年)	50,000,000	50,385,500	
	第 1 2 3 回 利 付 国 債 (5 年)	2,030,000,000	2,047,112,900	
	第 1 2 4 回 利 付 国 債 (5 年)	2,340,000,000	2,361,083,400	
	第 1 2 5 回 利 付 国 債 (5 年)	1,520,000,000	1,534,546,400	
	第 1 2 6 回 利 付 国 債 (5 年)	910,000,000	919,345,700	
	第 1 2 7 回 利 付 国 債 (5 年)	1,310,000,000	1,324,108,700	
	第 1 2 8 回 利 付 国 債 (5 年)	2,605,000,000	2,634,358,350	
	第 1 2 9 回 利 付 国 債 (5 年)	1,610,000,000	1,628,885,300	
	第 1 3 0 回 利 付 国 債 (5 年)	1,800,000,000	1,823,184,000	
	第 1 3 1 回 利 付 国 債 (5 年)	450,000,000	455,769,000	
	第 1 回 利 付 国 債 (4 0 年)	40,000,000	57,344,800	
	第 2 回 利 付 国 債 (4 0 年)	267,000,000	369,971,220	
	第 3 回 利 付 国 債 (4 0 年)	315,000,000	438,401,250	
	第 4 回 利 付 国 債 (4 0 年)	412,000,000	575,770,000	
	第 5 回 利 付 国 債 (4 0 年)	415,000,000	556,921,700	
	第 6 回 利 付 国 債 (4 0 年)	430,000,000	565,050,100	
	第 7 回 利 付 国 債 (4 0 年)	445,000,000	558,288,100	
	第 8 回 利 付 国 債 (4 0 年)	525,000,000	608,627,250	
	第 9 回 利 付 国 債 (4 0 年)	751,000,000	624,816,980	
	第 2 9 7 回 利 付 国 債 (1 0 年)	13,000,000	13,345,800	
	第 3 0 5 回 利 付 国 債 (1 0 年)	2,270,000,000	2,359,960,100	
	第 3 0 6 回 利 付 国 債 (1 0 年)	1,670,000,000	1,746,736,500	
	第 3 0 7 回 利 付 国 債 (1 0 年)	940,000,000	980,457,600	
	第 3 0 8 回 利 付 国 債 (1 0 年)	670,000,000	701,362,700	
	第 3 0 9 回 利 付 国 債 (1 0 年)	550,000,000	572,264,000	

第310回利付国債(10年)	3,080,000,000	3,203,662,000	
第312回利付国債(10年)	2,145,000,000	2,253,236,700	
第313回利付国債(10年)	2,105,000,000	2,226,690,050	
第315回利付国債(10年)	1,800,000,000	1,902,546,000	
第317回利付国債(10年)	1,005,000,000	1,061,068,950	
第318回利付国債(10年)	895,000,000	940,967,200	
第319回利付国債(10年)	980,000,000	1,037,800,400	
第320回利付国債(10年)	960,000,000	1,012,128,000	
第321回利付国債(10年)	960,000,000	1,014,662,400	
第322回利付国債(10年)	1,065,000,000	1,120,390,650	
第323回利付国債(10年)	510,000,000	537,764,400	
第324回利付国債(10年)	790,000,000	828,907,500	
第325回利付国債(10年)	1,290,000,000	1,356,306,000	
第326回利付国債(10年)	577,000,000	604,413,270	
第327回利付国債(10年)	375,000,000	394,950,000	
第328回利付国債(10年)	820,000,000	855,547,000	
第329回利付国債(10年)	2,650,000,000	2,801,792,000	
第330回利付国債(10年)	1,335,000,000	1,414,632,750	
第332回利付国債(10年)	838,000,000	878,425,120	
第333回利付国債(10年)	1,805,000,000	1,894,654,350	
第334回利付国債(10年)	1,370,000,000	1,439,527,500	
第335回利付国債(10年)	1,365,000,000	1,424,964,450	
第336回利付国債(10年)	1,190,000,000	1,242,621,800	
第337回利付国債(10年)	910,000,000	936,244,400	
第338回利付国債(10年)	1,470,000,000	1,524,228,300	
第339回利付国債(10年)	1,860,000,000	1,928,448,000	
第340回利付国債(10年)	1,810,000,000	1,877,875,000	
第341回利付国債(10年)	1,952,000,000	2,008,705,600	
第342回利付国債(10年)	1,825,000,000	1,845,330,500	
第343回利付国債(10年)	1,925,000,000	1,945,270,250	
第344回利付国債(10年)	2,386,000,000	2,409,549,820	
第345回利付国債(10年)	2,118,000,000	2,137,379,700	
第346回利付国債(10年)	180,000,000	181,510,200	
第2回利付国債(30年)	510,000,000	654,702,300	
第4回利付国債(30年)	300,000,000	408,045,000	
第5回利付国債(30年)	290,000,000	369,065,600	
第7回利付国債(30年)	474,000,000	614,138,100	
第9回利付国債(30年)	100,000,000	116,265,000	
第10回利付国債(30年)	585,000,000	653,017,950	
第11回利付国債(30年)	570,000,000	689,169,900	
第12回利付国債(30年)	590,000,000	750,692,400	
第14回利付国債(30年)	822,000,000	1,089,034,920	

第16回利付国債(30年)	465,000,000	625,355,250
第18回利付国債(30年)	500,000,000	657,530,000
第19回利付国債(30年)	490,000,000	644,771,400
第21回利付国債(30年)	345,000,000	454,796,250
第22回利付国債(30年)	335,000,000	453,791,000
第23回利付国債(30年)	329,000,000	446,308,240
第24回利付国債(30年)	310,000,000	421,119,500
第25回利付国債(30年)	300,000,000	396,957,000
第26回利付国債(30年)	383,000,000	514,200,480
第27回利付国債(30年)	395,000,000	539,226,350
第28回利付国債(30年)	436,000,000	597,564,160
第29回利付国債(30年)	227,000,000	307,689,420
第30回利付国債(30年)	557,000,000	746,006,810
第31回利付国債(30年)	425,000,000	562,032,750
第32回利付国債(30年)	690,000,000	929,844,000
第33回利付国債(30年)	743,000,000	956,411,890
第34回利付国債(30年)	737,000,000	983,415,950
第35回利付国債(30年)	700,000,000	905,667,000
第36回利付国債(30年)	365,000,000	473,620,350
第37回利付国債(30年)	680,000,000	868,122,000
第38回利付国債(30年)	685,000,000	860,538,100
第39回利付国債(30年)	375,000,000	480,288,750
第40回利付国債(30年)	475,000,000	597,402,750
第41回利付国債(30年)	475,000,000	586,278,250
第42回利付国債(30年)	450,000,000	555,615,000
第43回利付国債(30年)	465,000,000	574,344,750
第44回利付国債(30年)	500,000,000	617,780,000
第45回利付国債(30年)	625,000,000	741,675,000
第46回利付国債(30年)	540,000,000	640,812,600
第47回利付国債(30年)	685,000,000	829,952,850
第48回利付国債(30年)	615,000,000	714,439,350
第49回利付国債(30年)	575,000,000	667,851,000
第50回利付国債(30年)	565,000,000	569,005,850
第51回利付国債(30年)	560,000,000	490,341,600
第52回利付国債(30年)	633,000,000	586,404,870
第53回利付国債(30年)	507,000,000	482,121,510
第54回利付国債(30年)	95,000,000	95,228,950
第40回利付国債(20年)	10,000,000	10,350,200
第42回利付国債(20年)	480,000,000	505,584,000
第43回利付国債(20年)	1,120,000,000	1,203,193,600
第46回利付国債(20年)	775,000,000	833,442,750
第48回利付国債(20年)	955,000,000	1,048,437,200
第50回利付国債(20年)	918,000,000	992,578,320

第52回利付国債(20年)	720,000,000	791,748,000	
第54回利付国債(20年)	965,000,000	1,071,362,300	
第56回利付国債(20年)	818,000,000	908,953,420	
第59回利付国債(20年)	1,455,000,000	1,606,450,950	
第61回利付国債(20年)	1,215,000,000	1,296,526,500	
第64回利付国債(20年)	1,025,000,000	1,158,475,500	
第65回利付国債(20年)	1,020,000,000	1,157,271,600	
第69回利付国債(20年)	1,020,000,000	1,176,570,000	
第70回利付国債(20年)	780,000,000	920,002,200	
第72回利付国債(20年)	753,000,000	875,151,660	
第74回利付国債(20年)	664,000,000	774,768,480	
第75回利付国債(20年)	490,000,000	573,937,000	
第78回利付国債(20年)	590,000,000	684,093,200	
第82回利付国債(20年)	620,000,000	731,786,000	
第84回利付国債(20年)	850,000,000	999,583,000	
第85回利付国債(20年)	645,000,000	767,163,000	
第88回利付国債(20年)	742,000,000	899,304,000	
第89回利付国債(20年)	20,000,000	24,056,800	
第90回利付国債(20年)	580,000,000	700,234,000	
第92回利付国債(20年)	734,000,000	882,260,660	
第93回利付国債(20年)	632,000,000	755,922,560	
第95回利付国債(20年)	305,000,000	375,214,050	
第97回利付国債(20年)	677,000,000	828,837,560	
第99回利付国債(20年)	693,000,000	843,893,820	
第100回利付国債(20年)	247,000,000	304,202,730	
第101回利付国債(20年)	300,000,000	375,972,000	
第102回利付国債(20年)	382,000,000	480,429,940	
第105回利付国債(20年)	425,000,000	521,959,500	
第106回利付国債(20年)	370,000,000	458,589,100	
第107回利付国債(20年)	433,000,000	533,308,780	
第108回利付国債(20年)	640,000,000	773,510,400	
第109回利付国債(20年)	520,000,000	629,636,800	
第111回利付国債(20年)	606,000,000	757,336,380	
第113回利付国債(20年)	527,000,000	653,664,450	
第114回利付国債(20年)	818,000,000	1,017,232,080	
第116回利付国債(20年)	385,000,000	484,518,650	
第118回利付国債(20年)	460,000,000	568,233,400	
第119回利付国債(20年)	520,000,000	628,981,600	
第120回利付国債(20年)	540,000,000	638,874,000	
第121回利付国債(20年)	470,000,000	575,374,000	
第122回利付国債(20年)	565,000,000	684,288,450	
第123回利付国債(20年)	380,000,000	476,542,800	

	第124回利付国債(20年)	365,000,000	452,877,400
	第125回利付国債(20年)	195,000,000	247,718,250
	第126回利付国債(20年)	280,000,000	348,126,800
	第127回利付国債(20年)	175,000,000	215,068,000
	第128回利付国債(20年)	445,000,000	547,932,950
	第129回利付国債(20年)	440,000,000	535,735,200
	第130回利付国債(20年)	535,000,000	652,052,650
	第131回利付国債(20年)	460,000,000	554,231,000
	第132回利付国債(20年)	470,000,000	566,688,400
	第133回利付国債(20年)	610,000,000	744,639,200
	第134回利付国債(20年)	210,000,000	256,552,800
	第135回利付国債(20年)	345,000,000	416,528,850
	第136回利付国債(20年)	320,000,000	381,478,400
	第137回利付国債(20年)	175,000,000	211,410,500
	第138回利付国債(20年)	25,000,000	29,452,750
	第139回利付国債(20年)	400,000,000	477,060,000
	第140回利付国債(20年)	895,000,000	1,081,795,450
	第141回利付国債(20年)	520,000,000	628,326,400
	第142回利付国債(20年)	450,000,000	550,876,500
	第143回利付国債(20年)	345,000,000	411,785,100
	第144回利付国債(20年)	180,000,000	211,962,600
	第145回利付国債(20年)	515,000,000	622,671,050
	第146回利付国債(20年)	380,000,000	459,549,200
	第147回利付国債(20年)	1,175,000,000	1,402,715,000
	第148回利付国債(20年)	539,000,000	634,828,810
	第149回利付国債(20年)	970,000,000	1,142,107,100
	第150回利付国債(20年)	861,000,000	999,414,360
	第151回利付国債(20年)	1,030,000,000	1,161,026,300
	第152回利付国債(20年)	835,000,000	940,260,100
	第153回利付国債(20年)	727,000,000	830,662,930
	第154回利付国債(20年)	1,070,000,000	1,203,279,200
	第155回利付国債(20年)	890,000,000	968,373,400
	第156回利付国債(20年)	920,000,000	900,229,200
	第157回利付国債(20年)	935,000,000	878,310,950
	第158回利付国債(20年)	895,000,000	887,150,850
	第159回利付国債(20年)	928,000,000	934,560,960
	第160回利付国債(20年)	45,000,000	46,044,900
	国債証券合計	144,591,000,000	161,177,348,860
地方債証券	第1回東京都公募公債(20年)	100,000,000	109,373,000
	第1回東京都公募公債(30年)	100,000,000	125,831,000
	第6回東京都公募公債(20年)	100,000,000	115,294,000
	第7回東京都公募公債(20年)	100,000,000	117,452,000

第8回東京都公募公債(20年)	100,000,000	119,980,000	
第8回東京都公募公債(30年)	400,000,000	511,004,000	
第13回東京都公募公債(30年)	500,000,000	616,050,000	
第660回東京都公募公債	300,000,000	305,403,000	
第674回東京都公募公債	100,100,000	103,381,278	
平成20年度第4回北海道公募公債	100,000,000	102,275,000	
平成20年度第12回北海道公募公債	100,000,000	102,844,000	
平成21年度第14回北海道公募公債	100,000,000	104,270,000	
平成25年度第15回北海道公募公債	100,000,000	104,371,000	
第1回神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	117,984,000	
第3回神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	116,441,000	
第7回神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	119,834,000	
第57回神奈川県公募公債(5年)	200,000,000	200,832,000	
第157回神奈川県公募公債	115,600,000	118,607,912	
第167回神奈川県公募公債	100,000,000	103,615,000	
第97回大阪府公募公債(5年)	102,000,000	102,410,040	
第313回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	101,650,000	
第326回大阪府公募公債(10年)	200,000,000	206,858,000	
第332回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	104,051,000	
第342回大阪府公募公債(10年)	200,000,000	208,118,000	
第361回大阪府公募公債(10年)	200,000,000	209,356,000	
第373回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	105,480,000	
第377回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	104,612,000	
平成19年度第1回京都府公募公債	30,260,000	30,487,857	
平成20年度第3回京都府公募公債	100,000,000	102,564,000	
平成26年度第13回京都府公募公債	100,000,000	103,251,000	
平成27年度第4回京都府公募公債	100,000,000	103,787,000	
第5回兵庫県公募公債(15年)	300,000,000	333,384,000	
平成20年度第5回兵庫県公募公債	100,000,000	102,204,000	
平成21年度第3回兵庫県公募公債	200,000,000	206,640,000	
平成21年度第11回兵庫県公募公債	200,000,000	207,054,000	
第7回静岡県公募公債(30年)	100,000,000	125,021,000	
平成20年度第1回静岡県公募公債	200,000,000	234,944,000	
平成20年度第7回静岡県公募公債	100,000,000	102,693,000	
平成21年度第5回静岡県公募公債	300,000,000	309,927,000	
平成20年度第3回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	102,125,000	
平成20年度第6回愛知県公募公債(10年)	500,000,000	513,490,000	
平成21年度第1回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	103,204,000	
平成21年度第7回愛知県公募公債(10年)	200,000,000	207,114,000	
平成21年度第8回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	103,340,000	
平成21年度第10回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	103,428,000	
	100,000,000	103,847,000	

平成22年度第12回愛知県公募公債(10年)			
平成23年度第18回愛知県公募公債(7年)	100,000,000	101,005,000	
平成21年度第1回広島県公募公債	100,000,000	103,241,000	
平成20年度第7回埼玉県公募公債	100,000,000	102,693,000	
平成21年度第1回埼玉県公募公債	100,000,000	103,014,000	
平成21年度第2回埼玉県公募公債	100,000,000	103,237,000	
平成21年度第4回埼玉県公募公債	200,000,000	206,516,000	
平成20年度第10回福岡県公募公債	100,000,000	102,729,000	
平成21年度第3回福岡県公募公債	100,000,000	103,585,000	
平成25年度第5回福岡県公募公債	600,000,000	601,998,000	
平成25年度第11回福岡県公募公債	100,000,000	104,639,000	
平成25年度第12回福岡県公募公債	100,000,000	100,277,000	
平成26年度第4回福岡県公募公債	100,000,000	100,290,000	
平成26年度第10回福岡県公募公債	100,000,000	102,986,000	
平成20年度第8回千葉県公募公債	100,000,000	102,689,000	
平成21年度第2回千葉県公募公債	345,000,000	356,126,250	
平成21年度第6回千葉県公募公債	100,000,000	103,370,000	
第9回群馬県公募公債(10年)	100,000,000	104,386,000	
平成21年度第1回岐阜県公募公債(10年)	200,000,000	206,690,000	
第51回共同発行市場公募地方債	500,000	501,495	
第62回共同発行市場公募地方債	200,000,000	203,722,000	
第64回共同発行市場公募地方債	300,000,000	306,600,000	
第65回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,132,000	
第73回共同発行市場公募地方債	400,000,000	412,572,000	
第75回共同発行市場公募地方債	900,000,000	931,599,000	
第76回共同発行市場公募地方債	300,000,000	309,321,000	
第77回共同発行市場公募地方債	200,000,000	207,088,000	
第79回共同発行市場公募地方債	200,000,000	206,618,000	
第81回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,477,000	
第82回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,859,000	
第91回共同発行市場公募地方債	300,000,000	309,270,000	
第111回共同発行市場公募地方債	300,000,000	313,539,000	
第115回共同発行市場公募地方債	600,000,000	625,878,000	
第137回共同発行市場公募地方債	200,000,000	207,684,000	
平成21年度第4回大阪市公募公債	300,000,000	311,151,000	
平成26年度第2回大阪市公募公債(5年)	200,000,000	200,820,000	
第1回名古屋市公募公債(20年)	200,000,000	226,254,000	
第3回名古屋市公募公債(20年)	100,000,000	115,793,000	
第467回名古屋市公募公債(10年)	100,000,000	103,445,000	
第1回京都市公募公債(30年)	100,000,000	132,883,000	
第7回京都市公募公債(20年)	100,000,000	123,688,000	
平成26年度第1回京都市公募公債	100,000,000	100,339,000	

	平成26年度第17回神戸市公募公債	100,000,000	101,659,000
	第4回横浜市公募公債(20年)	100,000,000	115,439,000
	第9回横浜市公募公債(20年)	100,000,000	120,232,000
	第14回横浜市公募公債(20年)	100,000,000	122,271,000
	平成20年度第6回横浜市公募公債	200,000,000	205,406,000
	平成25年度第1回横浜市公債「ハマ債5」	100,000,000	100,175,000
	平成26年度第4回札幌市公募公債(10年)	100,000,000	103,639,000
	第2回川崎市15年公募公債	100,000,000	105,095,000
	第4回川崎市15年公募公債	100,000,000	109,737,000
	平成20年度第5回福岡市公募公債	100,000,000	102,326,000
	平成25年度第5回福岡市公募公債(5年)	100,000,000	100,375,000
	平成21年度第1回千葉市公募公債	200,000,000	206,294,000
地方債証券合計		16,593,460,000	17,616,234,832
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	102,555,000
	第2回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	200,000,000	204,702,000
	第3回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	200,000,000	228,374,000
	第5回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	102,816,000
	第15回政府保証日本政策投資銀行債券	100,000,000	109,466,000
	第20回政府保証日本政策投資銀行債券	100,000,000	111,488,000
	第23回政府保証日本政策投資銀行債券	400,000,000	408,592,000
	第36回日本政策投資銀行債券	100,000,000	120,013,000
	第51回日本政策投資銀行債券	100,000,000	102,107,000
	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	213,450,000
	第7回道路債券	100,000,000	113,528,000
	第8回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	120,455,000
	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	107,565,000
	第9回道路債券	100,000,000	134,948,000
	第18回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	146,724,000
	第22回日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	425,370,000
	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	53,153,170
	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	402,936,000
	第42回道路債券	100,000,000	116,714,000
	第47回日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	248,966,000
	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	101,173,000
	第52回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	202,750,000
	第56回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	202,812,000
	第58回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	500,000,000	509,455,000

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	102,151,000	
第62回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	306,555,000	
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	204,940,000	
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	102,595,000	
第71回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	204,766,000	
第81回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	243,726,000	
第88回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	130,788,000	
第89回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	600,000,000	619,404,000	
第90回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	366,654,000	
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	103,288,000	
第99回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	123,707,000	
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	1,350,102,000	
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	208,618,000	
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	103,270,000	
第340回政府保証道路債券	100,000,000	105,204,000	
第1回政府保証地方公営企業等金融機構債券	300,000,000	307,209,000	
第1回政府保証地方公共団体金融機構債券	300,000,000	309,786,000	
第2回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,159,000	
第2回地方公営企業等金融機構債券（20年）	100,000,000	123,058,000	
第3回政府保証地方公営企業等金融機構債券	100,000,000	102,340,000	
第3回公営企業債券（20年）	100,000,000	105,925,000	
第3回地方公共団体金融機構債券	300,000,000	310,968,000	
第4回政府保証地方公営企業等金融機構債券	100,000,000	102,318,000	
第4回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,171,000	
第5回政府保証地方公営企業等金融機構債券	100,000,000	102,416,000	
第5回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,051,000	
第5回公営企業債券（20年）	100,000,000	113,294,000	
第6回政府保証地方公営企業等金融機構債券	100,000,000	102,508,000	
第6回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	207,814,000	
第7回政府保証地方公営企業等金融機構債券	500,000,000	514,080,000	
第8回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,403,000	
第11回公営企業債券（20年）	100,000,000	115,867,000	
第11回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	104,372,000	
	200,000,000	201,440,000	

第14回政府保証地方公共団体金融機構債券(6年)			
第16回公営企業債券(20年)	100,000,000	116,949,000	
第17回公営企業債券(20年)	100,000,000	119,958,000	
第18回公営企業債券(20年)	100,000,000	122,094,000	
第22回公営企業債券(20年)	100,000,000	120,959,000	
第24回公営企業債券(20年)	200,000,000	243,666,000	
第30回公営企業債券	200,000,000	204,512,000	
第42回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	104,101,000	
第45回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	208,940,000	
第61回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	104,537,000	
第63回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,769,000	
第65回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,434,000	
F74回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,240,000	
第883回政府保証公営企業債券	100,000,000	101,280,000	
第884回政府保証公営企業債券	300,000,000	304,182,000	
第885回政府保証公営企業債券	200,000,000	203,706,000	
第886回政府保証公営企業債券	200,000,000	204,202,000	
第34回株式会社日本政策金融公庫社債	200,000,000	200,588,000	
第19回都市再生債券	100,000,000	101,825,000	
第7回本州四国連絡橋債券	100,000,000	117,418,000	
第332回東京交通債券	100,000,000	106,765,000	
第342回東京交通債券	100,000,000	111,937,000	
第13回関西国際空港株式会社社債	100,000,000	102,399,000	
第16回関西国際空港株式会社社債	100,000,000	103,040,000	
第51回政府保証関西国際空港債券	100,000,000	111,410,000	
第14回独立行政法人福祉医療機構債券	200,000,000	200,598,000	
第17回独立行政法人福祉医療機構債券	100,000,000	102,279,000	
第199回政府保証預金保険機構債	300,000,000	300,573,000	
第201回政府保証預金保険機構債	200,000,000	200,468,000	
第203回政府保証預金保険機構債	600,000,000	602,124,000	
第208回政府保証預金保険機構債	600,000,000	602,688,000	
第209回政府保証預金保険機構債	600,000,000	602,832,000	
第1回貸付債権担保住宅金融公庫債券	22,514,000	22,804,430	
第3回貸付債権担保住宅金融公庫債券	11,303,000	11,473,110	
第3回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	16,889,000	17,685,654	
第4回貸付債権担保住宅金融公庫債券	11,947,000	12,178,293	
第4回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	22,105,000	23,598,855	
第5回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	17,171,000	17,963,785	
第6回貸付債権担保住宅金融公庫債券	26,598,000	27,428,655	
第7回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	22,077,000	23,549,756	
第8回貸付債権担保住宅金融公庫債券	13,459,000	13,805,434	
第8回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	100,693,000	

第9回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	37,886,000	40,410,344
第9回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	22,409,000	23,955,893
第10回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	58,350,000	62,231,442
第10回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	22,001,000	23,240,096
第11回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	23,339,000	24,845,765
第12回貸付債権担保住宅金融公庫債券	15,070,000	15,560,980
第14回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	25,500,000	26,433,300
第14回一般担保住宅金融支援機構債券	200,000,000	203,326,000
第17回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	57,166,000	59,548,678
第19回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	30,406,000	32,697,396
第21回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	102,680,000
第24回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	61,542,000	66,947,233
第25回一般担保住宅金融支援機構債券	200,000,000	205,484,000
第26回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	92,103,000	99,485,976
第27回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	33,511,000	36,076,602
第28回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	37,282,000	40,079,268
第29回貸付債権担保住宅金融公庫債券	19,083,000	19,913,492
第29回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	39,351,000	42,290,519
第30回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	39,383,000	42,263,866
第32回貸付債権担保住宅金融公庫債券	22,070,000	23,035,341
第32回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	79,046,000	84,410,852
第35回貸付債権担保住宅金融公庫債券	22,060,000	23,134,101
第35回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	43,654,000	46,568,341
第36回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	45,080,000	47,959,710
第39回貸付債権担保住宅金融公庫債券	20,288,000	21,271,765
第41回貸付債権担保住宅金融公庫債券	22,025,000	23,377,775
第43回貸付債権担保住宅金融公庫債券	41,508,000	44,428,087
第43回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	57,720,000	61,233,993
第46回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	50,087,000	53,569,549
第48回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	95,634,000	102,454,616
第49回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	46,986,000	50,044,318
第51回貸付債権担保住宅金融公庫債券	19,461,000	20,691,713
第51回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	102,394,000	108,738,332
第52回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	120,899,000
第53回貸付債権担保住宅金融公庫債券	20,928,000	22,241,859
第55回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	125,642,000	132,445,514
第57回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	60,780,000	64,129,585
第58回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	63,359,000	66,751,240
第59回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	124,872,000	131,774,924
第60回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	192,885,000	202,629,550

第61回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	62,762,000	65,732,525
第67回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	69,650,000	72,368,439
第69回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	142,070,000	149,194,810
第70回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	127,568,000	133,798,421
第73回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	70,624,000	74,381,196
第95回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	105,056,000
第99回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	89,187,000	92,163,170
第130回一般担保住宅金融支援機構債券	200,000,000	236,846,000
第1回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	41,802,000	44,198,926
第2回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	43,850,000	46,615,619
第3回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	20,575,000	21,994,469
第6回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	21,203,000	22,528,611
第5回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	42,044,000	44,650,728
い第758号商工債	100,000,000	100,482,000
い第749号農林債	300,000,000	300,429,000
い第752号農林債	500,000,000	501,070,000
い第768号農林債	100,000,000	100,579,000
第281回信金中金債(5年)	100,000,000	100,235,000
第283回信金中金債(5年)	100,000,000	100,391,000
第291回信金中金債(5年)	100,000,000	100,432,000
第293回信金中金債(5年)	100,000,000	100,457,000
第297回信金中金債(5年)	200,000,000	200,836,000
第301回信金中金債(5年)	300,000,000	301,641,000
第171号商工債(3年)	300,000,000	300,000,000
第175号商工債(3年)	100,000,000	100,044,000
第177号商工債(3年)	300,000,000	300,204,000
第181号商工債(3年)	100,000,000	100,113,000
第183号商工債(3年)	500,000,000	500,675,000
第185号商工債(3年)	200,000,000	200,292,000
第197号商工債(3年)	200,000,000	199,988,000
第12回国際協力機構債券	100,000,000	104,292,000
第15回政府保証東日本高速道路債券	100,000,000	102,442,000
第5回中日本高速道路株式会社社債	200,000,000	205,188,000
第6回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	102,841,000
第19回政府保証中日本高速道路債券	124,000,000	125,413,600
第21回政府保証中日本高速道路債券	200,000,000	203,696,000
第25回政府保証中日本高速道路債券	200,000,000	206,524,000
第46回中日本高速道路株式会社社債	200,000,000	200,274,000
第8回政府保証西日本高速道路債券	33,000,000	33,035,640
第15回政府保証西日本高速道路債券	100,000,000	102,080,000
第19回政府保証西日本高速道路債券	100,000,000	102,820,000
第20回西日本高速道路株式会社社債	100,000,000	104,325,000

特殊債券合計		25,976,259,000	27,334,302,311
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	200,764,000
	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	200,728,000
	第21回コーペラティブ・セントラル・ライフアイゼン・ボエレンリーバンク・ピー・エー	200,000,000	200,910,000
	第18回コーペラティブ・セントラル・ライフアイゼン・ボエレンリーバンク・ピー・エー	300,000,000	300,843,000
	第18回 積水ハウス株式会社無担保社債	100,000,000	100,243,000
	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	207,896,000
	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	100,555,000
	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	102,477,000
	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	102,578,000
	第4回花王株式会社無担保社債	100,000,000	101,596,000
	第64回新日本製鐵株式会社無担保社債	100,000,000	104,069,000
	第62回株式会社神戸製鋼所無担保社債	100,000,000	99,774,000
	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	104,013,000
	第44回三菱電機株式会社無担保社債	100,000,000	100,402,000
	日本電産株式会社第1回無担保社債	100,000,000	100,129,000
	第36回富士通株式会社無担保社債	100,000,000	101,687,000
	第12回パナソニック株式会社無担保社債	200,000,000	201,512,000
	第13回パナソニック株式会社無担保社債	200,000,000	203,764,000
	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	200,510,000
	第1回日本生命2012基金特定目的会社特定社債	100,000,000	100,837,000
	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	100,769,000
	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	100,660,000
	第1回ユニ・ファミリーマートホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	100,336,000
	第63回三井物産株式会社無担保社債	100,000,000	119,041,000
	第47回住友商事株式会社無担保社債	100,000,000	103,356,000
	第3回株式会社みずほコーポレート銀行無担保社債	100,000,000	101,841,000
第8回株式会社みずほコーポレート銀行無担保社債	100,000,000	123,112,000	
株式会社三菱東京UFJ銀行第12回無担保社債	200,000,000	201,050,000	
第25回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	300,000,000	312,006,000	

第110回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	100,000,000	103,623,000	
株式会社三井住友フィナンシャル第1回無担保社債	100,000,000	102,849,000	
第4回株式会社りそな銀行無担保社債	100,000,000	105,542,000	
第9回三菱UFJ信託銀行株式会社無担保社債	100,000,000	105,923,000	
第7回住友信託銀行株式会社無担保社債	100,000,000	100,071,000	
第8回住友信託銀行株式会社無担保社債	100,000,000	119,001,000	
第6回株式会社セブン銀行無担保社債	200,000,000	200,118,000	
第1回株式会社みずほフィナンシャルグループ無担保社債	100,000,000	103,388,000	
第20回株式会社三井住友銀行無担保社債	200,000,000	209,216,000	
第24回株式会社三井住友銀行無担保社債	100,000,000	105,756,000	
第8回株式会社みずほ銀行無担保社債	200,000,000	200,010,000	
第9回株式会社みずほ銀行無担保社債	100,000,000	119,109,000	
第17回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	106,038,000	
第53回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	100,259,000	
第54回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	101,280,000	
第162回オリックス株式会社無担保社債	100,000,000	100,084,000	
第165回オリックス株式会社無担保社債	100,000,000	100,228,000	
第48回三菱UFJリース株式会社無担保社債	100,000,000	99,953,000	
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	105,042,000	
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	201,168,000	
第58回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	131,191,000	
第110回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	101,109,000	
第15回東日本旅客鉄道株式会社社債	100,000,000	108,684,000	
第34回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	117,255,000	
第110回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	118,150,000	
第41回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	121,476,000	
第42回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	200,000,000	246,880,000	
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	101,389,000	
第526回東京電力株式会社社債	300,000,000	300,465,000	
第528回東京電力株式会社社債	100,000,000	103,449,000	
第532回東京電力株式会社社債	100,000,000	100,672,000	
第537回東京電力株式会社社債	100,000,000	104,210,000	
第544回東京電力株式会社社債	100,000,000	102,003,000	
第547回東京電力株式会社社債	100,000,000	105,210,000	
第518回中部電力株式会社社債	100,000,000	100,056,000	
第467回関西電力株式会社社債	100,000,000	102,142,000	

第471回東北電力株式会社社債	100,000,000	106,089,000	
第472回東北電力株式会社社債	100,000,000	104,763,000	
第253回四国電力株式会社社債	100,000,000	105,059,000	
第400回九州電力株式会社社債	100,000,000	104,803,000	
第328回北海道電力株式会社社債	100,000,000	101,020,000	
第11回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	113,801,000	
第18回大阪瓦斯株式会社無担保社債	200,000,000	215,460,000	
第27回東邦瓦斯株式会社無担保社債	100,000,000	105,610,000	
社債券合計	9,400,000,000	9,808,138,000	
合計		215,936,024,003	

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

	(平成28年 4月26日現在)	(平成29年 4月26日現在)
(単位：円)		
資産の部		
流動資産		
預金	656,087,540	909,198,394
金銭信託	197,479,819	89,862,543
コール・ローン	41,436,442	186,971,239
国債証券	176,600,324,596	207,417,666,531
派生商品評価勘定	-	7,088
未収入金	52,000,000	600,120,347
未収利息	1,591,010,285	1,583,663,555
前払費用	29,000,885	146,186,993
流動資産合計	179,167,339,567	210,933,676,690
資産合計	179,167,339,567	210,933,676,690
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	-	8,764,406
未払解約金	8,544,129	800,627,417
未払利息	121	542
その他未払費用	3,984	14,649
流動負債合計	8,548,234	809,407,014
負債合計	8,548,234	809,407,014
純資産の部		
元本等		
元本	105,109,279,423	125,322,708,862
剰余金		
剰余金又は欠損金()	74,049,511,910	84,801,560,814
元本等合計	179,158,791,333	210,124,269,676
純資産合計	179,158,791,333	210,124,269,676
負債純資産合計	179,167,339,567	210,933,676,690

注記表

（重要な会計方針の注記）

項目	自 平成28年 4月27日 至 平成29年 4月26日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券は個別法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。</p>
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建資産等の会計処理</p> <p>「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。</p>

（貸借対照表に関する注記）

項目	（平成28年 4月26日現在）	（平成29年 4月26日現在）
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	105,109,279,423口	125,322,708,862口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.7045円 (10,000口当たりの純資産額 17,045円)	1口当たり純資産額 1.6767円 (10,000口当たりの純資産額 16,767円)

（金融商品に関する注記）

・金融商品の状況に関する事項

項目	自 平成28年 4月27日 至 平成29年 4月26日
1. 金融商品に対する取組方針	<p>当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。</p>
	(1) 金融商品の内容

<p>2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク</p>	<p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、国債証券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。当計算期間については、為替予約取引を行っております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</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 4月26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 4月26日現在）

該当事項はありません。

（平成29年 4月26日現在）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

（単位：円）

区 分	種 類	契 約 額 等		時 価	評 価 損 益
			うち1年超		
市場取引以外の 取引	為替予約取引				
	買建	847,369	-	854,457	7,088
	米ドル	847,369	-	854,457	7,088
	売建	560,188,139	-	568,952,545	8,764,406
	米ドル	255,232,706	-	258,558,288	3,325,582
	カナダドル	81,635,782	-	82,613,155	977,373
	ユーロ	223,319,651	-	227,781,102	4,461,451
	合計	561,035,508	-	569,807,002	8,757,318

（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 4月27日 至 平成29年 4月26日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。

（その他の注記）

（平成28年 4月26日現在）	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	125,038,069,926円
同期中における追加設定元本額	6,887,957,759円
同期中における一部解約元本額	26,816,748,262円
平成28年 4月26日現在における元本の内訳	
三井住友・DC外国債券インデックスファンドS	7,346,122,605円
三井住友・DC年金バランス30（債券重点型）	294,158,923円
三井住友・DC年金バランス50（標準型）	867,016,532円
三井住友・DC年金バランス70（株式重点型）	445,519,150円
SMAM・グローバルバランスファンド（機動的資産配分型）	51,994,867円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2020	8,071,455円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2025	20,293,188円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2030	58,678,871円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2035	37,995,060円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2040	20,804,114円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2045	44,568,324円
三井住友・DC年金バランスゼロ（債券型）	1,187,989円
アセットアロケーション・ファンド（安定型）	116,419,683円
アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）	198,602,167円
アセットアロケーション・ファンド（成長型）	265,051,792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＞	1,500,589,758円
SMAM・バランスファンドVA安定成長型＜適格機関投資家限定＞	3,821,555,609円
SMAM・バランスファンドVA25＜適格機関投資家専用＞	19,243,724,359円
SMAM・バランスファンドVA37.5＜適格機関投資家専用＞	7,379,971,636円
SMAM・バランスファンドVA50＜適格機関投資家専用＞	16,312,945,354円
SMAM・バランスファンドVL30＜適格機関投資家限定＞	45,968,708円

S M A M ・ バランスファンド V L 5 0 < 適格機関投資家限定 >	130,038,973円
世界 6 資産バランスファンド V A < 適格機関投資家限定 >	13,644,843円
S M A M ・ バランスファンド V A 7 5 < 適格機関投資家専用 >	939,503,001円
S M A M ・ バランスファンド V L 国際分散型 < 適格機関投資家限定 >	142,165,035円
S M A M ・ インデックス・バランス V A 2 5 < 適格機関投資家専用 >	1,513,583,466円
S M A M ・ インデックス・バランス V A 5 0 < 適格機関投資家専用 >	1,924,991,258円
S M A M ・ バランスファンド V A 4 0 < 適格機関投資家専用 >	4,909,027,048円
S M A M ・ バランスファンド V A 3 5 < 適格機関投資家専用 >	9,047,341,588円
S M A M ・ バランス V A 株 4 0 T < 適格機関投資家限定 >	150,974,873円
S M A M ・ 外国債券パッシブファンド V A < 適格機関投資家限定 >	14,447,331,155円
三井住友・外国債券インデックスファンド・ V A S (適格機関投資家専用)	1,238,240,133円
三井住友・ 5 資産バランスファンド・ V A S (適格機関投資家専用)	4,140,231,510円
S M A M ・ グローバルバランス 4 0 V A < 適格機関投資家限定 >	250,225,830円
S M A M ・ バランスファンド V A 2 0 < 適格機関投資家専用 >	861,343,324円
三井住友・ 7 資産バランスファンド・ V A S (適格機関投資家専用)	3,639,387,901円
S M A M ・ アセットバランスファンド V A 2 0 A < 適格機関投資家専用 >	185,069,203円
S M A M ・ アセットバランスファンド V A 3 5 A < 適格機関投資家専用 >	52,811,680円
S M A M ・ アセットバランスファンド V A 5 0 A < 適格機関投資家専用 >	16,896,401円
S M A M ・ アセットバランスファンド V A 2 0 L < 適格機関投資家専用 >	209,180,765円
S M A M ・ アセットバランスファンド V A 2 5 L < 適格機関投資家専用 >	717,216,112円
S M A M ・ アセットバランスファンド V A 2 0 T < 適格機関投資家専用 >	226,773,526円
S M A M ・ アセットバランスファンド V A 2 0 A 2 < 適格機関投資家専用 >	203,301,882円
S M A M ・ アセットバランスファンド V A 3 5 A 2 < 適格機関投資家専用 >	57,130,687円
S M A M ・ アセットバランスファンド V A 5 0 A 2 < 適格機関投資家専用 >	6,475,605円
S M A M ・ アセットバランスファンド V A 2 5 L 2 < 適格機関投資家専用 >	1,767,576,019円
S M A M ・ アセットバランスファンド V A 2 0 T 2 < 適格機関投資家専用 >	27,895,415円
S M A M ・ F G 新興国重視型バランス 2 0 V A < 適格機関投資家限定 >	2,078,450円
S M A M ・ F G グローバルバランス 2 5 V A < 適格機関投資家限定 >	13,397,833円
S M A M ・ 年金 W リスクコントロールファンド < 適格機関投資家限定 >	395,826円
S M A M ・ マルチアセットストラテジーファンド 2 0 1 6 - 0 1 < 適格機関投資家限定 >	193,809,937円
合計	105,109,279,423円

(平成29年 4月26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	105,109,279,423円
同期中における追加設定元本額	35,679,990,046円
同期中における一部解約元本額	15,466,560,607円
平成29年 4月26日現在における元本の内訳	
三井住友・ D C 外国債券インデックスファンド S	8,554,397,919円
三井住友・ D C 年金バランス 3 0 (債券重点型)	411,070,090円
三井住友・ D C 年金バランス 5 0 (標準型)	1,116,063,124円
三井住友・ D C 年金バランス 7 0 (株式重点型)	561,304,415円
S M A M ・ グローバルバランスファンド (機動的資産配分型)	41,542,505円

三井住友・DCターゲットイヤーファンド2020(4資産タイプ)	9,468,356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)	28,493,735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)	72,784,819円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2035(4資産タイプ)	58,581,648円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2040(4資産タイプ)	28,913,333円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2045(4資産タイプ)	70,375,265円
三井住友・DC年金バランスゼロ(債券型)	9,342,476円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	260,587,749円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	507,159,946円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	649,852,762円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2050	1,732,409円
SMAM・年金外国債券パッシブ・ファンド<適格機関投資家限定>	1,888,364,489円
SMAM・バランスファンドVA安定成長型<適格機関投資家限定>	2,436,806,632円
SMAM・バランスファンドVA25<適格機関投資家専用>	17,116,828,663円
SMAM・バランスファンドVA37.5<適格機関投資家専用>	7,291,831,583円
SMAM・バランスファンドVA50<適格機関投資家専用>	16,468,671,654円
SMAM・バランスファンドVL30<適格機関投資家限定>	44,556,535円
SMAM・バランスファンドVL50<適格機関投資家限定>	130,729,850円
世界6資産バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	5,171,525円
SMAM・バランスファンドVA75<適格機関投資家専用>	1,003,979,229円
SMAM・バランスファンドVL国際分散型<適格機関投資家限定>	152,420,385円
SMAM・インデックス・バランスVA25<適格機関投資家専用>	1,498,884,649円
SMAM・インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用>	1,946,874,902円
SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用>	5,025,358,072円
SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>	8,690,839,456円
SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定>	145,519,059円
SMAM・外国債券パッシブファンドVA<適格機関投資家限定>	13,871,863,878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)	1,218,981,709円
三井住友・5資産バランスファンド・VAS(適格機関投資家専用)	2,746,130,830円
SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	243,908,916円
SMAM・バランスファンドVA20<適格機関投資家専用>	789,873,249円
三井住友・7資産バランスファンド・VAS(適格機関投資家専用)	3,043,553,302円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>	184,222,109円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>	51,598,551円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用>	16,758,843円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>	192,439,673円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	668,513,101円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T<適格機関投資家専用>	220,923,296円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A2<適格機関投資家専用>	200,754,871円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A2<適格機関投資家専用>	58,420,979円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A2<適格機関投資家専用>	7,027,104円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L2<適格機関投資家専用>	1,723,836,681円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T2<適格機関投資家専用>	25,670,897円
SMAM・グローバルバランスファンド(標準型)VA<適格機関投資家限定>	5,275,114,213円
SMAM・グローバルバランスファンド(債券重視型)VA<適格機関投資家限定>	2,697,490,904円
SMAM・世界バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	8,378,009,216円
SMAM・世界バランスファンドVA2<適格機関投資家限定>	6,839,966,607円
SMAM・FG新興国重視型バランス20VA<適格機関投資家限定>	177,313円

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 >	235,574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 >	402,977円
S M A M ・ マルチアセットストラテジーファンド 2 0 1 6 - 0 4 < 適格機関投資家限定 >	302,296,032円
S M A M ・ マルチアセットストラテジーファンド 2 0 1 6 - 0 5 < 適格機関投資家限定 >	144,824,274円
S M A M ・ マルチアセットストラテジー・オープン < 適格機関投資家限定 >	191,206,529円
合計	125,322,708,862円

附属明細表

有価証券明細表

(a) 株式

該当事項はありません。

(b) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	米ドル	US TREASURY N/B 0.625	3,000,000.00	2,984,531.25	
		US TREASURY N/B 0.625	2,000,000.00	1,987,343.76	
		US TREASURY N/B 0.75	4,000,000.00	3,985,625.00	
		US TREASURY N/B 0.75	2,000,000.00	1,992,187.50	
		US TREASURY N/B 0.75	3,000,000.00	2,983,593.75	
		US TREASURY N/B 0.75	3,500,000.00	3,478,671.87	
		US TREASURY N/B 0.75	3,000,000.00	2,980,312.50	
		US TREASURY N/B 0.75	2,000,000.00	1,985,468.76	
		US TREASURY N/B 0.75	2,000,000.00	1,981,562.50	
		US TREASURY N/B 0.75	2,000,000.00	1,974,218.76	
		US TREASURY N/B 0.75	3,000,000.00	2,959,453.14	
		US TREASURY N/B 0.875	3,000,000.00	2,991,093.75	
		US TREASURY N/B 0.875	3,000,000.00	2,989,218.75	
		US TREASURY N/B 0.875	2,000,000.00	1,990,156.26	
		US TREASURY N/B 0.875	4,000,000.00	3,968,125.00	
		US TREASURY N/B 0.875	3,000,000.00	2,973,750.00	
		US TREASURY N/B 0.875	3,000,000.00	2,971,406.25	
		US TREASURY N/B 0.875	2,000,000.00	1,979,375.00	
		US TREASURY N/B 0.875	3,000,000.00	2,965,312.50	
		US TREASURY N/B 1	3,000,000.00	2,995,781.25	
		US TREASURY N/B 1	5,000,000.00	4,991,796.90	
		US TREASURY N/B 1	3,000,000.00	2,992,500.00	
		US TREASURY N/B 1	3,000,000.00	2,990,859.39	
US TREASURY N/B 1	3,000,000.00	2,988,515.64			

US TREASURY N/B 1	4,000,000.00	3,979,062.52	
US TREASURY N/B 1	3,000,000.00	2,979,609.39	
US TREASURY N/B 1	4,000,000.00	3,967,500.00	
US TREASURY N/B 1	2,000,000.00	1,982,656.26	
US TREASURY N/B 1	2,000,000.00	1,981,093.76	
US TREASURY N/B 1	2,000,000.00	1,979,531.26	
US TREASURY N/B 1	3,000,000.00	2,969,765.64	
US TREASURY N/B 1.125	2,000,000.00	1,999,218.76	
US TREASURY N/B 1.125	3,000,000.00	2,993,437.50	
US TREASURY N/B 1.125	3,000,000.00	2,992,968.75	
US TREASURY N/B 1.125	3,000,000.00	2,992,265.64	
US TREASURY N/B 1.125	2,000,000.00	1,992,656.26	
US TREASURY N/B 1.125	4,000,000.00	3,969,687.52	
US TREASURY N/B 1.125	2,800,000.00	2,772,437.50	
US TREASURY N/B 1.125	3,000,000.00	2,966,953.14	
US TREASURY N/B 1.125	3,800,000.00	3,719,843.75	
US TREASURY N/B 1.125	3,000,000.00	2,924,062.50	
US TREASURY N/B 1.125	3,000,000.00	2,921,015.64	
US TREASURY N/B 1.125	5,000,000.00	4,864,062.50	
US TREASURY N/B 1.125	5,000,000.00	4,857,421.90	
US TREASURY N/B 1.25	3,000,000.00	3,001,171.89	
US TREASURY N/B 1.25	3,000,000.00	3,000,468.75	
US TREASURY N/B 1.25	3,000,000.00	3,000,703.14	
US TREASURY N/B 1.25	3,000,000.00	3,000,000.00	
US TREASURY N/B 1.25	3,000,000.00	2,999,765.64	
US TREASURY N/B 1.25	4,000,000.00	3,999,375.00	
US TREASURY N/B 1.25	3,000,000.00	2,998,593.75	
US TREASURY N/B 1.25	2,000,000.00	1,998,750.00	
US TREASURY N/B 1.25	2,000,000.00	1,993,750.00	
US TREASURY N/B 1.25	3,000,000.00	2,984,062.50	
US TREASURY N/B 1.25	3,000,000.00	2,983,125.00	
US TREASURY N/B 1.25	4,000,000.00	3,930,937.52	
US TREASURY N/B 1.25	5,000,000.00	4,879,687.50	
US TREASURY N/B 1.25	3,000,000.00	2,854,921.89	
US TREASURY N/B 1.375	3,000,000.00	3,007,500.00	
US TREASURY N/B 1.375	3,000,000.00	3,006,796.89	
US TREASURY N/B 1.375	4,500,000.00	4,509,492.21	
US TREASURY N/B 1.375	3,000,000.00	3,006,562.50	
US TREASURY N/B 1.375	2,000,000.00	2,003,984.38	
US TREASURY N/B 1.375	5,000,000.00	5,010,156.25	
US TREASURY N/B 1.375	3,000,000.00	2,996,718.75	
US TREASURY N/B 1.375	3,000,000.00	2,994,843.75	

US TREASURY N/B 1.375	4,000,000.00	3,993,750.00
US TREASURY N/B 1.375	3,000,000.00	2,993,437.50
US TREASURY N/B 1.375	5,000,000.00	4,987,109.40
US TREASURY N/B 1.375	4,000,000.00	3,987,500.00
US TREASURY N/B 1.375	4,000,000.00	3,984,687.52
US TREASURY N/B 1.375	3,000,000.00	2,985,703.14
US TREASURY N/B 1.375	4,000,000.00	3,972,500.00
US TREASURY N/B 1.375	3,000,000.00	2,977,031.25
US TREASURY N/B 1.375	4,000,000.00	3,965,937.52
US TREASURY N/B 1.375	3,000,000.00	2,966,953.14
US TREASURY N/B 1.375	4,000,000.00	3,946,562.52
US TREASURY N/B 1.375	4,000,000.00	3,942,500.00
US TREASURY N/B 1.375	3,000,000.00	2,880,703.14
US TREASURY N/B 1.375	4,000,000.00	3,831,562.52
US TREASURY N/B 1.375	3,000,000.00	2,871,093.75
US TREASURY N/B 1.5	5,000,000.00	5,019,140.65
US TREASURY N/B 1.5	4,700,000.00	4,718,359.37
US TREASURY N/B 1.5	2,000,000.00	2,007,968.76
US TREASURY N/B 1.5	4,000,000.00	4,015,625.00
US TREASURY N/B 1.5	3,000,000.00	3,012,187.50
US TREASURY N/B 1.5	3,000,000.00	3,008,203.14
US TREASURY N/B 1.5	5,000,000.00	5,011,718.75
US TREASURY N/B 1.5	3,000,000.00	2,997,187.50
US TREASURY N/B 1.5	3,000,000.00	2,953,359.39
US TREASURY N/B 1.5	4,000,000.00	3,886,562.52
US TREASURY N/B 1.5	3,000,000.00	2,911,406.25
US TREASURY N/B 1.5	8,000,000.00	7,450,625.04
US TREASURY N/B 1.625	5,000,000.00	5,032,812.50
US TREASURY N/B 1.625	4,000,000.00	4,026,250.00
US TREASURY N/B 1.625	3,000,000.00	3,018,750.00
US TREASURY N/B 1.625	2,000,000.00	2,012,343.76
US TREASURY N/B 1.625	3,000,000.00	3,018,046.89
US TREASURY N/B 1.625	5,000,000.00	5,026,171.90
US TREASURY N/B 1.625	3,500,000.00	3,508,476.58
US TREASURY N/B 1.625	3,000,000.00	3,005,859.39
US TREASURY N/B 1.625	5,000,000.00	4,996,875.00
US TREASURY N/B 1.625	3,000,000.00	2,954,765.64
US TREASURY N/B 1.625	3,500,000.00	3,437,656.25
US TREASURY N/B 1.625	3,000,000.00	2,929,921.89
US TREASURY N/B 1.625	3,000,000.00	2,926,171.89
US TREASURY N/B 1.625	3,000,000.00	2,914,687.50
US TREASURY N/B 1.625	8,000,000.00	7,568,125.04
US TREASURY N/B 1.625	7,000,000.00	6,608,437.50

US TREASURY N/B 1.75	1,000,000.00	1,008,046.88
US TREASURY N/B 1.75	4,000,000.00	4,035,937.52
US TREASURY N/B 1.75	4,300,000.00	4,318,812.50
US TREASURY N/B 1.75	5,000,000.00	5,016,406.25
US TREASURY N/B 1.75	3,000,000.00	2,992,265.64
US TREASURY N/B 1.75	3,000,000.00	2,985,234.39
US TREASURY N/B 1.75	4,500,000.00	4,475,390.62
US TREASURY N/B 1.75	3,000,000.00	2,982,890.64
US TREASURY N/B 1.75	3,000,000.00	2,982,421.89
US TREASURY N/B 1.75	3,000,000.00	2,969,765.64
US TREASURY N/B 1.75	3,000,000.00	2,958,281.25
US TREASURY N/B 1.75	7,000,000.00	6,884,062.50
US TREASURY N/B 1.875	3,000,000.00	3,031,875.00
US TREASURY N/B 1.875	3,000,000.00	3,008,437.50
US TREASURY N/B 1.875	4,000,000.00	4,005,625.00
US TREASURY N/B 1.875	4,000,000.00	4,006,562.52
US TREASURY N/B 1.875	3,000,000.00	2,999,296.89
US TREASURY N/B 1.875	4,000,000.00	3,988,750.00
US TREASURY N/B 1.875	3,000,000.00	2,986,171.89
US TREASURY N/B 2	3,000,000.00	3,041,718.75
US TREASURY N/B 2	2,300,000.00	2,330,906.25
US TREASURY N/B 2	3,000,000.00	3,037,734.39
US TREASURY N/B 2	3,000,000.00	3,034,453.14
US TREASURY N/B 2	4,000,000.00	4,041,562.52
US TREASURY N/B 2	3,000,000.00	3,027,656.25
US TREASURY N/B 2	3,000,000.00	3,024,843.75
US TREASURY N/B 2	6,000,000.00	6,051,093.78
US TREASURY N/B 2	5,000,000.00	5,037,109.40
US TREASURY N/B 2	3,100,000.00	3,125,187.50
US TREASURY N/B 2	3,000,000.00	3,013,359.39
US TREASURY N/B 2	3,000,000.00	3,003,515.64
US TREASURY N/B 2	7,500,000.00	7,495,312.50
US TREASURY N/B 2	8,000,000.00	7,869,375.04
US TREASURY N/B 2	8,000,000.00	7,834,375.04
US TREASURY N/B 2	8,000,000.00	7,774,375.04
US TREASURY N/B 2.125	3,500,000.00	3,561,523.45
US TREASURY N/B 2.125	4,000,000.00	4,065,625.00
US TREASURY N/B 2.125	4,000,000.00	4,060,625.00
US TREASURY N/B 2.125	5,000,000.00	5,075,390.65
US TREASURY N/B 2.125	3,000,000.00	3,041,953.14
US TREASURY N/B 2.125	4,000,000.00	4,054,375.00
US TREASURY N/B 2.125	3,000,000.00	3,033,046.89

US TREASURY N/B 2.125	4,000,000.00	4,028,125.00
US TREASURY N/B 2.125	4,000,000.00	4,006,250.00
US TREASURY N/B 2.125	2,000,000.00	1,999,531.26
US TREASURY N/B 2.125	7,000,000.00	6,933,828.16
US TREASURY N/B 2.25	2,000,000.00	2,026,250.00
US TREASURY N/B 2.25	4,000,000.00	4,081,875.00
US TREASURY N/B 2.25	2,000,000.00	2,040,937.50
US TREASURY N/B 2.25	4,000,000.00	4,080,000.00
US TREASURY N/B 2.25	4,000,000.00	4,033,750.00
US TREASURY N/B 2.25	2,000,000.00	2,016,093.76
US TREASURY N/B 2.25	8,000,000.00	8,028,750.00
US TREASURY N/B 2.25	7,500,000.00	7,474,804.72
US TREASURY N/B 2.25	5,000,000.00	4,964,843.75
US TREASURY N/B 2.25	5,000,000.00	4,266,406.25
US TREASURY N/B 2.375	2,000,000.00	2,028,281.26
US TREASURY N/B 2.375	2,000,000.00	2,051,875.00
US TREASURY N/B 2.375	8,000,000.00	8,111,250.00
US TREASURY N/B 2.5	6,000,000.00	6,150,937.50
US TREASURY N/B 2.5	8,000,000.00	8,188,125.04
US TREASURY N/B 2.5	5,500,000.00	4,983,945.34
US TREASURY N/B 2.5	5,300,000.00	4,789,460.96
US TREASURY N/B 2.5	5,000,000.00	4,514,062.50
US TREASURY N/B 2.625	2,000,000.00	2,030,000.00
US TREASURY N/B 2.625	4,000,000.00	4,137,187.52
US TREASURY N/B 2.625	5,500,000.00	5,688,632.84
US TREASURY N/B 2.75	3,000,000.00	3,079,921.89
US TREASURY N/B 2.75	6,200,000.00	6,450,421.90
US TREASURY N/B 2.75	7,000,000.00	7,281,093.75
US TREASURY N/B 2.75	2,000,000.00	1,922,031.26
US TREASURY N/B 2.75	8,000,000.00	7,677,500.00
US TREASURY N/B 2.875	3,000,000.00	2,945,859.39
US TREASURY N/B 2.875	4,000,000.00	3,910,625.00
US TREASURY N/B 2.875	4,500,000.00	4,398,750.00
US TREASURY N/B 3	2,800,000.00	2,823,843.76
US TREASURY N/B 3	4,000,000.00	4,014,375.00
US TREASURY N/B 3	4,000,000.00	4,009,687.52
US TREASURY N/B 3	6,000,000.00	6,010,781.28
US TREASURY N/B 3	1,000,000.00	1,003,828.13
US TREASURY N/B 3.125	2,000,000.00	2,073,437.50
US TREASURY N/B 3.125	3,000,000.00	3,164,062.50
US TREASURY N/B 3.125	2,000,000.00	2,064,531.26
US TREASURY N/B 3.125	2,500,000.00	2,579,882.82
US TREASURY N/B 3.125	6,000,000.00	6,167,812.50

US TREASURY N/B 3.375	5,000,000.00	5,246,484.40	
US TREASURY N/B 3.375	4,000,000.00	4,303,750.00	
US TREASURY N/B 3.5	4,500,000.00	4,767,539.08	
US TREASURY N/B 3.5	2,000,000.00	2,222,343.76	
US TREASURY N/B 3.625	5,000,000.00	5,258,984.40	
US TREASURY N/B 3.625	6,000,000.00	6,357,656.28	
US TREASURY N/B 3.625	5,000,000.00	5,362,109.40	
US TREASURY N/B 3.625	6,000,000.00	6,732,656.28	
US TREASURY N/B 3.625	5,000,000.00	5,616,406.25	
US TREASURY N/B 3.75	3,000,000.00	3,115,664.07	
US TREASURY N/B 3.75	2,000,000.00	2,286,875.00	
US TREASURY N/B 3.75	4,000,000.00	4,587,187.52	
US TREASURY N/B 3.875	6,000,000.00	6,172,031.28	
US TREASURY N/B 3.875	2,000,000.00	2,332,656.26	
US TREASURY N/B 4	2,500,000.00	2,591,406.25	
US TREASURY N/B 4.25	2,000,000.00	2,463,125.00	
US TREASURY N/B 4.25	2,000,000.00	2,461,562.50	
US TREASURY N/B 4.375	1,200,000.00	1,509,843.75	
US TREASURY N/B 4.375	1,500,000.00	1,878,632.82	
US TREASURY N/B 4.375	2,500,000.00	3,129,296.87	
US TREASURY N/B 4.375	2,000,000.00	2,509,843.76	
US TREASURY N/B 4.5	1,500,000.00	1,917,421.87	
US TREASURY N/B 4.5	1,000,000.00	1,278,906.25	
US TREASURY N/B 4.5	1,000,000.00	1,273,906.25	
US TREASURY N/B 4.625	3,000,000.00	3,886,171.89	
US TREASURY N/B 4.75	1,500,000.00	1,980,468.75	
US TREASURY N/B 5	1,000,000.00	1,355,859.38	
US TREASURY N/B 5.25	1,000,000.00	1,285,468.75	
US TREASURY N/B 5.25	500,000.00	645,195.31	
US TREASURY N/B 5.375	1,320,000.00	1,774,265.63	
US TREASURY N/B 5.5	1,000,000.00	1,306,640.63	
US TREASURY N/B 6	1,000,000.00	1,299,453.13	
US TREASURY N/B 6.125	1,000,000.00	1,351,953.13	
US TREASURY N/B 6.25	800,000.00	999,812.50	
US TREASURY N/B 6.25	1,000,000.00	1,425,703.13	
US TREASURY N/B 6.5	500,000.00	679,921.87	
US TREASURY N/B 8	1,300,000.00	1,651,507.81	
US TREASURY N/B 8.75	1,000,000.00	1,230,937.50	
US TREASURY N/B 8.875	1,100,000.00	1,251,937.50	
米ドル 小計	815,020,000.00	824,318,791.04	(91,771,411,006)
カナダドル	CANADA-GOV'T 0.5	2,000,000.00	1,994,960.00

	CANADA-GOV'T 0.5	2,000,000.00	1,993,560.00
	CANADA-GOV'T 0.5	2,000,000.00	1,992,000.00
	CANADA-GOV'T 0.5	2,000,000.00	1,946,800.00
	CANADA-GOV'T 0.75	2,000,000.00	1,999,700.00
	CANADA-GOV'T 0.75	1,000,000.00	995,400.00
	CANADA-GOV'T 0.75	2,000,000.00	1,984,898.00
	CANADA-GOV'T 0.75	2,000,000.00	1,978,000.00
	CANADA-GOV'T 1	1,000,000.00	942,960.00
	CANADA-GOV'T 1.25	1,000,000.00	1,004,950.00
	CANADA-GOV'T 1.25	1,000,000.00	1,007,300.00
	CANADA-GOV'T 1.5	2,000,000.00	2,037,500.00
	CANADA-GOV'T 1.5	2,000,000.00	2,031,960.00
	CANADA-GOV'T 1.5	2,000,000.00	1,998,800.00
	CANADA-GOV'T 1.75	1,000,000.00	1,018,720.00
	CANADA-GOV'T 1.75	1,000,000.00	1,022,580.00
	CANADA-GOV'T 2.25	1,000,000.00	1,063,190.00
	CANADA-GOV'T 2.5	2,000,000.00	2,158,080.00
	CANADA-GOV'T 2.75	1,000,000.00	1,081,800.00
	CANADA-GOV'T 2.75	2,000,000.00	2,255,000.00
	CANADA-GOV'T 3.25	1,000,000.00	1,090,650.00
	CANADA-GOV'T 3.5	2,000,000.00	2,161,120.00
	CANADA-GOV'T 3.5	1,500,000.00	1,903,425.00
	CANADA-GOV'T 3.75	2,500,000.00	2,655,250.00
	CANADA-GOV'T 4	2,000,000.00	2,667,400.00
	CANADA-GOV'T 4.25	1,500,000.00	1,558,500.00
	CANADA-GOV'T 5	1,500,000.00	2,199,225.00
	CANADA-GOV'T 5.75	1,500,000.00	2,141,970.00
	CANADA-GOV'T 5.75	1,500,000.00	2,271,315.00
	CANADA-GOV'T 8	500,000.00	797,480.00
	カナダドル 小計	47,500,000.00	51,954,493.00 (4,262,866,150)
メキシコペソ	MEXICAN BONOS 10	40,000,000.00	46,712,000.00
	MEXICAN BONOS 5.75	20,000,000.00	18,172,000.00
	MEXICAN BONOS 6.5	30,000,000.00	29,265,000.00
	MEXICAN BONOS 7.75	20,000,000.00	20,130,000.00
	MEXICAN BONOS 8	50,000,000.00	51,375,000.00
	MEXICAN BONOS 8	20,000,000.00	20,950,000.00
	MEXICAN BONOS 8.5	20,000,000.00	20,522,000.00
	MEXICAN BONOS 8.5	50,000,000.00	54,600,000.00
	MEXICAN BONOS 8.5	40,000,000.00	43,604,000.00
	メキシコペソ 小計	290,000,000.00	305,330,000.00 (1,804,500,300)
ユーロ	BELGIAN 0326 4	1,000,000.00	1,392,010.00

BELGIAN 0.2	1,000,000.00	1,003,080.00
BELGIAN 0.8	2,000,000.00	2,048,260.00
BELGIAN 0.8	1,000,000.00	997,430.00
BELGIAN 0291 5.5	2,000,000.00	2,988,340.00
BELGIAN 0304 5	2,500,000.00	4,008,750.00
BELGIAN 0308 4	1,500,000.00	1,811,760.00
BELGIAN 0315 4	1,500,000.00	1,631,610.00
BELGIAN 0318 3.75	2,000,000.00	2,288,100.00
BELGIAN 0320 4.25	2,500,000.00	3,856,250.00
BELGIAN 0321 4.25	1,700,000.00	2,043,145.00
BELGIAN 0324 4.5	1,000,000.00	1,346,220.00
BELGIAN 0325 4.25	2,000,000.00	2,472,640.00
BELGIAN 0327 3	2,000,000.00	2,170,860.00
BELGIAN 0328 2.25	2,000,000.00	2,271,680.00
BELGIAN 0329 1.25	1,000,000.00	1,021,000.00
BELGIAN 0332 2.6	2,000,000.00	2,325,840.00
BELGIAN 0333 3	500,000.00	634,535.00
BELGIAN 1	2,000,000.00	2,063,180.00
BELGIAN 1	1,000,000.00	979,150.00
BELGIAN 1.9	1,000,000.00	1,076,260.00
BELGIAN 2.15	500,000.00	505,440.00
BELGIAN 3.75	1,000,000.00	1,460,000.00
BTPS 0.05	1,000,000.00	994,710.00
BTPS 0.1	1,000,000.00	1,001,540.00
BTPS 0.25	2,000,000.00	2,009,280.00
BTPS 0.3	1,000,000.00	1,005,370.00
BTPS 0.35	2,000,000.00	1,961,440.00
BTPS 0.45	2,000,000.00	1,987,060.00
BTPS 0.65	2,000,000.00	2,015,340.00
BTPS 0.65	2,000,000.00	1,902,320.00
BTPS 0.7	2,000,000.00	2,020,240.00
BTPS 0.95	2,000,000.00	1,964,380.00
BTPS 1.05	2,000,000.00	2,040,120.00
BTPS 1.2	1,000,000.00	1,007,500.00
BTPS 1.25	3,000,000.00	2,784,450.00
BTPS 1.35	2,000,000.00	2,032,140.00
BTPS 1.45	2,000,000.00	2,034,000.00
BTPS 1.5	2,000,000.00	2,059,000.00
BTPS 1.5	2,000,000.00	1,943,380.00
BTPS 1.6	2,000,000.00	1,924,540.00
BTPS 1.65	2,000,000.00	1,786,400.00
BTPS 2	2,000,000.00	2,001,640.00
BTPS 2.15	2,000,000.00	2,117,320.00

BTPS 2.2	1,000,000.00	996,040.00	
BTPS 2.25	1,000,000.00	914,880.00	
BTPS 2.5	3,000,000.00	3,144,630.00	
BTPS 2.5	2,000,000.00	2,099,080.00	
BTPS 2.7	2,000,000.00	1,790,080.00	
BTPS 2.8	1,000,000.00	839,560.00	
BTPS 3.25	1,500,000.00	1,502,070.00	
BTPS 3.5	2,400,000.00	2,495,496.00	
BTPS 3.5	2,000,000.00	2,111,540.00	
BTPS 3.5	3,000,000.00	3,324,420.00	
BTPS 3.75	3,000,000.00	3,369,870.00	
BTPS 3.75	2,000,000.00	2,248,180.00	
BTPS 3.75	3,300,000.00	3,717,912.00	
BTPS 3.75	2,000,000.00	2,273,900.00	
BTPS 4	2,500,000.00	2,795,350.00	
BTPS 4	3,000,000.00	3,473,940.00	
BTPS 4.25	2,400,000.00	2,578,248.00	
BTPS 4.25	3,500,000.00	3,828,930.00	
BTPS 4.25	3,300,000.00	3,664,848.00	
BTPS 4.5	3,000,000.00	3,175,350.00	
BTPS 4.5	2,700,000.00	2,921,643.00	
BTPS 4.5	2,700,000.00	3,011,499.00	
BTPS 4.5	2,800,000.00	3,305,848.00	
BTPS 4.5	3,000,000.00	3,557,730.00	
BTPS 4.5	3,000,000.00	3,592,110.00	
BTPS 4.75	2,600,000.00	3,040,752.00	
BTPS 4.75	2,500,000.00	3,004,400.00	
BTPS 4.75	3,000,000.00	3,699,420.00	
BTPS 4.75	2,000,000.00	2,533,820.00	
BTPS 5	3,000,000.00	3,566,370.00	
BTPS 5	3,000,000.00	3,690,240.00	
BTPS 5	2,470,000.00	3,198,230.10	
BTPS 5	2,000,000.00	2,613,220.00	
BTPS 5	2,500,000.00	3,237,575.00	
BTPS 5.25	3,700,000.00	4,802,637.00	
BTPS 5.5	2,500,000.00	3,065,550.00	
BTPS 5.5	2,500,000.00	3,071,075.00	
BTPS 5.75	2,200,000.00	3,053,116.00	
BTPS 6	4,100,000.00	5,736,105.00	
BTPS 6.5	2,960,000.00	4,127,157.60	
BTPS 7.25	1,000,000.00	1,442,870.00	
BTPS 9	1,000,000.00	1,467,460.00	

BUNDESUBL-166 0.25	2,000,000.00	2,019,520.00
BUNDESUBL-167 1	2,000,000.00	2,051,360.00
BUNDESUBL-168 1	1,000,000.00	1,031,730.00
BUNDESUBL-169 0.5	2,000,000.00	2,047,680.00
BUNDESUBL-170 0.25	1,000,000.00	1,022,710.00
BUNDESUBL-171 0	2,000,000.00	2,037,040.00
BUNDESUBL-172 0.25	2,000,000.00	2,055,440.00
BUNDESUBL-173 0	3,000,000.00	3,057,060.00
BUNDESUBL-174 0	3,000,000.00	3,055,020.00
BUNDESSCHATZANW 0	2,000,000.00	2,016,960.00
BUNDESSCHATZANW 0	1,000,000.00	1,010,130.00
BUNDESSCHATZANW 0	2,000,000.00	2,023,740.00
DEUTSCHLAND REP 0	3,000,000.00	2,917,140.00
DEUTSCHLAND REP 0.25	2,000,000.00	1,975,820.00
DEUTSCHLAND REP 0.5	3,000,000.00	3,104,160.00
DEUTSCHLAND REP 0.5	3,000,000.00	3,076,410.00
DEUTSCHLAND REP 1	2,000,000.00	2,149,600.00
DEUTSCHLAND REP 1	3,000,000.00	3,217,350.00
DEUTSCHLAND REP 1.5	2,500,000.00	2,739,650.00
DEUTSCHLAND REP 1.5	2,500,000.00	2,749,050.00
DEUTSCHLAND REP 1.5	2,000,000.00	2,204,480.00
DEUTSCHLAND REP 1.5	2,000,000.00	2,219,720.00
DEUTSCHLAND REP 1.75	2,500,000.00	2,767,900.00
DEUTSCHLAND REP 1.75	2,000,000.00	2,252,040.00
DEUTSCHLAND REP 2	2,000,000.00	2,225,560.00
DEUTSCHLAND REP 2	2,500,000.00	2,841,100.00
DEUTSCHLAND REP 2.25	1,500,000.00	1,643,295.00
DEUTSCHLAND REP 2.25	2,000,000.00	2,235,480.00
DEUTSCHLAND REP 2.5	2,000,000.00	2,225,520.00
DEUTSCHLAND REP 2.5	2,200,000.00	2,927,254.00
DEUTSCHLAND REP 2.5	2,000,000.00	2,686,220.00
DEUTSCHLAND REP 3	3,000,000.00	3,347,580.00
DEUTSCHLAND REP 3.25	3,000,000.00	3,319,200.00
DEUTSCHLAND REP 3.25	2,000,000.00	2,313,720.00
DEUTSCHLAND REP 3.25	1,500,000.00	2,237,850.00
DEUTSCHLAND REP 3.5	3,000,000.00	3,277,590.00
DEUTSCHLAND REP 3.75	3,500,000.00	3,767,715.00
DEUTSCHLAND REP 4	3,200,000.00	5,029,088.00
DEUTSCHLAND REP 4.25	2,200,000.00	2,331,406.00
DEUTSCHLAND REP 4.25	1,500,000.00	2,501,910.00
DEUTSCHLAND REP 4.75	1,300,000.00	1,911,377.00
DEUTSCHLAND REP 4.75	2,600,000.00	4,289,142.00
DEUTSCHLAND REP 4.75	2,400,000.00	4,300,512.00

DEUTSCHLAND REP 5.5	1,800,000.00	2,967,768.00	
DEUTSCHLAND REP 5.625	1,580,000.00	2,444,244.20	
DEUTSCHLAND REP 6.25	1,200,000.00	1,711,380.00	
DEUTSCHLAND REP 6.25	1,000,000.00	1,706,310.00	
DEUTSCHLAND REP 6.5	2,000,000.00	3,227,820.00	
FINNISH GOV'T 0.75	1,000,000.00	983,140.00	
FINNISH GOV'T 1.5	1,000,000.00	1,088,380.00	
FINNISH GOV'T 1.625	1,000,000.00	1,091,060.00	
FINNISH GOV'T 2	1,000,000.00	1,126,120.00	
FINNISH GOV'T 2.625	500,000.00	660,500.00	
FINNISH GOV'T 2.75	600,000.00	735,684.00	
FINNISH GOV'T 3.375	1,200,000.00	1,337,724.00	
FINNISH GOV'T 3.5	1,000,000.00	1,152,330.00	
FINNISH GOV'T 4	1,000,000.00	1,299,620.00	
FINNISH GOV'T 4.375	1,000,000.00	1,108,590.00	
FRANCE O.A.T. 0	2,000,000.00	2,018,700.00	
FRANCE O.A.T. 0	3,000,000.00	3,036,780.00	
FRANCE O.A.T. 0	3,000,000.00	3,028,440.00	
FRANCE O.A.T. 0	1,000,000.00	1,001,100.00	
FRANCE O.A.T. 0.25	3,000,000.00	3,062,340.00	
FRANCE O.A.T. 0.25	2,000,000.00	1,894,680.00	
FRANCE O.A.T. 0.5	3,000,000.00	3,074,640.00	
FRANCE O.A.T. 0.5	4,000,000.00	3,985,720.00	
FRANCE O.A.T. 0.5	3,000,000.00	2,937,780.00	
FRANCE O.A.T. 1	3,000,000.00	3,049,410.00	
FRANCE O.A.T. 1	3,000,000.00	3,072,000.00	
FRANCE O.A.T. 1	2,000,000.00	2,062,240.00	
FRANCE O.A.T. 1	3,000,000.00	3,090,660.00	
FRANCE O.A.T. 1.25	2,000,000.00	1,910,780.00	
FRANCE O.A.T. 1.5	3,000,000.00	3,105,180.00	
FRANCE O.A.T. 1.75	4,000,000.00	4,387,080.00	
FRANCE O.A.T. 1.75	4,000,000.00	4,395,120.00	
FRANCE O.A.T. 1.75	1,000,000.00	897,770.00	
FRANCE O.A.T. 2.25	3,800,000.00	4,261,206.00	
FRANCE O.A.T. 2.25	4,000,000.00	4,540,120.00	
FRANCE O.A.T. 2.5	4,500,000.00	4,951,755.00	
FRANCE O.A.T. 2.5	4,000,000.00	4,662,000.00	
FRANCE O.A.T. 2.75	4,000,000.00	4,722,560.00	
FRANCE O.A.T. 3	5,000,000.00	5,766,900.00	
FRANCE O.A.T. 3.25	4,800,000.00	5,541,504.00	
FRANCE O.A.T. 3.25	3,200,000.00	4,192,256.00	
FRANCE O.A.T. 3.5	4,000,000.00	4,470,960.00	

FRANCE O.A.T. 3.5	4,000,000.00	4,981,120.00
FRANCE O.A.T. 3.75	5,000,000.00	5,530,700.00
FRANCE O.A.T. 3.75	4,700,000.00	5,456,512.00
FRANCE O.A.T. 4	3,000,000.00	3,136,020.00
FRANCE O.A.T. 4	3,700,000.00	5,345,649.00
FRANCE O.A.T. 4	1,370,000.00	2,105,114.60
FRANCE O.A.T. 4	1,500,000.00	2,343,630.00
FRANCE O.A.T. 4.25	4,000,000.00	4,286,760.00
FRANCE O.A.T. 4.25	4,400,000.00	4,821,520.00
FRANCE O.A.T. 4.25	5,000,000.00	6,304,200.00
FRANCE O.A.T. 4.5	4,200,000.00	6,548,724.00
FRANCE O.A.T. 4.75	3,100,000.00	4,749,634.00
FRANCE O.A.T. 5.5	3,500,000.00	5,270,510.00
FRANCE O.A.T. 5.75	3,700,000.00	6,041,138.00
FRANCE O.A.T. 6	3,500,000.00	5,082,280.00
FRANCE O.A.T. 8.5	850,000.00	1,041,811.00
FRANCE O.A.T. 8.5	1,700,000.00	2,551,394.00
IRISH GOVT 0.8	1,000,000.00	1,036,900.00
IRISH GOVT 1	1,000,000.00	1,007,800.00
IRISH GOVT 2	1,000,000.00	999,290.00
IRISH GOVT 2.4	1,000,000.00	1,124,090.00
IRISH GOVT 3.4	1,000,000.00	1,198,780.00
IRISH GOVT 3.9	500,000.00	607,175.00
IRISH GOVT 4.4	1,000,000.00	1,102,820.00
IRISH GOVT 4.5	1,000,000.00	1,073,060.00
IRISH GOVT 4.5	1,490,000.00	1,701,729.00
IRISH GOVT 5	1,000,000.00	1,181,650.00
IRISH GOVT 5.4	1,500,000.00	2,041,755.00
IRISH GOVT 5.9	800,000.00	923,680.00
NETHERLANDS GOVT 0	2,000,000.00	2,012,600.00
NETHERLANDS GOVT 0	2,000,000.00	2,022,440.00
NETHERLANDS GOVT 0.25	2,000,000.00	2,046,500.00
NETHERLANDS GOVT 0.25	2,000,000.00	1,992,100.00
NETHERLANDS GOVT 0.5	1,500,000.00	1,507,680.00
NETHERLANDS GOVT 1.25	2,000,000.00	2,066,480.00
NETHERLANDS GOVT 1.75	2,200,000.00	2,444,904.00
NETHERLANDS GOVT 2	2,000,000.00	2,270,900.00
NETHERLANDS GOVT 2.25	2,000,000.00	2,256,640.00
NETHERLANDS GOVT 2.5	1,100,000.00	1,372,151.00
NETHERLANDS GOVT 2.75	2,000,000.00	2,778,100.00
NETHERLANDS GOVT 3.25	1,500,000.00	1,731,705.00
NETHERLANDS GOVT 3.5	2,000,000.00	2,261,080.00
NETHERLANDS GOVT 3.75	1,000,000.00	1,223,520.00

NETHERLANDS GOVT 3.75	1,500,000.00	2,371,005.00	
NETHERLANDS GOVT 4	1,500,000.00	1,585,725.00	
NETHERLANDS GOVT 4	1,500,000.00	1,654,845.00	
NETHERLANDS GOVT 4	2,200,000.00	3,417,238.00	
NETHERLANDS GOVT 5.5	1,500,000.00	2,271,750.00	
REP OF AUSTRIA 0.25	1,000,000.00	1,019,250.00	
REP OF AUSTRIA 0.75	1,900,000.00	1,934,485.00	
REP OF AUSTRIA 1.15	1,000,000.00	1,025,880.00	
REP OF AUSTRIA 1.2	1,500,000.00	1,602,120.00	
REP OF AUSTRIA 1.5	1,000,000.00	1,003,480.00	
REP OF AUSTRIA 1.65	1,000,000.00	1,104,250.00	
REP OF AUSTRIA 1.75	1,000,000.00	1,110,320.00	
REP OF AUSTRIA 1.95	1,000,000.00	1,053,460.00	
REP OF AUSTRIA 2.4	1,000,000.00	1,213,760.00	
REP OF AUSTRIA 3.15	500,000.00	698,775.00	
REP OF AUSTRIA 3.4	1,000,000.00	1,194,710.00	
REP OF AUSTRIA 3.5	2,000,000.00	2,333,200.00	
REP OF AUSTRIA 3.65	1,000,000.00	1,191,230.00	
REP OF AUSTRIA 3.8	500,000.00	842,645.00	
REP OF AUSTRIA 3.9	1,500,000.00	1,710,090.00	
REP OF AUSTRIA 4.15	1,300,000.00	1,989,039.00	
REP OF AUSTRIA 4.35	1,200,000.00	1,311,228.00	
REP OF AUSTRIA 4.85	1,000,000.00	1,391,180.00	
REP OF AUSTRIA 6.25	1,000,000.00	1,571,810.00	
SPANISH GOV'T 0.25	2,000,000.00	2,010,860.00	
SPANISH GOV'T 0.25	3,000,000.00	3,024,270.00	
SPANISH GOV'T 0.4	1,000,000.00	997,710.00	
SPANISH GOV'T 0.75	2,000,000.00	2,048,500.00	
SPANISH GOV'T 1.15	2,000,000.00	2,078,660.00	
SPANISH GOV'T 1.3	2,000,000.00	1,957,760.00	
SPANISH GOV'T 1.4	2,000,000.00	2,085,460.00	
SPANISH GOV'T 1.5	1,500,000.00	1,478,205.00	
SPANISH GOV'T 1.6	2,000,000.00	2,046,440.00	
SPANISH GOV'T 1.95	2,500,000.00	2,593,900.00	
SPANISH GOV'T 1.95	2,000,000.00	1,972,240.00	
SPANISH GOV'T 2.15	2,000,000.00	2,115,240.00	
SPANISH GOV'T 2.35	1,000,000.00	999,800.00	
SPANISH GOV'T 2.75	3,000,000.00	3,180,690.00	
SPANISH GOV'T 2.75	3,000,000.00	3,335,640.00	
SPANISH GOV'T 2.9	1,000,000.00	995,350.00	
SPANISH GOV'T 3.45	500,000.00	519,395.00	
SPANISH GOV'T 3.75	2,200,000.00	2,336,268.00	

	SPANISH GOV'T 3.8	2,000,000.00	2,372,860.00
	SPANISH GOV'T 4	3,000,000.00	3,367,290.00
	SPANISH GOV'T 4.1	2,000,000.00	2,109,700.00
	SPANISH GOV'T 4.2	2,050,000.00	2,576,768.00
	SPANISH GOV'T 4.3	3,000,000.00	3,335,250.00
	SPANISH GOV'T 4.4	3,000,000.00	3,669,780.00
	SPANISH GOV'T 4.6	2,500,000.00	2,771,200.00
	SPANISH GOV'T 4.65	3,000,000.00	3,767,970.00
	SPANISH GOV'T 4.7	1,500,000.00	2,022,105.00
	SPANISH GOV'T 4.8	2,000,000.00	2,503,980.00
	SPANISH GOV'T 4.85	2,000,000.00	2,340,140.00
	SPANISH GOV'T 4.9	2,000,000.00	2,756,820.00
	SPANISH GOV'T 5.15	1,500,000.00	2,012,595.00
	SPANISH GOV'T 5.15	2,000,000.00	2,865,520.00
	SPANISH GOV'T 5.4	3,000,000.00	3,805,350.00
	SPANISH GOV'T 5.5	3,000,000.00	3,649,200.00
	SPANISH GOV'T 5.75	2,200,000.00	3,214,530.00
	SPANISH GOV'T 5.85	2,500,000.00	3,149,700.00
	SPANISH GOV'T 5.9	2,500,000.00	3,440,650.00
	SPANISH GOV'T 6	2,900,000.00	4,161,616.00
	ユーロ 小計	583,670,000.00	678,897,574.50 (82,662,568,671)
英債券	UK TSY GILT 0.5	1,000,000.00	998,600.00
	UK TSY GILT 1.25	3,500,000.00	3,551,275.00
	UK TSY GILT 1.5	3,000,000.00	3,135,450.00
	UK TSY GILT 1.5	2,500,000.00	2,605,925.00
	UK TSY GILT 1.5	1,000,000.00	951,510.00
	UK TSY GILT 1.75	3,000,000.00	3,107,700.00
	UK TSY GILT 1.75	3,000,000.00	3,200,700.00
	UK TSY GILT 1.75	1,000,000.00	1,004,800.00
	UK TSY GILT 2	3,000,000.00	3,172,230.00
	UK TSY GILT 2	2,500,000.00	2,724,225.00
	UK TSY GILT 2.25	2,700,000.00	2,973,591.00
	UK TSY GILT 2.5	1,500,000.00	1,975,200.00
	UK TSY GILT 2.75	2,000,000.00	2,285,120.00
	UK TSY GILT 3.25	3,000,000.00	3,954,240.00
	UK TSY GILT 3.5	2,500,000.00	3,455,337.50
	UK TSY GILT 3.5	2,000,000.00	3,344,400.00
	UK TSY GILT 3.75	2,000,000.00	2,172,680.00
	UK TSY GILT 3.75	2,800,000.00	3,138,800.00
	UK TSY GILT 3.75	1,400,000.00	1,604,120.00
	UK TSY GILT 3.75	2,300,000.00	3,575,350.00
	UK TSY GILT 4	1,500,000.00	1,762,860.00

	UK TSY GILT 4	2,000,000.00	3,509,120.00	
	UK TSY GILT 4.25	1,300,000.00	1,710,023.90	
	UK TSY GILT 4.25	2,000,000.00	2,755,160.00	
	UK TSY GILT 4.25	3,000,000.00	4,268,430.00	
	UK TSY GILT 4.25	1,500,000.00	2,203,560.00	
	UK TSY GILT 4.25	2,500,000.00	3,699,000.00	
	UK TSY GILT 4.25	1,900,000.00	3,009,961.00	
	UK TSY GILT 4.25	1,900,000.00	3,125,006.00	
	UK TSY GILT 4.25	2,100,000.00	3,703,980.00	
	UK TSY GILT 4.5	2,000,000.00	2,165,040.00	
	UK TSY GILT 4.5	2,500,000.00	3,609,250.00	
	UK TSY GILT 4.5	2,000,000.00	3,143,950.00	
	UK TSY GILT 4.75	2,700,000.00	3,057,426.00	
	UK TSY GILT 4.75	1,800,000.00	2,551,140.00	
	UK TSY GILT 4.75	1,500,000.00	2,330,025.00	
	UK TSY GILT 5	2,000,000.00	2,642,540.00	
	UK TSY GILT 6	1,200,000.00	1,837,740.00	
	UK TSY GILT 8	1,620,000.00	2,137,411.80	
	英bond 小計	82,720,000.00	106,152,877.20 (15,167,123,094)	
スイスフラン	SWISS (GOVT) 2.25	900,000.00	988,200.00	
	SWISS (GOVT) 3	1,000,000.00	1,080,300.00	
	SWISS (GOVT) 4	500,000.00	632,050.00	
	SWISS (GOVT) 4	700,000.00	1,015,910.00	
	スイスフラン 小計	3,100,000.00	3,716,460.00 (416,652,330)	
スウェーデンクローナ	SWEDISH GOVRNMNT 1	8,000,000.00	8,261,920.00	
	SWEDISH GOVRNMNT 1.5	12,000,000.00	12,994,440.00	
	SWEDISH GOVRNMNT 2.5	8,000,000.00	9,303,440.00	
	SWEDISH GOVRNMNT 3.5	11,000,000.00	12,974,390.00	
	SWEDISH GOVRNMNT 3.5	6,000,000.00	8,080,800.00	
	SWEDISH GOVRNMNT 4.25	12,000,000.00	13,109,400.00	
	SWEDISH GOVRNMNT 5	11,000,000.00	13,117,500.00	
	スウェーデンクローナ 小計	68,000,000.00	77,841,890.00 (990,148,840)	
ノルウェークローネ	NORWEGIAN GOV'T 1.5	5,000,000.00	4,984,500.00	
	NORWEGIAN GOV'T 1.75	5,000,000.00	5,104,000.00	
	NORWEGIAN GOV'T 2	10,000,000.00	10,438,000.00	
	NORWEGIAN GOV'T 3	4,000,000.00	4,431,600.00	
	NORWEGIAN GOV'T 3.75	11,000,000.00	12,204,500.00	
	NORWEGIAN GOV'T 4.5	6,000,000.00	6,474,000.00	
	ノルウェークローネ 小計	41,000,000.00	43,636,600.00	

デンマーククローネ	DENMARK - BULLET 0.25	10,000,000.00	10,131,000.00	
	DENMARK - BULLET 1.5	5,000,000.00	5,464,000.00	
	DENMARK - BULLET 1.75	10,000,000.00	11,195,600.00	
	DENMARK - BULLET 3	10,000,000.00	11,473,700.00	
	DENMARK - BULLET 4	8,000,000.00	8,920,000.00	
	DENMARK - BULLET 4.5	17,000,000.00	28,544,700.00	
	DENMARK - BULLET 7	3,080,000.00	4,658,808.00	
デンマーククローネ 小計		63,080,000.00	80,387,808.00	(1,315,144,538)
ポーランドズロチ	POLAND GOVT BOND 1.5	3,000,000.00	2,932,500.00	
	POLAND GOVT BOND 1.75	3,000,000.00	2,884,800.00	
	POLAND GOVT BOND 2	3,000,000.00	2,931,000.00	
	POLAND GOVT BOND 2.5	5,000,000.00	5,035,000.00	
	POLAND GOVT BOND 2.5	4,000,000.00	3,741,600.00	
	POLAND GOVT BOND 3.25	5,000,000.00	5,010,000.00	
	POLAND GOVT BOND 4	2,000,000.00	2,106,200.00	
	POLAND GOVT BOND 5.25	5,000,000.00	5,092,000.00	
	POLAND GOVT BOND 5.25	2,000,000.00	2,176,000.00	
	POLAND GOVT BOND 5.5	4,000,000.00	4,318,400.00	
	POLAND GOVT BOND 5.75	4,000,000.00	4,510,800.00	
	POLAND GOVT BOND 5.75	4,200,000.00	4,787,790.00	
	POLAND GOVT BOND 5.75	2,000,000.00	2,448,500.00	
ポーランドズロチ 小計		46,200,000.00	47,974,590.00	(1,384,066,921)
オーストラリアドル	AUSTRALIAN GOVT. 1.75	3,000,000.00	2,980,650.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 2	1,000,000.00	996,400.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 2.25	2,000,000.00	1,912,800.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 2.75	3,000,000.00	3,073,050.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 2.75	3,000,000.00	3,073,320.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 2.75	2,000,000.00	2,015,400.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 2.75	1,000,000.00	1,001,962.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 2.75	1,000,000.00	940,400.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 3	1,000,000.00	899,490.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 3.25	2,000,000.00	2,046,820.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 3.25	4,000,000.00	4,224,800.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 3.25	1,500,000.00	1,573,200.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 3.25	1,000,000.00	983,800.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 3.75	1,000,000.00	1,070,000.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 4.25	4,000,000.00	4,545,600.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 4.5	3,000,000.00	3,231,768.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 4.5	1,500,000.00	1,779,450.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 4.75	3,200,000.00	3,802,240.00	

	AUSTRALIAN GOVT. 5.25	3,000,000.00	3,198,606.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 5.5	2,500,000.00	2,950,875.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 5.75	3,000,000.00	3,435,600.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 5.75	3,000,000.00	3,530,250.00	
オーストラリアドル 小計		49,700,000.00	53,266,481.00	(4,474,384,404)
シンガポールドル	SINGAPORE GOV'T 2.25	500,000.00	513,200.00	
	SINGAPORE GOV'T 2.75	1,000,000.00	1,051,000.00	
	SINGAPORE GOV'T 2.75	400,000.00	427,200.00	
	SINGAPORE GOV'T 2.875	400,000.00	427,372.00	
	SINGAPORE GOV'T 3	1,000,000.00	1,069,000.00	
	SINGAPORE GOV'T 3.125	1,000,000.00	1,070,200.00	
	SINGAPORE GOV'T 3.25	1,000,000.00	1,059,700.00	
	SINGAPORE GOV'T 3.375	500,000.00	569,500.00	
	SINGAPORE GOV'T 3.5	1,500,000.00	1,681,657.50	
	SINGAPORE GOV'T 4	2,100,000.00	2,181,690.00	
シンガポールドル 小計		9,400,000.00	10,050,519.50	(803,338,023)
マレーシアリングgit	MALAYSIA GOVT 3.418	8,000,000.00	7,819,808.00	
	MALAYSIA GOVT 3.502	9,000,000.00	8,434,800.00	
	MALAYSIA GOVT 4.24	5,000,000.00	5,038,080.00	
	MALAYSIA GOVT 4.378	5,000,000.00	5,107,500.00	
マレーシアリングgit 小計		27,000,000.00	26,400,188.00	(673,996,799)
南アフリカランド	REP SOUTH AFRICA 6.5	60,000,000.00	42,738,000.00	
	REP SOUTH AFRICA 6.75	30,000,000.00	29,040,000.00	
	REP SOUTH AFRICA 7	60,000,000.00	49,884,000.00	
	REP SOUTH AFRICA 8	10,000,000.00	10,079,300.00	
南アフリカランド 小計		160,000,000.00	131,741,300.00	(1,123,753,289)
合計			207,417,666,531	(207,417,666,531)

(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	43.7%	44.2%
カナダドル	国債証券 30銘柄	2.0%	2.1%
メキシコペソ	国債証券 9銘柄	0.9%	0.9%
ユーロ	国債証券 276銘柄	39.3%	39.9%
英ポンド	国債証券 39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	0.7%	0.7%
オーストラリアドル	国債証券	22銘柄	2.1%	2.2%
シンガポールドル	国債証券	10銘柄	0.4%	0.4%
マレーシアリングット	国債証券	4銘柄	0.3%	0.3%
南アフリカランド	国債証券	4銘柄	0.5%	0.5%

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「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。

ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	（平成28年 4月26日現在）	（平成29年 4月26日現在）
資産の部		
流動資産		
預金	395,557,524	245,360,510
金銭信託	737,135,744	172,896,804
コール・ローン	154,670,398	359,735,308
国債証券	37,470,353,819	59,784,087,499
派生商品評価勘定	558,523,360	38,872,372
未収入金	52,000,000	571,922,601
未収利息	251,663,741	350,679,362
前払費用	76,142,346	150,042,070
流動資産合計	39,696,046,932	61,673,596,526
資産合計	39,696,046,932	61,673,596,526
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	13,006,850	752,112,173
未払金	-	2,098,112
未払解約金	95,000,000	606,948,000
未払利息	453	1,043
その他未払費用	15,581	22,274
流動負債合計	108,022,884	1,361,181,602
負債合計	108,022,884	1,361,181,602
純資産の部		
元本等		
元本	28,443,896,912	43,677,470,657
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	11,144,127,136	16,634,944,267
元本等合計	39,588,024,048	60,312,414,924
純資産合計	39,588,024,048	60,312,414,924
負債純資産合計	39,696,046,932	61,673,596,526

注記表

（重要な会計方針の注記）

項目	自 平成28年 4月27日 至 平成29年 4月26日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券は個別法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。</p>
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建資産等の会計処理</p> <p>「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

項目	(平成28年 4月26日現在)	(平成29年 4月26日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	28,443,896,912口	43,677,470,657口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.3918円 (10,000口当たりの純資産額 13,918円)	1口当たり純資産額 1.3809円 (10,000口当たりの純資産額 13,809円)

(金融商品に関する注記)

. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 平成28年 4月27日 至 平成29年 4月26日
1. 金融商品に対する取組方針	<p>当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。</p>
	(1) 金融商品の内容

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

・ 金融商品の時価等に関する事項

項 目	(平成29年 4月26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 4月26日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位：円)

区 分	種 類	契 約 額 等		時 価	評 価 損 益
			うち1年超		
市場取引以外 の取引	為替予約取引				
	売建	38,759,226,510	-	38,213,710,000	545,516,510
	米ドル	16,389,166,200	-	16,216,504,000	172,662,200
	カナダドル	794,111,800	-	805,092,000	10,980,200
	メキシコペソ	394,938,180	-	384,930,000	10,008,180
	ユーロ	16,116,282,660	-	15,776,262,000	340,020,660
	英ポンド	3,026,066,800	-	3,021,912,000	4,154,800
	スイスフラン	81,757,200	-	79,702,000	2,055,200
	スウェーデンク ローナ	171,448,600	-	169,012,000	2,436,600
	ノルウェークロー ネ	121,951,800	-	121,590,000	361,800
	デンマーククロー ネ	251,841,870	-	246,960,000	4,881,870
	ポーランドズロチ	243,004,050	-	229,473,000	13,531,050
	オーストラリアドル	679,494,800	-	675,450,000	4,044,800
	シンガポールドル	316,004,200	-	311,638,000	4,366,200
	南アフリカランド	173,158,350	-	175,185,000	2,026,650
合計		38,759,226,510	-	38,213,710,000	545,516,510

(平成29年 4月26日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

（単位：円）

区 分	種 類	契 約 額 等		時 価	評 価 損 益
			うち1年超		
市場取引以外 の取引	為替予約取引				
	買建	1,260,197	-	1,275,369	15,172
	米ドル	785,614	-	794,179	8,565
	カナダドル	18,599	-	18,650	51
	ユーロ	225,321	-	229,205	3,884
	英ポンド	230,663	-	233,335	2,672
	売建	59,930,719,259	-	60,643,974,232	713,254,973
	米ドル	26,689,643,212	-	26,718,065,065	28,421,853
	カナダドル	1,293,813,139	-	1,271,447,787	22,365,352
	メキシコペソ	558,896,800	-	556,248,000	2,648,800
	ユーロ	23,640,515,933	-	24,219,985,956	579,470,023
	英ポンド	4,309,668,275	-	4,414,333,424	104,665,149
	スイスフラン	111,205,000	-	112,140,000	935,000
	スウェーデンク ローナ	261,093,000	-	267,120,000	6,027,000
	ノルウェークロー ネ	171,032,400	-	171,600,000	567,600
	デンマーククロー ネ	364,184,400	-	373,008,000	8,823,600
	ポーランドズロチ	417,632,100	-	429,418,000	11,785,900
	オーストラリアド ル	1,297,883,700	-	1,284,129,000	13,754,700
	シンガポールドル	485,736,900	-	487,329,000	1,592,100
	南アフリカランド	329,414,400	-	339,150,000	9,735,600
合計		59,931,979,456	-	60,645,249,601	713,239,801

（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 4月27日 至 平成29年 4月26日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。

（その他の注記）

（平成28年 4月26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	18,788,550,964円
同期中における追加設定元本額	19,329,357,560円
同期中における一部解約元本額	9,674,011,612円
平成28年 4月26日現在における元本の内訳	
アセットアロケーション・ファンド（安定型）	4,699,301,222円
アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）	3,800,933,413円
アセットアロケーション・ファンド（成長型）	2,824,867,699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＞	5,338,668,542円
S M A M ・バランスV A 株4 0 T ＜適格機関投資家限定＞	188,811,848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）	6,651,950,699円
S M A M ・ヘッジ付き年金外国債券パッシブファンド ＜適格機関投資家限定＞	3,587,481,324円
S M A M ・グローバル・マルチアセット・グロース・ファンド（安定成長型）＜適格機関投資家限定＞	796,470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＞	2,266,011円
S M A M ・マルチアセットストラテジーファンド2 0 1 6 - 0 1 ＜適格機関投資家限定＞	1,348,819,684円
合計	28,443,896,912円

（平成29年 4月26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	28,443,896,912円

同期中における追加設定元本額	29,280,785,770円
同期中における一部解約元本額	14,047,212,025円
平成29年 4月26日現在における元本の内訳	
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	17,117,938,799円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	6,810,810,650円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	2,915,602,988円
イオン・バランス戦略ファンド	268,297,808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>	5,365,344,501円
S M A M・バランスV A株4 0 T<適格機関投資家限定>	174,021,383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)	5,474,160,667円
S M A M・ヘッジ付き年金外国債券パッシブファンド<適格機関投資家限定>	3,666,660,246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>	1,636,586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>	891,586,465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>	427,274,050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>	564,136,514円
合計	43,677,470,657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	1,300,000.00	1,293,296.87	
		US TREASURY N/B 0.625	1,500,000.00	1,490,507.82	
		US TREASURY N/B 0.75	600,000.00	597,843.75	
		US TREASURY N/B 0.75	500,000.00	498,046.87	
		US TREASURY N/B 0.75	1,000,000.00	994,531.25	
		US TREASURY N/B 0.75	1,000,000.00	993,906.25	
		US TREASURY N/B 0.75	1,000,000.00	993,437.50	
		US TREASURY N/B 0.75	500,000.00	496,367.19	

US TREASURY N/B 0.75	500,000.00	495,390.62	
US TREASURY N/B 0.75	1,000,000.00	987,109.38	
US TREASURY N/B 0.75	500,000.00	493,242.19	
US TREASURY N/B 0.875	1,000,000.00	997,031.25	
US TREASURY N/B 0.875	800,000.00	797,125.00	
US TREASURY N/B 0.875	700,000.00	696,554.69	
US TREASURY N/B 0.875	500,000.00	496,015.62	
US TREASURY N/B 0.875	1,000,000.00	991,250.00	
US TREASURY N/B 0.875	1,000,000.00	990,468.75	
US TREASURY N/B 0.875	300,000.00	296,906.25	
US TREASURY N/B 0.875	1,000,000.00	988,437.50	
US TREASURY N/B 1	2,000,000.00	1,997,187.50	
US TREASURY N/B 1	800,000.00	798,687.50	
US TREASURY N/B 1	1,000,000.00	997,500.00	
US TREASURY N/B 1	1,000,000.00	996,953.13	
US TREASURY N/B 1	1,000,000.00	996,171.88	
US TREASURY N/B 1	700,000.00	696,335.94	
US TREASURY N/B 1	500,000.00	496,601.56	
US TREASURY N/B 1	2,000,000.00	1,983,750.00	
US TREASURY N/B 1	400,000.00	396,531.25	
US TREASURY N/B 1	1,000,000.00	990,546.88	
US TREASURY N/B 1	1,000,000.00	989,765.63	
US TREASURY N/B 1	700,000.00	692,945.31	
US TREASURY N/B 1.125	1,000,000.00	999,609.38	
US TREASURY N/B 1.125	500,000.00	498,906.25	
US TREASURY N/B 1.125	1,000,000.00	997,656.25	
US TREASURY N/B 1.125	1,000,000.00	997,421.88	
US TREASURY N/B 1.125	300,000.00	298,898.43	
US TREASURY N/B 1.125	700,000.00	694,695.31	
US TREASURY N/B 1.125	1,000,000.00	990,156.25	
US TREASURY N/B 1.125	1,000,000.00	988,984.38	
US TREASURY N/B 1.125	1,000,000.00	978,906.25	
US TREASURY N/B 1.125	1,000,000.00	974,687.50	
US TREASURY N/B 1.125	1,000,000.00	973,671.88	
US TREASURY N/B 1.125	1,000,000.00	972,812.50	

US TREASURY N/B 1.125	1,000,000.00	971,484.38	
US TREASURY N/B 1.25	1,500,000.00	1,500,585.94	
US TREASURY N/B 1.25	700,000.00	700,109.37	
US TREASURY N/B 1.25	800,000.00	800,187.50	
US TREASURY N/B 1.25	500,000.00	500,000.00	
US TREASURY N/B 1.25	1,000,000.00	999,921.88	
US TREASURY N/B 1.25	1,400,000.00	1,399,781.25	
US TREASURY N/B 1.25	900,000.00	899,437.50	
US TREASURY N/B 1.25	1,000,000.00	996,875.00	
US TREASURY N/B 1.25	1,000,000.00	994,687.50	
US TREASURY N/B 1.25	800,000.00	795,500.00	
US TREASURY N/B 1.25	1,500,000.00	1,474,101.57	
US TREASURY N/B 1.25	1,500,000.00	1,463,906.25	
US TREASURY N/B 1.25	700,000.00	666,148.44	
US TREASURY N/B 1.375	1,000,000.00	1,002,500.00	
US TREASURY N/B 1.375	1,000,000.00	1,002,265.63	
US TREASURY N/B 1.375	1,500,000.00	1,503,164.07	
US TREASURY N/B 1.375	2,000,000.00	2,004,375.00	
US TREASURY N/B 1.375	300,000.00	300,597.65	
US TREASURY N/B 1.375	500,000.00	501,015.62	
US TREASURY N/B 1.375	1,000,000.00	998,906.25	
US TREASURY N/B 1.375	1,000,000.00	998,281.25	
US TREASURY N/B 1.375	1,000,000.00	998,437.50	
US TREASURY N/B 1.375	1,000,000.00	997,812.50	
US TREASURY N/B 1.375	1,000,000.00	997,421.88	
US TREASURY N/B 1.375	600,000.00	598,125.00	
US TREASURY N/B 1.375	1,200,000.00	1,195,406.25	
US TREASURY N/B 1.375	900,000.00	895,710.94	
US TREASURY N/B 1.375	1,500,000.00	1,489,687.50	
US TREASURY N/B 1.375	1,800,000.00	1,786,218.75	
US TREASURY N/B 1.375	1,000,000.00	991,484.38	
US TREASURY N/B 1.375	1,500,000.00	1,483,476.57	
US TREASURY N/B 1.375	1,700,000.00	1,677,289.07	
US TREASURY N/B 1.375	1,000,000.00	985,625.00	
US TREASURY N/B 1.375	1,000,000.00	960,234.38	

US TREASURY N/B 1.375	1,000,000.00	957,890.63	
US TREASURY N/B 1.375	1,000,000.00	957,031.25	
US TREASURY N/B 1.5	1,500,000.00	1,505,742.19	
US TREASURY N/B 1.5	1,100,000.00	1,104,296.87	
US TREASURY N/B 1.5	1,000,000.00	1,003,984.38	
US TREASURY N/B 1.5	800,000.00	803,125.00	
US TREASURY N/B 1.5	700,000.00	703,062.50	
US TREASURY N/B 1.5	800,000.00	803,250.00	
US TREASURY N/B 1.5	1,000,000.00	1,002,734.38	
US TREASURY N/B 1.5	1,000,000.00	1,002,343.75	
US TREASURY N/B 1.5	1,700,000.00	1,698,406.25	
US TREASURY N/B 1.5	600,000.00	590,671.87	
US TREASURY N/B 1.5	1,500,000.00	1,457,460.94	
US TREASURY N/B 1.5	500,000.00	485,234.37	
US TREASURY N/B 1.5	2,500,000.00	2,328,320.32	
US TREASURY N/B 1.625	1,000,000.00	1,006,562.50	
US TREASURY N/B 1.625	1,000,000.00	1,006,562.50	
US TREASURY N/B 1.625	800,000.00	805,000.00	
US TREASURY N/B 1.625	1,500,000.00	1,509,257.82	
US TREASURY N/B 1.625	800,000.00	804,812.50	
US TREASURY N/B 1.625	1,000,000.00	1,005,234.38	
US TREASURY N/B 1.625	800,000.00	801,937.50	
US TREASURY N/B 1.625	1,500,000.00	1,502,929.69	
US TREASURY N/B 1.625	1,600,000.00	1,599,000.00	
US TREASURY N/B 1.625	800,000.00	787,937.50	
US TREASURY N/B 1.625	600,000.00	589,312.50	
US TREASURY N/B 1.625	1,000,000.00	976,640.63	
US TREASURY N/B 1.625	1,000,000.00	975,390.63	
US TREASURY N/B 1.625	1,000,000.00	971,562.50	
US TREASURY N/B 1.625	2,700,000.00	2,554,242.19	
US TREASURY N/B 1.625	1,800,000.00	1,699,312.50	
US TREASURY N/B 1.75	1,000,000.00	1,008,046.88	
US TREASURY N/B 1.75	1,000,000.00	1,008,984.38	
US TREASURY N/B 1.75	1,400,000.00	1,406,125.00	
US TREASURY N/B 1.75	1,000,000.00	1,003,281.25	

US TREASURY N/B 1.75	2,700,000.00	2,693,039.07	
US TREASURY N/B 1.75	1,500,000.00	1,492,617.19	
US TREASURY N/B 1.75	900,000.00	895,078.12	
US TREASURY N/B 1.75	1,500,000.00	1,491,445.32	
US TREASURY N/B 1.75	600,000.00	596,484.37	
US TREASURY N/B 1.75	1,000,000.00	989,921.88	
US TREASURY N/B 1.75	1,500,000.00	1,479,140.62	
US TREASURY N/B 1.75	1,800,000.00	1,770,187.50	
US TREASURY N/B 1.875	500,000.00	505,312.50	
US TREASURY N/B 1.875	600,000.00	601,687.50	
US TREASURY N/B 1.875	1,000,000.00	1,001,406.25	
US TREASURY N/B 1.875	1,000,000.00	1,001,640.63	
US TREASURY N/B 1.875	1,600,000.00	1,599,625.00	
US TREASURY N/B 1.875	1,000,000.00	997,187.50	
US TREASURY N/B 1.875	1,500,000.00	1,493,085.94	
US TREASURY N/B 2	500,000.00	506,953.12	
US TREASURY N/B 2	500,000.00	506,718.75	
US TREASURY N/B 2	400,000.00	405,031.25	
US TREASURY N/B 2	1,400,000.00	1,416,078.13	
US TREASURY N/B 2	1,000,000.00	1,010,390.63	
US TREASURY N/B 2	800,000.00	807,375.00	
US TREASURY N/B 2	500,000.00	504,140.62	
US TREASURY N/B 2	1,000,000.00	1,008,515.62	
US TREASURY N/B 2	1,000,000.00	1,007,421.88	
US TREASURY N/B 2	600,000.00	604,875.00	
US TREASURY N/B 2	700,000.00	703,117.19	
US TREASURY N/B 2	800,000.00	800,937.50	
US TREASURY N/B 2	1,200,000.00	1,199,250.00	
US TREASURY N/B 2	2,400,000.00	2,360,812.50	
US TREASURY N/B 2	2,600,000.00	2,546,171.88	
US TREASURY N/B 2	1,600,000.00	1,554,875.00	
US TREASURY N/B 2.125	500,000.00	508,789.06	
US TREASURY N/B 2.125	500,000.00	508,203.12	
US TREASURY N/B 2.125	500,000.00	507,578.12	
US TREASURY N/B 2.125	1,500,000.00	1,522,617.19	

US TREASURY N/B 2.125	1,400,000.00	1,419,578.13	
US TREASURY N/B 2.125	1,000,000.00	1,013,593.74	
US TREASURY N/B 2.125	700,000.00	707,710.94	
US TREASURY N/B 2.125	1,000,000.00	1,007,031.24	
US TREASURY N/B 2.125	1,000,000.00	1,001,562.50	
US TREASURY N/B 2.125	1,000,000.00	999,765.63	
US TREASURY N/B 2.125	1,900,000.00	1,882,039.07	
US TREASURY N/B 2.25	300,000.00	303,937.50	
US TREASURY N/B 2.25	600,000.00	612,281.25	
US TREASURY N/B 2.25	500,000.00	510,234.37	
US TREASURY N/B 2.25	1,000,000.00	1,020,000.00	
US TREASURY N/B 2.25	1,000,000.00	1,008,437.50	
US TREASURY N/B 2.25	1,000,000.00	1,008,046.88	
US TREASURY N/B 2.25	1,900,000.00	1,906,828.12	
US TREASURY N/B 2.25	1,800,000.00	1,793,953.12	
US TREASURY N/B 2.25	1,700,000.00	1,688,046.87	
US TREASURY N/B 2.25	1,800,000.00	1,535,906.25	
US TREASURY N/B 2.375	700,000.00	709,898.44	
US TREASURY N/B 2.375	500,000.00	512,968.75	
US TREASURY N/B 2.375	2,500,000.00	2,534,765.61	
US TREASURY N/B 2.5	1,300,000.00	1,332,703.12	
US TREASURY N/B 2.5	2,000,000.00	2,047,031.25	
US TREASURY N/B 2.5	1,000,000.00	906,171.88	
US TREASURY N/B 2.5	1,400,000.00	1,265,140.63	
US TREASURY N/B 2.5	900,000.00	812,531.25	
US TREASURY N/B 2.625	1,400,000.00	1,448,015.63	
US TREASURY N/B 2.625	2,300,000.00	2,378,882.82	
US TREASURY N/B 2.75	700,000.00	718,648.44	
US TREASURY N/B 2.75	2,300,000.00	2,392,898.44	
US TREASURY N/B 2.75	1,500,000.00	1,560,234.37	
US TREASURY N/B 2.75	600,000.00	576,609.37	
US TREASURY N/B 2.75	700,000.00	671,781.25	
US TREASURY N/B 2.875	1,000,000.00	981,953.12	
US TREASURY N/B 2.875	1,300,000.00	1,270,953.12	
US TREASURY N/B 2.875	1,300,000.00	1,270,750.00	

US TREASURY N/B 3	400,000.00	403,406.25	
US TREASURY N/B 3	1,900,000.00	1,906,828.12	
US TREASURY N/B 3	1,300,000.00	1,303,148.44	
US TREASURY N/B 3	1,600,000.00	1,602,875.00	
US TREASURY N/B 3	1,000,000.00	1,003,828.13	
US TREASURY N/B 3.125	800,000.00	829,375.00	
US TREASURY N/B 3.125	800,000.00	843,750.00	
US TREASURY N/B 3.125	300,000.00	309,679.68	
US TREASURY N/B 3.125	800,000.00	825,562.49	
US TREASURY N/B 3.125	1,600,000.00	1,646,125.00	
US TREASURY N/B 3.125	1,900,000.00	1,953,140.62	
US TREASURY N/B 3.375	1,500,000.00	1,573,945.32	
US TREASURY N/B 3.375	1,000,000.00	1,075,937.50	
US TREASURY N/B 3.5	800,000.00	847,562.50	
US TREASURY N/B 3.5	300,000.00	333,351.56	
US TREASURY N/B 3.625	800,000.00	841,437.50	
US TREASURY N/B 3.625	2,000,000.00	2,119,218.76	
US TREASURY N/B 3.625	1,200,000.00	1,286,906.25	
US TREASURY N/B 3.625	1,200,000.00	1,346,531.25	
US TREASURY N/B 3.625	1,500,000.00	1,684,921.87	
US TREASURY N/B 3.75	800,000.00	830,843.75	
US TREASURY N/B 3.75	1,300,000.00	1,486,468.75	
US TREASURY N/B 3.75	1,200,000.00	1,376,156.25	
US TREASURY N/B 3.875	1,000,000.00	1,028,671.88	
US TREASURY N/B 3.875	800,000.00	933,062.49	
US TREASURY N/B 4	800,000.00	829,250.00	
US TREASURY N/B 4.25	200,000.00	246,312.50	
US TREASURY N/B 4.25	400,000.00	492,312.50	
US TREASURY N/B 4.375	500,000.00	629,101.56	
US TREASURY N/B 4.375	300,000.00	375,726.56	
US TREASURY N/B 4.375	400,000.00	500,687.50	
US TREASURY N/B 4.375	300,000.00	376,476.56	
US TREASURY N/B 4.5	400,000.00	511,312.50	
US TREASURY N/B 4.5	200,000.00	255,781.25	
US TREASURY N/B 4.5	300,000.00	382,171.87	

	US TREASURY N/B 4.625	1,500,000.00	1,943,085.94	
	US TREASURY N/B 4.75	600,000.00	792,187.50	
	US TREASURY N/B 5	200,000.00	271,171.87	
	US TREASURY N/B 5.25	300,000.00	385,640.62	
	US TREASURY N/B 5.25	300,000.00	387,117.18	
	US TREASURY N/B 5.375	500,000.00	672,070.31	
	US TREASURY N/B 5.5	300,000.00	391,992.18	
	US TREASURY N/B 6	200,000.00	259,890.62	
	US TREASURY N/B 6.125	200,000.00	270,390.62	
	US TREASURY N/B 6.25	500,000.00	624,882.81	
	US TREASURY N/B 6.25	100,000.00	142,570.31	
	US TREASURY N/B 6.5	500,000.00	679,921.87	
	US TREASURY N/B 8	300,000.00	381,117.18	
	米ドル 小計	234,900,000.00	237,545,808.63 (26,445,974,874)	
カナダドル	CANADA-GOV'T 0.5	500,000.00	498,740.00	
	CANADA-GOV'T 0.5	500,000.00	498,390.00	
	CANADA-GOV'T 0.5	500,000.00	498,000.00	
	CANADA-GOV'T 0.5	600,000.00	584,040.00	
	CANADA-GOV'T 0.75	400,000.00	398,160.00	
	CANADA-GOV'T 0.75	500,000.00	496,224.50	
	CANADA-GOV'T 0.75	500,000.00	494,500.00	
	CANADA-GOV'T 1	500,000.00	471,480.00	
	CANADA-GOV'T 1.25	400,000.00	401,980.00	
	CANADA-GOV'T 1.25	400,000.00	402,920.00	
	CANADA-GOV'T 1.5	1,100,000.00	1,120,625.00	
	CANADA-GOV'T 1.5	400,000.00	406,392.00	
	CANADA-GOV'T 1.5	300,000.00	299,820.00	
	CANADA-GOV'T 1.75	300,000.00	305,616.00	
	CANADA-GOV'T 1.75	300,000.00	306,774.00	
	CANADA-GOV'T 2.25	300,000.00	318,957.00	
	CANADA-GOV'T 2.5	700,000.00	755,328.00	
	CANADA-GOV'T 2.75	800,000.00	865,440.00	
	CANADA-GOV'T 2.75	500,000.00	563,750.00	
	CANADA-GOV'T 3.25	300,000.00	327,195.00	

	CANADA-GOV'T 3.5	300,000.00	324,168.00	
	CANADA-GOV'T 3.5	500,000.00	634,475.00	
	CANADA-GOV'T 3.75	700,000.00	743,470.00	
	CANADA-GOV'T 4	400,000.00	533,480.00	
	CANADA-GOV'T 4.25	400,000.00	415,600.00	
	CANADA-GOV'T 5	500,000.00	733,075.00	
	CANADA-GOV'T 5.75	500,000.00	713,990.00	
	CANADA-GOV'T 5.75	600,000.00	908,526.00	
	カナダドル 小計	13,700,000.00	15,021,115.50	(1,232,482,526)
メキシコペソ	MEXICAN BONOS 10	7,000,000.00	8,174,600.00	
	MEXICAN BONOS 4.75	2,000,000.00	1,960,600.00	
	MEXICAN BONOS 5	6,000,000.00	5,742,000.00	
	MEXICAN BONOS 5.75	5,000,000.00	4,543,000.00	
	MEXICAN BONOS 6.5	13,000,000.00	12,753,000.00	
	MEXICAN BONOS 6.5	4,000,000.00	3,902,000.00	
	MEXICAN BONOS 7.75	6,000,000.00	6,039,000.00	
	MEXICAN BONOS 7.75	4,000,000.00	4,102,000.00	
	MEXICAN BONOS 7.75	4,000,000.00	4,080,800.00	
	MEXICAN BONOS 7.75	8,000,000.00	8,092,000.00	
	MEXICAN BONOS 8	7,000,000.00	7,192,500.00	
	MEXICAN BONOS 8	5,000,000.00	5,237,500.00	
	MEXICAN BONOS 8.5	6,000,000.00	6,156,600.00	
	MEXICAN BONOS 8.5	6,000,000.00	6,552,000.00	
	MEXICAN BONOS 8.5	6,000,000.00	6,540,600.00	
	メキシコペソ 小計	89,000,000.00	91,068,200.00	(538,213,062)
ユーロ	BELGIAN 0326 4	200,000.00	278,402.00	
	BELGIAN 0.8	500,000.00	512,065.00	
	BELGIAN 0.8	300,000.00	299,229.00	
	BELGIAN 0291 5.5	500,000.00	747,085.00	
	BELGIAN 0304 5	700,000.00	1,122,450.00	
	BELGIAN 0308 4	500,000.00	603,920.00	
	BELGIAN 0315 4	500,000.00	543,870.00	
	BELGIAN 0318 3.75	600,000.00	686,430.00	
	BELGIAN 0320 4.25	400,000.00	617,000.00	

BELGIAN 0321 4.25	600,000.00	721,110.00	
BELGIAN 0324 4.5	300,000.00	403,866.00	
BELGIAN 0325 4.25	800,000.00	989,056.00	
BELGIAN 0327 3	200,000.00	217,086.00	
BELGIAN 0328 2.25	500,000.00	567,920.00	
BELGIAN 0329 1.25	300,000.00	306,300.00	
BELGIAN 0332 2.6	400,000.00	465,168.00	
BELGIAN 0333 3	100,000.00	126,907.00	
BELGIAN 0338 0.5	300,000.00	302,853.00	
BELGIAN 1	400,000.00	412,636.00	
BELGIAN 1	800,000.00	783,320.00	
BELGIAN 1.6	500,000.00	478,515.00	
BELGIAN 1.9	300,000.00	322,878.00	
BELGIAN 2.15	200,000.00	202,176.00	
BELGIAN 3.75	200,000.00	292,000.00	
BTPS 0.05	300,000.00	298,413.00	
BTPS 0.1	400,000.00	400,616.00	
BTPS 0.25	400,000.00	401,856.00	
BTPS 0.3	1,000,000.00	1,005,370.00	
BTPS 0.35	400,000.00	392,288.00	
BTPS 0.45	500,000.00	496,765.00	
BTPS 0.65	800,000.00	806,136.00	
BTPS 0.65	300,000.00	285,348.00	
BTPS 0.7	1,100,000.00	1,111,132.00	
BTPS 0.95	1,100,000.00	1,080,409.00	
BTPS 1.05	600,000.00	612,036.00	
BTPS 1.25	600,000.00	556,890.00	
BTPS 1.35	600,000.00	609,642.00	
BTPS 1.45	600,000.00	610,200.00	
BTPS 1.5	400,000.00	411,800.00	
BTPS 1.5	700,000.00	680,183.00	
BTPS 1.6	600,000.00	577,362.00	
BTPS 1.65	600,000.00	535,920.00	
BTPS 2	400,000.00	400,328.00	
BTPS 2.15	800,000.00	846,928.00	

BTPS 2.2	300,000.00	298,812.00	
BTPS 2.25	300,000.00	274,464.00	
BTPS 2.45	300,000.00	289,704.00	
BTPS 2.5	600,000.00	628,926.00	
BTPS 2.5	600,000.00	629,724.00	
BTPS 2.7	500,000.00	447,520.00	
BTPS 2.8	200,000.00	167,912.00	
BTPS 3.25	400,000.00	400,552.00	
BTPS 3.5	500,000.00	519,895.00	
BTPS 3.5	500,000.00	527,885.00	
BTPS 3.5	600,000.00	664,884.00	
BTPS 3.75	700,000.00	786,303.00	
BTPS 3.75	500,000.00	562,045.00	
BTPS 3.75	1,100,000.00	1,239,304.00	
BTPS 3.75	600,000.00	682,170.00	
BTPS 4	700,000.00	782,698.00	
BTPS 4	900,000.00	1,042,182.00	
BTPS 4.25	800,000.00	859,416.00	
BTPS 4.25	700,000.00	765,786.00	
BTPS 4.25	700,000.00	777,392.00	
BTPS 4.5	1,300,000.00	1,375,985.00	
BTPS 4.5	800,000.00	865,672.00	
BTPS 4.5	1,100,000.00	1,226,907.00	
BTPS 4.5	600,000.00	708,396.00	
BTPS 4.5	1,100,000.00	1,304,501.00	
BTPS 4.5	700,000.00	838,159.00	
BTPS 4.75	800,000.00	935,616.00	
BTPS 4.75	700,000.00	841,232.00	
BTPS 4.75	1,000,000.00	1,233,140.00	
BTPS 4.75	800,000.00	1,013,528.00	
BTPS 5	700,000.00	832,153.00	
BTPS 5	1,100,000.00	1,353,088.00	
BTPS 5	600,000.00	776,898.00	
BTPS 5	600,000.00	783,966.00	
BTPS 5	600,000.00	777,018.00	

BTPS 5.25	1,000,000.00	1,298,010.00	
BTPS 5.5	400,000.00	490,488.00	
BTPS 5.5	600,000.00	737,058.00	
BTPS 5.75	900,000.00	1,249,002.00	
BTPS 6	1,000,000.00	1,399,050.00	
BTPS 6.5	800,000.00	1,115,448.00	
BTPS 7.25	500,000.00	721,435.00	
BTPS 9	300,000.00	440,238.00	
BUNDESOBL-166 0.25	500,000.00	504,880.00	
BUNDESOBL-167 1	600,000.00	615,408.00	
BUNDESOBL-168 1	700,000.00	722,211.00	
BUNDESOBL-169 0.5	800,000.00	819,072.00	
BUNDESOBL-170 0.25	600,000.00	613,626.00	
BUNDESOBL-171 0	1,000,000.00	1,018,520.00	
BUNDESOBL-172 0.25	600,000.00	616,632.00	
BUNDESOBL-173 0	500,000.00	509,510.00	
BUNDESOBL-174 0	500,000.00	509,170.00	
BUNDESSCHATZANW 0	500,000.00	504,240.00	
BUNDESSCHATZANW 0	600,000.00	606,078.00	
BUNDESSCHATZANW 0	300,000.00	303,561.00	
DEUTSCHLAND REP 0	600,000.00	583,428.00	
DEUTSCHLAND REP 0.25	300,000.00	296,373.00	
DEUTSCHLAND REP 0.5	500,000.00	517,360.00	
DEUTSCHLAND REP 0.5	1,600,000.00	1,640,752.00	
DEUTSCHLAND REP 1	600,000.00	644,880.00	
DEUTSCHLAND REP 1	600,000.00	643,470.00	
DEUTSCHLAND REP 1.5	700,000.00	767,102.00	
DEUTSCHLAND REP 1.5	600,000.00	659,772.00	
DEUTSCHLAND REP 1.5	500,000.00	551,120.00	
DEUTSCHLAND REP 1.5	600,000.00	665,916.00	
DEUTSCHLAND REP 1.75	800,000.00	885,728.00	
DEUTSCHLAND REP 1.75	700,000.00	788,214.00	
DEUTSCHLAND REP 2	600,000.00	667,668.00	
DEUTSCHLAND REP 2	1,100,000.00	1,250,084.00	
DEUTSCHLAND REP 2.25	400,000.00	438,212.00	

DEUTSCHLAND REP 2.25	500,000.00	558,870.00	
DEUTSCHLAND REP 2.5	500,000.00	556,380.00	
DEUTSCHLAND REP 2.5	700,000.00	931,399.00	
DEUTSCHLAND REP 2.5	600,000.00	805,866.00	
DEUTSCHLAND REP 3	800,000.00	892,688.00	
DEUTSCHLAND REP 3.25	500,000.00	553,200.00	
DEUTSCHLAND REP 3.25	1,100,000.00	1,272,546.00	
DEUTSCHLAND REP 3.25	400,000.00	596,760.00	
DEUTSCHLAND REP 3.5	1,000,000.00	1,092,530.00	
DEUTSCHLAND REP 3.75	800,000.00	861,192.00	
DEUTSCHLAND REP 4	600,000.00	942,954.00	
DEUTSCHLAND REP 4.25	700,000.00	741,811.00	
DEUTSCHLAND REP 4.25	600,000.00	1,000,764.00	
DEUTSCHLAND REP 4.75	500,000.00	735,145.00	
DEUTSCHLAND REP 4.75	800,000.00	1,319,736.00	
DEUTSCHLAND REP 4.75	600,000.00	1,075,128.00	
DEUTSCHLAND REP 5.5	600,000.00	989,256.00	
DEUTSCHLAND REP 5.625	410,000.00	634,265.90	
DEUTSCHLAND REP 6.25	200,000.00	285,230.00	
DEUTSCHLAND REP 6.25	300,000.00	511,893.00	
DEUTSCHLAND REP 6.5	200,000.00	322,782.00	
FINNISH GOV'T 0.875	300,000.00	312,237.00	
FINNISH GOV'T 1.125	200,000.00	204,918.00	
FINNISH GOV'T 1.5	300,000.00	326,514.00	
FINNISH GOV'T 1.625	300,000.00	327,318.00	
FINNISH GOV'T 2	300,000.00	337,836.00	
FINNISH GOV'T 2.625	200,000.00	264,200.00	
FINNISH GOV'T 2.75	100,000.00	122,614.00	
FINNISH GOV'T 3.375	200,000.00	222,954.00	
FINNISH GOV'T 3.5	200,000.00	230,466.00	
FINNISH GOV'T 4	300,000.00	389,886.00	
FINNISH GOV'T 4.375	500,000.00	554,295.00	
FRANCE O.A.T. 0	600,000.00	605,610.00	
FRANCE O.A.T. 0	300,000.00	303,567.00	
FRANCE O.A.T. 0	800,000.00	809,808.00	

FRANCE O.A.T. 0	700,000.00	706,636.00	
FRANCE O.A.T. 0	200,000.00	200,220.00	
FRANCE O.A.T. 0.25	700,000.00	714,546.00	
FRANCE O.A.T. 0.25	900,000.00	852,606.00	
FRANCE O.A.T. 0.5	700,000.00	717,416.00	
FRANCE O.A.T. 0.5	1,000,000.00	996,430.00	
FRANCE O.A.T. 0.5	1,200,000.00	1,175,112.00	
FRANCE O.A.T. 1	500,000.00	508,235.00	
FRANCE O.A.T. 1	600,000.00	614,400.00	
FRANCE O.A.T. 1	1,100,000.00	1,134,232.00	
FRANCE O.A.T. 1	700,000.00	721,154.00	
FRANCE O.A.T. 1.25	600,000.00	573,234.00	
FRANCE O.A.T. 1.5	1,100,000.00	1,138,566.00	
FRANCE O.A.T. 1.75	1,300,000.00	1,425,801.00	
FRANCE O.A.T. 1.75	1,000,000.00	1,098,780.00	
FRANCE O.A.T. 1.75	700,000.00	716,247.00	
FRANCE O.A.T. 1.75	200,000.00	179,554.00	
FRANCE O.A.T. 2.25	1,400,000.00	1,569,918.00	
FRANCE O.A.T. 2.25	1,000,000.00	1,135,030.00	
FRANCE O.A.T. 2.5	1,000,000.00	1,100,390.00	
FRANCE O.A.T. 2.5	900,000.00	1,048,950.00	
FRANCE O.A.T. 2.75	1,200,000.00	1,416,768.00	
FRANCE O.A.T. 3	1,700,000.00	1,960,746.00	
FRANCE O.A.T. 3.25	1,600,000.00	1,847,168.00	
FRANCE O.A.T. 3.25	700,000.00	917,056.00	
FRANCE O.A.T. 3.5	1,100,000.00	1,229,514.00	
FRANCE O.A.T. 3.5	1,000,000.00	1,245,280.00	
FRANCE O.A.T. 3.75	1,000,000.00	1,106,140.00	
FRANCE O.A.T. 3.75	1,200,000.00	1,393,152.00	
FRANCE O.A.T. 4	700,000.00	731,738.00	
FRANCE O.A.T. 4	900,000.00	1,300,293.00	
FRANCE O.A.T. 4	600,000.00	921,948.00	
FRANCE O.A.T. 4	400,000.00	624,968.00	
FRANCE O.A.T. 4.25	900,000.00	964,521.00	
FRANCE O.A.T. 4.25	1,000,000.00	1,095,800.00	

FRANCE O.A.T. 4.25	1,400,000.00	1,765,176.00	
FRANCE O.A.T. 4.5	1,000,000.00	1,559,220.00	
FRANCE O.A.T. 4.75	900,000.00	1,378,926.00	
FRANCE O.A.T. 5.5	900,000.00	1,355,274.00	
FRANCE O.A.T. 5.75	1,300,000.00	2,122,562.00	
FRANCE O.A.T. 6	1,200,000.00	1,742,496.00	
FRANCE O.A.T. 8.5	1,200,000.00	1,470,792.00	
FRANCE O.A.T. 8.5	200,000.00	300,164.00	
IRISH GOVT 0.8	300,000.00	311,070.00	
IRISH GOVT 1	200,000.00	201,560.00	
IRISH GOVT 2	200,000.00	199,858.00	
IRISH GOVT 2.4	500,000.00	562,045.00	
IRISH GOVT 3.4	300,000.00	359,634.00	
IRISH GOVT 3.9	200,000.00	242,870.00	
IRISH GOVT 4.4	200,000.00	220,564.00	
IRISH GOVT 4.5	400,000.00	429,224.00	
IRISH GOVT 4.5	200,000.00	228,420.00	
IRISH GOVT 5	200,000.00	236,330.00	
IRISH GOVT 5.4	300,000.00	408,351.00	
IRISH GOVT 5.9	200,000.00	230,920.00	
NETHERLANDS GOVT 0	300,000.00	301,890.00	
NETHERLANDS GOVT 0	300,000.00	303,366.00	
NETHERLANDS GOVT 0.25	400,000.00	409,300.00	
NETHERLANDS GOVT 0.25	300,000.00	298,815.00	
NETHERLANDS GOVT 0.5	1,300,000.00	1,306,656.00	
NETHERLANDS GOVT 0.75	300,000.00	304,269.00	
NETHERLANDS GOVT 1.25	300,000.00	309,972.00	
NETHERLANDS GOVT 1.75	500,000.00	555,660.00	
NETHERLANDS GOVT 2	400,000.00	454,180.00	
NETHERLANDS GOVT 2.25	500,000.00	564,160.00	
NETHERLANDS GOVT 2.5	200,000.00	249,482.00	
NETHERLANDS GOVT 2.75	400,000.00	555,620.00	
NETHERLANDS GOVT 3.25	600,000.00	692,682.00	
NETHERLANDS GOVT 3.5	800,000.00	904,432.00	
NETHERLANDS GOVT 3.75	300,000.00	367,056.00	

NETHERLANDS GOVT 3.75	700,000.00	1,106,469.00	
NETHERLANDS GOVT 4	800,000.00	845,720.00	
NETHERLANDS GOVT 4	500,000.00	551,615.00	
NETHERLANDS GOVT 4	500,000.00	776,645.00	
NETHERLANDS GOVT 5.5	400,000.00	605,800.00	
REP OF AUSTRIA 0.25	200,000.00	203,850.00	
REP OF AUSTRIA 0.75	500,000.00	509,075.00	
REP OF AUSTRIA 1.15	200,000.00	205,176.00	
REP OF AUSTRIA 1.2	200,000.00	213,616.00	
REP OF AUSTRIA 1.65	200,000.00	220,850.00	
REP OF AUSTRIA 1.75	200,000.00	222,064.00	
REP OF AUSTRIA 1.95	200,000.00	210,692.00	
REP OF AUSTRIA 2.4	200,000.00	242,752.00	
REP OF AUSTRIA 3.15	200,000.00	279,510.00	
REP OF AUSTRIA 3.4	200,000.00	238,942.00	
REP OF AUSTRIA 3.5	1,000,000.00	1,166,600.00	
REP OF AUSTRIA 3.65	400,000.00	476,492.00	
REP OF AUSTRIA 3.8	100,000.00	168,529.00	
REP OF AUSTRIA 3.9	300,000.00	342,018.00	
REP OF AUSTRIA 4.15	600,000.00	918,018.00	
REP OF AUSTRIA 4.35	400,000.00	437,076.00	
REP OF AUSTRIA 4.85	500,000.00	695,590.00	
REP OF AUSTRIA 6.25	200,000.00	314,362.00	
SPANISH GOV'T 0.25	500,000.00	502,715.00	
SPANISH GOV'T 0.25	400,000.00	403,236.00	
SPANISH GOV'T 0.4	300,000.00	299,313.00	
SPANISH GOV'T 0.75	500,000.00	512,125.00	
SPANISH GOV'T 1.15	700,000.00	727,531.00	
SPANISH GOV'T 1.3	600,000.00	587,328.00	
SPANISH GOV'T 1.4	500,000.00	521,365.00	
SPANISH GOV'T 1.5	500,000.00	492,735.00	
SPANISH GOV'T 1.6	600,000.00	613,932.00	
SPANISH GOV'T 1.95	600,000.00	622,536.00	
SPANISH GOV'T 1.95	900,000.00	887,508.00	
SPANISH GOV'T 2.15	500,000.00	528,810.00	

	SPANISH GOV'T 2.75	1,000,000.00	1,060,230.00	
	SPANISH GOV'T 2.75	700,000.00	778,316.00	
	SPANISH GOV'T 2.9	400,000.00	398,140.00	
	SPANISH GOV'T 3.45	200,000.00	207,758.00	
	SPANISH GOV'T 3.75	1,000,000.00	1,061,940.00	
	SPANISH GOV'T 3.8	600,000.00	711,858.00	
	SPANISH GOV'T 4	700,000.00	785,701.00	
	SPANISH GOV'T 4.1	800,000.00	843,880.00	
	SPANISH GOV'T 4.2	670,000.00	842,163.20	
	SPANISH GOV'T 4.3	700,000.00	778,225.00	
	SPANISH GOV'T 4.4	800,000.00	978,608.00	
	SPANISH GOV'T 4.6	700,000.00	775,936.00	
	SPANISH GOV'T 4.65	1,000,000.00	1,255,990.00	
	SPANISH GOV'T 4.7	600,000.00	808,842.00	
	SPANISH GOV'T 4.8	500,000.00	625,995.00	
	SPANISH GOV'T 4.85	500,000.00	585,035.00	
	SPANISH GOV'T 4.9	400,000.00	551,364.00	
	SPANISH GOV'T 5.15	700,000.00	939,211.00	
	SPANISH GOV'T 5.15	400,000.00	573,104.00	
	SPANISH GOV'T 5.4	1,000,000.00	1,268,450.00	
	SPANISH GOV'T 5.5	700,000.00	851,480.00	
	SPANISH GOV'T 5.75	500,000.00	730,575.00	
	SPANISH GOV'T 5.85	1,100,000.00	1,385,868.00	
	SPANISH GOV'T 5.9	900,000.00	1,238,634.00	
	SPANISH GOV'T 6	700,000.00	1,004,528.00	
	ユーロ 小計	168,480,000.00	195,500,003.10 (23,804,080,377)	
英ポンド	UK TSY GILT 0.5	500,000.00	499,300.00	
	UK TSY GILT 1.25	900,000.00	913,185.00	
	UK TSY GILT 1.5	900,000.00	940,635.00	
	UK TSY GILT 1.5	900,000.00	938,133.00	
	UK TSY GILT 1.5	800,000.00	761,208.00	
	UK TSY GILT 1.75	1,000,000.00	1,035,900.00	
	UK TSY GILT 1.75	700,000.00	746,830.00	
	UK TSY GILT 1.75	300,000.00	301,440.00	

	UK TSY GILT 1.75	300,000.00	313,980.00	
	UK TSY GILT 2	700,000.00	740,187.00	
	UK TSY GILT 2	600,000.00	653,814.00	
	UK TSY GILT 2.25	900,000.00	991,197.00	
	UK TSY GILT 2.5	200,000.00	263,360.00	
	UK TSY GILT 2.75	500,000.00	571,280.00	
	UK TSY GILT 3.25	800,000.00	1,054,464.00	
	UK TSY GILT 3.5	1,000,000.00	1,382,135.00	
	UK TSY GILT 3.5	500,000.00	836,100.00	
	UK TSY GILT 3.75	400,000.00	434,536.00	
	UK TSY GILT 3.75	500,000.00	560,500.00	
	UK TSY GILT 3.75	400,000.00	458,320.00	
	UK TSY GILT 3.75	900,000.00	1,399,050.00	
	UK TSY GILT 4	500,000.00	587,620.00	
	UK TSY GILT 4	400,000.00	701,824.00	
	UK TSY GILT 4.25	600,000.00	789,241.80	
	UK TSY GILT 4.25	600,000.00	826,548.00	
	UK TSY GILT 4.25	900,000.00	1,280,529.00	
	UK TSY GILT 4.25	600,000.00	881,424.00	
	UK TSY GILT 4.25	500,000.00	739,800.00	
	UK TSY GILT 4.25	400,000.00	633,676.00	
	UK TSY GILT 4.25	300,000.00	493,422.00	
	UK TSY GILT 4.25	400,000.00	705,520.00	
	UK TSY GILT 4.5	900,000.00	974,268.00	
	UK TSY GILT 4.5	600,000.00	866,220.00	
	UK TSY GILT 4.5	700,000.00	1,100,382.50	
	UK TSY GILT 4.75	600,000.00	679,428.00	
	UK TSY GILT 4.75	400,000.00	566,920.00	
	UK TSY GILT 4.75	600,000.00	932,010.00	
	UK TSY GILT 5	500,000.00	660,635.00	
	UK TSY GILT 6	200,000.00	306,290.00	
	UK TSY GILT 8	600,000.00	791,634.00	
	英債券 小計	24,000,000.00	30,312,946.30 (4,331,113,767)	
スイスフラン	SWISS (GOVT) 2	300,000.00	332,790.00	
	SWISS (GOVT) 3	200,000.00	216,060.00	

	SWISS (GOVT) 4	100,000.00	126,410.00	
	SWISS (GOVT) 4	200,000.00	290,260.00	
スイスフラン 小計		800,000.00	965,520.00	(108,244,447)
スウェーデンクローナ	SWEDISH GOVRNMNT 1	2,500,000.00	2,581,850.00	
	SWEDISH GOVRNMNT 1.5	2,500,000.00	2,707,175.00	
	SWEDISH GOVRNMNT 2.5	1,500,000.00	1,744,395.00	
	SWEDISH GOVRNMNT 3.5	3,000,000.00	3,538,470.00	
	SWEDISH GOVRNMNT 3.5	1,600,000.00	2,154,880.00	
	SWEDISH GOVRNMNT 4.25	4,000,000.00	4,369,800.00	
	SWEDISH GOVRNMNT 5	3,000,000.00	3,577,500.00	
スウェーデンクローナ 小計		18,100,000.00	20,674,070.00	(262,974,170)
ノルウェークローネ	NORWEGIAN GOV'T 1.5	1,000,000.00	996,900.00	
	NORWEGIAN GOV'T 1.75	1,000,000.00	1,020,800.00	
	NORWEGIAN GOV'T 2	3,000,000.00	3,131,400.00	
	NORWEGIAN GOV'T 3	2,000,000.00	2,215,800.00	
	NORWEGIAN GOV'T 3.75	3,000,000.00	3,328,500.00	
	NORWEGIAN GOV'T 4.5	2,000,000.00	2,158,000.00	
ノルウェークローネ 小計		12,000,000.00	12,851,400.00	(167,196,714)
デンマーククローネ	DENMARK - BULLET 0.25	800,000.00	810,480.00	
	DENMARK - BULLET 1.5	2,000,000.00	2,185,600.00	
	DENMARK - BULLET 1.75	3,000,000.00	3,358,680.00	
	DENMARK - BULLET 3	2,300,000.00	2,638,951.00	
	DENMARK - BULLET 4	1,500,000.00	1,537,590.00	
	DENMARK - BULLET 4	2,000,000.00	2,230,000.00	
	DENMARK - BULLET 4.5	5,000,000.00	8,395,500.00	
	DENMARK - BULLET 7	820,000.00	1,240,332.00	
デンマーククローネ 小計		17,420,000.00	22,397,133.00	(366,417,095)
ポーランドズロチ	POLAND GOVT BOND	600,000.00	583,680.00	
	POLAND GOVT BOND 1.5	2,000,000.00	1,955,000.00	
	POLAND GOVT BOND 1.75	1,000,000.00	961,600.00	
	POLAND GOVT BOND 2	2,000,000.00	1,954,000.00	

	POLAND GOVT BOND 2.5	1,700,000.00	1,711,900.00	
	POLAND GOVT BOND 2.5	900,000.00	841,860.00	
	POLAND GOVT BOND 2.5	1,000,000.00	917,800.00	
	POLAND GOVT BOND 3.25	900,000.00	901,800.00	
	POLAND GOVT BOND 4	1,200,000.00	1,263,720.00	
	POLAND GOVT BOND 5.5	1,400,000.00	1,511,440.00	
	POLAND GOVT BOND 5.75	600,000.00	676,620.00	
	POLAND GOVT BOND 5.75	900,000.00	1,025,955.00	
	POLAND GOVT BOND 5.75	300,000.00	367,275.00	
	ポーランドズロチ 小計	14,500,000.00	14,672,650.00 (423,305,952)	
オーストラリアドル	AUSTRALIAN GOVT. 1.75	800,000.00	794,840.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 2	600,000.00	597,840.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 2.25	500,000.00	478,200.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 2.75	500,000.00	512,175.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 2.75	900,000.00	921,996.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 2.75	700,000.00	705,390.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 2.75	500,000.00	500,981.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 2.75	400,000.00	376,160.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 3	300,000.00	269,847.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 3.25	500,000.00	511,705.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 3.25	700,000.00	739,340.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 3.25	400,000.00	419,520.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 3.25	200,000.00	196,760.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 3.75	200,000.00	214,000.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 4.25	1,200,000.00	1,363,680.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 4.5	700,000.00	754,079.20	
	AUSTRALIAN GOVT. 4.5	300,000.00	355,890.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 4.75	1,100,000.00	1,307,020.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 5.25	900,000.00	959,581.80	
	AUSTRALIAN GOVT. 5.5	900,000.00	1,062,315.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 5.75	1,000,000.00	1,145,200.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 5.75	900,000.00	1,059,075.00	
	オーストラリアドル 小計	14,200,000.00	15,245,595.00 (1,280,629,980)	
シンガポールドル	SINGAPORE GOV'T 1.25	500,000.00	493,350.00	

	SINGAPORE GOV'T 1.625	500,000.00	504,000.00	
	SINGAPORE GOV'T 2	600,000.00	611,100.00	
	SINGAPORE GOV'T 2.125	300,000.00	301,650.00	
	SINGAPORE GOV'T 2.25	300,000.00	307,920.00	
	SINGAPORE GOV'T 2.5	200,000.00	205,329.00	
	SINGAPORE GOV'T 2.75	300,000.00	315,300.00	
	SINGAPORE GOV'T 2.75	200,000.00	213,600.00	
	SINGAPORE GOV'T 2.875	500,000.00	534,250.00	
	SINGAPORE GOV'T 2.875	400,000.00	427,372.00	
	SINGAPORE GOV'T 3	500,000.00	534,500.00	
	SINGAPORE GOV'T 3.125	200,000.00	214,040.00	
	SINGAPORE GOV'T 3.25	200,000.00	211,940.00	
	SINGAPORE GOV'T 3.375	200,000.00	227,800.00	
	SINGAPORE GOV'T 3.5	600,000.00	672,663.00	
	SINGAPORE GOV'T 4	300,000.00	311,670.00	
	シンガポールドル 小計	5,800,000.00	6,086,484.00 (486,492,666)	
南アフリカランド	REP SOUTH AFRICA 6.5	21,000,000.00	14,958,300.00	
	REP SOUTH AFRICA 7	14,000,000.00	11,639,600.00	
	REP SOUTH AFRICA 7.75	8,000,000.00	7,865,600.00	
	REP SOUTH AFRICA 8	5,000,000.00	5,039,650.00	
	南アフリカランド 小計	48,000,000.00	39,503,150.00 (336,961,869)	
	合計		59,784,087,499 (59,784,087,499)	

(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 231銘柄	43.8%	44.2%
カナダドル	国債証券 28銘柄	2.0%	2.1%
メキシコペソ	国債証券 15銘柄	0.9%	0.9%
ユーロ	国債証券 279銘柄	39.5%	39.8%
英ポンド	国債証券 40銘柄	7.2%	7.2%
スイスフラン	国債証券 4銘柄	0.2%	0.2%

スウェーデンクローナ	国債証券	7銘柄	0.4%	0.4%
ノルウェークローネ	国債証券	6銘柄	0.3%	0.3%
デンマーククローネ	国債証券	8銘柄	0.6%	0.6%
ポーランドズロチ	国債証券	13銘柄	0.7%	0.7%
オーストラリアドル	国債証券	22銘柄	2.1%	2.1%
シンガポールドル	国債証券	16銘柄	0.8%	0.8%
南アフリカランド	国債証券	4銘柄	0.6%	0.6%

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「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。

バンガード・米ドル建て新興国政府債券ETFは、米国籍の上場外国投資信託で、現地での監査を受けております。

なお、以下の財務諸表は、入手しうる直近の現地監査済み財務諸表を委託会社において抜粋して翻訳したものです。

バンガード・米ドル建て新興国政府債券ETF

（純資産計算書）

区分	2016年10月31日現在
	金額（千米ドル）
債券	-
短期金融資産	-
投資総額	-
その他資産及び負債	-
純資産額	873,634

（1口当たり情報）

（2016年10月31日現在）	
1口当たり純資産額	
（一般投資家クラス） 80.11米ドル	

iシェアーズ J.P.モルガン・米ドル建てエマージング・マーケット債券ETFは、米国籍の上場外国投資信託で、現地での監査を受けております。

なお、以下の財務諸表は、入手しうる直近の現地監査済み財務諸表を委託会社において抜粋して翻訳したものです。

iシェアーズ J.P.モルガン・米ドル建てエマージング・マーケット債券ETF

(純資産計算書)

区分	2016年10月31日現在
	金額(千米ドル)
債券	9,435,708
短期金融資産	27,984
投資総額	9,463,693
その他資産及び負債	185,603
純資産額	9,649,296

(1口当たり情報)

(2016年10月31日現在)
1口当たり純資産額 (一般投資家クラス) 114.74米ドル

S P D R ブルームバーグ・バークレイズ・ハイ・イールド債券 E T F は、米国籍の上場外国投資信託で、現地での監査を受けております。

なお、以下の財務諸表は、入手しうる直近の現地監査済み財務諸表を委託会社において抜粋して翻訳したものです。

S P D R ブルームバーグ・バークレイズ・ハイ・イールド債券 E T F

(純資産計算書)

区分	2016年6月30日現在
	金額(千米ドル)
債券	10,954,600
短期金融資産	927,827
投資総額	11,882,427
その他資産及び負債	644,146
純資産額	11,238,281

(1口当たり情報)

(2016年6月30日現在)
1口当たり純資産額 (一般投資家クラス) 35.28米ドル

【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 4月27日から平成29年10月26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。

【アセットアロケーション・ファンド（安定型）】

（１）【中間貸借対照表】

（単位：円）

第3期中間計算期間
（平成29年10月26日現在）

資産の部	
流動資産	
預金	182,009
コール・ローン	973,459,168
投資信託受益証券	5,676,114,384
親投資信託受益証券	33,156,981,171
派生商品評価勘定	107,892
未収入金	304,000,000
流動資産合計	40,110,844,624
資産合計	40,110,844,624
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	42,568,622
未払金	245,000,000
未払解約金	80,649,166
未払受託者報酬	6,992,341
未払委託者報酬	209,770,143
未払利息	2,672
その他未払費用	1,423,868
流動負債合計	586,406,812
負債合計	586,406,812
純資産の部	
元本等	
元本	39,065,141,116
剰余金	
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	459,296,696
元本等合計	39,524,437,812
純資産合計	39,524,437,812
負債純資産合計	40,110,844,624

（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 4月27日 至 平成29年10月26日
営業収益	
受取配当金	143,250,350
有価証券売買等損益	674,837,190
為替差損益	26,431,061
営業収益合計	791,656,479
営業費用	
支払利息	434,421
受託者報酬	6,992,341
委託者報酬	209,770,143
その他費用	2,004,952
営業費用合計	219,201,857
営業利益又は営業損失（ ）	572,454,622
経常利益又は経常損失（ ）	572,454,622
中間純利益又は中間純損失（ ）	572,454,622
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（ ）	98,504,476
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	41,180,212
剰余金増加額又は欠損金減少額	26,526,762
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	8,308,666
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	18,218,096
剰余金減少額又は欠損金増加額	-
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-
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（ ）	459,296,696

(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 4月27日 至 平成29年10月26日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資信託受益証券、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. 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. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金の計上基準</p> <p>受取配当金は原則として、配当落ち日において、確定配当金額または予想配当金額を計上しております。なお、配当金額が未確定の場合は、入金日基準で計上しております。</p>
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建資産等の会計処理</p> <p>「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。</p>

(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10月26日現在)
1. 当中間計算期間の末日における受益権の総数	39,065,141,116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 (10,000口当たりの純資産額 10,118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10月26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（投資信託受益証券、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）

第3期中間計算期間（平成29年10月26日現在）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

（単位：円）

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	88,950,657	-	89,058,250	107,593
	米ドル	88,950,657	-	89,058,250	107,593
	売建	5,305,578,127	-	5,348,146,450	42,568,323
	米ドル	5,305,578,127	-	5,348,146,450	42,568,323
	合計	5,394,528,784	-	5,437,204,700	42,460,730

（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) 中間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。

中間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。

中間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。

- ・ 中間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。
- ・ 中間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)中間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、中間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)

項 目	第3期中間計算期間 (平成29年10月26日現在)
期首元本額	48,593,117,939円
期中追加設定元本額	1,842,201,760円
期中一部解約元本額	11,370,178,583円

【アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）】

（１）【中間貸借対照表】

（単位：円）

第3期中間計算期間
（平成29年10月26日現在）

資産の部	
流動資産	
預金	699,486
コール・ローン	595,939,900
投資信託受益証券	6,243,887,792
親投資信託受益証券	19,963,474,274
派生商品評価勘定	135,420
未収入金	363,000,000
流動資産合計	27,167,136,872
資産合計	
27,167,136,872	
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	48,032,666
未払金	190,000,000
未払解約金	86,700,780
未払受託者報酬	4,685,473
未払委託者報酬	140,564,192
未払利息	1,635
その他未払費用	955,639
流動負債合計	470,940,385
負債合計	
470,940,385	
純資産の部	
元本等	
元本	25,777,047,284
剰余金	
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	919,149,203
元本等合計	26,696,196,487
純資産合計	
26,696,196,487	
負債純資産合計	
27,167,136,872	

（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 4月27日 至 平成29年10月26日
営業収益	
受取配当金	155,127,675
有価証券売買等損益	929,796,183
為替差損益	29,253,458
営業収益合計	1,055,670,400
営業費用	
支払利息	303,643
受託者報酬	4,685,473
委託者報酬	140,564,192
その他費用	1,601,268
営業費用合計	147,154,576
営業利益又は営業損失（ ）	908,515,824
経常利益又は経常損失（ ）	908,515,824
中間純利益又は中間純損失（ ）	908,515,824
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（ ）	115,149,388
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	129,607,135
剰余金増加額又は欠損金減少額	27,743,431
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	27,743,431
剰余金減少額又は欠損金増加額	31,567,799
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	31,567,799
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（ ）	919,149,203

(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 4月27日 至 平成29年10月26日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資信託受益証券、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. 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. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金の計上基準</p> <p>受取配当金は原則として、配当落ち日において、確定配当金額または予想配当金額を計上しております。なお、配当金額が未確定の場合は、入金日基準で計上しております。</p>
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建資産等の会計処理</p> <p>「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。</p>

(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10月26日現在)
1. 当中間計算期間の末日における受益権の総数	25,777,047,284口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.0357円 (10,000口当たりの純資産額 10,357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10月26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ぬ。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券（投資信託受益証券、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）

第3期中間計算期間（平成29年10月26日現在）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

（単位：円）

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	101,969,870	-	102,105,000	135,130
	米ドル	101,969,870	-	102,105,000	135,130
	売建	5,986,600,024	-	6,034,632,400	48,032,376
	米ドル	5,986,600,024	-	6,034,632,400	48,032,376
	合計	6,088,569,894	-	6,136,737,400	47,897,246

（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) 中間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せん。

中間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。

中間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。

- ・ 中間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。
- ・ 中間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)中間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、中間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)

項 目	第3期中間計算期間 (平成29年10月26日現在)
期首元本額	32,112,350,663円
期中追加設定元本額	1,147,632,282円
期中一部解約元本額	7,482,935,661円

【アセットアロケーション・ファンド（成長型）】

（１）【中間貸借対照表】

（単位：円）

第3期中間計算期間
（平成29年10月26日現在）

資産の部	
流動資産	
預金	549,924
コール・ローン	470,401,838
投資信託受益証券	6,064,382,882
親投資信託受益証券	14,192,008,209
派生商品評価勘定	80,364
未収入金	380,000,000
流動資産合計	21,107,423,217
資産合計	21,107,423,217
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	47,188,801
未払金	185,000,000
未払解約金	71,450,209
未払受託者報酬	3,702,368
未払委託者報酬	111,070,939
未払利息	1,291
その他未払費用	754,922
流動負債合計	419,168,530
負債合計	419,168,530
純資産の部	
元本等	
元本	19,731,645,736
剰余金	
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	956,608,951
元本等合計	20,688,254,687
純資産合計	20,688,254,687
負債純資産合計	21,107,423,217

（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 4月27日 至 平成29年10月26日
営業収益	
受取配当金	154,439,992
有価証券売買等損益	930,686,883
為替差損益	33,866,457
営業収益合計	1,051,260,418
営業費用	
支払利息	246,555
受託者報酬	3,702,368
委託者報酬	111,070,939
その他費用	1,442,179
営業費用合計	116,462,041
営業利益又は営業損失（ ）	934,798,377
経常利益又は経常損失（ ）	934,798,377
中間純利益又は中間純損失（ ）	934,798,377
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（ ）	146,805,131
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	184,663,393
剰余金増加額又は欠損金減少額	47,461,300
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	47,461,300
剰余金減少額又は欠損金増加額	63,508,988
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	63,508,988
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（ ）	956,608,951

(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 4月27日 至 平成29年10月26日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資信託受益証券、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. 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. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金の計上基準</p> <p>受取配当金は原則として、配当落ち日において、確定配当金額または予想配当金額を計上しております。なお、配当金額が未確定の場合は、入金日基準で計上しております。</p>
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建資産等の会計処理</p> <p>「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。</p>

(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10月26日現在)
1. 当中間計算期間の末日における受益権の総数	19,731,645,736口
2. 1単位当たり純資産の額	1.0485円
	(10,000口当たりの純資産額 10,485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10月26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はありません。	
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券（投資信託受益証券、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）

第3期中間計算期間（平成29年10月26日現在）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

（単位：円）

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	110,448,711	-	110,386,850	61,861
	米ドル	110,448,711	-	110,386,850	61,861
	売建	5,849,857,524	-	5,896,904,100	47,046,576
	米ドル	5,849,857,524	-	5,896,904,100	47,046,576
	合計	5,960,306,235	-	6,007,290,950	47,108,437

（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) 中間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。

中間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。

中間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。

- ・ 中間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。
- ・ 中間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)中間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、中間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）

項目	第3期中間計算期間 (平成29年10月26日現在)
期首元本額	26,858,575,783円
期中追加設定元本額	1,562,362,836円
期中一部解約元本額	8,689,292,883円

（参考）

「アセットアロケーション・ファンド（安定型）」、「アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）」および「アセットアロケーション・ファンド（成長型）」は、「国内株式インデックス・マザーファンド（B号）」、「外国株式インデックス・マザーファンド」、「エマージング株式インデックス・マザーファンド」、「リート・インデックス・マザーファンド」、「外国リート・インデックス・マザーファンド」、「国内債券パッシブ・マザーファンド」、「外国債券パッシブ・マザーファンド」、「ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド」、「バンガード・米ドル建て新興国政府債券ETF」、「iシェアーズ J.P.モルガン・米ドル建てエマージング・マーケット債券ETF」および「SPDR ブルームバーグ・バークレイズ・ハイ・イールド債券ETF」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」および「投資信託受益証券」はこれらの親投資信託および投資信託の受益証券です。

なお、以下に記載した状況は、監査の対象外です。

国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

貸借対照表

（単位：円）

（平成29年10月26日現在）

資産の部

流動資産

コール・ローン	2,266,881,137
株式	192,863,619,510
派生商品評価勘定	24,227,840
未収入金	26,629,800
未収配当金	1,504,720,376
流動資産合計	196,686,078,663

資産合計

196,686,078,663

負債の部

流動負債

前受金	24,230,000
未払金	22,815,000
未払解約金	1,189,714,960
未払利息	6,223
その他未払費用	54,853
流動負債合計	1,236,821,036

負債合計

1,236,821,036

純資産の部

元本等

元本	73,324,932,087
剰余金	

(平成29年10月26日現在)

剰余金又は欠損金（ ）	122,124,325,540
元本等合計	195,449,257,627
純資産合計	195,449,257,627
負債純資産合計	196,686,078,663

注記表

(重要な会計方針の注記)

項目	自平成29年4月27日 至平成29年10月26日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>先物取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場によっております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金の計上基準</p> <p>受取配当金は原則として、配当落ち日において、確定配当金額または予想配当金額を計上しております。なお、配当金額が未確定の場合は、入金日基準で計上しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

項目	(平成29年10月26日現在)
1. 担保資産	<p>代用として、担保に供している資産は次の通りであります。</p> <p>株式 3,516,000,000円</p>
2. 当計算期間の末日における受益権の総数	73,324,932,087口
3. 1単位当たり純資産の額	<p>1口当たり純資産額 2.6655円</p> <p>(10,000口当たりの純資産額 26,655円)</p>

(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10月26日現在)
1.貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1) 有価証券（株式） 「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10月26日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	1,627,352,160	-	1,651,580,000	24,227,840
	東証株価指数先物	1,627,352,160	-	1,651,580,000	24,227,840
	合計	1,627,352,160	-	1,651,580,000	24,227,840

(注) 1.時価の算定方法

(1)株価指数先物取引の時価の算定方法について

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

2)株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

2.ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

(その他の注記)

(平成29年10月26日現在)	
開示対象ファンドの 期首における当該親投資信託の元本額	88,558,263,766円

同期中における追加設定元本額	3,042,066,256円
同期中における一部解約元本額	18,275,397,935円
平成29年10月26日現在における元本の内訳	
三井住友・日本株式インデックス年金ファンド	9,624,816,949円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	597,671,550円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	2,936,063,520円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	2,128,461,608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)	128,760,560円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2020(4資産タイプ)	7,635,446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)	21,737,956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)	56,321,929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)	60,699,029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)	34,271,398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)	91,755,769円
国内株式指数ファンド(T O P I X)	1,227,885,749円
三井住友・DCつみたてN I S A・日本株インデックスファンド	3,174,831,148円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	557,383,094円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	897,213,911円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	942,681,578円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2050	3,695,480円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	50,704円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	321,221円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	1,629,468円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	3,164,418円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	4,585,702円
三井住友・DCつみたてN I S A・世界分散ファンド	422,445円
S M A M・国内株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	8,770,758,148円
バランスファンドV A(安定運用型) <適格機関投資家限定>	33,370,471円
S M A M・バランスファンドV A安定成長型 <適格機関投資家限定>	3,987,208,512円
S M A M・バランスファンドV A 2 5 <適格機関投資家専用>	4,444,858,787円
S M A M・バランスファンドV A 3 7 . 5 <適格機関投資家専用>	2,867,942,525円
S M A M・バランスファンドV A 5 0 <適格機関投資家専用>	10,488,601,611円
S M A M・バランスファンドV L 3 0 <適格機関投資家限定>	60,501,621円
S M A M・バランスファンドV L 5 0 <適格機関投資家限定>	255,821,698円
世界6資産バランスファンドV A <適格機関投資家限定>	4,606,962円
S M A M・バランスファンドV A 7 5 <適格機関投資家専用>	1,137,710,175円
S M A M・バランスファンドV L国際分散型 <適格機関投資家限定>	68,761,675円
S M A M・インデックス・バランスV A 2 5 <適格機関投資家専用>	436,037,553円
S M A M・インデックス・バランスV A 5 0 <適格機関投資家専用>	1,225,607,195円
S M A M・バランスファンドV A 4 0 <適格機関投資家専用>	1,608,193,095円
S M A M・バランスファンドV A 3 5 <適格機関投資家専用>	3,656,059,304円
S M A M・バランスV A株40T <適格機関投資家限定>	93,822,777円
三井住友・5資産バランスファンド・V A S(適格機関投資家専用)	1,607,714,395円
S M A M・グローバルバランス40V A <適格機関投資家限定>	79,872,680円
S M A M・バランスファンドV A 2 0 <適格機関投資家専用>	125,149,233円
三井住友・7資産バランスファンド・V A S(適格機関投資家専用)	1,888,179,875円
S M A M・アセットバランスファンドV A 2 0 A <適格機関投資家専用>	121,540,038円
S M A M・アセットバランスファンドV A 3 5 A <適格機関投資家専用>	56,246,044円

S M A M ・ アセットバランスファンドV A 5 0 A < 適格機関投資家専用 >	25,301,876円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 2 0 L < 適格機関投資家専用 >	239,527,878円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 2 5 L < 適格機関投資家専用 >	428,958,089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 >	183,319,068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 >	124,191,748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 >	63,775,461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 >	11,280,700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 >	83,136,550円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 2 5 L 2 < 適格機関投資家専用 >	1,083,893,238円
S M A M ・ 国内株式インデックスファンド・ V A (適格機関投資家専用)	215,992,147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 >	21,310,839円
S M A M ・ グローバルバランスファンド(標準型) V A < 適格機関投資家限定 >	2,019,625,759円
S M A M ・ グローバルバランスファンド(債券重視型) V A < 適格機関投資家限定 >	314,354,344円
S M A M ・ 世界バランスファンドV A < 適格機関投資家限定 >	1,992,564,713円
S M A M ・ 世界バランスファンドV A 2 < 適格機関投資家限定 >	558,322,797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 >	277,973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 >	185,539,807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 >	88,821,775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 >	164,112,319円
合計	73,324,932,087円

外国株式インデックス・マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

(平成29年10月26日現在)

資産の部

流動資産

預金	1,043,083,483
コール・ローン	460,090,912
株式	189,574,763,365
投資証券	4,590,515,475
派生商品評価勘定	48,862,052
未収配当金	177,038,857
差入委託証拠金	2,048,360,583
流動資産合計	197,942,714,727

資産合計

197,942,714,727

負債の部

流動負債

派生商品評価勘定	476,465
前受金	46,823,618
未払解約金	869,342,871
未払利息	1,263
その他未払費用	11,207
流動負債合計	916,655,424

負債合計

916,655,424

純資産の部

元本等

元本	58,754,443,486
剰余金	

(平成29年10月26日現在)

剰余金又は欠損金（ ）	138,271,615,817
元本等合計	197,026,059,303
純資産合計	197,026,059,303
負債純資産合計	197,942,714,727

注記表

(重要な会計方針の注記)

項目	自平成29年4月27日 至平成29年10月26日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式、投資証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1) 先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場によっております。</p> <p>(2) 為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金の計上基準 受取配当金は原則として、配当落ち日において、確定配当金額または予想配当金額を計上しております。なお、配当金額が未確定の場合は、入金日基準で計上しております。</p>
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建資産等の会計処理 「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

項目	(平成29年10月26日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	58,754,443,486口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 3.3534円

(10,000口当たりの純資産額

33,534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10月26日現在)
1.貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1) 有価証券(株式、投資証券) 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定(デリバティブ取引) デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(デリバティブ取引に関する注記)

(平成29年10月26日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	2,804,816,573	-	2,851,640,191	46,823,618
	SPMINI 1712	1,925,768,160	-	1,961,339,703	35,571,543
	DJ EUR 1712	544,698,680	-	547,656,228	2,957,548
	FTSE 1712	198,041,136	-	201,004,977	2,963,841
	SPI200 1712	136,308,597	-	141,639,283	5,330,686
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	529,625,169	-	528,063,200	1,561,969
	米ドル	455,644,000	-	454,238,000	1,406,000
	カナダドル	17,067,320	-	16,858,700	208,620
	ユーロ	8,037,560	-	8,051,400	13,840
	英ポンド	14,959,443	-	15,063,000	103,557
	スイスフラン	13,789,164	-	13,771,200	17,964

スウェーデンク ローナ	4,981,428	-	4,978,800	2,628
ノルウェークロー ネ	1,137,224	-	1,132,800	4,424
デンマーククロー ネ	3,237,768	-	3,245,400	7,632
オーストラリアドル	2,644,650	-	2,623,500	21,150
香港ドル	6,132,210	-	6,106,800	25,410
シンガポールドル	1,670,602	-	1,670,000	602
イスラエルシケ ル	323,800	-	323,600	200
合計	3,334,441,742	-	3,379,703,391	48,385,587

(注) 1. 時価の算定方法

(1) 株価指数先物取引の時価の算定方法について

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

2) 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

(2) 為替予約取引の時価の算定方法について

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

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

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

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

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

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

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

(その他の注記)

(平成29年10月26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	67,999,201,436円
同期中における追加設定元本額	2,385,530,677円
同期中における一部解約元本額	11,630,288,627円

平成29年10月26日現在における元本の内訳	
三井住友・DC外国株式インデックスファンドS	11,213,563,211円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	235,386,539円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	989,147,993円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	670,264,051円
SMAM・グローバルバランスファンド(機動的資産配分型)	50,433,839円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2020(4資産タイプ)	2,915,191円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2025(4資産タイプ)	8,257,320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)	24,251,129円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2035(4資産タイプ)	32,349,355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)	19,473,295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)	54,037,227円
外国株式指数ファンド	429,624,092円
三井住友・DCつみたてNISA・全海外株インデックスファンド	1,504,600,052円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	478,963,326円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	532,443,645円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	499,446,846円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2050	2,412,784円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	39,209円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	253,419円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	1,276,848円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	2,494,600円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	3,592,527円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	674,643円
SMAM・外国株式バッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	3,567,033,168円
バランスファンドVA(安定運用型)<適格機関投資家限定>	12,913,067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>	1,571,232,712円
SMAM・バランスファンドVA25<適格機関投資家専用>	2,326,431,464円
SMAM・バランスファンドVA37.5<適格機関投資家専用>	1,970,723,990円
SMAM・バランスファンドVA50<適格機関投資家専用>	8,237,132,835円
SMAM・バランスファンドVL30<適格機関投資家限定>	23,772,348円
SMAM・バランスファンドVL50<適格機関投資家限定>	133,780,501円
世界6資産バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	2,683,096円
SMAM・バランスファンドVA75<適格機関投資家専用>	1,018,669,711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>	80,028,137円
SMAM・インデックス・バランスVA25<適格機関投資家専用>	225,022,348円
SMAM・インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用>	945,362,865円
SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用>	1,259,842,881円
SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>	2,158,440,470円
SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定>	72,475,113円
三井住友・外国株式インデックスファンド・VAS(適格機関投資家専用)	953,618,934円
三井住友・5資産バランスファンド・VAS(適格機関投資家専用)	1,259,634,109円
SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	185,777,905円
SMAM・バランスファンドVA20<適格機関投資家専用>	97,876,198円
三井住友・7資産バランスファンド・VAS(適格機関投資家専用)	1,479,441,427円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>	31,159,210円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>	17,426,511円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用>	8,407,404円

S M A M ・ アセットバランスファンドV A 2 0 L < 適格機関投資家専用 >	62,508,305円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 2 5 L < 適格機関投資家専用 >	146,143,163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 >	143,747,801円
S M A M ・ グローバルバランスファンド(標準型) V A < 適格機関投資家限定 >	1,584,891,049円
S M A M ・ グローバルバランスファンド(債券重視型) V A < 適格機関投資家限定 >	249,396,884円
S M A M ・ 世界バランスファンドV A < 適格機関投資家限定 >	8,252,008,039円
S M A M ・ 世界バランスファンドV A 2 < 適格機関投資家限定 >	1,406,172,737円
S M A M ・ 外国株式インデックスファンドS A < 適格機関投資家限定 >	2,253,291,786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 >	167,655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 >	110,584,265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 >	52,942,626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 >	97,801,631円
合計	58,754,443,486円

エマージング株式インデックス・マザーファンド

貸借対照表

(単位:円)

(平成29年10月26日現在)

資産の部

流動資産

預金	11,602,209
コール・ローン	282,698,486
国債証券	225,966,442
派生商品評価勘定	166,185,348
現先取引勘定	2,804,992,400
未収入金	120,000,000
差入委託証拠金	617,526,932
流動資産合計	4,228,971,817

資産合計

4,228,971,817

負債の部

流動負債

派生商品評価勘定	2,739,716
前受金	18,054,223
未払利息	776
その他未払費用	25,457
流動負債合計	20,820,172

負債合計

20,820,172

純資産の部

元本等

元本	2,943,397,896
剰余金	
剰余金又は欠損金()	1,264,753,749
元本等合計	4,208,151,645

純資産合計

4,208,151,645

負債純資産合計

4,228,971,817

注記表

(重要な会計方針の注記)

項目	自 平成29年 4月27日 至 平成29年10月26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>(1) 先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場によっております。</p> <p>(2) 為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。</p>
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建資産等の会計処理 「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

項目	(平成29年10月26日現在)
1. 担保資産	<p>代用として、担保に供している資産は次の通りであります。</p> <p style="text-align: right;">国債証券 225,966,442円</p>
2. 当計算期間の末日における受益権の総数	2,943,397,896口
3. 1単位当たり純資産の額	<p>1口当たり純資産額 1.4297円</p> <p>(10,000口当たりの純資産額 14,297円)</p>

(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10月26日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。

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

（デリバティブ取引に関する注記）

（平成29年10月26日現在）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

（単位：円）

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	4,203,440,347	-	4,221,494,570	18,054,223
	MSCIE 1712	4,203,440,347	-	4,221,494,570	18,054,223
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	3,281,000,000	-	3,427,744,601	146,744,601
	米ドル	3,281,000,000	-	3,427,744,601	146,744,601
	売建	73,000,000	-	74,353,192	1,353,192
	米ドル	73,000,000	-	74,353,192	1,353,192
	合計	7,557,440,347	-	7,723,592,363	163,445,632

（注）1.時価の算定方法

(1) 株価指数先物取引の時価の算定方法について

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

2) 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

(2) 為替予約取引の時価の算定方法について

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

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

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

- ・ 計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物相場が発表されている場合には、発表されている対顧客先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの対顧客先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いています。
 - ・ 計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い受渡日として、発表されている対顧客先物相場の仲値を用いています。
- 2) 計算期間末日において対顧客先物相場の仲値が発表されていない外貨については、計算期間末日の対顧客相場の仲値で評価しております。

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

(その他の注記)

(平成29年10月26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	7,131,406,613円
同期中における追加設定元本額	747,415,401円
同期中における一部解約元本額	4,935,424,118円
平成29年10月26日現在における元本の内訳	
三井住友・DCつみたてNISA・全海外株インデックスファンド	473,394,837円
三井住友・DC新興国株式インデックスファンド	793,355,588円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	173,974,761円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	754,713,634円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	735,923,234円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2050	2,900,019円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	30,556円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	127,283円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	848,085円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	2,250,028円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	4,628,353円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	775,850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>	475,668円
合計	2,943,397,896円

Jリート・インデックス・マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

(平成29年10月26日現在)

資産の部

流動資産

コール・ローン

77,594,978

投資証券

9,517,531,360

未収配当金

81,818,559

流動資産合計

9,676,944,897

資産合計

9,676,944,897

負債の部

流動負債

(平成29年10月26日現在)

未払解約金	19,000,000
未払利息	213
その他未払費用	1,154
流動負債合計	19,001,367
負債合計	19,001,367
純資産の部	
元本等	
元本	5,270,125,449
剰余金	
剰余金又は欠損金()	4,387,818,081
元本等合計	9,657,943,530
純資産合計	9,657,943,530
負債純資産合計	9,676,944,897

注記表

(重要な会計方針の注記)

項目	自平成29年4月27日 至平成29年10月26日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金の計上基準</p> <p>受取配当金は原則として、配当落ち日において、確定配当金額または予想配当金額を計上しております。なお、配当金額が未確定の場合は、入金日基準で計上しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

項目	(平成29年10月26日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	5,270,125,449口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.8326円 (10,000口当たりの純資産額 18,326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10月26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（投資証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

（平成29年10月26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	6,864,702,791円
同期中における追加設定元本額	750,181,496円
同期中における一部解約元本額	2,344,758,838円
平成29年10月26日現在における元本の内訳	
アセットアロケーション・ファンド（安定型）	105,784,324円
アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）	411,045,226円
アセットアロケーション・ファンド（成長型）	398,162,486円
三井住友・DC日本リートインデックスファンド	188,543,811円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2050	1,563,106円
三井住友・資産最適化ファンド（1安定重視型）	22,994円
三井住友・資産最適化ファンド（2やや安定型）	101,821円
三井住友・資産最適化ファンド（3バランス型）	443,413円
三井住友・資産最適化ファンド（4やや成長型）	872,029円
三井住友・資産最適化ファンド（5成長重視型）	845,744円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	302,803円

世界6資産バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	3,184,233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)	2,304,680,831円
三井住友・7資産バランスファンド・VAS(適格機関投資家専用)	1,291,707,219円
SMAM・年金WRリスクコントロールファンド<適格機関投資家限定>	371,281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>	238,035,739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>	113,924,486円
SMAM・マルチアセットストラテジー・オープン<適格機関投資家限定>	210,533,903円
合計	5,270,125,449円

外国リート・インデックス・マザーファンド

貸借対照表

(単位:円)

(平成29年10月26日現在)

資産の部	
流動資産	
預金	33,490,085
コール・ローン	6,448,048
投資証券	4,040,721,345
未収入金	17,430
未収配当金	4,626,711
流動資産合計	4,085,303,619
資産合計	4,085,303,619
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	1,410
未払利息	17
その他未払費用	291
流動負債合計	1,718
負債合計	1,718
純資産の部	
元本等	
元本	2,038,904,748
剰余金	
剰余金又は欠損金()	2,046,397,153
元本等合計	4,085,301,901
純資産合計	4,085,301,901
負債純資産合計	4,085,303,619

注記表

(重要な会計方針の注記)

項目	自平成29年4月27日 至平成29年10月26日
----	-----------------------------

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>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. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金の計上基準</p> <p>受取配当金は原則として、配当落ち日において、確定配当金額または予想配当金額を計上しております。なお、配当金額が未確定の場合は、入金日基準で計上しております。</p>
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建資産等の会計処理</p> <p>「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

項目	(平成29年10月26日現在)	
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	2,038,904,748口	
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額	2.0037円
	(10,000口当たりの純資産額)	20,037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10月26日現在)	
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。	

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

（デリバティブ取引に関する注記）

（平成29年10月26日現在）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

（単位：円）

区 分	種 類	契 約 額 等		時 価	評 価 損 益
			うち1年超		
市場取引以外の 取引	為替予約取引				
	買建	9,800,000	-	9,798,590	1,410
	米ドル	6,900,000	-	6,899,999	1
	ユーロ	900,000	-	899,597	403
	英ポンド	500,000	-	499,800	200
	オーストラリアドル	1,000,000	-	999,542	458
	香港ドル	200,000	-	199,725	275
	シンガポールドル	300,000	-	299,927	73
	合計	9,800,000	-	9,798,590	1,410

（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10月26日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	2,517,086,687円
同期中における追加設定元本額	313,133,344円
同期中における一部解約元本額	791,315,283円
平成29年10月26日現在における元本の内訳	
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	127,333,804円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	104,798,496円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	102,057,244円
三井住友・DC外国リートインデックスファンド	465,574,198円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2050	552,601円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	31,690円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	122,211円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	501,594円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	946,886円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	956,333円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	836,876円
世界6資産バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	2,878,867円
三井住友・7資産バランスファンド・VAS(適格機関投資家専用)	1,232,018,149円
SMA・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>	295,799円
合計	2,038,904,748円

国内債券パッシブ・マザーファンド

貸借対照表

(単位:円)

(平成29年10月26日現在)

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	1,243,024,697
国債証券	164,102,251,150
地方債証券	20,056,731,707
特殊債券	27,973,793,368
社債券	8,444,631,000
未収入金	501,867,210
未収利息	514,639,488
前払費用	3,839,996
流動資産合計	222,840,778,616
資産合計	222,840,778,616
負債の部	
流動負債	
未払金	635,588,315

(平成29年10月26日現在)

未払解約金	29,309,907
未払利息	3,412
その他未払費用	18,507
流動負債合計	664,920,141
負債合計	664,920,141
純資産の部	
元本等	
元本	177,365,709,360
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	44,810,149,115
元本等合計	222,175,858,475
純資産合計	222,175,858,475
負債純資産合計	222,840,778,616

注記表

(重要な会計方針の注記)

項 目	自 平成29年 4月27日
	至 平成29年10月26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10月26日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	177,365,709,360口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.2526円
	(10,000口当たりの純資産額 12,526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10月26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10月26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	173,031,066,223円
同期中における追加設定元本額	14,277,680,473円
同期中における一部解約元本額	9,943,037,336円
平成29年10月26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）	3,454,064,913円
三井住友・DC年金バランス50（標準型）	6,152,213,030円
三井住友・DC年金バランス70（株式重点型）	1,344,678,330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）	338,919,432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）	53,140,396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）	136,912,019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）	234,305,450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）	145,147,217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）	58,811,516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）	128,753,362円
三井住友・DC年金バランスゼロ（債券型）	52,371,813円
アセットアロケーション・ファンド（安定型）	7,714,882,397円
アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）	1,803,067,694円
アセットアロケーション・ファンド（成長型）	1,344,615,601円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2050	4,050,760円
三井住友・資産最適化ファンド（1安定重視型）	16,694円

三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	48,630円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	165,898円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	258,266円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	301,382円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	1,356,675円
SMAM・年金グローバル債券ファンド<適格機関投資家限定>	5,923,076,544円
SMAM・バランスファンドVA25<適格機関投資家専用>	24,793,813,220円
SMAM・バランスファンドVA37.5<適格機関投資家専用>	8,770,523,523円
SMAM・バランスファンドVA50<適格機関投資家専用>	21,601,659,259円
SMAM・バランスファンドVL30<適格機関投資家限定>	379,049,176円
SMAM・バランスファンドVL50<適格機関投資家限定>	714,835,210円
世界6資産バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	16,942,804円
SMAM・バランスファンドVA75<適格機関投資家専用>	339,355,163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>	141,794,921円
SMAM・インデックス・バランスVA25<適格機関投資家専用>	2,298,695,618円
SMAM・インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用>	2,473,280,454円
SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用>	5,113,635,894円
SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>	13,132,497,935円
SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定>	184,376,815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)	6,963,124,518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)	20,425,062,883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>	1,028,537,942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)	17,519,133,264円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>	1,056,449,361円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>	233,452,636円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用>	50,797,230円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>	2,437,990,872円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	2,947,334,226円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T<適格機関投資家専用>	2,809,227,581円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A2<適格機関投資家専用>	1,131,135,942円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A2<適格機関投資家専用>	255,171,944円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A2<適格機関投資家専用>	22,879,494円
SMAM・アセットバランスファンドVA30L2<適格機関投資家専用>	405,081,438円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L2<適格機関投資家専用>	7,393,022,466円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T2<適格機関投資家専用>	325,783,821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>	2,403,131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>	1,211,086,766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>	580,206,197円
SMAM・マルチアセットストラテジー・オープン<適格機関投資家限定>	1,071,675,812円
合計	177,365,709,360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10月26日現在)

資産の部	
流動資産	
預金	694,606,388
コール・ローン	280,429,667
国債証券	197,488,183,019
派生商品評価勘定	463,382
未収入金	431,886,954
未収利息	1,599,680,380
前払費用	26,076,672
流動資産合計	200,521,326,462
資産合計	200,521,326,462
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	651,853
未払解約金	312,177,487
未払利息	769
その他未払費用	10,898
流動負債合計	312,841,007
負債合計	312,841,007
純資産の部	
元本等	
元本	112,296,546,436
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	87,911,939,019
元本等合計	200,208,485,455
純資産合計	200,208,485,455
負債純資産合計	200,521,326,462

注記表

(重要な会計方針の注記)

項目	自平成29年4月27日 至平成29年10月26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	外貨建資産等の会計処理 「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。
---------------------------	---

(貸借対照表に関する注記)

項目	(平成29年10月26日現在)	
1. 当計算期間の末日における受益権の総数		112,296,546,436口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額	1.7829円
	(10,000口当たりの純資産額)	17,829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10月26日現在)
1.貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1) 有価証券（国債証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(デリバティブ取引に関する注記)

(平成29年10月26日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	102,286	-	102,012	274
	米ドル	102,286	-	102,012	274
	売建	433,331,923	-	433,520,120	188,197
	米ドル	222,851,738	-	222,388,356	463,382

	ユーロ	195,046,049	-	195,572,800	526,751
	英ポンド	15,434,136	-	15,558,964	124,828
	合計	433,434,209	-	433,622,132	188,471

(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10月26日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	125,322,708,862円
同期中における追加設定元本額	2,831,081,489円
同期中における一部解約元本額	15,857,243,915円
平成29年10月26日現在における元本の内訳	
三井住友・DC外国債券インデックスファンドS	9,121,486,933円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	441,659,829円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	1,235,182,822円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	628,531,791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)	129,470,257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)	9,129,539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)	28,641,802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)	74,465,004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)	64,037,002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)	32,457,364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)	82,616,520円
三井住友・DC年金バランスゼロ(債券型)	9,794,553円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	114,960,257円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	589,996,294円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	659,085,557円

三井住友・DCターゲットイヤーファンド2050	1,817,782円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	135,809円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	553,834円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	1,601,956円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	1,979,533円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	872,972円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	1,275,515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>	2,092,489,311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>	1,471,583,670円
SMAM・バランスファンドVA25<適格機関投資家専用>	15,336,934,939円
SMAM・バランスファンドVA37.5<適格機関投資家専用>	6,768,990,902円
SMAM・バランスファンドVA50<適格機関投資家専用>	15,303,038,807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>	123,918,123円
世界6資産バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	3,297,316円
SMAM・バランスファンドVA75<適格機関投資家専用>	964,196,849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>	150,250,165円
SMAM・インデックス・バランスVA25<適格機関投資家専用>	1,435,401,231円
SMAM・インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用>	1,754,107,713円
SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用>	3,584,078,393円
SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>	8,022,521,108円
SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定>	131,496,723円
SMAM・外国債券パッシブファンドVA<適格機関投資家限定>	12,798,738,815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)	1,157,565,857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)	2,382,585,805円
SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	230,101,247円
SMAM・バランスファンドVA20<適格機関投資家専用>	733,153,352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)	2,785,354,085円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>	171,817,237円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>	49,262,037円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用>	15,384,453円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>	176,219,444円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	636,648,630円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T<適格機関投資家専用>	204,168,942円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A2<適格機関投資家専用>	183,960,784円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A2<適格機関投資家専用>	54,582,186円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A2<適格機関投資家専用>	7,027,104円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L2<適格機関投資家専用>	1,602,409,837円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T2<適格機関投資家専用>	23,792,981円
SMAM・グローバルバランスファンド(標準型)VA<適格機関投資家限定>	4,831,008,735円
SMAM・グローバルバランスファンド(債券重視型)VA<適格機関投資家限定>	2,335,098,778円
SMAM・世界バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	7,399,900,677円
SMAM・世界バランスファンドVA2<適格機関投資家限定>	3,094,293,254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>	648,772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>	426,051,275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>	204,054,435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 >	376,963,136円
合計	112,296,546,436円

ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

(平成29年10月26日現在)

資産の部	
流動資産	
預金	234,707,362
コール・ローン	10,187,274
国債証券	58,289,099,243
派生商品評価勘定	66,581,657
未収入金	478,565,276
未収利息	461,448,691
前払費用	18,421,523
流動資産合計	59,559,011,026
資産合計	59,559,011,026
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	410,510,579
未払金	1,613,975
未払解約金	313,000,000
未払利息	27
その他未払費用	8,469
流動負債合計	725,133,050
負債合計	725,133,050
純資産の部	
元本等	
元本	42,571,039,123
剰余金	
剰余金又は欠損金()	16,262,838,853
元本等合計	58,833,877,976
純資産合計	58,833,877,976
負債純資産合計	59,559,011,026

注記表

(重要な会計方針の注記)

項 目	自 平成29年 4月27日 至 平成29年10月26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10月26日現在)	
1. 当計算期間の末日における受益権の総数		42,571,039,123口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額	1.3820円
	(10,000口当たりの純資産額)	13,820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10月26日現在)	
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券（国債証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>	

（デリバティブ取引に関する注記）

（平成29年10月26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	189,997	-	190,876	879
	ユーロ	73,882	-	74,185	303
	英ポンド	107,093	-	107,632	539
	デンマーククローネ	9,022	-	9,059	37
	売建	59,083,644,895	-	59,427,574,696	343,929,801
	米ドル	25,413,416,028	-	25,596,339,625	182,923,597
	カナダドル	1,254,943,282	-	1,233,391,263	21,552,019
	メキシコペソ	534,207,579	-	516,780,000	17,427,579
	ユーロ	24,291,757,611	-	24,503,170,667	211,413,056
	英ポンド	4,109,883,666	-	4,104,059,808	5,823,858
	スイスフラン	116,402,800	-	114,790,000	1,612,800
	スウェーデンクローナ	287,841,632	-	287,664,000	177,632
	ノルウェークローネ	183,741,090	-	184,080,000	338,910
	デンマーククローネ	395,970,970	-	399,260,755	3,289,785
	ポーランドズロチ	380,018,955	-	388,926,000	8,907,045
	オーストラリアドル	1,297,160,122	-	1,284,764,578	12,395,544
	シンガポールドル	488,846,860	-	492,355,000	3,508,140
	南アフリカランド	329,454,300	-	321,993,000	7,461,300
	合計		59,083,834,892	-	59,427,765,572

（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10月26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	43,677,470,657円
同期中における追加設定元本額	5,487,345,208円
同期中における一部解約元本額	6,593,776,742円
平成29年10月26日現在における元本の内訳	
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	14,109,092,457円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	7,549,744,416円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	3,732,838,027円
イオン・バランス戦略ファンド	693,402,932円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	1,075,290円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	1,922,750円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	3,705,548円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	2,568,920円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	542,580円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	400,106円
SMAM・年金グローバル債券ファンド<適格機関投資家限定>	5,357,127,012円
SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定>	166,107,660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)	5,257,099,933円
SMAM・ヘッジ付き年金外国債券パッシブファンド<適格機関投資家限定>	3,684,724,282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>	1,572,573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>	849,913,020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>	407,122,128円
SMAM・マルチアセットストラテジー・オープン<適格機関投資家限定>	752,079,489円
合計	42,571,039,123円

バンガード・米ドル建て新興国政府債券ETFは、米国籍の上場外国投資信託で、現地での監査を受けております。

なお、以下の財務諸表は、入手しうる直近の現地監査済み財務諸表を委託会社において抜粋して翻訳したものです。

バンガード・米ドル建て新興国政府債券ETF

（純資産計算書）

区分	2016年10月31日現在
	金額（千米ドル）
債券	-
短期金融資産	-
投資総額	-
その他資産及び負債	-
純資産額	873,634

（1口当たり情報）

（2016年10月31日現在）
1口当たり純資産額 （一般投資家クラス） 80.11米ドル

i シェアーズ J.P.モルガン・米ドル建てエマージング・マーケット債券ETFは、米国籍の上場外国投資信託で、現地での監査を受けております。

なお、以下の財務諸表は、入手しうる直近の現地監査済み財務諸表を委託会社において抜粋して翻訳したものです。

i シェアーズ J.P.モルガン・米ドル建てエマージング・マーケット債券ETF

（純資産計算書）

区分	2016年10月31日現在
	金額（千米ドル）
債券	9,435,708
短期金融資産	27,984
投資総額	9,463,693
その他資産及び負債	185,603
純資産額	9,649,296

（1口当たり情報）

（2016年10月31日現在）
1口当たり純資産額 （一般投資家クラス） 114.74米ドル

SPDR バークレイズ・ハイ・イールド債券ETFは、米国籍の上場外国投資信託で、現地での監査を受けております。

なお、以下の財務諸表は、入手しうる直近の現地監査済み財務諸表を委託会社において抜粋して翻訳したものです。

SPDR ブルームバーグ・バークレイズ・ハイ・イールド債券ETF

（純資産計算書）

区分	2017年6月30日現在
	金額（千米ドル）
債券	11,388,205
短期金融資産等	515,532
投資総額	11,903,737
その他資産及び負債	290,558
純資産額	11,613,179

（1口当たり情報）

（2017年6月30日）
1口当たり純資産額
（一般投資家クラス） 37.10米ドル

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

アセットアロケーション・ファンド（安定型）

2017年11月30日現在

資産総額	39,036,520,666円
負債総額	228,394,248円
純資産総額（ - ）	38,808,126,418円
発行済口数	38,188,753,075口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0162円
（1万口当たり純資産額）	（10,162円）

アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）

2017年11月30日現在

資産総額	26,180,602,956円
負債総額	235,878,190円
純資産総額（ - ）	25,944,724,766円
発行済口数	24,927,352,305口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0408円
（1万口当たり純資産額）	（10,408円）

アセットアロケーション・ファンド（成長型）

2017年11月30日現在

資産総額	19,487,531,372円
負債総額	90,050,870円
純資産総額（ - ）	19,397,480,502円
発行済口数	18,410,651,900口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0536円
（1万口当たり純資産額）	（10,536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。
- ヘ 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11月30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。

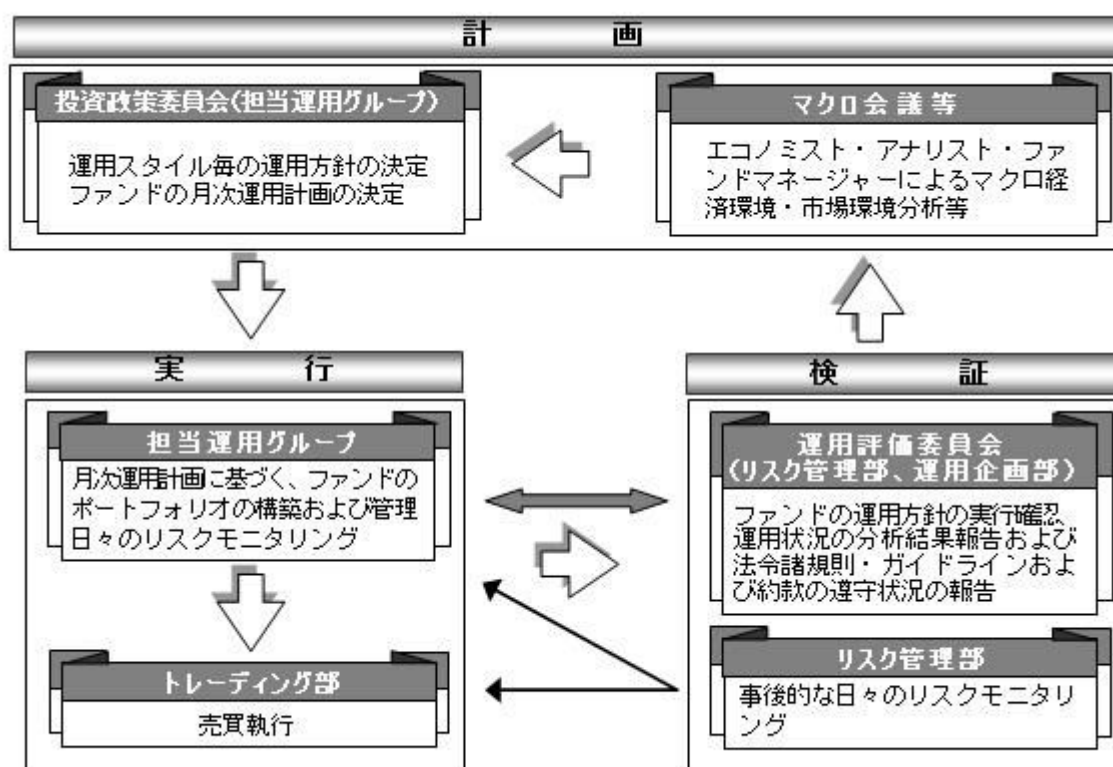
取締役の任期は、選任後1年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会の終結の時までとし、補欠または増員によって選任された取締役の任期は、他の現任取締役の任期の満了する時までとします。

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11月30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11月30日現在)			
		本数(本)	純資産総額(百万円)
株式投資信託	単位型	78 (30)	220,595 (126,184)
	追加型	452 (191)	5,558,804 (2,836,082)
	計	530 (221)	5,779,399 (2,962,265)
公社債投資信託	単位型	107 (107)	384,131 (384,131)
	追加型	1 (0)	31,332 (0)
	計	108 (107)	415,463 (384,131)
合 計		638 (328)	6,194,862 (3,346,397)

()内は、私募投資信託分であり、内書き表記しております。

3【委託会社等の経理状況】

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

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

2 当社は、第32期（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、第33期中間会計期間（平成29年4月1日から平成29年9月30日まで）の中間財務諸表については、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、有限責任 あずさ監査法人の中間監査を受けております。

(1)【貸借対照表】

		(単位：千円)	
		前事業年度 (平成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		当事業年度	
	(自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)	(自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)	(自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)	(自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)
営業収益				
委託者報酬	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）

（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	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	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

おります。

退職給付見込額の期間帰属方法

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

数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法

過去勤務費用については、その発生時において一時に費用処理しております。

数理計算上の差異については、その発生時において一時に費用処理しております。

4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

消費税等の会計処理

消費税等の会計処理は税抜方式によっております。

(会計方針の変更)

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

(4)金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

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

2.金融商品の時価等に関する事項

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

前事業年度（平成28年3月31日）

（単位：千円）

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

当事業年度（平成29年3月31日）

（単位：千円）

	貸借対照表計上額	時価	差額
(1)現金及び預金	13,279,384	13,279,384	-
(2)顧客分別金信託	20,008	20,008	-
(3)未収委託者報酬	5,511,715	5,511,715	-
(4)未収運用受託報酬	1,297,104	1,297,104	-
(5)未収投資助言報酬	343,523	343,523	-
(6)投資有価証券 その他有価証券	12,098,074	12,098,074	-
(7)長期差入保証金	677,681	677,681	-
資産計	33,227,492	33,227,492	-

(1)顧客からの預り金	304	304	-
(2)未払手数料	2,424,318	2,424,318	-
負債計	2,424,622	2,424,622	-

(注1)金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

資産

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

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

(6)投資有価証券

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

(7)長期差入保証金

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

負債

(1)顧客からの預り金、(2)未払手数料

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

(注2)時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品の貸借対照表計上額
(単位：千円)

	前事業年度 (平成28年3月31日)	当事業年度 (平成29年3月31日)
その他有価証券 非上場株式	298	298
合計	298	298
子会社株式及び関連会社株式 非上場株式	10,412,523	10,412,523
合計	10,412,523	10,412,523

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

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

(注3)金銭債権及び満期がある有価証券の決算日後の償還予定額
前事業年度（平成28年3月31日）

(単位：千円)

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

合計	18,851,060	66,567	-	-
----	------------	--------	---	---

当事業年度（平成29年3月31日）

（単位：千円）

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

（有価証券関係）

1. 子会社株式及び関連会社株式

前事業年度（平成28年3月31日）

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

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	1,770,996,505	銀行業	% (被所有) 直接 40	投信の販売 委託 役員の兼任	委託販売 手数料	2,740,552	未払手数料	471,118

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

2．取引条件及び取引条件の決定方針等

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	SMEC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いません。

2. 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	前事業年度 (自平成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。

中間財務諸表

(1) 中間貸借対照表

(単位：千円)

		第33期中間会計期間 (平成29年9月30日)
資産の部		
流動資産		
現金及び預金		14,667,306
顧客分別金信託		20,009
前払費用		398,529
未収委託者報酬		5,467,704
未収運用受託報酬		1,390,552
未収投資助言報酬		331,978
未収収益		30,823
繰延税金資産		484,857
その他		20,343
流動資産合計		22,812,104
固定資産		
有形固定資産	1	449,121
無形固定資産		689,045
投資その他の資産		
投資有価証券		11,924,034
関係会社株式		10,412,523
その他		1,439,858
投資その他の資産合計		23,776,417
固定資産合計		24,914,583
資産合計		47,726,688
負債の部		
流動負債		
顧客からの預り金		243
その他の預り金		18,672
未払金		2,563,327
未払費用		3,141,458
未払法人税等		908,285
前受収益		8,531
賞与引当金		977,049
その他	2	255,033
流動負債合計		7,872,601
固定負債		
退職給付引当金		3,313,253
賞与引当金		20,083
その他		995
固定負債合計		3,334,332
負債合計		11,206,933
純資産の部		

株主資本		
資本金		2,000,000
資本剰余金		
資本準備金		8,628,984
資本剰余金合計		8,628,984
利益剰余金		
利益準備金		284,245
その他利益剰余金		
配当準備積立金		60,000
別途積立金		1,476,959
繰越利益剰余金		23,341,758
利益剰余金合計		25,162,963
株主資本合計		35,791,947
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金		727,807
評価・換算差額等合計		727,807
純資産合計		36,519,754
負債純資産合計		47,726,688

(2) 中間損益計算書

(単位：千円)

		第33期中間会計期間 (自 平成29年4月1日 至 平成29年9月30日)
営業収益		
委託者報酬		17,308,525
運用受託報酬		2,835,650
投資助言報酬		727,606
その他の営業収益		74,834
営業収益計		20,946,618
営業費用		13,255,417
一般管理費	1	5,122,317
営業利益		2,568,883
営業外収益	2	49,201
営業外費用	3	8,278
経常利益		2,609,805
特別利益	4	31,986
特別損失	5	106,330
税引前中間純利益		2,535,462
法人税、住民税及び事業税		827,642
法人税等調整額		28,344
法人税等合計		799,298
中間純利益		1,736,163

(3) 中間株主資本等変動計算書

第33期中間会計期間（自 平成29年4月1日 至 平成29年9月30日）

（単位：千円）

	株主資本								
	資本金	資本剰余金		利益剰余金					株主資本 合計
		資本準備金	資本剰余金 合計	利益準備金	その他利益剰余金			利益剰余金 合計	
					配当準備 積立金	別途積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	2,000,000	8,628,984	8,628,984	284,245	60,000	1,476,959	23,493,074	25,314,279	35,943,263
当中間期変動額									
剰余金の配当							1,887,480	1,887,480	1,887,480
中間純利益							1,736,163	1,736,163	1,736,163
株主資本以外の項目の 当中間期変動額（純額）									
当中間期変動額合計	-	-	-	-	-	-	151,316	151,316	151,316
当中間期末残高	2,000,000	8,628,984	8,628,984	284,245	60,000	1,476,959	23,341,758	25,162,963	35,791,947

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価証券 評価差額金	評価・換算 差額等合計	
当期首残高	327,116	327,116	36,270,379
当中間期変動額			
剰余金の配当			1,887,480
中間純利益			1,736,163
株主資本以外の項目の 当中間期変動額（純額）	400,690	400,690	400,690
当中間期変動額合計	400,690	400,690	249,374
当中間期末残高	727,807	727,807	36,519,754

注記事項

(重要な会計方針)

1. 資産の評価基準及び評価方法

(1) 有価証券

満期保有目的の債券

償却原価法

子会社株式及び関連会社株式

移動平均法による原価法

その他有価証券

時価のあるもの

中間会計期間末日の市場価格等に基づく時価法

（評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定）

時価のないもの

移動平均法による原価法

2. 固定資産の減価償却の方法

(1)有形固定資産

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

なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。

建物 3～50年

器具備品 3～20年

(2)無形固定資産

定額法によっております。

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

3. 引当金の計上基準

(1)賞与引当金

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

(2)退職給付引当金

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

退職給付見込額の期間帰属方法

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

数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法

過去勤務費用については、その発生時において一時に費用処理しております。

数理計算上の差異については、その発生時において一時に費用処理しております。

4. その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項

消費税等の会計処理

消費税等の会計処理は税抜方式によっております。

(中間貸借対照表関係)

第33期中間会計期間 (平成29年9月30日)	
1.有形固定資産の減価償却累計額	1,008,543千円
2.消費税等の取扱い	
仮払消費税等及び仮受消費税等は、相殺のうえ、金額的重要性が乏しいため、流動負債のその他に含めて表示しております。	

3. 当社は、運転資金の効率的な調達を行うため取引銀行1行と当座借越契約を締結しております。当中間会計期間末における当座借越契約に係る借入金未実行残高等は次のとおりであります。	
当座借越極度額の総額	10,000,000千円
借入実行残高	-
差引額	10,000,000千円
4. 当社は、子会社であるSumitomo Mitsui Asset Management(New York) Inc.における賃貸借契約に係る賃借料に対し、平成35年6月までの賃借料総額237,363千円の支払保証を行っております。	

(中間損益計算書関係)

第33期中間会計期間 (自 平成29年4月1日 至 平成29年9月30日)	
1. 減価償却実施額	
有形固定資産	64,918千円
無形固定資産	99,520千円
2. 営業外収益のうち主要なもの	
受取配当金	42,925千円
雑益	6,025千円
3. 営業外費用のうち主要なもの	
為替差損	8,278千円
4. 特別利益のうち主要なもの	
投資有価証券売却益	30,103千円
5. 特別損失のうち主要なもの	
投資有価証券償還損	106,200千円

(中間株主資本等変動計算書関係)

第33期中間会計期間(自 平成29年4月1日 至 平成29年9月30日)

1. 発行済株式数に関する事項

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

2. 剰余金の配当に関する事項

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

(リース取引関係)

第33期中間会計期間 (自 平成29年4月1日 至 平成29年9月30日)	
1. オペレーティング・リース取引 (借主側)	
未経過リース料(解約不能のもの)	
1年以内	477,255千円
1年超	28,771千円
合計	506,027千円

（金融商品関係）

1．金融商品の時価等に関する事項

第33期中間会計期間（平成29年9月30日）

平成29年9月30日における中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次の通りです。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含まれておりません（（注2）参照）。

（単位：千円）

区分	中間貸借対照表計上額	時価	差額
(1)現金及び預金	14,667,306	14,667,306	-
(2)顧客分別金信託	20,009	20,009	-
(3)未収委託者報酬	5,467,704	5,467,704	-
(4)未収運用受託報酬	1,390,552	1,390,552	-
(5)未収投資助言報酬	331,978	331,978	-
(6)投資有価証券 その他有価証券	11,923,736	11,923,736	-
(7)投資その他の資産 長期差入保証金	656,670	656,670	-
資産計	34,457,958	34,457,958	-
(1)顧客からの預り金	243	243	-
(2)未払金 未払手数料	2,365,135	2,365,135	-
負債計	2,365,378	2,365,378	-

（注1）金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

資 産

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

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

- (6)投資有価証券

その他有価証券

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

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

- (7)投資その他の資産

長期差入保証金

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

負 債

- (1)顧客からの預り金、及び(2)未払金 未払手数料

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

（注2）時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

(単位：千円)

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

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。

(有価証券関係)

第33期中間会計期間（平成29年9月30日）

1. 満期保有目的の債券

該当事項はありません。

2. 子会社株式及び関連会社株式

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

3. その他有価証券

(単位：千円)

区分	中間貸借対照表計上額	取得原価	差額
(1) 中間貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの 投資信託等	8,658,097	7,538,725	1,119,372
小計	8,658,097	7,538,725	1,119,372
(2) 中間貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの 投資信託等	3,265,638	3,335,995	70,356
小計	3,265,638	3,335,995	70,356
合計	11,923,736	10,874,721	1,049,015

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

(デリバティブ取引関係)

当社は、デリバティブ取引を全く行っていませんので、該当事項はありません。

(資産除去債務等)

該当事項はありません。

(セグメント情報等)

第33期中間会計期間（自 平成29年4月1日 至 平成29年9月30日）

1. セグメント情報

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

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

2. 関連情報

(1) 製品及びサービスごとの情報

（単位：千円）

	委託者報酬	運用受託報酬	投資助言報酬	その他	合計
外部顧客への営業収益	17,308,525	2,835,650	727,606	74,834	20,946,618

(2) 地域ごとの情報

営業収益

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

有形固定資産

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

(3) 主要な顧客ごとの情報

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

3. 報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

該当事項はありません。

4. 報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

該当事項はありません。

5. 報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

該当事項はありません。

（1株当たり情報）

第33期中間会計期間 （自 平成29年4月1日 至 平成29年9月30日）
--

1株当たり純資産額	2,070,280円85銭
1株当たり中間純利益	98,421円97銭

なお、潜在株式調整後1株当たり中間純利益については、潜在株式が存在しないため記載していません。

(注) 1株当たり純資産額の算定上の基礎

中間貸借対照表の純資産の部の合計額	36,519,754千円
普通株式に係る純資産額	36,519,754千円
普通株式の発行済株式数	17,640株
1株当たり純資産額の算定に用いられた普通株式の数	17,640株

1株当たり中間純利益の算定上の基礎

中間損益計算書上の中間純利益	1,736,163千円
普通株式に係る中間純利益	1,736,163千円
普通株主に帰属しない金額の主要な内訳	
該当事項はありません。	
普通株式の期中平均株式数	17,640株

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

[参考情報：再信託受託会社の概要]

- ・ 名称 日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社
- ・ 資本金の額 51,000百万円(2017年9月末現在)
- ・ 事業の内容 銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

□ 販売会社

□ 販売会社

(イ) 名称	(ロ) 資本金の額	(ハ) 事業の内容
S M B C 日興証券株式会社	10,000百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
株式会社S B I証券	48,323百万円	
カブドットコム証券株式会社	7,196百万円	
フィデリティ証券株式会社	8,157百万円	
楽天証券株式会社	7,495百万円	
株式会社栃木銀行	27,408百万円	銀行法に基づき、銀行業を営んでいます。
株式会社福岡中央銀行	2,500百万円	

資本金の額は、2017年9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。

□ 販売会社

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

3【資本関係】

該当ありません。

第3【その他】

1. 目論見書の表紙等にロゴ・マーク、写真、イラスト、図案およびキャッチコピーを採用すること、

ファンドの形態および属性、申込みにかかる事項、ユニバーサルデザインフォントマーク、委託会社の金融商品取引業者登録番号、当該目論見書の使用開始日などを記載することがあります。

2. 目論見書は、目論見書の別称として「投資信託説明書(交付目論見書)」または「投資信託説明書(請求目論見書)」と称して使用することがあります。
3. 目論見書に当ファンドの信託約款を掲載すること、および投資信託の財産は受託会社において信託法に基づき分別管理されている旨を記載することがあります。
4. 目論見書は、電子媒体等として使用されるほか、インターネット等に掲載されることがあります。
5. 有価証券届出書の表紙記載情報を抜粋して、目論見書に記載することがあります。
6. 目論見書の冒頭または巻末に届出書記載内容に関連する用語集を掲載することがあります。
7. 評価機関等から当ファンドに対する評価を取得し、使用することがあります。
8. 有価証券届出書を個別に提出している複数のファンドの実質的な投資対象資産に共通性がある場合には、当該複数のファンドを一つの投資信託説明書(交付目論見書)で説明することがあります。このため、有価証券届出書に他のファンドの情報を合わせて記載することがあります。
9. 当ファンドとスイッチング対象ファンドにかかる投資信託説明書(交付目論見書)を一体のものとして使用することがあります。

独立監査人の監査報告書

平成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6月6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」に掲げられているアセットアロケーション・ファンド（安定型）の平成28年4月27日から平成29年4月26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、アセットアロケーション・ファンド（安定型）の平成29年4月26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。

独立監査人の監査報告書

平成29年6月6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」に掲げられているアセットアロケーション・ファンド（安定成長型）の平成28年4月27日から平成29年4月26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、アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）の平成29年4月26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。

独立監査人の監査報告書

平成29年6月6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」に掲げられているアセットアロケーション・ファンド（成長型）の平成28年4月27日から平成29年4月26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、アセットアロケーション・ファンド（成長型）の平成29年4月26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11月24日

三井住友アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている三井住友アセットマネジメント株式会社の平成29年4月1日から平成30年3月31日までの第33期事業年度の中間会計期間（平成29年4月1日から平成29年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、三井住友アセットマネジメント株式会社の平成29年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（平成29年4月1日から平成29年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

利害関係

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

以上

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

独立監査人の中間監査報告書

平成29年12月5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」に掲げられているアセットアロケーション・ファンド（安定型）の平成29年4月27日から平成29年10月26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、アセットアロケーション・ファンド（安定型）の平成29年10月26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4月27日から平成29年10月26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。

独立監査人の中間監査報告書

平成29年12月5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」に掲げられているアセットアロケーション・ファンド（安定成長型）の平成29年4月27日から平成29年10月26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、アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）の平成29年10月26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4月27日から平成29年10月26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。

独立監査人の中間監査報告書

平成29年12月5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」に掲げられているアセットアロケーション・ファンド（成長型）の平成29年4月27日から平成29年10月26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、アセットアロケーション・ファンド（成長型）の平成29年10月26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4月27日から平成29年10月26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。